

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年3月8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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したこと等に伴い、平成24年9月11日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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

原届出書の「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」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

(1) ファンドの目的及び基本的性格

基本的性格

該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

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。

（中略）

属性区分表

（中略）

（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。

（後略）

<訂正後>

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

（中略）

属性区分表

（中略）

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類及び属性区分に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、これ以外の用語の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ<http://www.toushin.or.jp/>をご覧ください。

（後略）

ファンドの特色

該当情報の記載中「各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。」は、以下の内容に

更新します。

<更新・訂正後>

◆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、東京証券取引所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。

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・マーケット・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・マーケット・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。

(3) ファンドの仕組み

該当情報を以下の内容に訂正します。

(注) 下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

(前略)

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)

(中略)

C. 大株主の状況(平成24年6月29日現在)

(後略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成24年12月28日現在）

（中略）

C．大株主の状況（平成24年12月28日現在）

（後略）

[次へ](#)

2 投資方針

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」につきまして
は、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

(2) 投資対象

(参考) マザーファンドの概要を以下の内容に訂正します。

(注) 下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

(前略)

「海外リートマザーファンド」の概要

1. 基本方針

(中略)

2. 運用方法

(1) 投資対象

(中略)

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。

(後略)

<訂正後>

(前略)

「海外リートマザーファンド」の概要

1. 基本方針

(中略)

2. 運用方法

(1) 投資対象

(中略)

1: 上場に準ずるものを含みます。

2: 一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。

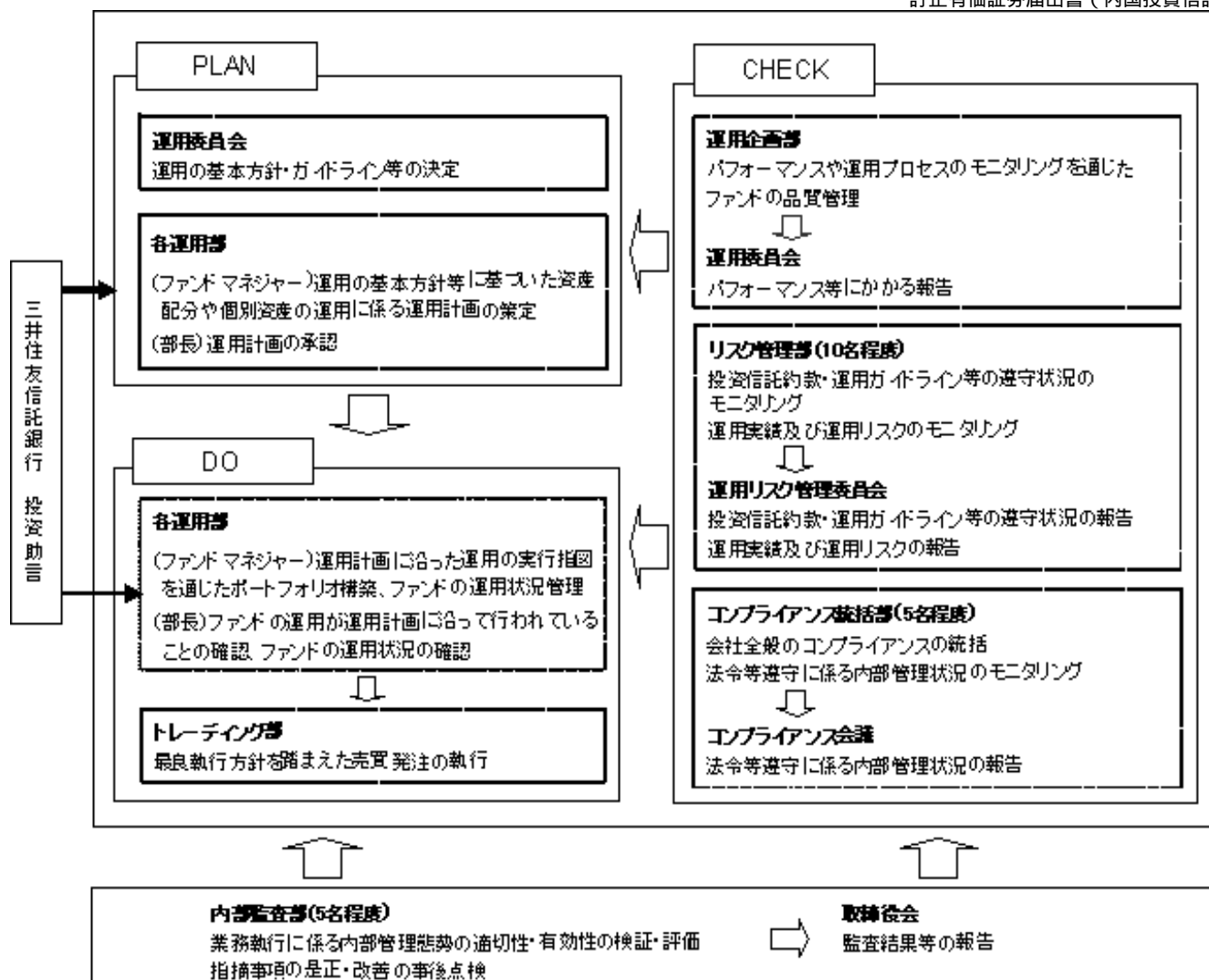
(後略)

(3) 運用体制

該当情報を以下の内容に更新します。

<更新・訂正後>

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年
3月8日現在のものであり、今後変更されることがあります。



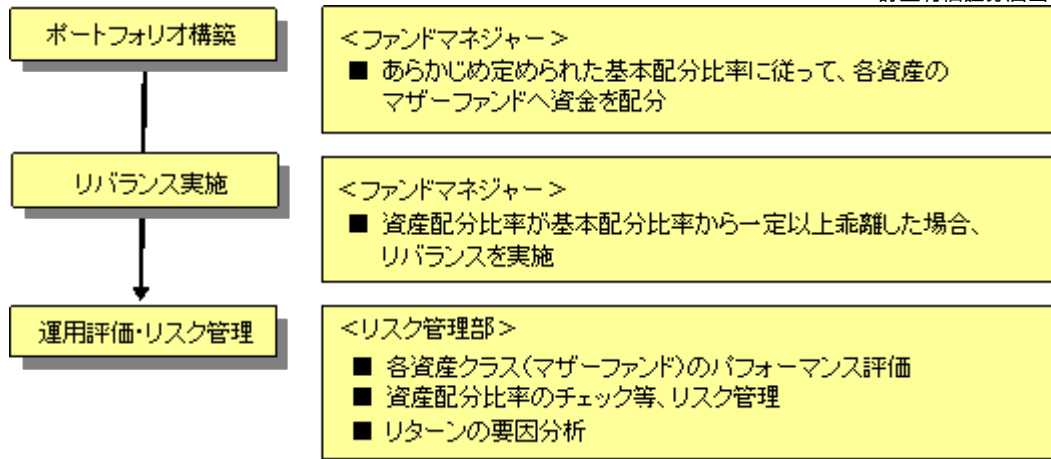
三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

< 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、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。



[次△](#)

4 手数料等及び税金

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部____は訂正部分を示します。

（5）課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

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。

（後略）

<訂正後>

（前略）

上記は、平成24年12月28日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきまして
は、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(1)投資状況

(平成24年12月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,074,522,699	100.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,713,852	0.25
合計(純資産総額)		1,071,808,847	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	164,264,036	1.0844	178,127,921	1.1498	188,870,788	17.62
日本	親投資信託受益証券	Jリートマザーファンド(M)	138,092,806	1.2478	172,312,204	1.3250	182,972,967	17.07
日本	親投資信託受益証券	海外リートマザーファンド	268,028,826	0.6384	171,109,603	0.6799	182,232,798	17.00
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	103,227,366	1.6522	170,552,255	1.7536	181,019,509	16.89
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	223,648,136	0.7310	163,486,788	0.7980	178,471,212	16.65
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	131,876,629	1.2269	161,812,242	1.2205	160,955,425	15.02

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.25
合計	100.25

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

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3)運用実績

純資産の推移

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間末 (平成19年12月10日)	3,586,283,463	3,589,844,188	9,957	9,967
第2特定期間末 (平成20年 6月10日)	3,192,838,387	3,196,433,746	8,877	8,887
第3特定期間末 (平成20年12月10日)	2,013,785,577	2,017,176,994	5,938	5,948
第4特定期間末 (平成21年 6月10日)	2,100,580,982	2,103,869,774	6,387	6,397
第5特定期間末 (平成21年12月10日)	2,016,006,579	2,022,240,837	6,467	6,487
第6特定期間末 (平成22年 6月10日)	1,808,286,497	1,813,977,919	6,354	6,374
第7特定期間末 (平成22年12月10日)	1,702,409,568	1,710,097,724	6,643	6,673
第8特定期間末 (平成23年 6月10日)	1,531,647,646	1,538,702,069	6,514	6,544
第9特定期間末 (平成23年12月12日)	1,212,675,791	1,218,975,235	5,775	5,805

第10特定期間末 (平成24年 6月11日)	1,107,710,596	1,113,337,628	5,906	5,936
第11特定期間末 (平成24年12月10日)	1,042,705,830	1,044,316,718	6,473	6,483
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	
2月末日	1,258,178,534		6,297	
3月末日	1,249,655,222		6,422	
4月末日	1,209,925,983		6,299	
5月末日	1,106,357,785		5,872	
6月末日	1,107,966,649		6,008	
7月末日	1,084,062,408		6,025	
8月末日	1,057,534,926		6,082	
9月末日	1,031,348,027		6,170	
10月末日	1,031,287,383		6,265	
11月末日	1,040,868,655		6,444	
12月末日	1,071,808,847		6,832	

分配の推移

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

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1特定期間(平成19年 8月31日～平成19年12月10日)	0.2
第2特定期間(平成19年12月11日～平成20年 6月10日)	10.2
第3特定期間(平成20年 6月11日～平成20年12月10日)	32.4
第4特定期間(平成20年12月11日～平成21年 6月10日)	8.6

第5特定期間(平成21年 6月11日～平成21年12月10日)	2.7
第6特定期間(平成21年12月11日～平成22年 6月10日)	0.1
第7特定期間(平成22年 6月11日～平成22年12月10日)	6.8
第8特定期間(平成22年12月11日～平成23年 6月10日)	0.8
第9特定期間(平成23年 6月11日～平成23年12月12日)	8.6
第10特定期間(平成23年12月13日～平成24年 6月11日)	5.4
第11特定期間(平成24年 6月12日～平成24年12月10日)	10.6

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1特定期間 (平成19年 8月31日～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 (平成19年12月11日～平成20年 6月10日)	137,066,455	141,987,767	3,596,828,006
第3特定期間 (平成20年 6月11日～平成20年12月10日)	20,837,684	226,248,338	3,391,417,352
第4特定期間 (平成20年12月11日～平成21年 6月10日)	1,444,362	103,953,055	3,288,908,659
第5特定期間 (平成21年 6月11日～平成21年12月10日)	7,833,268	179,383,448	3,117,358,479
第6特定期間 (平成21年12月11日～平成22年 6月10日)	7,973,109	279,620,527	2,845,711,061
第7特定期間 (平成22年 6月11日～平成22年12月10日)	154,462	283,146,803	2,562,718,720
第8特定期間 (平成22年12月11日～平成23年 6月10日)	1,801,557	213,045,766	2,351,474,511
第9特定期間 (平成23年 6月11日～平成23年12月12日)	1,457,958	253,117,712	2,099,814,757
第10特定期間 (平成23年12月13日～平成24年 6月11日)	196,582	224,333,874	1,875,677,465
第11特定期間 (平成24年 6月12日～平成24年12月10日)	273,173	265,062,129	1,610,888,509

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

(参考情報)

日本株式マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年12月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	266,436,538,131	97.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,836,632,955	2.86
合計(純資産総額)		274,273,171,086	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,891,400	2,735.82	7,910,349,948	4,005.00	11,580,057,000	4.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,820,400	355.21	5,974,774,284	461.00	7,754,204,400	2.83
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,898,800	2,667.65	5,065,333,820	3,145.00	5,971,726,000	2.18
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,679,900	2,398.69	4,029,559,331	3,115.00	5,232,888,500	1.91
日本	株式	キヤノン	電気機器	1,398,100	3,372.94	4,715,707,414	3,340.00	4,669,654,000	1.70
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	28,624,000	117.34	3,358,740,160	157.00	4,493,968,000	1.64
日本	株式	ファナック	電気機器	234,300	12,951.46	3,034,527,078	15,920.00	3,730,056,000	1.36
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	882,900	3,253.90	2,872,868,310	3,855.00	3,403,579,500	1.24
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	935,200	3,824.59	3,576,756,568	3,630.00	3,394,776,000	1.24
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,555,000	1,279.62	1,989,809,100	2,049.00	3,186,195,000	1.16
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,012,700	2,261.34	2,290,059,018	3,140.00	3,179,878,000	1.16
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,733,300	1,671.63	2,897,436,279	1,647.00	2,854,745,100	1.04
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,118,100	1,916.41	2,142,738,021	2,440.00	2,728,164,000	0.99
日本	株式	日立製作所	電気機器	5,267,000	432.85	2,279,820,950	504.00	2,654,568,000	0.97
日本	株式	三井物産	卸売業	1,917,400	1,260.71	2,417,285,354	1,283.00	2,460,024,200	0.90
日本	株式	小松製作所	機械	1,099,300	2,079.58	2,286,082,294	2,184.00	2,400,871,200	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	415,100	4,723.11	1,960,562,961	5,580.00	2,316,258,000	0.84
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	2,843,300	717.11	2,038,958,863	811.00	2,305,916,300	0.84

日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	4,543,800	285.47	1,297,118,586	503.00	2,285,531,400	0.83
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,303	137,525.89	2,517,136,364	124,000.00	2,269,572,000	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	929,200	2,125.17	1,974,707,964	2,437.00	2,264,460,400	0.83
日本	株式	信越化学工業	化学	422,800	3,980.60	1,682,997,680	5,230.00	2,211,244,000	0.81
日本	株式	三井不動産	不動産業	1,047,000	1,308.25	1,369,737,750	2,090.00	2,188,230,000	0.80
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	9,962,000	198.09	1,973,372,580	210.00	2,092,020,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	860,400	1,870.58	1,609,447,032	2,383.00	2,050,333,200	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	523,200	3,033.76	1,587,263,232	3,875.00	2,027,400,000	0.74
日本	株式	KDDI	情報・通信業	313,400	4,842.59	1,517,667,706	6,090.00	1,908,606,000	0.70
日本	株式	デンソー	輸送用機器	556,000	2,202.07	1,224,350,920	2,973.00	1,652,988,000	0.60
日本	株式	三菱電機	電気機器	2,251,000	764.26	1,720,349,260	731.00	1,645,481,000	0.60
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	738,700	1,701.01	1,256,536,087	2,224.00	1,642,868,800	0.60

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	97.14
合計	97.14

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.58
		建設業	2.61
		食料品	3.70
		繊維製品	0.82
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.56
		医薬品	4.66
		石油・石炭製品	0.74
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.98
		鉄鋼	1.67
		非鉄金属	1.07
		金属製品	0.68
		機械	5.05

	電気機器	11.79
	輸送用機器	10.90
	精密機器	1.36
	その他製品	1.32
	電気・ガス業	2.39
	陸運業	3.93
	海運業	0.31
	空運業	0.55
	倉庫・運輸関連業	0.24
	情報・通信業	5.79
	卸売業	5.05
	小売業	3.99
	銀行業	10.09
	証券、商品先物取引業	1.51
	保険業	2.42
	その他金融業	0.98
	不動産業	3.26
	サービス業	1.98
合計		97.14

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	524	4,321,499,900	4,514,260,000	4,514,260,000	1.65

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

日本債券マザーファンド

(1) 投資状況

(平成24年12月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	263,795,614,400	78.05

地方債証券	日本	22,020,870,438	6.52
特殊債券	日本	32,836,062,908	9.72
	韓国	103,607,000	0.03
	小計	32,939,669,908	9.75
社債券	日本	19,140,608,000	5.66
	オーストラリア	1,426,992,000	0.42
	アメリカ	611,868,000	0.18
	フランス	200,595,000	0.06
	イギリス	101,774,000	0.03
	スウェーデン	101,749,000	0.03
	小計	21,583,586,000	6.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,347,759,987	0.69
合計(純資産総額)		337,991,980,759	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第3 2 5 回利付国債(10年)	5,910,000,000	100.40	5,934,054,300	100.22	5,923,297,500	0.8	2022/09/20	1.75
日本	国債証券	第1 0 6 回利付国債(5年)	5,320,000,000	100.09	5,324,959,100	100.11	5,326,171,200	0.2	2017/09/20	1.58
日本	国債証券	第1 0 5 回利付国債(5年)	4,020,000,000	100.09	4,023,931,400	100.17	4,027,075,200	0.2	2017/06/20	1.19
日本	国債証券	第8 7 回利付国債(5年)	3,900,000,000	100.92	3,935,880,000	100.78	3,930,732,000	0.5	2014/12/20	1.16
日本	国債証券	第8 8 回利付国債(5年)	3,640,000,000	100.92	3,673,655,800	100.88	3,672,323,200	0.5	2015/03/20	1.09
日本	国債証券	第2 8 5 回利付国債(10年)	3,400,000,000	106.76	3,630,146,000	106.48	3,620,558,000	1.7	2017/03/20	1.07
日本	国債証券	第3 1 2 回利付国債(10年)	3,200,000,000	102.85	3,291,200,000	104.91	3,357,152,000	1.2	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第2 8 4 回利付国債(10年)	2,950,000,000	106.55	3,143,284,000	106.15	3,131,425,000	1.7	2016/12/20	0.93
日本	国債証券	第3 0 5 回利付国債(10年)	2,900,000,000	104.49	3,030,312,000	105.94	3,072,347,000	1.3	2019/12/20	0.91
日本	国債証券	第3 1 3 回利付国債(2年)	2,770,000,000	99.98	2,769,446,000	100.00	2,770,138,500	0.1	2014/02/15	0.82
日本	国債証券	第3 2 1 回利付国債(10年)	2,600,000,000	100.47	2,612,220,000	102.45	2,663,934,000	1.0	2022/03/20	0.79
日本	国債証券	第1 0 3 回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.04	2,601,062,000	100.62	2,616,250,000	0.3	2017/03/20	0.77
日本	国債証券	第2 9 6 回利付国債(10年)	2,400,000,000	106.44	2,554,782,000	107.02	2,568,624,000	1.5	2018/09/20	0.76
日本	国債証券	第3 2 0 回利付国債(10年)	2,440,000,000	100.93	2,462,882,400	102.65	2,504,806,400	1.0	2021/12/20	0.74

日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,330,000,000	106.27	2,476,179,700	106.47	2,480,914,100	1.5	2017/12/20	0.73
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	2,400,000,000	100.06	2,401,456,000	100.44	2,410,584,000	0.8	2022/06/20	0.71
日本	国債証券	第320回利付国債（2年）	2,400,000,000	100.00	2,400,062,000	100.00	2,400,192,000	0.1	2014/09/15	0.71
日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	2,200,000,000	100.26	2,205,720,000	102.84	2,262,480,000	1.0	2021/09/20	0.67
日本	国債証券	第314回利付国債（2年）	2,200,000,000	99.97	2,199,470,000	100.00	2,200,110,000	0.1	2014/03/15	0.65
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	2,100,000,000	103.50	2,173,636,000	102.94	2,161,824,000	1.3	2015/06/20	0.64
日本	国債証券	第93回利付国債（5年）	2,100,000,000	100.96	2,120,274,000	101.19	2,125,011,000	0.5	2015/12/20	0.63
日本	国債証券	第85回利付国債（5年）	2,100,000,000	101.39	2,129,337,000	101.02	2,121,567,000	0.7	2014/09/20	0.63
日本	国債証券	第82回利付国債（5年）	2,100,000,000	101.63	2,134,356,000	100.96	2,120,202,000	0.9	2014/03/20	0.63
日本	国債証券	第86回利付国債（5年）	2,100,000,000	101.13	2,123,734,000	100.85	2,117,997,000	0.6	2014/09/20	0.63
日本	国債証券	第99回利付国債（5年）	2,090,000,000	100.58	2,102,290,200	101.01	2,111,171,700	0.4	2016/09/20	0.62
日本	国債証券	第318回利付国債（2年）	2,100,000,000	100.01	2,100,350,000	100.00	2,100,147,000	0.1	2014/07/15	0.62
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1,900,000,000	103.46	1,965,740,000	105.59	2,006,248,000	1.3	2021/03/20	0.59
日本	国債証券	第140回利付国債（20年）	2,010,000,000	100.35	2,017,035,900	99.26	1,995,266,700	1.7	2032/09/20	0.59
日本	国債証券	第92回利付国債（20年）	1,750,000,000	109.16	1,910,377,300	110.75	1,938,212,500	2.1	2026/12/20	0.57
日本	国債証券	第311回利付国債（10年）	1,900,000,000	99.76	1,895,440,000	101.99	1,937,943,000	0.8	2020/09/20	0.57

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.05
地方債証券	6.52
特殊債券	9.75
社債券	6.39
合計	100.69

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	13	1,871,504,095	1,867,450,000	1,867,450,000	0.55

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

外国株式マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年12月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	145,986,050,973	51.15
	イギリス	27,890,252,522	9.77
	カナダ	14,494,176,977	5.08
	スイス	12,206,154,536	4.28
	フランス	11,344,340,601	3.98
	ドイツ	11,243,330,251	3.94
	オーストラリア	10,355,379,658	3.63
	スウェーデン	3,986,979,885	1.40
	スペイン	3,902,432,588	1.37
	オランダ	3,891,246,909	1.36
	香港	3,285,469,607	1.15
	イタリア	2,806,655,141	0.98
	シンガポール	2,192,234,967	0.77
	アイルランド	1,956,373,961	0.69
	ベルギー	1,489,785,712	0.52
	デンマーク	1,478,791,139	0.52
	バミューダ	1,154,122,643	0.40
	アンティル	1,074,277,896	0.38
	ジャージー	1,049,653,263	0.37
	フィンランド	1,014,011,445	0.36
	ノルウェー	963,115,703	0.34
	イスラエル	690,370,992	0.24
ルクセンブルク	530,893,724	0.19	
オーストリア	384,594,761	0.13	
ケイマン	253,104,981	0.09	
ポルトガル	232,421,397	0.08	
パナマ	191,109,895	0.07	

	ニュージーランド	155,342,082	0.05
	マン島	76,519,691	0.03
	ギリシャ	69,715,169	0.02
	リベリア	57,925,310	0.02
	ガーンジー	51,867,959	0.02
	モーリシャス	43,095,677	0.02
	小計	266,501,798,015	93.38
投資信託受益証券	オーストラリア	115,466,685	0.04
	シンガポール	45,332,855	0.02
	香港	23,337,704	0.01
	小計	184,137,244	0.06
投資証券	アメリカ	4,125,957,945	1.45
	オーストラリア	819,004,090	0.29
	フランス	401,067,182	0.14
	イギリス	364,178,131	0.13
	香港	138,844,496	0.05
	シンガポール	118,973,252	0.04
	カナダ	73,282,172	0.03
	オランダ	37,366,130	0.01
	小計	6,078,673,398	2.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,626,378,153	4.42
合計(純資産総額)		285,390,986,810	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	126,268	40,396.49	5,100,784,807	44,593.89	5,630,781,908	1.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	621,642	7,422.50	4,614,139,858	7,520.33	4,674,958,452	1.64
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	1,422,685	1,648.48	2,345,272,321	1,791.34	2,548,512,832	0.89
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	264,302	9,225.96	2,438,440,948	9,395.66	2,483,292,152	0.87
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	433,994	5,042.98	2,188,625,666	5,679.76	2,464,983,931	0.86
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	146,202	16,694.35	2,440,748,177	16,684.83	2,439,355,778	0.85

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,016,562	2,612.98	2,656,260,647	2,334.19	2,372,855,767	0.83
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	775,724	2,600.86	2,017,552,004	2,914.28	2,260,679,110	0.79
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	370,918	5,628.56	2,087,736,369	6,068.39	2,250,875,898	0.79
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	2,469,299	774.33	1,912,067,110	909.67	2,246,248,209	0.79
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,004,602	1,813.85	1,822,198,342	2,176.62	2,186,638,010	0.77
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	370,929	5,496.09	2,038,662,283	5,884.84	2,182,858,780	0.76
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	35,303	52,686.52	1,859,992,476	61,150.58	2,158,799,215	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	675,128	2,616.44	1,766,437,035	2,959.30	1,997,909,260	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	511,516	3,292.63	1,684,236,712	3,777.48	1,932,244,221	0.68
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	547,002	2,949.78	1,613,535,887	3,153.24	1,724,830,555	0.60
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	309,471	4,905.38	1,518,073,163	5,475.72	1,694,579,638	0.59
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	94,596	14,982.81	1,417,314,083	17,622.92	1,667,058,686	0.58
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	227,065	6,660.59	1,512,389,002	7,252.80	1,646,858,530	0.58
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	2,567,039	679.46	1,744,206,479	597.77	1,534,507,732	0.54
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	526,708	2,506.49	1,320,188,861	2,880.51	1,517,191,137	0.53
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	501,090	3,139.20	1,573,021,728	2,994.09	1,500,313,168	0.53
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	249,802	5,361.03	1,339,196,915	5,903.89	1,474,803,579	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	409,609	3,322.94	1,361,106,294	3,567.09	1,461,114,625	0.51
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	6,632,395	245.55	1,628,619,080	217.72	1,444,011,405	0.51
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	434,661	3,417.78	1,485,579,149	3,321.70	1,443,814,313	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	1,452,924	684.84	995,031,804	993.07	1,442,859,014	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	382,883	3,307.35	1,266,330,387	3,764.49	1,441,362,440	0.51

アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	395,588	2,869.26	1,135,045,299	3,398.26	1,344,312,854	0.47
フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	160,782	6,389.34	1,027,291,989	8,276.32	1,330,684,327	0.47

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	93.38
投資信託受益証券	0.06
投資証券	2.13
合計	95.58

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.63
		素材	6.69
		資本財	7.06
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.67
		自動車・自動車部品	1.40
		耐久消費財・アパレル	1.40
		消費者サービス	1.58
		メディア	2.63
		小売	2.81
		食品・生活必需品小売り	2.23
		食品・飲料・タバコ	6.56
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	2.54
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.88
		銀行	7.66
		各種金融	4.72
		保険	4.15
		不動産	0.77
		ソフトウェア・サービス	5.87
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.13
電気通信サービス	3.63		

	公益事業	3.36
	半導体・半導体製造装置	1.33
合計		93.38

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	192	68,281,126.50	67,713,600	5,862,643,488	2.05
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	45	6,360,386.50	6,363,000	553,899,150	0.19
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	スイスフラン	92	6,297,434	6,253,240	593,432,476	0.21
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	372	9,868,374	9,872,880	1,132,518,064	0.40
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	82	9,462,599	9,487,400	851,968,520	0.30
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物オブ ション取引所	買建	イギリスポンド	152	9,004,665	8,993,840	1,254,820,556	0.44

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

外国債券マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年12月28日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	173,921,471,591	40.11
	フランス	42,349,875,168	9.77
	イタリア	39,486,991,323	9.11
	ドイツ	38,494,833,873	8.88
	イギリス	33,499,423,364	7.73
	スペイン	18,391,158,553	4.24
	カナダ	11,714,681,081	2.70
	オランダ	11,602,398,435	2.68
	ベルギー	11,470,487,981	2.65

オーストリア	7,281,760,645	1.68
オーストラリア	6,713,727,487	1.55
メキシコ	4,207,637,612	0.97
デンマーク	3,481,781,793	0.80
ポーランド	3,289,473,920	0.76
アイルランド	3,264,928,070	0.75
南アフリカ	2,783,298,525	0.64
フィンランド	2,617,740,146	0.60
スウェーデン	2,585,833,600	0.60
マレーシア	2,261,994,392	0.52
スイス	1,837,731,463	0.42
シンガポール	1,682,843,685	0.39
ノルウェー	1,096,305,472	0.25
小計	424,036,378,179	97.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	9,605,316,902	2.22
合計(純資産総額)	433,641,695,081	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 1.5% 12/31/13	40,120,000	8,864.98	3,556,630,101	8,772.64	3,519,586,873	1.500	2013/12/31	0.81
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	31,900,000	8,782.16	2,801,510,661	8,738.49	2,787,579,402	1.750	2022/05/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	28,850,000	9,606.91	2,771,595,496	9,520.75	2,746,737,062	3.000	2017/02/28	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/19	30,050,000	8,610.31	2,587,399,164	8,811.54	2,647,868,062	1.250	2019/01/31	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	28,200,000	9,159.29	2,582,922,092	8,985.03	2,533,780,894	2.625	2014/07/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	26,000,000	9,117.95	2,370,668,625	8,965.09	2,330,923,556	2.375	2014/08/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	22,030,000	10,036.35	2,211,008,698	10,117.68	2,228,926,413	3.625	2020/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	22,050,000	9,954.96	2,195,070,532	10,057.48	2,217,676,055	3.500	2020/05/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/15/14	25,000,000	8,804.10	2,201,025,937	8,759.80	2,189,950,191	1.250	2014/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/21	24,320,000	8,731.05	2,123,391,816	8,990.11	2,186,395,292	2.000	2021/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	23,900,000	9,098.34	2,174,503,382	8,993.83	2,149,526,603	1.875	2015/06/30	0.50

アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	23,700,000	8,659.69	2,052,346,771	8,671.18	2,055,071,113	0.375	2015/04/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.125% 08/15/21	22,400,000	8,885.21	1,990,288,918	9,109.84	2,040,604,989	2.125	2021/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 09/30/14	22,150,000	9,069.12	2,008,812,051	8,980.98	1,989,288,551	2.375	2014/09/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	22,000,000	9,031.47	1,986,923,554	8,973.20	1,974,104,692	1.750	2015/07/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 06/30/16	21,960,000	8,990.11	1,974,229,366	8,970.50	1,969,922,206	1.500	2016/06/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.75% 08/15/17	19,000,000	10,413.27	1,978,522,101	10,277.65	1,952,753,891	4.750	2017/08/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/15	21,980,000	8,915.03	1,959,524,555	8,871.74	1,950,010,365	1.250	2015/09/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	21,400,000	9,040.95	1,934,764,212	8,965.76	1,918,673,908	2.125	2014/11/30	0.44
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	13,500,000	12,728.22	1,718,309,916	13,840.67	1,868,491,689	4.250	2023/10/25	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/17	18,500,000	10,303.02	1,906,058,700	10,089.61	1,866,579,258	4.625	2017/02/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1% 08/31/16	21,000,000	8,824.07	1,853,055,046	8,818.98	1,851,987,238	1.000	2016/08/31	0.43
フランス	国債証券	FRTR 3% 10/25/15	14,210,000	12,153.52	1,727,015,831	12,377.78	1,758,882,900	3.000	2015/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.5% 08/15/14	20,150,000	8,701.62	1,753,378,176	8,694.86	1,752,015,451	0.500	2014/08/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/15	20,090,000	8,629.59	1,733,684,819	8,644.81	1,736,742,409	0.250	2015/05/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/40	14,700,000	11,314.92	1,663,293,791	11,744.43	1,726,432,455	4.625	2040/02/15	0.40
ドイツ	国債証券	DBR 2.25% 09/04/20	13,530,000	12,021.60	1,626,523,562	12,600.09	1,704,792,248	2.250	2020/09/04	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 10/25/19	12,750,000	12,439.15	1,585,991,931	13,368.30	1,704,458,683	3.750	2019/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	18,900,000	8,913.68	1,684,685,814	8,804.10	1,663,975,608	1.750	2014/01/31	0.38
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	12,220,000	12,314.11	1,504,785,280	13,372.08	1,634,069,255	3.750	2021/04/25	0.38

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.78
合計	97.78

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券 先物 取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	36	4,466,956.68	4,477,500	387,661,950	0.09
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	20	2,643,205	2,658,437.60	230,167,527	0.05
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	14	2,051,056	2,076,812.50	179,810,426	0.04
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	21	2,326,359	2,326,485	266,871,094	0.06
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	22	2,798,928	2,808,740	322,190,565	0.07
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	34	4,907,016	4,948,360	567,626,375	0.13

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

Jリートマザーファンド(M)

(1)投資状況

(平成24年12月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	12,520,966,020	96.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		438,453,789	3.38
合計(純資産総額)		12,959,419,809	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,895	780,000.00	1,478,100,000	893,000.00	1,692,235,000	13.06
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,847	751,797.79	1,388,570,518	850,000.00	1,569,950,000	12.11
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5,897	132,851.22	783,423,644	158,600.00	935,264,200	7.22

日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,045	84,700.00	512,011,500	99,200.00	599,664,000	4.63
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3,336	150,500.00	502,068,000	177,100.00	590,805,600	4.56
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,369	208,900.00	494,884,100	249,200.00	590,354,800	4.56
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	711	633,000.00	450,063,000	755,000.00	536,805,000	4.14
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	627	661,000.00	414,447,000	727,000.00	455,829,000	3.52
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	781	445,000.00	347,545,000	497,000.00	388,157,000	3.00
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	825	319,221.19	263,357,481	463,000.00	381,975,000	2.95
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	473	676,070.14	319,781,176	752,000.00	355,696,000	2.74
日本	投資証券	G L P 投資法人	5,197	62,465.66	324,634,081	66,200.00	344,041,400	2.65
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	507	549,000.00	278,343,000	676,000.00	342,732,000	2.64
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	538	532,000.00	286,216,000	600,000.00	322,800,000	2.49
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	671	377,915.20	253,581,099	470,500.00	315,705,500	2.44
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	569	464,000.00	264,016,000	542,000.00	308,398,000	2.38
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	459	516,000.00	236,844,000	646,000.00	296,514,000	2.29
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	690	355,000.00	244,950,000	425,500.00	293,595,000	2.27
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	948	264,816.05	251,045,623	301,000.00	285,348,000	2.20
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	543	386,500.00	209,869,500	485,000.00	263,355,000	2.03
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	860	222,900.00	191,694,000	298,500.00	256,710,000	1.98
日本	投資証券	プレミアム投資法人	678	275,202.27	186,587,142	318,500.00	215,943,000	1.67
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	343	503,048.40	172,545,601	549,000.00	188,307,000	1.45
日本	投資証券	福岡リート投資法人	285	550,000.00	156,750,000	658,000.00	187,530,000	1.45
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	473	348,046.17	164,625,838	396,000.00	187,308,000	1.45
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	354	417,000.00	147,618,000	478,000.00	169,212,000	1.31
日本	投資証券	トップリート投資法人	452	367,000.00	165,884,000	371,500.00	167,918,000	1.30
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,154	21,102.65	129,865,708	23,880.00	146,957,520	1.13
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	181	476,000.00	86,156,000	514,000.00	93,034,000	0.72
日本	投資証券	阪急リート投資法人	94	355,000.00	33,370,000	413,000.00	38,822,000	0.30

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	96.62
合計	96.62

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

c . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

(1)投資状況

(平成24年12月28日現在)

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	517,679,969	62.25
	オーストラリア	93,119,765	11.20
	イギリス	48,342,569	5.81
	フランス	43,824,190	5.27
	シンガポール	32,543,985	3.91
	カナダ	25,336,787	3.05
	香港	16,811,183	2.02
	オランダ	9,692,669	1.17
	ベルギー	4,706,850	0.57
	ニュージーランド	2,673,556	0.32
	ドイツ	1,340,827	0.16
	イタリア	821,259	0.10
	イスラエル	254,048	0.03
	小計	797,147,657	95.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		34,432,137	4.14
合計(純資産総額)		831,579,794	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年12月28日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	4,059	13,770.54	55,894,658	13,673.57	55,501,058	6.67
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	27,158	924.93	25,119,520	951.87	25,851,157	3.11
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	1,198	18,732.14	22,441,107	21,554.00	25,821,702	3.11
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,892	12,711.67	24,050,490	12,499.55	23,649,157	2.84
アメリカ	投資証券	HCP INC	5,932	4,030.29	23,907,733	3,908.22	23,183,568	2.79
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	3,878	5,631.16	21,837,650	5,573.15	21,612,693	2.60
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	4,222	5,225.10	22,060,384	4,885.70	20,627,465	2.48
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6,048	3,093.50	18,709,508	3,141.12	18,997,508	2.28
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	1,980	9,902.15	19,606,266	9,148.90	18,114,839	2.18
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	3,408	5,068.39	17,273,084	5,258.00	17,919,275	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,501	12,399.12	18,611,081	11,755.83	17,645,504	2.12
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	2,223	7,089.17	15,759,225	6,886.57	15,308,852	1.84
香港	投資証券	LINK REIT	30,000	393.74	11,812,275	437.30	13,119,165	1.58
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	9,510	1,411.25	13,421,025	1,348.05	12,819,961	1.54
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,237	1,120.34	11,468,977	1,151.73	11,790,337	1.42
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	5,914	1,817.31	10,747,596	1,705.62	10,087,072	1.21
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	36,867	264.90	9,766,436	272.09	10,031,289	1.21
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,619	6,355.83	10,290,101	5,860.59	9,488,311	1.14
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	11,666	756.19	8,821,810	797.35	9,301,964	1.12
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	29,130	300.82	8,763,177	316.99	9,234,035	1.11
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	1,793	5,265.79	9,441,571	5,038.08	9,033,295	1.09
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	5,349	1,773.15	9,484,624	1,682.24	8,998,352	1.08
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	1,186	7,133.32	8,460,124	6,618.17	7,849,155	0.94
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	19,986	374.46	7,484,077	391.52	7,825,078	0.94
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	848	9,431.15	7,997,623	9,091.76	7,709,817	0.93
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	21,380	324.17	6,930,925	329.56	7,046,121	0.85
アメリカ	投資証券	UDR INC	3,282	2,239.82	7,351,104	2,057.14	6,751,536	0.81
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,104	6,012.98	6,638,331	5,896.96	6,510,248	0.78
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	9,353	652.95	6,107,075	693.41	6,485,504	0.78
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	1,751	3,703.89	6,485,515	3,510.81	6,147,444	0.74

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	95.86
合計	95.86

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報) 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	投資比率	上位購入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期	MYE投資比率
外国株式 マザーファンド	17.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/機器	-	-	0.3%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.3%
リートマザー ファンド(M)	17.1%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	2.2%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	2.1%
海外リート マザーファンド	17.0%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.1%
		WESTFIELD GROUP	オーストラリア	投資証券	-	-	-	0.5%
外国債券 マザーファンド	16.9%	T 1.5% 12/31/13	アメリカ	国債証券	-	1.500%	2013/12/31	0.1%
		T 1.75% 05/15/22	アメリカ	国債証券	-	1.750%	2022/05/15	0.1%
日本株式 マザーファンド	16.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
日本債券 マザーファンド	15.0%	第325回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	0.800%	2022/09/20	0.3%
		第106回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.200%	2017/09/20	0.2%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2007年は当初設定日から年末までの収益率です。

※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】

3 資産管理等の概要

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「3 資産管理等の概要」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部____は訂正部分を示します。

（1）資産の評価

<訂正前>

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。

（後略）

<訂正後>

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。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た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。

（後略）

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(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11特定期間(平成24年6月12日から平成24年12月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

[次へ](#)

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

項目	第10特定期間 (平成24年 6月11日現在) 金額(円)	第11特定期間 (平成24年12月10日現在) 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	-	2,998,125
親投資信託受益証券	1,114,314,517	1,039,714,141
未収入金	586,350	3,658,410
未収利息	-	5
流動資産合計	1,114,900,867	1,046,370,681
資産合計	1,114,900,867	1,046,370,681
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,627,032	1,610,888
未払解約金	586,350	1,267,972
未払受託者報酬	41,351	33,269
未払委託者報酬	930,379	748,573
その他未払費用	5,159	4,149
流動負債合計	7,190,271	3,664,851
負債合計	7,190,271	3,664,851
純資産の部		
元本等		
元本	1,875,677,465	1,610,888,509
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	767,966,869	568,182,679
（分配準備積立金）	(16,150,992)	(16,977,422)
元本等合計	1,107,710,596	1,042,705,830
純資産合計	1,107,710,596	1,042,705,830
負債純資産合計	1,114,900,867	1,046,370,681

(2)損益及び剰余金計算書

項目	第10特定期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月11日 金額(円)	第11特定期間 自 平成24年 6月12日 至 平成24年12月10日 金額(円)
営業収益		
受取利息	-	583
有価証券売買等損益	72,111,422	112,704,853
営業収益合計	72,111,422	112,705,436
営業費用		
受託者報酬	251,351	222,890
委託者報酬	5,655,379	5,014,962
その他費用	31,359	27,800

営業費用合計	5,938,089	5,265,652
営業利益又は営業損失()	66,173,333	107,439,784
経常利益又は経常損失()	66,173,333	107,439,784
当期純利益又は当期純損失()	66,173,333	107,439,784
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()	1,004,352	1,492,252
期首剰余金又は期首欠損金()	887,138,966	767,966,869
剰余金増加額又は欠損金減少額	89,512,594	104,206,014
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	89,512,594	104,206,014
剰余金減少額又は欠損金増加額	78,115	106,620
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	78,115	106,620
分配金	35,431,363	10,262,736
期末剰余金又は期末欠損金()	767,966,869	568,182,679

[次へ](#)

(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11特定期間(自 平成24年 6月12日 至 平成24年12月10日) 第11特定期間は前特定期間末日が休業日のため、平成24年 6月12日から平成24年12月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第10特定期間 (平成24年 6月11日現在)	第11特定期間 (平成24年12月10日現在)
1. 期首元本額	2,099,814,757円	1,875,677,465円
期中追加設定元本額	196,582円	273,173円
期中一部解約元本額	224,333,874円	265,062,129円
2. 当該特定期間の末日における受益権総数	1,875,677,465口	1,610,888,509口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 767,966,869円	元本の欠損 568,182,679円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5906円 (5,906円)	0.6473円 (6,473円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第10特定期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月11日	第11特定期間 自 平成24年 6月12日 至 平成24年12月10日
		第52期 自 平成23年12月13日 至 平成24年1月10日	第58期 自 平成24年6月12日 至 平成24年7月10日
費用控除後の配当等収益額	A	2,660,142円 (3,600,656円)	3,151,325円 (3,260,493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	33,661,280円	29,852,373円
分配準備積立金額	D	37,906,895円	15,836,280円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	74,228,317円	48,839,978円
当ファンドの期末残存口数	F	2,073,963,421口	1,839,130,346口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	357.90円	265.56円
10,000口当たり分配金額	H	30円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,221,890円	1,839,130円

		第53期 自 平成24年1月11日 至 平成24年2月10日	第59期 自 平成24年7月11日 至 平成24年8月10日
費用控除後の配当等収益額	A	2,134,626円 (2,170,712円)	1,714,404円 (1,998,330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	32,793,608円	28,969,738円
分配準備積立金額	D	33,457,560円	16,640,255円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	68,385,794円	47,324,397円
当ファンドの期末残存口数	F	2,020,431,503口	1,784,704,281口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	338.47円	265.16円
10,000口当たり分配金額	H	30円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,061,294円	1,784,704円
		第54期 自 平成24年2月11日 至 平成24年3月12日	第60期 自 平成24年8月11日 至 平成24年9月10日
費用控除後の配当等収益額	A	3,005,239円 (3,046,299円)	2,504,876円 (2,642,338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	32,170,812円	28,000,247円
分配準備積立金額	D	28,969,580円	16,013,035円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	64,145,631円	46,518,158円
当ファンドの期末残存口数	F	1,982,043,242口	1,724,877,858口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	323.63円	269.68円
10,000口当たり分配金額	H	30円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	5,946,129円	1,724,877円
		第55期 自 平成24年3月13日 至 平成24年4月10日	第61期 自 平成24年9月11日 至 平成24年10月10日
費用控除後の配当等収益額	A	5,067,692円 (6,058,877円)	2,891,973円 (3,745,696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	31,522,377円	27,064,396円
分配準備積立金額	D	25,503,264円	16,231,240円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,093,333円	46,187,609円
当ファンドの期末残存口数	F	1,942,064,153口	1,667,207,259口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	319.72円	277.03円
10,000口当たり分配金額	H	30円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	5,826,192円	1,667,207円
		第56期 自 平成24年4月11日 至 平成24年5月10日	第62期 自 平成24年10月11日 至 平成24年11月12日

費用控除後の配当等収益額	A	2,100,324円 (3,082,520円)	1,531,105円 (1,822,335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	31,104,214円	26,556,673円
分配準備積立金額	D	24,415,772円	17,128,534円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,620,310円	45,216,312円
当ファンドの期末残存口数	F	1,916,275,462口	1,635,930,194口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	300.68円	276.39円
10,000口当たり分配金額	H	30円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	5,748,826円	1,635,930円
		第57期 自 平成24年5月11日 至 平成24年6月11日	第63期 自 平成24年11月13日 至 平成24年12月10日
費用控除後の配当等収益額	A	1,451,087円 (2,427,976円)	1,825,187円 (1,852,870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	30,445,624円	26,150,164円
分配準備積立金額	D	20,326,937円	16,763,123円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,223,648円	44,738,474円
当ファンドの期末残存口数	F	1,875,677,465口	1,610,888,509口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	278.42円	277.72円
10,000口当たり分配金額	H	30円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	5,627,032円	1,610,888円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	(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. 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10特定期間 (平成24年 6月11日現在)	第11特定期間 (平成24年12月10日現在)
	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)	計算期間(自 平成24年11月13日 至 平成24年12月10日)の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	29,293,524	52,274,345
合計	29,293,524	52,274,345

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

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	229,695,028	167,907,065	
	日本債券マザーファンド	131,730,561	161,633,398	
	外国株式マザーファンド	168,532,784	182,756,950	
	外国債券マザーファンド	105,928,835	175,015,621	
	Jリートマザーファンド(M)	141,690,447	176,815,508	
	海外リートマザーファンド	275,040,099	175,585,599	
親投資信託受益証券 小計		1,052,617,754	1,039,714,141	
合計		1,052,617,754	1,039,714,141	

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）」、「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12月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「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12月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,936,957,732
株式	248,212,309,783
派生商品評価勘定	276,435,475
未収入金	2,711,325
未収配当金	190,518,294
未収利息	9,767
流動資産合計	253,618,942,376
資産合計	253,618,942,376
負債の部	
流動負債	
前受金	240,939,000
未払金	3,900,790
未払解約金	136,610,255
流動負債合計	381,450,045
負債合計	381,450,045
純資産の部	
元本等	
元本	346,425,374,590
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	93,187,882,259
元本等合計	253,237,492,331
純資産合計	253,237,492,331
負債純資産合計	253,618,942,376

(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12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日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 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月10日現在
1. 特定期間の期首元本額	348,529,838,430円
特定期間中の追加設定元本額	16,367,753,409円
特定期間中の一部解約元本額	18,472,217,249円
計算日の元本額	346,425,374,590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	2,278,136,227円
DC日本株式インデックスファンド	366,953,881円
DC日本株式インデックスファンドL	49,339,714,504円
DC日本株式インデックスファンドA	1,604,493,249円
DCバランスファンド30	526,121,092円
DCバランスファンド50	1,198,217,529円
DCバランスファンド70	629,699,835円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	229,695,028円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	154,601,019円
新生・4分散ファンド	212,812,382円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	989,170,103円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	53,219,434円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	190,718,538円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	269,598,617円
日本株式インデックスe	1,358,547,585円
インデックスコレクション（国内株式）	3,593,920,472円
インデックスコレクション（バランス株式30）	629,610,693円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,051,429,601円
インデックスコレクション（バランス株式70）	867,082,879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）	30,930,955,162円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	6,728,096,555円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	54,190,992,746円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	39,426,699,837円

V Aバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	6,393,459,357円
V Aバランス株式30(適格機関投資家専用)	1,028,059,191円
V Aバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	7,995,301,186円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,535,307,856円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,604,272,233円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	39,632,547,795円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,832,149,807円
V Aバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	20,113,897,345円
V Aポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	7,891,398,451円
V Aポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	267,695,509円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,543,826,377円
V Aバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,794,560,211円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	8,558,077,062円
V Aバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	410,452,068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)	1,215,216,930円
V Aバランス50-50(適格機関投資家専用)	331,085,296円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,791,093,446円
V Aファンド25(適格機関投資家専用)	3,649,240,664円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	3,342,691,237円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	144,177,466円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,901,784,886円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	24,960,872,390円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	621,699,061円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	231,272,460円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	79,121,853円
V Aバランス20-80(適格機関投資家専用)	708,791,809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)	22,022,708円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	4,812,968円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 株式 9,121,500,000円 なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。
3. 計算日における受益権総数	346,425,374,590口
4. 「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 93,187,882,259円
5. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7310円 (7,310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12月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	10,426,902,935	
合計	10,426,902,935	

(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12月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

. 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12月10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	4,705,309,525	-	4,981,745,000	276,435,475
	合計	4,705,309,525	-	4,981,745,000	276,435,475

(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12月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年12月10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12月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	109,000	184.00	20,056,000	
日本水産	275,500	152.00	41,876,000	
マルハニチロホールディングス	491,000	141.00	69,231,000	
サカタのタネ	37,800	1,056.00	39,916,800	
ホクト	26,000	1,672.00	43,472,000	
住石ホールディングス	75,200	79.00	5,940,800	
日鉄鉱業	65,000	348.00	22,620,000	
三井松島産業	167,000	135.00	22,545,000	
国際石油開発帝石	3,114	440,000.00	1,370,160,000	
日本海洋掘削	6,400	2,374.00	15,193,600	
関東天然瓦斯開発	26,000	450.00	11,700,000	
石油資源開発	36,500	2,817.00	102,820,500	
ショーボンドホールディングス	22,700	2,754.00	62,515,800	
ミライト・ホールディングス	73,300	690.00	50,577,000	
ダイセキ環境ソリューション	37	123,000.00	4,551,000	
間組	86,700	230.00	19,941,000	
東急建設	102,380	180.00	18,428,400	
コムシスホールディングス	124,400	1,006.00	125,146,400	
ミサワホーム	33,700	1,150.00	38,755,000	
高松コンストラクショングループ	19,700	1,316.00	25,925,200	
東建コーポレーション	9,700	4,185.00	40,594,500	
ヤマウラ	19,000	253.00	4,807,000	
大成建設	1,297,000	236.00	306,092,000	
大林組	770,000	411.00	316,470,000	
清水建設	785,000	266.00	208,810,000	
長谷工コーポレーション	1,601,500	59.00	94,488,500	
松井建設	30,000	322.00	9,660,000	
鹿島建設	1,128,000	246.00	277,488,000	
鉄建建設	156,000	117.00	18,252,000	
安藤建設	85,000	120.00	10,200,000	
太平工業	57,000	328.00	18,696,000	
西松建設	348,000	154.00	53,592,000	
三井住友建設	356,900	75.00	26,767,500	
前田建設工業	166,000	396.00	65,736,000	
ナカノフドー建設	47,000	172.00	8,084,000	
奥村組	229,000	294.00	67,326,000	
大和小田急建設	12,500	176.00	2,200,000	
東鉄工業	33,900	1,002.00	33,967,800	
イチケン	53,000	150.00	7,950,000	
戸田建設	300,000	206.00	61,800,000	
熊谷組	185,000	85.00	15,725,000	
青木あすなる建設	15,000	526.00	7,890,000	
北野建設	61,000	203.00	12,383,000	

植木組	59,000	174.00	10,266,000
三井ホーム	34,000	419.00	14,246,000
矢作建設工業	38,700	376.00	14,551,200
ピーエス三菱	16,200	503.00	8,148,600
大東建託	97,300	7,990.00	777,427,000
新日本建設	51,900	203.00	10,535,700
N I P P O	59,000	997.00	58,823,000
東亜道路工業	59,000	249.00	14,691,000
前田道路	74,000	1,185.00	87,690,000
日本道路	82,000	340.00	27,880,000
東亜建設工業	232,000	130.00	30,160,000
五洋建設	314,000	211.00	66,254,000
大林道路	41,000	243.00	9,963,000
福田組	51,000	378.00	19,278,000
住友林業	177,000	742.00	131,334,000
日本基礎技術	36,900	319.00	11,771,100
日成ビルド工業	104,000	180.00	18,720,000
巴コーポレーション	34,700	276.00	9,577,200
パナホーム	97,000	530.00	51,410,000
大和ハウス工業	639,000	1,306.00	834,534,000
ライト工業	63,300	428.00	27,092,400
積水ハウス	769,000	806.00	619,814,000
日特建設	32,200	333.00	10,722,600
北陸電気工事	21,000	233.00	4,893,000
ユアテック	40,000	300.00	12,000,000
西部電気工業	25,000	353.00	8,825,000
四電工	24,000	311.00	7,464,000
中電工	37,000	799.00	29,563,000
関電工	117,000	365.00	42,705,000
きんでん	170,000	516.00	87,720,000
東京エネシス	32,000	410.00	13,120,000
トーエネック	40,000	474.00	18,960,000
住友電設	20,900	820.00	17,138,000
日本電設工業	46,000	754.00	34,684,000
協和エクシオ	92,000	846.00	77,832,000
新日本空調	24,300	481.00	11,688,300
N D S	43,000	255.00	10,965,000
九電工	45,000	390.00	17,550,000
三機工業	59,000	391.00	23,069,000
日揮	258,000	2,767.00	713,886,000
中外炉工業	95,000	222.00	21,090,000
ヤマト	24,000	290.00	6,960,000
太平電業	35,000	499.00	17,465,000
高砂熱学工業	73,800	630.00	46,494,000
三晃金属工業	48,000	216.00	10,368,000
朝日工業社	28,000	271.00	7,588,000
大気社	36,800	1,686.00	62,044,800
ダイダン	35,000	521.00	18,235,000

日比谷総合設備	31,500	956.00	30,114,000
東芝プラントシステム	42,000	1,171.00	49,182,000
東洋エンジニアリング	149,000	370.00	55,130,000
千代田化工建設	185,000	1,205.00	222,925,000
新興プランテック	52,600	663.00	34,873,800
日本製粉	157,000	355.00	55,735,000
日清製粉グループ本社	232,000	1,074.00	249,168,000
日東富士製粉	20,000	298.00	5,960,000
昭和産業	105,000	278.00	29,190,000
鳥越製粉	20,300	643.00	13,052,900
協同飼料	89,000	96.00	8,544,000
中部飼料	23,600	518.00	12,224,800
日本配合飼料	70,000	103.00	7,210,000
東洋精糖	46,000	90.00	4,140,000
日本甜菜製糖	131,000	158.00	20,698,000
三井製糖	101,000	257.00	25,957,000
森永製菓	250,000	182.00	45,500,000
中村屋	60,000	405.00	24,300,000
江崎グリコ	93,000	891.00	82,863,000
名糖産業	11,300	1,010.00	11,413,000
不二家	146,000	198.00	28,908,000
山崎製パン	188,000	969.00	182,172,000
モロゾフ	39,000	284.00	11,076,000
亀田製菓	14,300	1,957.00	27,985,100
カルビー	23,200	6,650.00	154,280,000
森永乳業	219,000	271.00	59,349,000
ヤクルト本社	149,800	3,770.00	564,746,000
明治ホールディングス	75,900	3,665.00	278,173,500
雪印メグミルク	50,200	1,371.00	68,824,200
プリマハム	148,000	143.00	21,164,000
日本ハム	195,000	1,211.00	236,145,000
伊藤ハム	141,000	373.00	52,593,000
丸大食品	122,000	283.00	34,526,000
米久	22,500	709.00	15,952,500
S Foods	16,500	787.00	12,985,500
サッポロホールディングス	425,000	258.00	109,650,000
アサヒグループホールディングス	514,900	1,908.00	982,429,200
キリンホールディングス	1,096,000	1,035.00	1,134,360,000
宝ホールディングス	201,000	616.00	123,816,000
オエノンホールディングス	68,000	207.00	14,076,000
養命酒製造	19,000	719.00	13,661,000
三国コカ・コーラボトリング	26,600	695.00	18,487,000
コカ・コーラウエスト	86,800	1,292.00	112,145,600
コカ・コーラ セントラル ジャパン	32,000	1,058.00	33,856,000
ダイトードリンコ	12,900	3,440.00	44,376,000
伊藤園	71,200	1,554.00	110,644,800
キーコーヒー	22,300	1,565.00	34,899,500
ユニカフェ	6,900	416.00	2,870,400

ジャパンフーズ	3,900	885.00	3,451,500
日清オイリオグループ	111,000	303.00	33,633,000
不二製油	62,200	1,204.00	74,888,800
J-オイルミルズ	107,000	233.00	24,931,000
キッコーマン	209,000	1,192.00	249,128,000
味の素	675,000	1,179.00	795,825,000
キューピー	130,300	1,212.00	157,923,600
ハウス食品	91,000	1,292.00	117,572,000
カゴメ	91,900	1,651.00	151,726,900
焼津水産化学工業	12,000	749.00	8,988,000
アリアケジャパン	23,300	1,614.00	37,606,200
ニチレイ	287,000	441.00	126,567,000
東洋水産	118,000	2,349.00	277,182,000
日清食品ホールディングス	100,100	3,280.00	328,328,000
永谷園	24,000	813.00	19,512,000
フジッコ	27,000	1,013.00	27,351,000
ロック・フィールド	13,300	1,438.00	19,125,400
日本たばこ産業	1,135,800	2,376.00	2,698,660,800
ケンコーマヨネーズ	8,800	780.00	6,864,000
わらべや日洋	15,700	1,544.00	24,240,800
なとり	11,800	861.00	10,159,800
ミヨシ油脂	87,000	104.00	9,048,000
片倉工業	30,200	684.00	20,656,800
グンゼ	179,000	208.00	37,232,000
東洋紡	1,014,000	115.00	116,610,000
ユニチカ	656,000	42.00	27,552,000
富士紡ホールディングス	108,000	328.00	35,424,000
日清紡ホールディングス	153,000	611.00	93,483,000
倉敷紡績	247,000	137.00	33,839,000
シキボウ	146,000	106.00	15,476,000
日本毛織	75,000	558.00	41,850,000
トーア紡コーポレーション	108,000	62.00	6,696,000
ダイドーリミテッド	27,100	501.00	13,577,100
帝国繊維	25,000	640.00	16,000,000
帝人	910,000	190.00	172,900,000
東レ	1,853,000	492.00	911,676,000
サカイオーベックス	65,000	116.00	7,540,000
住江織物	60,000	164.00	9,840,000
日本フェルト	13,400	410.00	5,494,000
イチカワ	18,000	155.00	2,790,000
日本バイリーン	32,000	339.00	10,848,000
芦森工業	67,000	109.00	7,303,000
アツギ	201,000	101.00	20,301,000
ダイニック	45,000	160.00	7,200,000
セーレン	64,500	498.00	32,121,000
東海染工	33,000	92.00	3,036,000
小松精練	41,000	384.00	15,744,000
ワコールホールディングス	143,000	896.00	128,128,000

ホギメディカル	15,100	4,160.00	62,816,000
レナウン	51,700	108.00	5,583,600
クラウドシア	3,500	1,064.00	3,724,000
T S Iホールディングス	124,100	462.00	57,334,200
三陽商会	128,000	244.00	31,232,000
オンワードホールディングス	160,000	640.00	102,400,000
ルック	43,000	393.00	16,899,000
ゴールドウイン	57,000	528.00	30,096,000
デサント	61,000	504.00	30,744,000
ヤマトインターナショナル	14,500	370.00	5,365,000
特種東海製紙	139,000	206.00	28,634,000
王子ホールディングス	1,058,000	250.00	264,500,000
三菱製紙	340,000	79.00	26,860,000
北越紀州製紙	148,500	434.00	64,449,000
中越パルプ工業	91,000	140.00	12,740,000
巴川製紙所	37,000	155.00	5,735,000
大王製紙	101,000	545.00	55,045,000
日本製紙グループ本社	115,500	1,030.00	118,965,000
レンゴー	192,000	387.00	74,304,000
トーモク	76,000	229.00	17,404,000
ザ・バック	17,000	1,458.00	24,786,000
クラレ	407,700	1,039.00	423,600,300
旭化成	1,494,000	478.00	714,132,000
共和レザー	13,900	260.00	3,614,000
コープケミカル	36,000	95.00	3,420,000
昭和電工	1,488,000	118.00	175,584,000
住友化学	1,645,000	239.00	393,155,000
日本化成	45,000	108.00	4,860,000
住友精化	45,000	288.00	12,960,000
日産化学工業	170,000	955.00	162,350,000
ラサ工業	85,000	83.00	7,055,000
クレハ	168,000	286.00	48,048,000
テイカ	40,000	238.00	9,520,000
石原産業	430,000	60.00	25,800,000
片倉チッカリン	15,000	195.00	2,925,000
日本曹達	142,000	355.00	50,410,000
東ソー	640,000	179.00	114,560,000
トクヤマ	348,000	145.00	50,460,000
セントラル硝子	214,000	277.00	59,278,000
東亜合成	281,000	350.00	98,350,000
ダイソー	95,000	228.00	21,660,000
関東電化工業	57,000	169.00	9,633,000
電気化学工業	479,000	275.00	131,725,000
信越化学工業	429,400	4,920.00	2,112,648,000
日本カーバイド工業	70,000	195.00	13,650,000
堺化学工業	89,000	233.00	20,737,000
エア・ウォーター	197,000	1,058.00	208,426,000
大陽日酸	315,000	461.00	145,215,000

日本化学工業	89,000	113.00	10,057,000
日本パーカラライジング	56,000	1,238.00	69,328,000
高压ガス工業	36,000	427.00	15,372,000
チタン工業	28,000	223.00	6,244,000
四国化成工業	35,000	475.00	16,625,000
戸田工業	34,000	370.00	12,580,000
ステラ ケミファ	10,500	1,487.00	15,613,500
保土谷化学工業	54,000	158.00	8,532,000
日本触媒	174,000	849.00	147,726,000
大日精化工業	86,000	332.00	28,552,000
カネカ	298,000	413.00	123,074,000
三菱瓦斯化学	378,000	477.00	180,306,000
三井化学	1,016,000	184.00	186,944,000
J S R	236,200	1,562.00	368,944,400
東京応化工業	46,300	1,618.00	74,913,400
大阪有機化学工業	15,900	341.00	5,421,900
三菱ケミカルホールディングス	1,497,000	374.00	559,878,000
日本合成化学工業	49,000	657.00	32,193,000
ダイセル	285,000	524.00	149,340,000
住友ベークライト	187,000	325.00	60,775,000
積水化学工業	491,000	696.00	341,736,000
日本ゼオン	206,000	667.00	137,402,000
アイカ工業	67,200	1,432.00	96,230,400
宇部興産	1,146,000	169.00	193,674,000
積水樹脂	34,000	810.00	27,540,000
タキロン	56,000	282.00	15,792,000
旭有機材工業	84,000	197.00	16,548,000
日立化成工業	103,600	1,172.00	121,419,200
ニチバン	24,000	252.00	6,048,000
リケンテクノス	39,000	238.00	9,282,000
大倉工業	57,000	252.00	14,364,000
積水化成品工業	61,000	202.00	12,322,000
群栄化学工業	64,000	197.00	12,608,000
タイガースポリマー	11,800	281.00	3,315,800
日本カーリット	19,100	417.00	7,964,700
日本化薬	168,000	914.00	153,552,000
日本精化	19,900	580.00	11,542,000
A D E K A	103,000	687.00	70,761,000
日油	186,000	376.00	69,936,000
ハリマ化成グループ	20,400	360.00	7,344,000
花王	635,000	2,309.00	1,466,215,000
第一工業製薬	43,000	208.00	8,944,000
三洋化成工業	75,000	433.00	32,475,000
大日本塗料	137,000	94.00	12,878,000
日本ペイント	207,000	681.00	140,967,000
関西ペイント	271,000	874.00	236,854,000
中国塗料	74,000	442.00	32,708,000
日本特殊塗料	18,500	351.00	6,493,500

藤倉化成	27,900	333.00	9,290,700
太陽ホールディングス	19,500	2,321.00	45,259,500
D I C	849,000	142.00	120,558,000
サカタインクス	49,000	414.00	20,286,000
東洋インキＳＣホールディングス	215,000	348.00	74,820,000
富士フイルムホールディングス	511,400	1,555.00	795,227,000
資生堂	425,900	1,157.00	492,766,300
ライオン	276,000	430.00	118,680,000
高砂香料工業	79,000	415.00	32,785,000
マンダム	25,700	2,223.00	57,131,100
ミルボン	11,800	2,823.00	33,311,400
ファンケル	60,100	860.00	51,686,000
コーセー	43,000	1,812.00	77,916,000
ドクターシーラボ	162	271,900.00	44,047,800
ポーラ・オルビスホールディングス	28,500	2,535.00	72,247,500
ノエビアホールディングス	14,000	1,252.00	17,528,000
エステー	14,700	894.00	13,141,800
コニシ	17,400	1,455.00	25,317,000
長谷川香料	30,300	1,085.00	32,875,500
星光P M C	9,800	306.00	2,998,800
小林製薬	36,200	4,230.00	153,126,000
荒川化学工業	18,600	676.00	12,573,600
メック	17,100	250.00	4,275,000
日本高純度化学	63	186,300.00	11,736,900
J C U	3,500	3,175.00	11,112,500
アース製薬	17,200	2,948.00	50,705,600
イハラケミカル工業	40,000	406.00	16,240,000
北興化学工業	24,000	220.00	5,280,000
大成ラミック	6,700	2,348.00	15,731,600
クミアイ化学工業	49,000	396.00	19,404,000
日本農薬	55,000	429.00	23,595,000
アキレス	194,000	110.00	21,340,000
有沢製作所	37,400	310.00	11,594,000
日東電工	197,400	4,335.00	855,729,000
レック	7,500	954.00	7,155,000
きもと	21,400	667.00	14,273,800
藤森工業	18,400	2,224.00	40,921,600
前澤化成工業	16,800	849.00	14,263,200
J S P	15,600	1,154.00	18,002,400
エフピコ	11,800	5,720.00	67,496,000
天馬	19,000	805.00	15,295,000
信越ポリマー	47,000	283.00	13,301,000
東リ	62,000	179.00	11,098,000
ニフコ	53,400	1,805.00	96,387,000
日本バルカー工業	100,000	208.00	20,800,000
ユニ・チャーム	132,200	4,430.00	585,646,000
協和発酵キリン	286,000	844.00	241,384,000

武田薬品工業	896,900	3,865.00	3,466,518,500	代用有価証券で 600,000株 担保差入
アステラス製薬	531,500	4,120.00	2,189,780,000	
大日本住友製薬	169,500	981.00	166,279,500	
塩野義製薬	349,000	1,393.00	486,157,000	
田辺三菱製薬	199,300	1,133.00	225,806,900	
わかもと製薬	27,000	223.00	6,021,000	
あすか製薬	28,000	443.00	12,404,000	
日本新薬	50,000	988.00	49,400,000	
中外製薬	278,100	1,649.00	458,586,900	
科研製薬	94,000	1,304.00	122,576,000	
エーザイ	294,700	3,505.00	1,032,923,500	
ロート製薬	100,000	1,062.00	106,200,000	
小野薬品工業	117,100	4,585.00	536,903,500	
久光製薬	74,300	4,335.00	322,090,500	
有機合成薬品工業	17,000	228.00	3,876,000	
持田製薬	90,000	1,099.00	98,910,000	
参天製薬	86,600	3,540.00	306,564,000	
扶桑薬品工業	81,000	304.00	24,624,000	
日本ケミファ	33,000	515.00	16,995,000	
ツムラ	65,300	2,691.00	175,722,300	
日医工	34,700	1,655.00	57,428,500	
キッセイ薬品工業	44,400	1,540.00	68,376,000	
生化学工業	45,700	889.00	40,627,300	
栄研化学	17,000	1,126.00	19,142,000	
日水製薬	9,600	845.00	8,112,000	
鳥居薬品	14,300	1,935.00	27,670,500	
東和薬品	12,200	4,670.00	56,974,000	
富士製薬工業	6,000	1,376.00	8,256,000	
沢井製薬	15,700	9,090.00	142,713,000	
ゼリア新薬工業	34,000	1,329.00	45,186,000	
第一三共	754,900	1,288.00	972,311,200	
キョーリン製薬ホールディングス	63,800	1,754.00	111,905,200	
大幸薬品	11,100	821.00	9,113,100	
ダイト	6,700	1,463.00	9,802,100	
大塚ホールディングス	475,200	2,428.00	1,153,785,600	
大正製薬ホールディングス	57,600	6,180.00	355,968,000	
日本コークス工業	193,000	101.00	19,493,000	
昭和シェル石油	214,000	476.00	101,864,000	
コスモ石油	662,000	161.00	106,582,000	
ニチレキ	29,000	427.00	12,383,000	
東燃ゼネラル石油	361,000	776.00	280,136,000	
ユシロ化学工業	12,900	865.00	11,158,500	
ビービー・カストロール	9,800	366.00	3,586,800	
AOCホールディングス	55,500	332.00	18,426,000	
MORESCO	4,500	794.00	3,573,000	
出光興産	28,400	6,940.00	197,096,000	
JXホールディングス	2,657,200	443.00	1,177,139,600	

横浜ゴム	268,000	562.00	150,616,000
東洋ゴム工業	199,000	234.00	46,566,000
ブリヂストン	750,300	2,010.00	1,508,103,000
住友ゴム工業	186,700	975.00	182,032,500
藤倉ゴム工業	13,300	253.00	3,364,900
オカモト	85,000	309.00	26,265,000
フコク	10,000	723.00	7,230,000
ニッタ	23,600	1,296.00	30,585,600
東海ゴム工業	44,300	794.00	35,174,200
三ツ星ベルト	61,000	489.00	29,829,000
パンドー化学	82,000	275.00	22,550,000
日東紡績	176,000	293.00	51,568,000
旭硝子	1,179,000	637.00	751,023,000
日本板硝子	1,090,000	86.00	93,740,000
石塚硝子	31,000	139.00	4,309,000
日本山村硝子	99,000	176.00	17,424,000
日本電気硝子	424,000	462.00	195,888,000
オハラ	9,200	634.00	5,832,800
住友大阪セメント	425,000	272.00	115,600,000
太平洋セメント	1,322,000	191.00	252,502,000
デイ・シイ	29,700	268.00	7,959,600
日本ヒューム	24,000	415.00	9,960,000
日本コンクリート工業	42,000	284.00	11,928,000
東海カーボン	208,000	283.00	58,864,000
日本カーボン	126,000	148.00	18,648,000
東洋炭素	11,800	1,485.00	17,523,000
ノリタケカンパニーリミテド	126,000	199.00	25,074,000
TOTO	369,000	593.00	218,817,000
日本碍子	312,000	884.00	275,808,000
日本特殊陶業	206,000	1,050.00	216,300,000
MARUWA	5,300	2,605.00	13,806,500
品川リフクトリーズ	65,000	174.00	11,310,000
黒崎播磨	54,000	195.00	10,530,000
東京窯業	31,000	162.00	5,022,000
ニッカトー	8,300	454.00	3,768,200
フジインコーポレーテッド	21,800	1,786.00	38,934,800
ニチアス	107,000	426.00	45,582,000
ニチハ	27,000	993.00	26,811,000
新日鐵住金	10,119,000	186.00	1,882,134,000
神戸製鋼所	3,326,000	78.00	259,428,000
合同製鐵	134,000	145.00	19,430,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	611,100	1,307.00	798,707,700
日新製鋼ホールディングス	101,500	590.00	59,885,000
東京製鐵	134,600	304.00	40,918,400
共英製鋼	22,400	1,324.00	29,657,600
大和工業	49,500	2,285.00	113,107,500
東京鐵鋼	47,000	282.00	13,254,000
大阪製鐵	12,000	1,401.00	16,812,000

淀川製鋼所	170,000	274.00	46,580,000
東洋鋼鈑	50,000	239.00	11,950,000
住友鋼管	16,300	612.00	9,975,600
丸一鋼管	80,100	1,859.00	148,905,900
モリ工業	36,000	237.00	8,532,000
大同特殊鋼	370,000	395.00	146,150,000
日本高周波鋼業	95,000	79.00	7,505,000
日本冶金工業	192,500	78.00	15,015,000
山陽特殊製鋼	119,000	259.00	30,821,000
愛知製鋼	127,000	350.00	44,450,000
日立金属	169,000	677.00	114,413,000
日本金属	62,000	112.00	6,944,000
大平洋金属	153,000	318.00	48,654,000
日本電工	94,000	224.00	21,056,000
栗本鐵工所	105,000	298.00	31,290,000
日本鑄鉄管	26,000	206.00	5,356,000
三菱製鋼	149,000	152.00	22,648,000
日亜鋼業	33,000	213.00	7,029,000
日本精線	16,000	293.00	4,688,000
シンニッタン	18,700	339.00	6,339,300
新家工業	52,000	122.00	6,344,000
大紀アルミニウム工業所	41,000	209.00	8,569,000
日本軽金属ホールディングス	503,100	78.00	39,241,800
三井金属鉱業	611,000	186.00	113,646,000
東邦亜鉛	135,000	326.00	44,010,000
三菱マテリアル	1,401,000	242.00	339,042,000
住友金属鉱山	619,000	1,120.00	693,280,000
DOWAホールディングス	264,000	521.00	137,544,000
古河機械金属	402,000	76.00	30,552,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,600	1,634.00	38,562,400
東邦チタニウム	40,800	729.00	29,743,200
住友軽金属工業	583,000	72.00	41,976,000
古河スカイ	81,000	212.00	17,172,000
古河電気工業	753,000	162.00	121,986,000
住友電気工業	845,400	900.00	760,860,000
フジクラ	385,000	236.00	90,860,000
昭和電線ホールディングス	306,000	66.00	20,196,000
タツタ電線	45,000	824.00	37,080,000
日立電線	188,000	124.00	23,312,000
沖電線	27,000	126.00	3,402,000
カナレ電気	3,500	1,338.00	4,683,000
平河ヒューテック	6,000	652.00	3,912,000
リョービ	134,000	202.00	27,068,000
アサヒホールディングス	36,000	1,424.00	51,264,000
稲葉製作所	10,400	1,011.00	10,514,400
トーカロ	14,400	1,370.00	19,728,000
アルファC o	9,500	891.00	8,464,500
SUMCO	149,400	680.00	101,592,000

川田テクノロジーズ	6,700	1,061.00	7,108,700
東洋製罐	170,000	994.00	168,980,000
ホッカンホールディングス	64,000	241.00	15,424,000
コロナ	11,000	1,091.00	12,001,000
横河ブリッジホールディングス	46,000	644.00	29,624,000
駒井ハルテック	57,000	235.00	13,395,000
高田機工	27,000	184.00	4,968,000
三和ホールディングス	221,000	361.00	79,781,000
文化シャッター	64,000	390.00	24,960,000
三協立山	33,200	1,606.00	53,319,200
東洋シャッター	9,300	468.00	4,352,400
LIxilグループ	333,400	1,814.00	604,787,600
日本ファイルコン	19,500	376.00	7,332,000
ノーリツ	46,900	1,432.00	67,160,800
長府製作所	23,000	1,905.00	43,815,000
リンナイ	38,500	5,830.00	224,455,000
ダイニチ工業	13,700	856.00	11,727,200
日東精工	38,000	251.00	9,538,000
三洋工業	37,000	157.00	5,809,000
岡部	48,300	579.00	27,965,700
東プレ	46,900	752.00	35,268,800
高周波熱錬	33,900	480.00	16,272,000
東京製綱	162,000	125.00	20,250,000
パイオラックス	10,800	1,847.00	19,947,600
日本発條	174,500	659.00	114,995,500
中央発條	34,000	293.00	9,962,000
三益半導体工業	21,100	640.00	13,504,000
アタカ大機	17,000	341.00	5,797,000
日本製鋼所	369,000	468.00	172,692,000
三浦工業	35,600	2,126.00	75,685,600
タクマ	81,000	445.00	36,045,000
ツガミ	64,000	523.00	33,472,000
オークマ	156,000	509.00	79,404,000
東芝機械	119,000	369.00	43,911,000
アマダ	366,000	475.00	173,850,000
アイダエンジニアリング	56,400	621.00	35,024,400
牧野フライス製作所	113,000	462.00	52,206,000
オーエスジー	98,400	1,134.00	111,585,600
ダイジェット工業	32,000	149.00	4,768,000
旭ダイヤモンド工業	59,000	759.00	44,781,000
森精機製作所	126,300	590.00	74,517,000
ディスコ	26,600	4,400.00	117,040,000
日東工器	13,900	1,850.00	25,715,000
豊和工業	143,000	83.00	11,869,000
大阪機工	93,000	104.00	9,672,000
東洋機械金属	20,700	201.00	4,160,700
津田駒工業	58,000	121.00	7,018,000
島精機製作所	31,300	1,313.00	41,096,900

日阪製作所	30,000	704.00	21,120,000
やまびこ	10,500	1,151.00	12,085,500
ペガサスミシン製造	31,700	178.00	5,642,600
ナブテスコ	118,400	1,711.00	202,582,400
三井海洋開発	19,800	1,687.00	33,402,600
レオン自動機	22,000	193.00	4,246,000
S M C	71,400	14,750.00	1,053,150,000
新川	19,900	393.00	7,820,700
ホソカワミクロン	41,000	507.00	20,787,000
ユニオンツール	13,100	1,305.00	17,095,500
オイレス工業	24,900	1,675.00	41,707,500
サトーホールディングス	25,000	1,360.00	34,000,000
日本エアーテック	8,400	367.00	3,082,800
日精樹脂工業	19,600	356.00	6,977,600
ワイエイシイ	12,100	439.00	5,311,900
小松製作所	1,116,700	1,897.00	2,118,379,900
住友重機械工業	655,000	348.00	227,940,000
日立建機	122,200	1,478.00	180,611,600
日工	33,000	345.00	11,385,000
巴工業	9,000	1,557.00	14,013,000
井関農機	229,000	216.00	49,464,000
T O W A	25,000	537.00	13,425,000
丸山製作所	54,000	158.00	8,532,000
北川鉄工所	105,000	139.00	14,595,000
クボタ	1,278,000	885.00	1,131,030,000
荏原実業	5,700	1,241.00	7,073,700
三菱化工機	74,000	142.00	10,508,000
月島機械	39,000	745.00	29,055,000
帝国電機製作所	8,100	1,274.00	10,319,400
新東工業	48,300	589.00	28,448,700
澁谷工業	15,100	900.00	13,590,000
アイチ コーポレーション	39,800	373.00	14,845,400
小森コーポレーション	58,400	602.00	35,156,800
鶴見製作所	18,000	626.00	11,268,000
住友精密工業	40,000	392.00	15,680,000
酒井重工業	48,000	276.00	13,248,000
荏原製作所	451,000	331.00	149,281,000
石井鐵工所	36,000	143.00	5,148,000
西島製作所	28,400	594.00	16,869,600
ダイキン工業	312,100	2,669.00	832,994,900
オルガノ	41,000	493.00	20,213,000
トーヨーカネツ	129,000	182.00	23,478,000
栗田工業	132,000	1,775.00	234,300,000
椿本チエイン	123,000	454.00	55,842,000
大同工業	52,000	136.00	7,072,000
日本コンベヤ	74,000	74.00	5,476,000
木村化工機	23,700	302.00	7,157,400
アネスト岩田	37,000	348.00	12,876,000

ダイフク	105,000	522.00	54,810,000
加藤製作所	57,000	232.00	13,224,000
油研工業	47,000	142.00	6,674,000
タダノ	110,000	625.00	68,750,000
フジテック	67,000	570.00	38,190,000
C K D	64,100	479.00	30,703,900
キトー	151	67,300.00	10,162,300
平和	50,000	1,266.00	63,300,000
理想科学工業	16,400	1,568.00	25,715,200
S A N K Y O	69,300	3,390.00	234,927,000
日本金銭機械	21,600	725.00	15,660,000
マースエンジニアリング	12,900	1,775.00	22,897,500
福島工業	6,300	1,716.00	10,810,800
オーイズミ	12,300	292.00	3,591,600
ダイコク電機	10,100	1,726.00	17,432,600
アマノ	69,200	731.00	50,585,200
サンデン	135,000	315.00	42,525,000
マックス	36,000	987.00	35,532,000
グローリー	68,200	1,871.00	127,602,200
大和冷機工業	37,000	390.00	14,430,000
セガサミーホールディングス	245,700	1,412.00	346,928,400
日本ピストンリング	83,000	143.00	11,869,000
リケン	83,000	297.00	24,651,000
T P R	26,700	1,028.00	27,447,600
ホシザキ電機	49,900	2,299.00	114,720,100
大豊工業	17,800	863.00	15,361,400
日本精工	509,000	512.00	260,608,000
N T N	504,000	193.00	97,272,000
ジェイテクト	243,700	680.00	165,716,000
不二越	220,000	293.00	64,460,000
日本トムソン	83,000	331.00	27,473,000
T H K	152,000	1,420.00	215,840,000
ユーシン精機	11,400	1,544.00	17,601,600
前澤給装工業	8,700	1,078.00	9,378,600
イーグル工業	32,000	622.00	19,904,000
前澤工業	25,800	198.00	5,108,400
日本ビラー工業	24,000	508.00	12,192,000
キッツ	94,000	392.00	36,848,000
日立工機	61,200	596.00	36,475,200
マキタ	139,100	3,445.00	479,199,500
日立造船	905,000	106.00	95,930,000
三菱重工業	3,832,000	379.00	1,452,328,000
I H I	1,563,000	182.00	284,466,000
イビデン	139,300	1,142.00	159,080,600
コニカミノルタホールディングス	604,000	591.00	356,964,000
ブラザー工業	295,600	803.00	237,366,800
ミネベア	312,000	290.00	90,480,000
日立製作所	5,350,000	464.00	2,482,400,000

東芝	4,512,000	274.00	1,236,288,000
三菱電機	2,286,000	660.00	1,508,760,000
富士電機	689,000	183.00	126,087,000
東洋電機製造	45,000	227.00	10,215,000
安川電機	251,000	684.00	171,684,000
シンフォニアテクノロジー	138,000	148.00	20,424,000
明電舎	226,000	270.00	61,020,000
オリジン電気	33,000	429.00	14,157,000
デンヨー	22,500	978.00	22,005,000
東芝テック	143,000	422.00	60,346,000
芝浦メカトロニクス	41,000	155.00	6,355,000
マブチモーター	34,000	3,455.00	117,470,000
日本電産	123,600	4,980.00	615,528,000
東光高岳ホールディングス	11,600	1,237.00	14,349,200
ダイヘン	125,000	248.00	31,000,000
ヤーマン	1,900	1,113.00	2,114,700
JVCケンウッド	138,500	297.00	41,134,500
第一精工	7,200	1,220.00	8,784,000
日新電機	46,000	448.00	20,608,000
大崎電気工業	30,000	430.00	12,900,000
オムロン	254,600	1,879.00	478,393,400
日東工業	33,600	1,165.00	39,144,000
I D E C	29,900	728.00	21,767,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	441,000	329.00	145,089,000
サクサホールディングス	58,000	153.00	8,874,000
メルコホールディングス	14,300	1,550.00	22,165,000
テクノメディカ	17	489,500.00	8,321,500
日本電気	2,959,000	152.00	449,768,000
富士通	2,204,000	293.00	645,772,000
沖電気工業	831,000	85.00	70,635,000
岩崎通信機	100,000	67.00	6,700,000
電気興業	60,000	360.00	21,600,000
サンケン電気	116,000	317.00	36,772,000
ナカヨ通信機	22,000	237.00	5,214,000
アイホン	13,200	1,353.00	17,859,600
ルネサスエレクトロニクス	59,200	308.00	18,233,600
セイコーエプソン	156,100	489.00	76,332,900
ワコム	420	231,900.00	97,398,000
アルバック	45,500	601.00	27,345,500
アクセル	11,500	1,986.00	22,839,000
ナナオ	19,400	1,289.00	25,006,600
日本信号	57,700	557.00	32,138,900
京三製作所	49,000	289.00	14,161,000
能美防災	30,000	553.00	16,590,000
ホーチキ	21,000	426.00	8,946,000
日本無線	49,000	218.00	10,682,000
パナソニック	2,612,100	417.00	1,089,245,700
シャープ	1,183,000	204.00	241,332,000

アンリツ	123,000	1,050.00	129,150,000
富士通ゼネラル	54,000	765.00	41,310,000
日立国際電気	52,000	572.00	29,744,000
ソニー	1,426,400	820.00	1,169,648,000
T D K	128,800	3,000.00	386,400,000
帝国通信工業	55,000	144.00	7,920,000
ミツミ電機	87,200	417.00	36,362,400
タムラ製作所	88,000	188.00	16,544,000
アルプス電気	167,700	522.00	87,539,400
パイオニア	278,100	209.00	58,122,900
日本電波工業	19,300	908.00	17,524,400
日本トリム	3,000	2,225.00	6,675,000
ローランド ディー . ジー .	10,200	957.00	9,761,400
フォスター電機	23,400	1,477.00	34,561,800
クラリオン	120,000	147.00	17,640,000
S M K	68,000	211.00	14,348,000
ヨコオ	18,000	397.00	7,146,000
東光	115,000	209.00	24,035,000
ホシデン	62,100	501.00	31,112,100
ヒロセ電機	39,800	9,590.00	381,682,000
日本航空電子工業	53,000	668.00	35,404,000
T O A	25,000	566.00	14,150,000
ユニデン	68,000	178.00	12,104,000
アルパイン	44,700	739.00	33,033,300
スミダコーポレーション	14,400	425.00	6,120,000
アイコム	12,700	1,799.00	22,847,300
リオン	5,200	591.00	3,073,200
船井電機	23,100	961.00	22,199,100
横河電機	228,900	883.00	202,118,700
新電元工業	74,000	230.00	17,020,000
アズビル	64,000	1,747.00	111,808,000
日本光電工業	45,500	2,750.00	125,125,000
チノー	41,000	202.00	8,282,000
共和電業	26,000	255.00	6,630,000
日本電子材料	9,900	381.00	3,771,900
堀場製作所	45,300	2,362.00	106,998,600
アドバンテスト	155,900	1,108.00	172,737,200
小野測器	27,000	387.00	10,449,000
エスベック	23,800	637.00	15,160,600
パナソニック デバイス S U N X	20,300	337.00	6,841,100
キーエンス	56,100	23,800.00	1,335,180,000
日置電機	12,000	1,407.00	16,884,000
シスメックス	80,600	3,810.00	307,086,000
メガチップス	18,800	1,803.00	33,896,400
O B A R A G R O U P	16,400	931.00	15,268,400
日本電産コパル電子	23,800	419.00	9,972,200
ミヤチテクノス	10,400	523.00	5,439,200
東京電波	6,900	365.00	2,518,500

澤藤電機	14,000	212.00	2,968,000
コーセル	33,300	1,076.00	35,830,800
日立メディコ	17,000	1,016.00	17,272,000
新日本無線	17,000	164.00	2,788,000
オブテックス	14,600	1,008.00	14,716,800
千代田インテグレ	11,100	846.00	9,390,600
スタンレー電気	178,000	1,150.00	204,700,000
岩崎電気	84,000	163.00	13,692,000
ウシオ電機	138,900	919.00	127,649,100
岡谷電機産業	12,500	319.00	3,987,500
ヘリオス テクノ ホールディング	20,100	158.00	3,175,800
日本セラミック	15,000	1,213.00	18,195,000
日本デジタル研究所	19,300	867.00	16,733,100
古河電池	17,000	453.00	7,701,000
双信電機	11,400	307.00	3,499,800
山一電機	24,800	140.00	3,472,000
図研	13,400	532.00	7,128,800
日本電子	85,000	192.00	16,320,000
カシオ計算機	218,000	636.00	138,648,000
ファナック	238,000	14,300.00	3,403,400,000
日本シイエムケイ	49,600	280.00	13,888,000
エンプラス	10,100	3,520.00	35,552,000
ローム	120,800	2,402.00	290,161,600
浜松ホトニクス	89,200	2,905.00	259,126,000
三井ハイテック	33,300	626.00	20,845,800
新光電気工業	77,000	556.00	42,812,000
京セラ	190,100	7,700.00	1,463,770,000
太陽誘電	111,300	710.00	79,023,000
村田製作所	239,900	4,695.00	1,126,330,500
ユーシン	32,100	420.00	13,482,000
双葉電子工業	42,400	885.00	37,524,000
北陸電気工業	92,000	99.00	9,108,000
ニチコン	72,200	592.00	42,742,400
日本ケミコン	132,000	142.00	18,744,000
K O A	28,900	655.00	18,929,500
市光工業	55,000	123.00	6,765,000
小糸製作所	114,000	1,157.00	131,898,000
ミツバ	42,000	557.00	23,394,000
スター精密	40,200	819.00	32,923,800
大日本スクリーン製造	234,000	461.00	107,874,000
キャノン電子	21,000	1,869.00	39,249,000
キャノン	1,420,200	2,993.00	4,250,658,600
リコー	687,000	745.00	511,815,000
M U T O Hホールディングス	32,000	214.00	6,848,000
東京エレクトロン	192,300	3,615.00	695,164,500
トヨタ紡織	79,900	834.00	66,636,600
鬼怒川ゴム工業	43,000	529.00	22,747,000
ユニプレス	40,100	1,924.00	77,152,400

豊田自動織機	208,200	2,428.00	505,509,600	
モリタホールディングス	40,000	758.00	30,320,000	
三櫻工業	29,000	523.00	15,167,000	
デンソー	564,800	2,678.00	1,512,534,400	
東海理化電機製作所	53,500	1,038.00	55,533,000	
三井造船	885,000	111.00	98,235,000	
佐世保重工業	149,000	80.00	11,920,000	
川崎重工業	1,780,000	193.00	343,540,000	
日本車輛製造	83,000	336.00	27,888,000	
日本輸送機	30,000	294.00	8,820,000	
近畿車輛	39,000	280.00	10,920,000	
日産自動車	2,888,200	770.00	2,223,914,000	
いすゞ自動車	1,325,000	483.00	639,975,000	
トヨタ自動車	2,937,100	3,535.00	10,382,648,500	代用有価証券で 1,500,000株 担保差 入
日野自動車	286,000	700.00	200,200,000	
三菱自動車工業	5,340,000	79.00	421,860,000	
エフテック	7,900	1,127.00	8,903,300	
武蔵精密工業	24,400	1,714.00	41,821,600	
日産車体	78,000	963.00	75,114,000	
新明和工業	92,000	514.00	47,288,000	
極東開発工業	42,500	751.00	31,917,500	
日信工業	46,500	1,223.00	56,869,500	
トピー工業	171,000	185.00	31,635,000	
ティラド	77,000	194.00	14,938,000	
曙ブレーキ工業	106,200	373.00	39,612,600	
タチエス	29,800	1,331.00	39,663,800	
NOK	110,600	1,290.00	142,674,000	
フタバ産業	69,600	321.00	22,341,600	
カヤバ工業	174,000	298.00	51,852,000	
シロキ工業	51,000	188.00	9,588,000	
大同メタル工業	32,000	643.00	20,576,000	
プレス工業	97,000	343.00	33,271,000	
カルソニックカンセイ	155,000	369.00	57,195,000	
太平洋工業	46,500	480.00	22,320,000	
ケーヒン	47,300	1,139.00	53,874,700	
河西工業	28,000	377.00	10,556,000	
アイシン精機	209,200	2,373.00	496,431,600	
富士機工	26,000	259.00	6,734,000	
マツダ	3,620,000	131.00	474,220,000	
ダイハツ工業	243,000	1,529.00	371,547,000	
今仙電機製作所	16,800	988.00	16,598,400	
本田技研工業	1,928,800	2,745.00	5,294,556,000	
スズキ	477,900	1,927.00	920,913,300	
富士重工業	722,000	908.00	655,576,000	
ヤマハ発動機	347,600	926.00	321,877,600	
ショーワ	54,000	818.00	44,172,000	

T B K	23,000	409.00	9,407,000
エクセディ	31,000	1,799.00	55,769,000
豊田合成	64,600	1,658.00	107,106,800
愛三工業	23,600	641.00	15,127,600
ヨロズ	16,800	1,218.00	20,462,400
エフ・シー・シー	37,400	1,613.00	60,326,200
シマノ	92,100	5,690.00	524,049,000
タカタ	41,300	1,638.00	67,649,400
テイ・エス テック	48,300	1,448.00	69,938,400
日本電産トーソク	10,900	621.00	6,768,900
テルモ	175,200	3,430.00	600,936,000
クリエートメディック	6,900	824.00	5,685,600
日機装	80,000	910.00	72,800,000
島津製作所	273,000	538.00	146,874,000
J M S	34,000	303.00	10,302,000
モリテックス	4,900	292.00	1,430,800
長野計器	16,100	706.00	11,366,600
ブイ・テクノロジー	47	191,900.00	9,019,300
東京計器	73,000	143.00	10,439,000
愛知時計電機	25,000	296.00	7,400,000
東京精密	41,000	1,345.00	55,145,000
マニー	7,000	3,215.00	22,505,000
ニコン	426,900	2,203.00	940,460,700
トプコン	46,100	571.00	26,323,100
オリンパス	269,600	1,381.00	372,317,600
理研計器	18,500	508.00	9,398,000
タムロン	17,600	2,473.00	43,524,800
H O Y A	555,800	1,597.00	887,612,600
ノーリツ鋼機	20,600	316.00	6,509,600
エー・アンド・デイ	20,700	286.00	5,920,200
日本電産コバル	17,900	689.00	12,333,100
シチズンホールディングス	273,600	398.00	108,892,800
リズム時計工業	103,000	155.00	15,965,000
大研医器	2,800	1,945.00	5,446,000
松風	11,200	844.00	9,452,800
セイコーホールディングス	146,000	193.00	28,178,000
ニプロ	121,700	582.00	70,829,400
パラマウントベッドホールディングス	19,700	2,714.00	53,465,800
S H O - B I	7,600	376.00	2,857,600
前田工織	2,300	1,668.00	3,836,400
永大産業	30,000	358.00	10,740,000
ダンロップスポーツ	12,500	1,073.00	13,412,500
バンダイナムコホールディングス	236,500	1,142.00	270,083,000
共立印刷	35,800	224.00	8,019,200
フランスベッドホールディングス	144,000	171.00	24,624,000
パイロットコーポレーション	200	157,900.00	31,580,000
トッパン・フォームズ	41,000	771.00	31,611,000
フジシールインターナショナル	27,800	1,650.00	45,870,000

タカラトミー	77,900	450.00	35,055,000	
廣済堂	19,500	305.00	5,947,500	
タカノ	10,300	405.00	4,171,500	
プロネクサス	26,700	468.00	12,495,600	
ホクシン	16,100	180.00	2,898,000	
ウッドワン	46,000	247.00	11,362,000	
大建工業	95,000	217.00	20,615,000	
凸版印刷	646,000	515.00	332,690,000	
大日本印刷	696,000	622.00	432,912,000	
図書印刷	41,000	137.00	5,617,000	
共同印刷	75,000	213.00	15,975,000	
日本写真印刷	35,300	896.00	31,628,800	
光村印刷	22,000	241.00	5,302,000	
宝印刷	13,000	572.00	7,436,000	
アシックス	213,000	1,169.00	248,997,000	
ツツミ	11,500	2,039.00	23,448,500	
ローランド	22,000	644.00	14,168,000	
小松ウオール工業	8,600	1,113.00	9,571,800	
ヤマハ	168,200	743.00	124,972,600	
河合楽器製作所	85,000	152.00	12,920,000	
クリナップ	24,300	608.00	14,774,400	
ビジョン	17,300	3,975.00	68,767,500	
兼松日産農林	35,000	139.00	4,865,000	
キングジム	19,200	647.00	12,422,400	
リンテック	49,000	1,507.00	73,843,000	
イトーキ	51,700	429.00	22,179,300	
任天堂	130,700	9,240.00	1,207,668,000	
三菱鉛筆	18,900	1,413.00	26,705,700	
タカラスタンダード	105,000	619.00	64,995,000	
コクヨ	119,000	630.00	74,970,000	
ナカバヤシ	49,000	177.00	8,673,000	
グローブライド	111,000	100.00	11,100,000	
岡村製作所	88,000	617.00	54,296,000	
美津濃	113,000	384.00	43,392,000	
アデランス	28,600	1,169.00	33,433,400	
東京電力	1,939,300	140.00	271,502,000	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	699,500	1,085.00	758,957,500	
関西電力	932,900	776.00	723,930,400	
中国電力	316,100	1,201.00	379,636,100	
北陸電力	224,000	935.00	209,440,000	
東北電力	571,200	747.00	426,686,400	
四国電力	205,900	1,110.00	228,549,000	
九州電力	504,900	780.00	393,822,000	
北海道電力	214,000	828.00	177,192,000	
沖縄電力	13,700	2,497.00	34,208,900	
電源開発	141,900	2,063.00	292,739,700	
東京瓦斯	2,745,000	402.00	1,103,490,000	

大阪瓦斯	2,218,000	323.00	716,414,000
東邦瓦斯	581,000	476.00	276,556,000
北海道瓦斯	41,000	227.00	9,307,000
西部瓦斯	257,000	218.00	56,026,000
静岡瓦斯	59,500	589.00	35,045,500
東武鉄道	1,298,000	432.00	560,736,000
相鉄ホールディングス	366,000	273.00	99,918,000
東京急行電鉄	1,345,000	424.00	570,280,000
京浜急行電鉄	587,000	747.00	438,489,000
小田急電鉄	732,000	837.00	612,684,000
京王電鉄	639,000	608.00	388,512,000
京成電鉄	343,000	698.00	239,414,000
富士急行	62,000	487.00	30,194,000
新京成電鉄	29,000	357.00	10,353,000
東日本旅客鉄道	425,900	5,470.00	2,329,673,000
西日本旅客鉄道	198,800	3,360.00	667,968,000
東海旅客鉄道	190,100	6,700.00	1,273,670,000
西日本鉄道	296,000	346.00	102,416,000
ハマキョウレックス	6,500	2,520.00	16,380,000
サカイ引越センター	4,200	1,712.00	7,190,400
近畿日本鉄道	2,065,000	330.00	681,450,000
阪急阪神ホールディングス	1,444,000	436.00	629,584,000
南海電気鉄道	476,000	378.00	179,928,000
京阪電気鉄道	512,000	387.00	198,144,000
名糖運輸	9,400	602.00	5,658,800
名古屋鉄道	798,000	220.00	175,560,000
日本通運	905,000	304.00	275,120,000
ヤマトホールディングス	431,900	1,273.00	549,808,700
山九	278,000	324.00	90,072,000
丸運	12,300	194.00	2,386,200
丸全昭和運輸	77,000	238.00	18,326,000
センコー	92,000	351.00	32,292,000
トナミホールディングス	47,000	175.00	8,225,000
日本梱包運輸倉庫	73,800	982.00	72,471,600
日本石油輸送	26,000	189.00	4,914,000
福山通運	139,000	420.00	58,380,000
セイノーホールディングス	177,000	509.00	90,093,000
神奈川中央交通	27,000	471.00	12,717,000
日立物流	39,700	1,203.00	47,759,100
日本郵船	1,814,000	169.00	306,566,000
商船三井	1,128,000	201.00	226,728,000
川崎汽船	1,041,000	106.00	110,346,000
N S ユナイテッド海運	98,000	97.00	9,506,000
乾汽船	29,400	208.00	6,115,200
飯野海運	117,400	253.00	29,702,200
共栄タンカー	44,000	180.00	7,920,000
日本航空	193,100	3,745.00	723,159,500
全日本空輸	4,493,000	177.00	795,261,000

パスコ	21,000	256.00	5,376,000
日新	86,000	202.00	17,372,000
三菱倉庫	162,000	1,090.00	176,580,000
三井倉庫	106,000	281.00	29,786,000
住友倉庫	153,000	365.00	55,845,000
澁澤倉庫	59,000	243.00	14,337,000
東陽倉庫	36,000	189.00	6,804,000
日本トランスシティ	52,000	282.00	14,664,000
ケイヒン	42,000	99.00	4,158,000
安田倉庫	17,800	568.00	10,110,400
東洋埠頭	66,000	131.00	8,646,000
宇徳	18,500	224.00	4,144,000
上組	253,000	641.00	162,173,000
サンリツ	6,000	508.00	3,048,000
キムラユニティー	5,100	762.00	3,886,200
キューソー流通システム	6,300	916.00	5,770,800
郵船ロジスティクス	18,000	728.00	13,104,000
近鉄エクスプレス	20,400	2,549.00	51,999,600
東海運	12,300	222.00	2,730,600
エーアイティー	1,800	1,215.00	2,187,000
NEC ネットエスアイ	21,200	1,535.00	32,542,000
システナ	241	75,800.00	18,267,800
新日鉄住金ソリューションズ	15,100	1,545.00	23,329,500
コア	8,500	744.00	6,324,000
ソフトクリエイトホールディングス	2,500	1,239.00	3,097,500
デジタルハーツ	4,200	656.00	2,755,200
ITホールディングス	74,900	992.00	74,300,800
ネオス	45	66,400.00	2,988,000
電算システム	2,500	1,199.00	2,997,500
グリー	116,500	1,412.00	164,498,000
コーエーテクモホールディングス	44,700	717.00	32,049,900
三菱総合研究所	8,800	1,725.00	15,180,000
ボルテージ	3,600	894.00	3,218,400
K L a b	6,900	567.00	3,912,300
ネクソン	185,100	855.00	158,260,500
ドワンゴ	116	186,700.00	21,657,200
ベリサーブ	13	136,100.00	1,769,300
マクロミル	22,000	948.00	20,856,000
ティーガイア	28,100	788.00	22,142,800
GMOペイメントゲートウェイ	7,400	1,405.00	10,397,000
ザッパラス	125	80,500.00	10,062,500
インターネットイニシアティブ	26,400	1,941.00	51,242,400
ソネットエンタテインメント	18	576,000.00	10,368,000
S R Aホールディングス	10,900	897.00	9,777,300
朝日ネット	19,000	434.00	8,246,000
パナソニック インフォメーションシステムズ	5,300	1,912.00	10,133,600
フェイス	773	8,700.00	6,725,100
野村総合研究所	127,800	1,636.00	209,080,800

サイバネットシステム	187	22,170.00	4,145,790	
インテージ	6,700	1,857.00	12,441,900	
シンプレクス・ホールディングス	422	22,680.00	9,570,960	
ソースネクスト	5,600	347.00	1,943,200	
クレスコ	5,200	535.00	2,782,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,182	116,600.00	254,421,200	
オービック	7,780	17,450.00	135,761,000	
TDCソフトウェアエンジニアリング	4,600	784.00	3,606,400	
ヤフー	16,527	28,230.00	466,557,210	
トレンドマイクロ	89,700	2,189.00	196,353,300	
日本オラクル	45,100	3,535.00	159,428,500	
アルファシステムズ	7,500	1,026.00	7,695,000	
フューチャーアーキテクト	273	33,400.00	9,118,200	
シーエーシー	13,900	677.00	9,410,300	
ソフトバンク・テクノロジー	5,400	792.00	4,276,800	
トーセ	5,700	522.00	2,975,400	
オービックビジネスコンサルタント	7,200	4,390.00	31,608,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,600	3,565.00	94,829,000	
アイティフォー	25,300	323.00	8,171,900	
東計電算	4,000	1,263.00	5,052,000	
エクスネット	21	117,500.00	2,467,500	
大塚商会	20,200	6,530.00	131,906,000	
サイボウズ	377	25,460.00	9,598,420	
ソフトブレン	338	11,410.00	3,856,580	
アグレックス	6,100	750.00	4,575,000	
電通国際情報サービス	14,000	780.00	10,920,000	
ウェザーニューズ	5,900	2,758.00	16,272,200	
C I J	22,600	330.00	7,458,000	
WOWOW	69	185,800.00	12,820,200	
ネットワンシステムズ	82,200	815.00	66,993,000	
アルゴグラフィックス	8,200	1,085.00	8,897,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	42,600	1,833.00	78,085,800	
日本ユニシス	62,400	544.00	33,945,600	
兼松エレクトロニクス	14,300	942.00	13,470,600	
東京放送ホールディングス	121,800	799.00	97,318,200	
日本テレビホールディングス	206,100	1,114.00	229,595,400	
テレビ朝日	57,200	1,123.00	64,235,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,959	35,200.00	68,956,800	
テレビ東京ホールディングス	16,400	911.00	14,940,400	
アイ・ティー・シーネットワーク	20,000	622.00	12,440,000	
イー・アクセス	2,461	59,800.00	147,167,800	
NECモバイリング	8,300	3,420.00	28,386,000	
日本電信電話	950,000	3,645.00	3,462,750,000	代用有価証券で 400,000株 担保差入
KDDI	318,400	5,850.00	1,862,640,000	
光通信	24,900	3,740.00	93,126,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,592	123,200.00	2,290,534,400	
GMOインターネット	75,400	505.00	38,077,000	

学研ホールディングス	68,000	216.00	14,688,000
ゼンリン	29,900	1,134.00	33,906,600
昭文社	13,600	540.00	7,344,000
角川グループホールディングス	19,400	2,371.00	45,997,400
インプレスホールディングス	18,600	131.00	2,436,600
アイネット	9,900	599.00	5,930,100
松竹	149,000	856.00	127,544,000
東宝	161,000	1,396.00	224,756,000
東映	95,000	452.00	42,940,000
AOI Pro.	10,500	554.00	5,817,000
エヌ・ティ・ティ・データ	1,394	241,800.00	337,069,200
DTS	21,500	1,058.00	22,747,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,000	1,060.00	86,920,000
シーイーシー	14,800	485.00	7,178,000
カプコン	43,300	1,516.00	65,642,800
ジャステック	13,100	488.00	6,392,800
SCSK	53,700	1,348.00	72,387,600
日本システムウエア	8,700	325.00	2,827,500
アイネス	30,800	496.00	15,276,800
TKC	20,900	1,424.00	29,761,600
富士ソフト	32,100	1,651.00	52,997,100
NSD	44,500	752.00	33,464,000
コナミ	101,900	1,946.00	198,297,400
福井コンピュータホールディングス	3,200	474.00	1,516,800
JBCCHホールディングス	19,000	610.00	11,590,000
ミロク情報サービス	15,000	336.00	5,040,000
ソフトバンク	1,028,400	2,999.00	3,084,171,600
ハウスイ	18,000	102.00	1,836,000
高千穂交易	9,400	875.00	8,225,000
伊藤忠食品	5,600	2,903.00	16,256,800
エレマテック	10,600	1,054.00	11,172,400
JALUX	6,400	827.00	5,292,800
あらた	51,000	341.00	17,391,000
トーメンデバイス	3,400	1,723.00	5,858,200
東京エレクトロン デバイス	45	138,400.00	6,228,000
双日	1,421,400	109.00	154,932,600
アルフレッサ ホールディングス	58,400	3,530.00	206,152,000
横浜冷凍	55,900	594.00	33,204,600
神栄	28,000	112.00	3,136,000
山下医科器械	1,900	1,000.00	1,900,000
ラサ商事	9,800	388.00	3,802,400
アルコニックス	6,300	1,267.00	7,982,100
あい ホールディングス	36,200	552.00	19,982,400
ダイワボウホールディングス	205,000	165.00	33,825,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	42,400	829.00	35,149,600
八洲電機	16,400	348.00	5,707,200
UKCホールディングス	13,400	1,638.00	21,949,200
TOKAIホールディングス	88,300	268.00	23,664,400

ミタチ産業	5,300	369.00	1,955,700
シップヘルスケアホールディングス	32,200	2,608.00	83,977,600
富士興産	8,100	454.00	3,677,400
協栄産業	28,000	142.00	3,976,000
小野建	19,700	678.00	13,356,600
佐島電機	16,700	427.00	7,130,900
エコトレーディング	5,600	738.00	4,132,800
伯東	13,800	752.00	10,377,600
コンドーテック	17,400	437.00	7,603,800
中山福	13,000	625.00	8,125,000
ナガイレーベン	29,900	1,151.00	34,414,900
三菱食品	24,800	2,137.00	52,997,600
松田産業	16,500	1,017.00	16,780,500
メディカルホールディングス	225,700	1,001.00	225,925,700
アドヴァン	11,500	832.00	9,568,000
S P K	5,300	1,400.00	7,420,000
アズワン	14,700	1,768.00	25,989,600
スズデン	7,400	458.00	3,389,200
尾家産業	7,300	833.00	6,080,900
シモジマ	13,800	937.00	12,930,600
ドウシシャ	12,000	2,238.00	26,856,000
高速	13,500	695.00	9,382,500
黒田電気	30,200	916.00	27,663,200
丸文	20,000	353.00	7,060,000
ハピネット	13,700	622.00	8,521,400
トーマンエレクトロニクス	11,500	1,008.00	11,592,000
エクセル	9,700	691.00	6,702,700
マルカキカイ	7,300	961.00	7,015,300
ガリバーインターナショナル	7,600	3,185.00	24,206,000
日本エム・ディ・エム	20,900	249.00	5,204,100
進和	13,400	963.00	12,904,200
エスケイジャパン	5,500	254.00	1,397,000
ダイトエレクトロン	10,400	346.00	3,598,400
シークス	14,300	985.00	14,085,500
田中商事	7,600	434.00	3,298,400
オーハシテクニカ	12,100	598.00	7,235,800
マクニカ	11,600	1,609.00	18,664,400
白銅	7,400	769.00	5,690,600
伊藤忠商事	1,800,100	831.00	1,495,883,100
丸紅	1,851,000	552.00	1,021,752,000
高島	42,000	261.00	10,962,000
F & A アクアホールディングス	17,200	891.00	15,325,200
長瀬産業	127,800	894.00	114,253,200
蝶理	14,400	878.00	12,643,200
豊田通商	251,400	1,881.00	472,883,400
三共生興	38,500	278.00	10,703,000
兼松	480,000	98.00	47,040,000
ツカモトコーポレーション	38,000	133.00	5,054,000

三井物産	1,947,700	1,158.00	2,255,436,600
日本紙パルプ商事	117,000	275.00	32,175,000
日立ハイテクノロジーズ	68,500	1,821.00	124,738,500
カメイ	27,000	707.00	19,089,000
東都水産	40,000	125.00	5,000,000
スターゼン	75,000	239.00	17,925,000
山善	86,700	569.00	49,332,300
椿本興業	26,000	244.00	6,344,000
住友商事	1,331,600	1,031.00	1,372,879,600
内田洋行	48,000	223.00	10,704,000
三菱商事	1,760,600	1,554.00	2,735,972,400
第一実業	51,000	380.00	19,380,000
キヤノンマーケティングジャパン	75,100	1,184.00	88,918,400
西華産業	81,000	233.00	18,873,000
佐藤商事	20,200	558.00	11,271,600
菱洋エレクトロ	26,600	785.00	20,881,000
東京産業	22,500	262.00	5,895,000
ユアサ商事	230,000	145.00	33,350,000
神鋼商事	57,000	153.00	8,721,000
阪和興業	226,000	270.00	61,020,000
カナデン	22,000	526.00	11,572,000
菱電商事	33,000	479.00	15,807,000
フルサト工業	12,200	739.00	9,015,800
岩谷産業	250,000	300.00	75,000,000
すてきなイスグループ	91,000	197.00	17,927,000
昭光通商	80,000	135.00	10,800,000
ニチモウ	33,000	185.00	6,105,000
極東貿易	26,000	135.00	3,510,000
イワキ	34,000	171.00	5,814,000
三愛石油	54,000	356.00	19,224,000
稲畑産業	55,600	562.00	31,247,200
G S Iクレオス	60,000	108.00	6,480,000
明和産業	17,900	382.00	6,837,800
東邦ホールディングス	72,300	1,588.00	114,812,400
サンゲツ	40,000	2,096.00	83,840,000
ミツウロコグループホールディングス	36,400	474.00	17,253,600
シナネン	49,000	348.00	17,052,000
伊藤忠エネクス	49,900	437.00	21,806,300
サンリオ	56,900	2,769.00	157,556,100
サンワテクノス	11,100	606.00	6,726,600
リョーサン	36,800	1,404.00	51,667,200
新光商事	24,800	699.00	17,335,200
トーホー	47,000	316.00	14,852,000
三信電気	32,300	574.00	18,540,200
東陽テクニカ	32,700	949.00	31,032,300
モスフードサービス	29,600	1,579.00	46,738,400
加賀電子	22,500	748.00	16,830,000
ソーダニッカ	23,000	357.00	8,211,000

立花エレテック	13,700	674.00	9,233,800
P a l t a c	23,800	933.00	22,205,400
ヤマタネ	105,000	112.00	11,760,000
丸紅建材リース	19,000	143.00	2,717,000
日鐵商事	50,000	197.00	9,850,000
トラスコ中山	25,800	1,509.00	38,932,200
オートバックスセブン	27,800	3,425.00	95,215,000
加藤産業	32,500	1,493.00	48,522,500
イノテック	19,500	355.00	6,922,500
イエローハット	21,300	1,259.00	26,816,700
富士エレクトロニクス	11,600	1,104.00	12,806,400
J Kホールディングス	19,000	465.00	8,835,000
日伝	10,200	2,067.00	21,083,400
北沢産業	17,000	160.00	2,720,000
杉本商事	12,200	782.00	9,540,400
因幡電機産業	26,600	2,353.00	62,589,800
住金物産	117,000	218.00	25,506,000
ミスミグループ本社	83,800	2,196.00	184,024,800
江守商事	5,100	858.00	4,375,800
アルテック	11,000	195.00	2,145,000
タキヒヨー	34,000	423.00	14,382,000
スズケン	86,700	2,517.00	218,223,900
ジェコス	15,600	574.00	8,954,400
ローソン	85,400	5,730.00	489,342,000
サンエー	8,500	3,005.00	25,542,500
キリン堂	8,100	558.00	4,519,800
ダイユーエイト	4,600	627.00	2,884,200
カワチ薬品	15,700	1,697.00	26,642,900
エービーシー・マート	26,700	3,675.00	98,122,500
ハードオフコーポレーション	11,000	550.00	6,050,000
アスクル	15,500	1,127.00	17,468,500
ゲオホールディングス	386	89,200.00	34,431,200
ポイント	20,800	3,095.00	64,376,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	29,000	88.00	2,552,000
くらコーポレーション	13,300	1,137.00	15,122,100
キャンドウ	119	103,800.00	12,352,200
パル	6,600	3,865.00	25,509,000
エディオン	97,600	329.00	32,110,400
サーラコーポレーション	19,400	498.00	9,661,200
あみやき亭	39	203,100.00	7,920,900
ひらまつ	78	98,300.00	7,667,400
ゲンキー	2,200	1,860.00	4,092,000
大黒天物産	3,800	2,601.00	9,883,800
ハニーズ	19,840	1,150.00	22,816,000
アルペン	17,300	1,489.00	25,759,700
ビックカメラ	857	41,150.00	35,265,550
D C Mホールディングス	116,900	549.00	64,178,100
M o n o t a R O	15,100	2,499.00	37,734,900

J・フロントリテイリング	533,000	409.00	217,997,000
ドトール・日レスホールディングス	39,600	1,035.00	40,986,000
マツモトキヨシホールディングス	38,100	2,003.00	76,314,300
ブロンコビリー	1,400	2,148.00	3,007,200
スタートトゥデイ	46,800	748.00	35,006,400
物語コーポレーション	2,900	2,341.00	6,788,900
ココカラファイン	23,500	2,763.00	64,930,500
三越伊勢丹ホールディングス	448,400	747.00	334,954,800
ウエルシアホールディングス	7,900	2,826.00	22,325,400
クリエイトSDホールディングス	9,500	2,268.00	21,546,000
丸善CHIホールディングス	13,100	225.00	2,947,500
ブックオフコーポレーション	12,500	674.00	8,425,000
あさひ	13,100	1,206.00	15,798,600
日本調剤	2,860	2,057.00	5,883,020
コスモス薬品	9,900	8,550.00	84,645,000
セブン&アイ・ホールディングス	943,900	2,417.00	2,281,406,300
ツルハホールディングス	18,700	6,520.00	121,924,000
サンマルクホールディングス	7,300	2,997.00	21,878,100
フェリシモ	6,500	1,087.00	7,065,500
トリドール	19,500	987.00	19,246,500
クスリのアオキ	3,300	4,835.00	15,955,500
メディカルシステムネットワーク	12,500	433.00	5,412,500
総合メディカル	5,500	2,900.00	15,950,000
はるやま商事	9,500	473.00	4,493,500
カッパ・クリエイトホールディングス	16,550	1,795.00	29,707,250
ライトオン	16,900	647.00	10,934,300
良品計画	23,900	5,140.00	122,846,000
三城ホールディングス	27,900	460.00	12,834,000
コナカ	26,600	605.00	16,093,000
ハウスオブローゼ	2,500	1,293.00	3,232,500
G-7ホールディングス	6,700	421.00	2,820,700
イオン北海道	14,100	400.00	5,640,000
コジマ	33,300	265.00	8,824,500
ヒマラヤ	6,600	629.00	4,151,400
コーナン商事	29,600	1,010.00	29,896,000
エコス	7,700	521.00	4,011,700
ワタミ	26,700	1,689.00	45,096,300
マルシェ	5,500	749.00	4,119,500
ドン・キホーテ	60,200	3,190.00	192,038,000
メガネトップ	38,800	1,082.00	41,981,600
西松屋チェーン	44,500	676.00	30,082,000
ゼンショーホールディングス	86,000	976.00	83,936,000
幸楽苑	13,900	1,217.00	16,916,300
ハークスレイ	6,300	662.00	4,170,600
サイゼリヤ	33,400	1,187.00	39,645,800
ポプラ	7,700	545.00	4,196,500
ユニテッドアローズ	27,400	2,164.00	59,293,600
ハイデイ日高	11,900	1,443.00	17,171,700

京都きもの友禅	14,900	981.00	14,616,900
コロワイド	75,000	717.00	53,775,000
壱番屋	9,100	2,569.00	23,377,900
トップカルチャー	8,200	368.00	3,017,600
スギホールディングス	36,000	2,838.00	102,168,000
スクロール	29,400	260.00	7,644,000
ファミリーマート	69,300	3,755.00	260,221,500
木曽路	27,600	1,651.00	45,567,600
千趣会	40,600	534.00	21,680,400
タカキュー	17,500	305.00	5,337,500
ケーヨー	38,800	469.00	18,197,200
上新電機	49,000	852.00	41,748,000
日本瓦斯	31,100	1,200.00	37,320,000
ベスト電器	70,500	124.00	8,742,000
マルエツ	46,000	270.00	12,420,000
ロイヤルホールディングス	37,700	1,041.00	39,245,700
東天紅	16,000	201.00	3,216,000
いなげや	25,100	998.00	25,049,800
島忠	51,100	1,803.00	92,133,300
チヨダ	26,600	2,194.00	58,360,400
ライフコーポレーション	15,300	1,278.00	19,553,400
カスミ	46,200	527.00	24,347,400
リンガーハット	20,400	1,055.00	21,522,000
MrMax	22,600	318.00	7,186,800
テナライド	17,000	280.00	4,760,000
AOKIホールディングス	19,900	1,928.00	38,367,200
オークワ	36,000	1,105.00	39,780,000
コメリ	34,800	2,153.00	74,924,400
青山商事	62,200	1,535.00	95,477,000
しまむら	26,200	8,750.00	229,250,000
CFSコーポレーション	15,700	366.00	5,746,200
高島屋	305,000	547.00	166,835,000
松屋	47,000	752.00	35,344,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	147,000	801.00	117,747,000
ニッセンホールディングス	40,700	329.00	13,390,300
パルコ	43,300	864.00	37,411,200
丸井グループ	294,100	576.00	169,401,600
原信ナルスホールディングス	12,500	1,495.00	18,687,500
ダイエー	130,550	166.00	21,671,300
イズミヤ	87,000	426.00	37,062,000
イオン	795,500	949.00	754,929,500
ユニー	218,100	612.00	133,477,200
イズミ	56,500	1,886.00	106,559,000
東武ストア	30,000	266.00	7,980,000
平和堂	46,000	1,189.00	54,694,000
フジ	25,100	1,792.00	44,979,200
ヤオコー	11,400	3,240.00	36,936,000
ゼビオ	30,600	1,573.00	48,133,800

ケーズホールディングス	56,300	2,066.00	116,315,800
Olympic	13,300	794.00	10,560,200
日産東京販売ホールディングス	33,000	321.00	10,593,000
インファーマシーズ	12,500	4,665.00	58,312,500
元気寿司	7,000	1,049.00	7,343,000
ヤマダ電機	102,920	2,902.00	298,673,840
アークランドサカモト	14,700	1,297.00	19,065,900
ニトリホールディングス	44,700	6,380.00	285,186,000
グルメ杵屋	16,000	535.00	8,560,000
愛眼	18,100	299.00	5,411,900
吉野家ホールディングス	612	104,800.00	64,137,600
松屋フーズ	10,900	1,506.00	16,415,400
サガミチェーン	27,000	650.00	17,550,000
プレナス	25,200	1,377.00	34,700,400
ミニストップ	16,700	1,420.00	23,714,000
アークス	38,500	1,715.00	66,027,500
パロー	48,600	1,331.00	64,686,600
ベルク	11,100	1,203.00	13,353,300
大庄	10,600	1,062.00	11,257,200
ファーストリテイリング	45,200	19,420.00	877,784,000
サンドラッグ	42,900	2,993.00	128,399,700
東京デリカ	7,500	1,095.00	8,212,500
ヤマザワ	5,900	1,430.00	8,437,000
やまや	4,700	1,200.00	5,640,000
ペルーナ	28,200	626.00	17,653,200
島根銀行	5,000	1,111.00	5,555,000
じもとホールディングス	161,900	211.00	34,160,900
新生銀行	1,952,000	146.00	284,992,000
あおぞら銀行	820,000	250.00	205,000,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	17,086,100	379.00	6,475,631,900
りそなホールディングス	2,320,900	345.00	800,710,500
三井住友トラスト・ホールディングス	4,717,000	256.00	1,207,552,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,706,400	2,692.00	4,593,628,800
第四銀行	291,000	284.00	82,644,000
北越銀行	230,000	170.00	39,100,000
西日本シティ銀行	792,000	198.00	156,816,000
千葉銀行	870,000	490.00	426,300,000
横浜銀行	1,435,000	393.00	563,955,000
常陽銀行	851,000	405.00	344,655,000
群馬銀行	510,000	405.00	206,550,000
武蔵野銀行	36,400	2,749.00	100,063,600
千葉興業銀行	43,200	456.00	19,699,200
筑波銀行	93,800	279.00	26,170,200
東京都民銀行	42,600	711.00	30,288,600
七十七銀行	354,000	326.00	115,404,000
青森銀行	169,000	233.00	39,377,000
秋田銀行	155,000	225.00	34,875,000
山形銀行	137,000	378.00	51,786,000

岩手銀行	16,300	3,360.00	54,768,000
東邦銀行	190,000	272.00	51,680,000
東北銀行	115,000	131.00	15,065,000
みちのく銀行	112,000	171.00	19,152,000
ふくおかフィナンシャルグループ	915,000	328.00	300,120,000
静岡銀行	661,000	819.00	541,359,000
十六銀行	283,000	286.00	80,938,000
スルガ銀行	220,000	1,067.00	234,740,000
八十二銀行	416,000	419.00	174,304,000
山梨中央銀行	138,000	341.00	47,058,000
大垣共立銀行	301,000	289.00	86,989,000
福井銀行	194,000	157.00	30,458,000
北國銀行	261,000	304.00	79,344,000
清水銀行	7,700	2,405.00	18,518,500
滋賀銀行	212,000	550.00	116,600,000
南都銀行	225,000	399.00	89,775,000
百五銀行	204,000	366.00	74,664,000
京都銀行	404,000	697.00	281,588,000
三重銀行	93,000	179.00	16,647,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,581,000	118.00	186,558,000
広島銀行	666,000	352.00	234,432,000
山陰合同銀行	133,000	588.00	78,204,000
中国銀行	174,000	1,164.00	202,536,000
鳥取銀行	72,000	164.00	11,808,000
伊予銀行	241,000	644.00	155,204,000
百十四銀行	248,000	322.00	79,856,000
四国銀行	163,000	213.00	34,719,000
阿波銀行	186,000	489.00	90,954,000
鹿児島銀行	157,000	526.00	82,582,000
大分銀行	133,000	289.00	38,437,000
宮崎銀行	150,000	209.00	31,350,000
肥後銀行	186,000	473.00	87,978,000
佐賀銀行	137,000	187.00	25,619,000
十八銀行	144,000	216.00	31,104,000
沖縄銀行	16,800	3,275.00	55,020,000
琉球銀行	46,800	1,012.00	47,361,600
八千代銀行	11,600	1,632.00	18,931,200
セブン銀行	760,900	210.00	159,789,000
みずほフィナンシャルグループ	29,030,100	132.00	3,831,973,200
紀陽ホールディングス	899,000	114.00	102,486,000
山口フィナンシャルグループ	225,000	745.00	167,625,000
長野銀行	79,000	149.00	11,771,000
名古屋銀行	204,000	295.00	60,180,000
北洋銀行	339,900	232.00	78,856,800
愛知銀行	8,200	4,395.00	36,039,000
第三銀行	128,000	149.00	19,072,000
中京銀行	93,000	182.00	16,926,000
東日本銀行	98,000	180.00	17,640,000

大光銀行	80,000	204.00	16,320,000
愛媛銀行	133,000	224.00	29,792,000
トマト銀行	87,000	154.00	13,398,000
みなと銀行	204,000	151.00	30,804,000
京葉銀行	186,000	365.00	67,890,000
関西アーバン銀行	314,000	108.00	33,912,000
栃木銀行	113,000	284.00	32,092,000
北日本銀行	6,600	2,240.00	14,784,000
東和銀行	243,000	88.00	21,384,000
福島銀行	278,000	71.00	19,738,000
大東銀行	143,000	83.00	11,869,000
トモニホールディングス	173,100	345.00	59,719,500
フィデアホールディングス	129,800	181.00	23,493,800
池田泉州ホールディングス	186,200	503.00	93,658,600
F P G	4,600	1,055.00	4,853,000
S B Iホールディングス	288,500	635.00	183,197,500
ジャフコ	31,700	2,229.00	70,659,300
大和証券グループ本社	2,238,000	381.00	852,678,000
野村ホールディングス	4,615,600	345.00	1,592,382,000
岡三証券グループ	194,000	355.00	68,870,000
丸三証券	72,200	327.00	23,609,400
東洋証券	94,000	178.00	16,732,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	259,000	333.00	86,247,000
水戸証券	77,000	183.00	14,091,000
いちよし証券	52,300	485.00	25,365,500
松井証券	133,900	633.00	84,758,700
だいこう証券ビジネス	14,500	324.00	4,698,000
マネックスグループ	2,611	17,130.00	44,726,430
カブドットコム証券	92,300	275.00	25,382,500
極東証券	31,200	768.00	23,961,600
岩井コスモホールディングス	25,400	361.00	9,169,400
N K S Jホールディングス	501,200	1,590.00	796,908,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	674,300	1,430.00	964,249,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	216,200	1,428.00	308,733,600
第一生命保険	12,068	94,800.00	1,144,046,400
東京海上ホールディングス	874,000	2,117.00	1,850,258,000
T & Dホールディングス	774,000	882.00	682,668,000
クレディセゾン	197,600	1,855.00	366,548,000
芙蓉総合リース	22,100	2,416.00	53,393,600
興銀リース	35,300	2,175.00	76,777,500
東京センチュリーリース	53,800	1,640.00	88,232,000
日本証券金融	93,500	411.00	38,428,500
大阪証券金融	56,000	201.00	11,256,000
ポケットカード	37,500	353.00	13,237,500
リコーリース	16,900	1,910.00	32,279,000
イオンクレジットサービス	83,700	1,620.00	135,594,000
アコム	46,430	2,254.00	104,653,220

ジャックス	135,000	327.00	44,145,000
オリエントコーポレーション	475,000	169.00	80,275,000
日立キャピタル	45,200	1,630.00	73,676,000
オリックス	117,420	8,640.00	1,014,508,800
三菱UFJリース	57,290	3,585.00	205,384,650
アサックス	39	78,300.00	3,053,700
NECキャピタルソリューション	12,300	1,145.00	14,083,500
日本駐車場開発	2,457	4,275.00	10,503,675
ヒューリック	279,100	487.00	135,921,700
東京建物不動産販売	11,700	275.00	3,217,500
三栄建築設計	5,600	731.00	4,093,600
野村不動産ホールディングス	109,100	1,446.00	157,758,600
常和ホールディングス	5,900	1,495.00	8,820,500
パーク24	117,400	1,368.00	160,603,200
三井不動産	1,064,000	1,769.00	1,882,216,000
三菱地所	1,579,000	1,630.00	2,573,770,000
平和不動産	46,300	994.00	46,022,200
東京建物	445,000	333.00	148,185,000
ダイビル	65,400	716.00	46,826,400
東急不動産	498,000	506.00	251,988,000
京阪神ビルディング	38,500	396.00	15,246,000
住友不動産	541,000	2,294.00	1,241,054,000
東宝不動産	19,900	501.00	9,969,900
大京	349,000	196.00	68,404,000
テーオーシー	77,900	447.00	34,821,300
東京楽天地	37,000	308.00	11,396,000
フジ住宅	31,600	438.00	13,840,800
空港施設	27,400	391.00	10,713,400
明和地所	11,200	366.00	4,099,200
住友不動産販売	8,130	3,595.00	29,227,350
ゴールドクレスト	17,900	1,224.00	21,909,600
東栄住宅	15,400	910.00	14,014,000
日本エスリード	11,700	775.00	9,067,500
東急リパブル	23,900	1,259.00	30,090,100
飯田産業	21,400	681.00	14,573,400
日神不動産	16,100	438.00	7,051,800
アーネストワン	37,300	1,158.00	43,193,400
タカラレーベン	27,500	803.00	22,082,500
サンヨーハウジング名古屋	117	84,100.00	9,839,700
イオンモール	103,000	2,150.00	221,450,000
フージャースコーポレーション	356	58,500.00	20,826,000
タクトホーム	120	83,600.00	10,032,000
トーセイ	442	39,950.00	17,657,900
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,439	70,000.00	100,730,000
サンフロンティア不動産	329	44,050.00	14,492,450
ランドビジネス	152	41,700.00	6,338,400
グランディハウス	5,000	666.00	3,330,000
日本空港ビルデング	78,000	938.00	73,164,000

日本工営	80,000	281.00	22,480,000
ネクスト	12,500	794.00	9,925,000
日本M&Aセンター	12,300	2,829.00	34,796,700
ノバレーゼ	62	55,000.00	3,410,000
アコーディア・ゴルフ	1,048	75,700.00	79,333,600
タケエイ	3,000	1,855.00	5,565,000
パソナグループ	238	48,550.00	11,554,900
リンクアンドモチベーション	123	31,900.00	3,923,700
GCAサヴィアングループ	132	100,000.00	13,200,000
エス・エム・エス	71	182,700.00	12,971,700
テンプホールディングス	32,600	1,079.00	35,175,400
クックパッド	4,700	2,550.00	11,985,000
学情	10,500	282.00	2,961,000
スタジオアリス	11,000	1,273.00	14,003,000
シミックホールディングス	9,100	1,266.00	11,520,600
NECフィールドディング	19,400	973.00	18,876,200
総合警備保障	87,000	1,085.00	94,395,000
カカコム	33,100	2,898.00	95,923,800
ルネサンス	11,400	649.00	7,398,600
ツクイ	11,600	1,668.00	19,348,800
エムスリー	564	151,100.00	85,220,400
ベストブライダル	70	83,600.00	5,852,000
ディー・エヌ・エー	117,800	2,916.00	343,504,800
博報堂DYホールディングス	33,110	5,410.00	179,125,100
ぐるなび	16,700	922.00	15,397,400
一休	150	57,700.00	8,655,000
ジャパンベストレスキューシステム	30	79,000.00	2,370,000
ジェイコムホールディングス	4,300	696.00	2,992,800
PGMホールディングス	350	72,200.00	25,270,000
JPホールディングス	7,700	957.00	7,368,900
イーピーエス	141	229,000.00	32,289,000
アミューズ	7,300	1,677.00	12,242,100
ドリームインキュベータ	86	81,900.00	7,043,400
ケネディクス	2,277	14,820.00	33,745,140
電通	217,300	2,126.00	461,979,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,150	8,350.00	9,602,500
ぴあ	7,000	1,092.00	7,644,000
イオンファンタジー	7,800	1,144.00	8,923,200
ネクシィーズ	888	2,121.00	1,883,448
みらかホールディングス	62,400	3,480.00	217,152,000
アルプス技研	9,700	673.00	6,528,100
サニックス	34,700	252.00	8,744,400
ダイオーズ	4,400	519.00	2,283,600
日本空調サービス	5,900	738.00	4,354,200
オリエンタルランド	71,000	10,540.00	748,340,000
ダスキン	65,900	1,543.00	101,683,700
明光ネットワークジャパン	21,800	897.00	19,554,600
ファルコSDホールディングス	13,000	1,000.00	13,000,000

秀英予備校	8,500	285.00	2,422,500
田谷	3,700	695.00	2,571,500
ラウンドワン	77,900	477.00	37,158,300
リゾートトラスト	40,700	1,636.00	66,585,200
ビー・エム・エル	14,100	2,101.00	29,624,100
ワタベウェディング	7,100	616.00	4,373,600
もしもしホットライン	39,500	1,147.00	45,306,500
東急コミュニティー	6,200	3,050.00	18,910,000
リソー教育	2,435	6,550.00	15,949,250
ウェアハウス	7,300	212.00	1,547,600
ユー・エス・エス	26,690	8,870.00	236,740,300
東京個別指導学院	12,000	158.00	1,896,000
テー・オー・ダブリュー	8,000	477.00	3,816,000
セントラルスポーツ	7,400	1,251.00	9,257,400
フルキャストホールディングス	225	16,530.00	3,719,250
リゾートソリューション	27,000	165.00	4,455,000
リブセンス	2,100	3,720.00	7,812,000
リロ・ホールディング	8,200	3,040.00	24,928,000
エイチ・アイ・エス	19,500	2,556.00	49,842,000
共立メンテナンス	12,500	1,770.00	22,125,000
イチネンホールディングス	27,800	473.00	13,149,400
建設技術研究所	13,200	559.00	7,378,800
スペース	13,000	735.00	9,555,000
燦ホールディングス	5,200	1,224.00	6,364,800
スバル興業	17,000	268.00	4,556,000
東京テアトル	91,000	108.00	9,828,000
よみうりランド	48,000	277.00	13,296,000
東京都競馬	184,000	123.00	22,632,000
カナモト	29,000	990.00	28,710,000
東京ドーム	183,000	269.00	49,227,000
トランス・コスモス	31,200	904.00	28,204,800
乃村工藝社	51,000	326.00	16,626,000
藤田観光	61,000	293.00	17,873,000
日本管財	8,800	1,535.00	13,508,000
トーカイ	10,600	2,193.00	23,245,800
白洋舎	29,000	209.00	6,061,000
セコム	248,400	4,250.00	1,055,700,000
セントラル警備保障	10,600	814.00	8,628,400
丹青社	25,000	321.00	8,025,000
メイテック	37,000	1,883.00	69,671,000
アサツー ディ・ケイ	39,400	1,947.00	76,711,800
応用地質	25,100	972.00	24,397,200
船井総合研究所	24,500	553.00	13,548,500
進学会	11,600	300.00	3,480,000
ベネッセホールディングス	72,700	3,530.00	256,631,000
イオンディライト	23,100	1,681.00	38,831,100
ナック	5,400	1,954.00	10,551,600
ニチイ学館	46,700	651.00	30,401,700

ダイセキ	35,300	1,161.00	40,983,300	
ステップ	7,200	685.00	4,932,000	
合計	350,695,300	-	248,212,309,783	

(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(デリバティブ取引に関する注記)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12月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,475,977,894
国債証券	251,244,590,700
地方債証券	22,120,176,703
特殊債券	34,755,433,120
社債券	21,021,296,000
派生商品評価勘定	138,740
未収入金	11,480,569,000
未収利息	1,336,288,198
前払金	780,000
前払費用	49,892,921
流動資産合計	343,485,143,276
資産合計	343,485,143,276
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,260
未払解約金	10,847,769,889
流動負債合計	10,847,811,149
負債合計	10,847,811,149
純資産の部	
元本等	
元本	271,094,781,512
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	61,542,550,615
元本等合計	332,637,332,127
純資産合計	332,637,332,127
負債純資産合計	343,485,143,276

(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12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、 時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価 格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統 計値等で評価しております。</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 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>

3. 収益及び費用の計上基準	<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> <p>派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月10日現在
1. 特定期間の期首元本額	292,037,306,349円
特定期間中の追加設定元本額	13,925,151,797円
特定期間中の一部解約元本額	34,867,676,634円
計算日の元本額	271,094,781,512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	5,796,241,098円
D C日本債券インデックスファンド	2,146,246,790円
D C日本債券インデックスファンドL	23,626,974,614円
D Cバランスファンド30	921,177,346円
D Cバランスファンド50	909,282,621円
D Cバランスファンド70	225,892,611円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	131,730,561円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	87,972,487円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	269,166,495円
新生・4分散ファンド	121,244,449円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	30,262,660円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	107,327,935円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	642,447,585円
日本債券インデックスe	695,345,540円
インデックスコレクション（国内債券）	2,134,586,417円
インデックスコレクション（バランス株式30）	1,076,524,560円
インデックスコレクション（バランス株式50）	805,553,710円
インデックスコレクション（バランス株式70）	311,555,278円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	9,623,333,839円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	29,926,758,093円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	27,645,896,116円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,494,546,821円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	6,933,725,537円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,448,816,796円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,266,947,968円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	22,961,833,236円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	205,990,885円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	29,267,219,450円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	6,893,821,492円

V Aポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	623,516,349円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,155,483,969円
V Aバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,597,191,937円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	4,824,022,322円
V Aバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	956,822,813円
V Aバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,739,113,090円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	4,512,542,592円
V Aファンド25(適格機関投資家専用)	4,247,153,228円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	6,401,943,993円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	599,220,752円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	3,738,342,956円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	48,065,169,150円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,221,402,891円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	301,118,360円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	135,175,598円
V Aバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,233,643,841円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	12,711,760円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	21,782,921円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券 105,888,000円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
3. 計算日における受益権総数	271,094,781,512口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2270円 (12,270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12月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年12月10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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,946,050,000	
地方債証券	239,058,094	
特殊債券	332,658,544	
社債券	257,987,000	
合計	3,775,753,638	

(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12月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

. 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12月10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	1,157,662,520	-	1,157,760,000	97,480
	合計	1,157,662,520	-	1,157,760,000	97,480

(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12月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年12月10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12月10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	第3 1 2 回利付国債(2年)	400,000,000	400,020,000	
	第3 1 3 回利付国債(2年)	2,770,000,000	2,770,138,500	
	第3 1 4 回利付国債(2年)	2,200,000,000	2,200,132,000	
	第3 1 5 回利付国債(2年)	600,000,000	600,036,000	
	第3 1 6 回利付国債(2年)	700,000,000	700,049,000	
	第3 1 7 回利付国債(2年)	300,000,000	300,021,000	
	第3 1 8 回利付国債(2年)	2,100,000,000	2,100,147,000	
	第3 1 9 回利付国債(2年)	200,000,000	200,016,000	
	第3 2 0 回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,400,192,000	
	第3 2 1 回利付国債(2年)	1,150,000,000	1,150,103,500	
	第3 2 2 回利付国債(2年)	1,370,000,000	1,370,123,300	
	第8 1 回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,715,181,000	
	第8 2 回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,121,399,000	
	第8 3 回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,214,664,000	
	第8 4 回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,816,524,000	
	第8 5 回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,122,470,000	
	第8 6 回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,118,753,000	
	第8 7 回利付国債(5年)	3,900,000,000	3,931,863,000	
	第8 8 回利付国債(5年)	2,900,000,000	2,926,564,000	
	第8 9 回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,209,192,000	
	第9 0 回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,306,695,000	
	第9 1 回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,008,430,000	
	第9 2 回利付国債(5年)	800,000,000	804,528,000	
	第9 3 回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,125,620,000	
第9 4 回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,218,252,000		
第9 5 回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,930,932,000		

第96回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,316,939,000	
第97回利付国債（5年）	1,600,000,000	1,616,272,000	
第98回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,912,654,000	
第99回利付国債（5年）	1,220,000,000	1,233,054,000	
第100回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,409,716,000	
第101回利付国債（5年）	1,600,000,000	1,617,600,000	
第102回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,913,300,000	
第103回利付国債（5年）	2,600,000,000	2,618,200,000	
第104回利付国債（5年）	100,000,000	100,275,000	
第105回利付国債（5年）	2,400,000,000	2,405,928,000	
第106回利付国債（5年）	5,320,000,000	5,331,331,600	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	441,768,000	
第2回利付国債（40年）	500,000,000	525,435,000	
第3回利付国債（40年）	600,000,000	628,302,000	
第4回利付国債（40年）	800,000,000	833,776,000	
第5回利付国債（40年）	460,000,000	452,042,000	
第258回利付国債（10年）	480,000,000	487,324,800	
第259回利付国債（10年）	1,180,000,000	1,201,004,000	
第260回利付国債（10年）	860,000,000	879,651,000	
第261回利付国債（10年）	790,000,000	810,445,200	
第262回利付国債（10年）	730,000,000	750,002,000	
第263回利付国債（10年）	750,000,000	769,972,500	
第264回利付国債（10年）	1,330,000,000	1,363,063,800	
第265回利付国債（10年）	730,000,000	750,695,500	
第266回利付国債（10年）	560,000,000	574,744,800	
第267回利付国債（10年）	410,000,000	419,967,100	
第268回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,547,700,000	
第269回利付国債（10年）	840,000,000	862,906,800	
第270回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,163,630,000	
第271回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,438,892,000	
第272回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,554,120,000	
第273回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,454,390,000	
第274回利付国債（10年）	900,000,000	938,097,000	

第275回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,247,184,000	
第276回利付国債（10年）	800,000,000	836,272,000	
第277回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,363,739,000	
第278回利付国債（10年）	800,000,000	844,440,000	
第279回利付国債（10年）	700,000,000	743,449,000	
第280回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,594,440,000	
第281回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,066,460,000	
第282回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,695,248,000	
第283回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,488,606,000	
第284回利付国債（10年）	2,950,000,000	3,136,558,000	
第285回利付国債（10年）	3,400,000,000	3,626,576,000	
第286回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,504,384,000	
第287回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,834,402,000	
第288回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,180,784,000	
第289回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,706,800,000	
第290回利付国債（10年）	900,000,000	957,798,000	
第291回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,270,800,000	
第292回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,295,868,000	
第293回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,306,260,000	
第294回利付国債（10年）	900,000,000	974,772,000	
第295回利付国債（10年）	800,000,000	857,720,000	
第296回利付国債（10年）	2,400,000,000	2,578,032,000	
第297回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,283,772,000	
第298回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,063,870,000	
第299回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,171,643,000	
第300回利付国債（10年）	900,000,000	969,723,000	
第301回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,833,977,000	
第302回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,286,880,000	
第303回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,287,612,000	
第304回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,492,918,000	
第305回利付国債（10年）	2,900,000,000	3,093,053,000	
第306回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,504,188,000	
第307回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,387,529,000	

第308回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,387,945,000	
第309回利付国債（10年）	800,000,000	842,112,000	
第310回利付国債（10年）	1,190,000,000	1,242,883,600	
第311回利付国債（10年）	1,900,000,000	1,955,062,000	
第312回利付国債（10年）	3,200,000,000	3,388,416,000	(注)
第313回利付国債（10年）	1,900,000,000	2,026,312,000	
第314回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,470,196,000	
第315回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,374,360,000	
第316回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,363,739,000	
第318回利付国債（10年）	2,200,000,000	2,285,712,000	
第319回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,202,808,000	
第320回利付国債（10年）	1,900,000,000	1,970,946,000	
第321回利付国債（10年）	2,600,000,000	2,692,482,000	
第322回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,128,974,000	
第323回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,741,225,000	
第324回利付国債（10年）	2,400,000,000	2,435,544,000	
第325回利付国債（10年）	3,570,000,000	3,614,196,600	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	60,120,500	
第2回利付国債（30年）	100,000,000	113,935,000	
第3回利付国債（30年）	330,000,000	370,326,000	
第4回利付国債（30年）	190,000,000	230,369,300	
第5回利付国債（30年）	180,000,000	197,910,000	
第6回利付国債（30年）	270,000,000	304,716,600	
第7回利付国債（30年）	390,000,000	433,040,400	
第8回利付国債（30年）	270,000,000	276,490,800	
第9回利付国債（30年）	180,000,000	171,932,400	
第10回利付国債（30年）	170,000,000	153,351,900	
第11回利付国債（30年）	210,000,000	210,640,500	
第12回利付国債（30年）	370,000,000	396,677,000	
第13回利付国債（30年）	350,000,000	368,830,000	
第14回利付国債（30年）	350,000,000	393,183,000	
第15回利付国債（30年）	640,000,000	729,868,800	
第16回利付国債（30年）	250,000,000	284,950,000	

第17回利付国債（30年）	430,000,000	482,090,200	
第18回利付国債（30年）	660,000,000	727,491,600	
第19回利付国債（30年）	370,000,000	407,814,000	
第20回利付国債（30年）	140,000,000	159,565,000	
第21回利付国債（30年）	420,000,000	462,457,800	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	455,632,000	
第23回利付国債（30年）	400,000,000	455,680,000	
第24回利付国債（30年）	200,000,000	227,666,000	
第25回利付国債（30年）	400,000,000	439,808,000	
第26回利付国債（30年）	700,000,000	783,510,000	
第27回利付国債（30年）	700,000,000	797,615,000	
第28回利付国債（30年）	600,000,000	683,634,000	
第29回利付国債（30年）	1,100,000,000	1,230,273,000	
第30回利付国債（30年）	570,000,000	625,290,000	
第31回利付国債（30年）	1,100,000,000	1,182,687,000	
第32回利付国債（30年）	1,100,000,000	1,206,106,000	
第33回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,339,455,000	
第34回利付国債（30年）	1,400,000,000	1,502,102,000	
第35回利付国債（30年）	1,200,000,000	1,232,640,000	
第36回利付国債（30年）	1,500,000,000	1,538,340,000	
第37回利付国債（30年）	740,000,000	740,703,000	
第24回利付国債（20年）	160,000,000	169,334,400	
第25回利付国債（20年）	80,000,000	84,059,200	
第26回利付国債（20年）	50,000,000	53,904,500	
第27回利付国債（20年）	410,000,000	445,657,700	
第28回利付国債（20年）	110,000,000	122,213,300	
第29回利付国債（20年）	100,000,000	111,362,000	
第30回利付国債（20年）	200,000,000	219,956,000	
第31回利付国債（20年）	280,000,000	311,038,000	
第32回利付国債（20年）	80,000,000	89,390,400	
第33回利付国債（20年）	430,000,000	489,610,900	
第34回利付国債（20年）	70,000,000	80,030,300	
第35回利付国債（20年）	270,000,000	306,331,200	

第37回利付国債（20年）	410,000,000	467,313,900	
第39回利付国債（20年）	640,000,000	721,395,200	
第40回利付国債（20年）	450,000,000	504,072,000	
第41回利付国債（20年）	620,000,000	668,242,200	
第42回利付国債（20年）	380,000,000	435,784,000	
第43回利付国債（20年）	340,000,000	399,071,600	
第44回利付国債（20年）	370,000,000	426,536,000	
第45回利付国債（20年）	270,000,000	309,449,700	
第46回利付国債（20年）	290,000,000	328,738,200	
第47回利付国債（20年）	470,000,000	533,995,200	
第48回利付国債（20年）	230,000,000	267,138,100	
第49回利付国債（20年）	280,000,000	316,724,800	
第50回利付国債（20年）	590,000,000	657,979,800	
第51回利付国債（20年）	240,000,000	269,870,400	
第52回利付国債（20年）	430,000,000	487,220,100	
第53回利付国債（20年）	350,000,000	397,141,500	
第54回利付国債（20年）	280,000,000	320,121,200	
第55回利付国債（20年）	490,000,000	551,700,800	
第56回利付国債（20年）	410,000,000	461,483,700	
第57回利付国債（20年）	360,000,000	401,785,200	
第58回利付国債（20年）	250,000,000	279,100,000	
第59回利付国債（20年）	440,000,000	482,785,600	
第60回利付国債（20年）	570,000,000	608,788,500	
第61回利付国債（20年）	390,000,000	400,631,400	
第62回利付国債（20年）	250,000,000	251,217,500	
第63回利付国債（20年）	570,000,000	630,511,200	
第64回利付国債（20年）	410,000,000	457,449,300	
第65回利付国債（20年）	370,000,000	412,476,000	
第66回利付国債（20年）	240,000,000	264,979,200	
第67回利付国債（20年）	510,000,000	567,987,000	
第68回利付国債（20年）	230,000,000	263,554,700	
第69回利付国債（20年）	260,000,000	295,243,000	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	467,260,000	

第71回利付国債（20年）	400,000,000	458,584,000	
第72回利付国債（20年）	920,000,000	1,044,181,600	
第73回利付国債（20年）	540,000,000	606,409,200	
第74回利付国債（20年）	310,000,000	351,688,800	
第75回利付国債（20年）	360,000,000	407,952,000	
第76回利付国債（20年）	530,000,000	588,231,100	
第77回利付国債（20年）	410,000,000	459,827,300	
第78回利付国債（20年）	200,000,000	221,632,000	
第79回利付国債（20年）	300,000,000	335,997,000	
第80回利付国債（20年）	250,000,000	282,960,000	
第81回利付国債（20年）	720,000,000	805,190,400	
第82回利付国債（20年）	510,000,000	576,473,400	
第83回利付国債（20年）	530,000,000	598,200,400	
第84回利付国債（20年）	500,000,000	558,250,000	
第85回利付国債（20年）	550,000,000	620,141,500	
第86回利付国債（20年）	270,000,000	311,115,600	
第87回利付国債（20年）	500,000,000	569,615,000	
第88回利付国債（20年）	400,000,000	460,288,000	
第89回利付国債（20年）	800,000,000	910,536,000	
第90回利付国債（20年）	220,000,000	249,990,400	
第91回利付国債（20年）	600,000,000	689,412,000	
第92回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,234,376,000	
第93回利付国債（20年）	600,000,000	664,548,000	
第94回利付国債（20年）	800,000,000	895,896,000	
第95回利付国債（20年）	500,000,000	572,255,000	
第96回利付国債（20年）	500,000,000	558,755,000	
第97回利付国債（20年）	400,000,000	451,892,000	
第98回利付国債（20年）	600,000,000	669,858,000	
第99回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,225,994,000	
第100回利付国債（20年）	800,000,000	901,488,000	
第101回利付国債（20年）	500,000,000	577,050,000	
第102回利付国債（20年）	400,000,000	460,992,000	
第103回利付国債（20年）	300,000,000	341,388,000	

第104回利付国債（20年）	600,000,000	666,288,000	
第105回利付国債（20年）	900,000,000	996,849,000	
第106回利付国債（20年）	300,000,000	336,660,000	
第107回利付国債（20年）	700,000,000	773,738,000	
第108回利付国債（20年）	700,000,000	753,690,000	
第109回利付国債（20年）	700,000,000	751,352,000	
第110回利付国債（20年）	700,000,000	772,086,000	
第111回利付国債（20年）	320,000,000	356,739,200	
第112回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,319,784,000	
第113回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,207,866,000	
第114回利付国債（20年）	800,000,000	876,368,000	
第115回利付国債（20年）	700,000,000	777,511,000	
第116回利付国債（20年）	600,000,000	665,358,000	
第117回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,312,248,000	
第118回利付国債（20年）	800,000,000	860,864,000	
第119回利付国債（20年）	200,000,000	209,048,000	
第120回利付国債（20年）	200,000,000	202,774,000	
第121回利付国債（20年）	800,000,000	846,088,000	
第122回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,146,299,000	
第123回利付国債（20年）	600,000,000	651,996,000	
第124回利付国債（20年）	600,000,000	642,558,000	
第125回利付国債（20年）	300,000,000	330,111,000	
第126回利付国債（20年）	800,000,000	854,904,000	
第127回利付国債（20年）	500,000,000	526,410,000	
第128回利付国債（20年）	800,000,000	840,288,000	
第129回利付国債（20年）	800,000,000	827,584,000	
第130回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,135,035,000	
第131回利付国債（20年）	500,000,000	507,580,000	
第133回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,647,856,000	
第134回利付国債（20年）	500,000,000	513,970,000	
第135回利付国債（20年）	300,000,000	303,300,000	
第136回利付国債（20年）	400,000,000	397,948,000	
第137回利付国債（20年）	500,000,000	504,435,000	

	第138回利付国債（20年）	600,000,000	585,846,000	
	第139回利付国債（20年）	600,000,000	595,566,000	
	第140回利付国債（20年）	2,010,000,000	2,024,974,500	
	国債証券 小計	238,620,000,000	251,244,590,700	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,447,000	
	第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	225,270,000	
	第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	221,956,000	
	第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,641,000	
	第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,730,000	
	第605回東京都公募公債	100,000,000	101,408,000	
	第608回東京都公募公債	100,000,000	101,832,000	
	第609回東京都公募公債	200,000,000	203,512,000	
	第616回東京都公募公債	100,000,000	102,552,000	
	第617回東京都公募公債	100,000,000	102,532,000	
	第619回東京都公募公債	100,000,000	103,150,000	
	第624回東京都公募公債	100,000,000	103,419,000	
	第628回東京都公募公債	100,000,000	104,346,000	
	第637回東京都公募公債	180,000,000	191,149,200	
	第642回東京都公募公債	100,000,000	106,701,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	108,101,000	
	第647回東京都公募公債	100,000,000	108,011,000	
	第656回東京都公募公債	100,000,000	106,782,000	
	第657回東京都公募公債	100,000,000	108,346,000	
	第659回東京都公募公債	100,000,000	107,615,000	
	第681回東京都公募公債	100,000,000	107,140,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	106,574,000	
	第692回東京都公募公債	100,000,000	106,678,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	103,629,000	
	平成17年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,831,000	
	平成19年度第14回北海道公募公債（10年）	100,000,000	107,257,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	108,488,000	
	平成20年度第15回北海道公募公債（5年）	100,000,000	101,244,000	
	平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	107,883,000	

平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	107,137,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	103,176,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	104,835,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,034,000	
第126回神奈川県公募公債	100,000,000	101,875,000	
第127回神奈川県公募公債	100,000,000	102,700,000	
第130回神奈川県公募公債	100,000,000	102,669,000	
第134回神奈川県公募公債	100,000,000	103,387,000	
第135回神奈川県公募公債	100,000,000	104,175,000	
第144回神奈川県公募公債	100,000,000	106,640,000	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	108,308,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	106,750,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	106,339,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	105,392,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	104,809,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	101,836,000	
第50回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	101,132,000	
第267回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,180,000	
第275回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,454,000	
第285回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,944,000	
第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,052,000	
第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,975,000	
第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,870,000	
第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,863,000	
第309回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,950,000	
第324回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,981,000	
第331回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,699,000	
第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,164,000	
第335回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,269,000	
第339回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,484,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	134,267,900	
平成17年度第3回京都府公募公債	100,000,000	104,090,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	107,313,000	

平成21年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,890,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	106,691,000	
平成22年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,024,000	
平成16年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	102,585,000	
平成17年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	102,727,000	
平成18年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	107,022,000	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	110,000,000	116,833,200	
平成18年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	106,984,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	107,942,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	107,191,000	
平成17年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,100,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	108,127,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,884,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,661,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	106,930,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	106,890,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,920,000	
平成17年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,974,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債（10年）	129,000,000	137,044,440	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,286,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	108,488,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	108,173,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,218,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	107,107,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,056,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,116,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,890,000	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,522,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,806,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	107,247,000	
平成15年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	101,425,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,845,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	107,889,000	

平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	107,403,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	108,602,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,944,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	105,349,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,109,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	112,518,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	211,292,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	108,207,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,786,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	107,692,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,214,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	175,000,000	185,724,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	106,766,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	108,453,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,380,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,606,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,002,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	107,444,000	
平成18年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	106,257,000	
第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,397,000	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,235,000	
第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	130,399,790	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,817,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,590,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,704,000	
第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,635,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,641,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,545,000	
第24回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,089,000	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,825,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,922,000	
第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	167,440,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,340,000	

第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,463,000	
第53回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,920,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,120,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,425,000	
第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,209,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	109,028,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,755,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,204,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,968,000	
第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,453,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,796,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,901,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,577,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,978,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,178,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,364,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,938,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,405,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,279,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,380,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,838,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,738,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,070,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,121,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,811,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,133,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,014,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,299,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,895,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,677,000	
第103回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,327,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,852,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,009,000	

平成18年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	106,814,000	
平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,652,000	
平成17年度第1回大阪市公募公債	100,000,000	102,786,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	213,606,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	107,199,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	111,499,000	
第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	105,050,000	
第12回せ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,499,000	
第12回ゆ号名古屋市公募公債	100,000,000	101,610,000	
第12回し号名古屋市公募公債	100,000,000	103,082,000	
第455回名古屋市公募公債（10年）	186,700,000	198,124,173	
第463回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	109,550,000	
第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	107,775,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	112,053,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	107,559,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	107,284,000	
平成22年度第3回京都市公募公債	100,000,000	100,585,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	113,024,000	
平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,033,000	
平成20年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	108,811,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	107,443,000	
平成21年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	106,750,000	
平成22年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,793,000	
平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	105,312,000	
平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	103,546,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,246,000	
平成23年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	103,681,000	
平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	106,117,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,741,000	
第79回川崎市公募公債	100,000,000	107,831,000	
平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	107,961,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	106,593,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	107,513,000	

	平成17年度第1回広島市公募公債	100,000,000	104,027,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	103,113,000	
	地方債証券 小計	20,897,700,000	22,120,176,703	
特殊債券	第8回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,852,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	235,386,900	
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,700,000	
	第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,279,000	
	第19回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,658,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,198,000	
	第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,912,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,461,000	
	第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,887,000	
	第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,148,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,722,000	
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,246,000	
	第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,276,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	171,957,000	
	第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	166,738,710	
	第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	107,784,170	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,792,000	
	第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,515,000	
	第21回道路債券	100,000,000	112,711,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,392,000	
	第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	133,462,500	
	第27回道路債券	100,000,000	114,972,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,186,000	
	第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,318,000	
	第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,830,000	
	第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,663,000	
	第33回道路債券	100,000,000	114,916,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,768,000	
	第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,037,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,817,000	

第38回道路債券	100,000,000	113,216,000	
第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,506,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,885,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,110,000	
第41回道路債券	100,000,000	102,929,000	
第42回道路債券	100,000,000	112,662,000	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,606,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,916,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,498,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,969,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,214,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,671,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,601,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,294,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,301,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,363,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,645,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,170,000	
第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,149,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,288,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,255,000	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,267,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,796,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,969,000	
第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,626,000	
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,124,000	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,296,000	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,317,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,916,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,650,000	
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,767,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,458,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,292,000	

第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,794,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,149,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,778,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,511,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	220,442,000	
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,242,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,546,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,249,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,046,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,519,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,797,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	131,000,000	135,328,240	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,470,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,355,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,534,000	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,329,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,983,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,531,000	
第328回政府保証道路債券	100,000,000	102,008,000	
第329回政府保証道路債券	150,000,000	153,399,000	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	102,720,000	
第333回政府保証道路債券	100,000,000	102,758,000	
第334回政府保証道路債券	100,000,000	102,686,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	102,590,000	
第336回政府保証道路債券	131,000,000	134,554,030	
第343回政府保証道路債券	100,000,000	102,990,000	
第346回政府保証道路債券	115,000,000	118,959,450	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	108,459,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,238,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	112,821,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	215,914,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,575,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	111,140,000	

第3回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	213,622,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,755,000	
第3回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	108,139,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,263,000	
第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,820,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,905,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,799,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,340,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	218,734,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,154,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,850,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,485,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,568,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,532,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,254,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,960,000	
第12回公営企業債券	200,000,000	204,794,000	
第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,637,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,516,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,517,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	103,128,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,007,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,150,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	315,276,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	229,372,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	102,276,000	
第19回公営企業債券	200,000,000	211,982,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,622,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,385,000	
第23回公営企業債券	100,000,000	106,789,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	106,908,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,021,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,557,000	

第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,683,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	221,667,670	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,877,000	
第839回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,993,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,702,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,463,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,709,000	
第848回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,587,000	
第850回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,002,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,863,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,974,000	
第855回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,232,000	
第857回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,355,000	
第859回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,280,000	
第860回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,692,000	
第862回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,585,000	
第864回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,184,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,744,000	
第877回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,752,000	
第879回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,342,000	
第884回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,354,000	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,053,000	
第886回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,682,000	
第5回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,824,000	
第9回首都高速道路債券	100,000,000	102,039,000	
第189回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,387,000	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,595,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,117,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	102,816,000	
第144回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,094,000	
第148回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,255,000	
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,193,000	
第4回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,838,000	

第7回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,800,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,580,000	
第187回政府保証中小企業債券	100,000,000	104,096,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	214,310,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	101,760,000	
第15回国際協力銀行債券	100,000,000	102,319,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	110,985,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	108,511,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	103,747,000	
第25回国際協力銀行債券	100,000,000	105,923,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	106,438,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	107,123,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	106,827,000	
第24回都市再生債券	100,000,000	108,967,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	106,080,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,280,000	
第49回都市再生債券	100,000,000	106,484,000	
第27回政府保証本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,446,000	
第323回東京交通債券	100,000,000	112,051,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	112,974,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	107,830,000	
第174回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,309,000	
第177回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,255,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,686,000	32,061,653	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	267,845,000	286,353,089	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	75,478,000	80,553,895	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	39,060,000	42,001,608	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,474,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	94,725,000	100,338,403	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,851,000	34,635,794	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,070,000	36,695,434	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,170,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,370,000	24,442,449	

第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	138,372,000	149,001,737	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,742,000	38,412,642	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,820,000	118,652,202	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,509,000	38,118,911	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,712,000	57,659,691	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,500,000	39,109,750	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,621,000	31,975,471	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,761,000	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,932,000	36,511,275	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,621,000	62,602,538	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,100,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	184,866,000	195,368,237	
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,651,000	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,190,000	40,283,193	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	61,931,000	65,044,271	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,680,000	84,916,569	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	218,026,000	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,210,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,035,000	73,494,128	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,594,000	44,647,882	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,394,000	71,552,813	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,761,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,460,000	141,697,760	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,331,000	49,726,895	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	151,548,000	159,337,567	
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,719,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,334,000	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,582,000	56,038,198	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	168,120,000	175,603,021	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,381,000	60,332,678	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,497,000	83,878,079	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,597,000	88,353,669	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,566,000	56,546,412	

第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,816,000	89,281,562	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,788,000	56,775,385	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	159,423,000	167,901,115	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,650,000	181,551,840	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	108,198,000	114,431,286	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,877,000	58,551,015	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,049,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,957,000	56,173,830	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,481,000	93,058,803	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,913,000	94,644,978	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,599,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,246,000	96,268,179	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,159,000	52,712,704	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,826,000	97,649,238	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,238,000	97,402,009	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	155,463,000	166,853,774	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,733,000	97,781,328	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,995,000	56,518,637	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,827,000	97,787,498	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,174,000	98,113,924	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,780,000	98,338,283	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,203,000	98,969,798	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,050,000	
第67回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,861,000	
第12回政府保証国民生活債券	100,000,000	101,613,000	
第15回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,098,000	
第19回政府保証国民生活債券	125,000,000	132,723,750	
第20回政府保証国民生活債券	100,000,000	102,236,000	
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,480,000	
い第705号商工債	100,000,000	101,475,000	
い第707号商工債	200,000,000	203,190,000	
い第710号商工債	200,000,000	202,472,000	
い第713号商工債	100,000,000	101,141,000	

い第714号商工債	100,000,000	101,378,000	
い第715号商工債	100,000,000	101,016,000	
い第716号商工債	100,000,000	101,060,000	
い第717号商工債	100,000,000	101,102,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,765,000	
い第733号商工債	100,000,000	101,231,000	
い第740号商工債	100,000,000	100,941,000	
い第741号商工債	200,000,000	201,878,000	
い第708号農林債	100,000,000	101,354,000	
い第717号農林債	100,000,000	101,157,000	
い第718号農林債	100,000,000	101,072,000	
い第720号農林債	100,000,000	101,027,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,947,000	
い第724号農林債	100,000,000	100,748,000	
い第725号農林債	100,000,000	100,485,000	
い第728号農林債	100,000,000	101,009,000	
い第729号農林債	100,000,000	101,674,000	
い第730号農林債	100,000,000	101,550,000	
い第732号農林債	200,000,000	202,540,000	
い第736号農林債	100,000,000	100,957,000	
い第745号農林債	120,000,000	120,430,800	
第231回信金中金債（5年）	100,000,000	101,408,000	
第234回信金中金債（5年）	100,000,000	101,398,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,381,000	
第238回信金中金債（5年）	100,000,000	101,170,000	
第243回信金中金債（5年）	100,000,000	101,102,000	
第246回信金中金債（5年）	100,000,000	101,101,000	
第248回信金中金債（5年）	100,000,000	100,914,000	
第251回信金中金債（5年）	100,000,000	100,429,000	
第259回信金中金債（5年）	100,000,000	101,214,000	
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	101,123,000	
第266回信金中金債（5年）	100,000,000	100,921,000	
第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,918,000	

	第5回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	106,818,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	108,305,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	107,734,000	
	第8回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,773,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	172,000,000	183,076,800	
	第14回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,763,000	
	第20回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,250,000	
	第3回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,485,000	
	第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	107,049,000	
	特殊債券 小計	32,890,433,000	34,755,433,120	
社債券	第1回フランス電力円貨社債	100,000,000	100,530,000	
	第1回ジーディーエフ・スエズ円貨社債	100,000,000	100,073,000	
	第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券	100,000,000	101,697,000	
	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	203,486,000	
	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	103,595,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	102,061,000	
	第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	102,192,000	
	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	101,701,000	
	第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,815,000	
	第6回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,985,000	
	第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	103,137,000	
	第2回ウエストパック・バンキング・コーポ・円貨社債	100,000,000	101,663,000	
	第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	203,208,000	
	第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,640,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,893,000	
	第1回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,634,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,612,000	

第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,591,000	
第3回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	102,016,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	101,768,000	
第1回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	101,819,000	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,989,000	
第8回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,853,000	
第5回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,301,000	
第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,274,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,005,000	
第37回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	108,639,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	103,868,000	
第2回第一三共株式会社無担保社債	100,000,000	108,495,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	106,378,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	101,791,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,896,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,912,000	
第42回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	101,412,000	
第17回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,549,000	
第25回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,682,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	99,024,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	100,041,000	
第22回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	107,884,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	103,084,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,320,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	108,758,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,382,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,542,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,808,000	
第58回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,547,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,901,000	

第46回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,077,000	
第53回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,572,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,337,000	
第75回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,659,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,873,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,846,000	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	304,425,000	
第17回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,172,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,096,000	
第19回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,998,000	
第20回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	202,212,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,533,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,415,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,270,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,600,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,395,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	226,924,000	
第83回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	212,410,000	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,100,000	
第106回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	303,420,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,658,000	
第109回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,076,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,373,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	211,366,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	210,730,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	202,298,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,143,000	
第48回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,057,000	

第50回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,781,000	
第51回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,419,000	
第52回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,122,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,873,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,966,000	
第37回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,988,000	
第14回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,796,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	101,145,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,094,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,305,000	
第25回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,760,000	
第42回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,783,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,671,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,450,000	
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,461,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,358,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,078,000	
第2回大和証券キャピタル・マーケット株式会社無担保社債	100,000,000	99,700,000	
第5回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	100,937,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,296,000	
第48回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,173,000	
第70回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,842,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,400,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	112,374,000	
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,133,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,496,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,270,000	
第13回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,054,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,950,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,415,000	
第33回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,517,000	
第37回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,558,000	

第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,062,000	
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,525,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,019,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,023,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,287,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,007,000	
第5回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	114,941,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,424,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	214,150,000	
第25回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,209,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,538,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,233,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	111,995,000	
第27回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	104,879,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,663,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,457,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,747,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	212,838,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,438,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,272,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	108,306,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	106,898,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	108,934,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	85,859,000	
第511回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,336,000	
第513回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,409,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,500,000	
第515回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,324,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	94,643,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,854,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,144,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,376,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,982,000	

第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	85,265,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	85,108,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	86,455,000	
第405回中部電力株式会社社債	100,000,000	108,523,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	216,164,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	111,943,000	
第466回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,979,000	
第478回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,890,000	
第480回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,875,000	
第484回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,624,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,002,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,324,000	
第306回中国電力株式会社社債	100,000,000	111,631,000	
第311回中国電力株式会社社債	100,000,000	110,718,000	
第354回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,528,000	
第283回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,723,000	
第288回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,992,000	
第383回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,235,000	
第414回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,244,000	
第416回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,802,000	
第420回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,896,000	
第435回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,435,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,494,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,442,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,550,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,016,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,928,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,838,000	
第257回北海道電力株式会社社債	100,000,000	110,652,000	
第284回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,723,000	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,595,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	102,507,000	
第16回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,917,000	

第17回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,194,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,826,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,910,000	
第29回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,650,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,460,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,539,000	
第7回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,320,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,332,000	
第25回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,346,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	106,667,000	
第24回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,066,000	
社債券 小計	20,300,000,000	21,021,296,000	
合計	312,708,133,000	329,141,496,523	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

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(デリバティブ取引に関する注記)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12月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,180,763,252
コール・ローン	1,053,109,377
株式	258,174,942,150
投資信託受益証券	185,404,227
投資証券	5,877,509,779
派生商品評価勘定	100,650,434
未収入金	8,276,186
未収配当金	727,570,670
未収利息	2,083
差入委託証拠金	1,833,602,097
流動資産合計	273,141,830,255
資産合計	273,141,830,255
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	63,368,608
未払解約金	106,202,482
流動負債合計	169,571,090
負債合計	169,571,090
純資産の部	
元本等	
元本	251,723,450,627
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,248,808,538
元本等合計	272,972,259,165
純資産合計	272,972,259,165
負債純資産合計	273,141,830,255

(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12月10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。</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>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<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。</p> <p>(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>

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月10日現在
1. 特定期間の期首元本額	270,920,058,283円
特定期間中の追加設定元本額	4,552,037,613円
特定期間中の一部解約元本額	23,748,645,269円
計算日の元本額	251,723,450,627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	4,347,363,822円
DC外国株式インデックスファンド	4,354,199,814円

D C 外国株式インデックスファンド L	18,862,576,941円
D C バランスファンド 3 0	189,220,594円
D C バランスファンド 5 0	560,407,551円
D C バランスファンド 7 0	326,646,804円
ベスタ・世界 6 資産ファンド(毎月決算型)	168,532,784円
ベスタ・世界 6 資産ファンド(1年決算型)	110,830,600円
新生・4分散ファンド	150,565,299円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	688,528,922円
4 資産インデックスバランスオープン(分配型)	37,801,161円
4 資産インデックスバランスオープン(成長型)	133,413,799円
外国株式インデックス e	4,843,747,685円
インデックスコレクション(外国株式)	2,234,702,822円
インデックスコレクション(バランス株式 3 0)	226,651,060円
インデックスコレクション(バランス株式 5 0)	491,735,050円
インデックスコレクション(バランス株式 7 0)	450,819,372円
外国株式インデックスファンド V A (適格機関投資家専用)	18,744,704,948円
バランス V A 3 0 (適格機関投資家専用)	4,977,088,585円
バランス V A 5 0 (適格機関投資家専用)	36,822,503,977円
V A バランスファンド(株 2 5 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	26,586,674,164円
V A バランスファンド(株 5 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	4,311,321,633円
V A バランス株式 3 0 (適格機関投資家専用)	348,595,784円
V A バランスファンド(株 6 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	26,955,079,026円
バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	3,193,879,277円
バランス V A 3 7 . 5 (適格機関投資家専用)	1,646,791,444円
バランス V A 5 0 L (適格機関投資家専用)	27,972,266,958円
バランス V A 7 5 (適格機関投資家専用)	2,204,980,482円
V A バランスファンド(株 4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	40,687,662,661円
V A ポートフォリオ 4 0 (適格機関投資家専用)	5,321,202,565円
V A ポートフォリオ 2 0 (適格機関投資家専用)	180,497,887円
バランス V A 4 0 (適格機関投資家専用)	2,628,011,410円
V A バランス株式 4 0 (適格機関投資家専用)	1,991,901,243円
V A バランスファンド 2 (株 4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	830,246,223円
V A バランス 5 0 - 5 0 (適格機関投資家専用)	2,009,153,638円
バランス V A 2 0 (適格機関投資家専用)	1,452,150,414円
V A ファンド 2 5 (適格機関投資家専用)	2,460,704,605円
バランス V A 2 0 L (適格機関投資家専用)	107,423,621円
バランス V A 2 5 L (適格機関投資家専用)	609,107,468円
V A バランス 2 0 - 8 0 (適格機関投資家専用)	1,433,787,802円
私募外国株式インデックスファンド A L (適格機関投資家専用)	69,970,732円

2. 計算日における受益権総数

251,723,450,627円

3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0844円 (10,844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12月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	12,185,693,895	
投資信託受益証券	19,850,082	
投資証券	415,027,998	
合計	12,620,571,975	

(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12月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

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12月10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	8,674,534,132	-	8,671,110,336	3,423,796
	合計	8,674,534,132	-	8,671,110,336	3,423,796

(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12月10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				
	アメリカドル	714,610,142	-	740,796,500	26,186,358
	イギリスポンド	129,224,337	-	135,322,440	6,098,103
	ユーロ	175,827,395	-	184,242,240	8,414,845
	計	1,019,661,874	-	1,060,361,180	40,699,306
	売 建				
アメリカドル	59,930,356	-	59,924,040	6,316	
計	59,930,356	-	59,924,040	6,316	
合計		1,079,592,230	-	1,120,285,220	40,705,622

(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12月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年12月10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12月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	68,812	76.32	5,251,731.84	
	APACHE CORP	53,589	76.51	4,100,094.39	
	BAKER HUGHES	61,559	42.26	2,601,483.34	
	CABOT OIL & GAS CORP	29,500	48.84	1,440,780.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	34,600	55.09	1,906,114.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	92,900	17.25	1,602,525.00	
	CHEVRON CORP	271,582	106.99	29,056,558.18	
	CIMAREX ENERGY CO	12,100	58.07	702,647.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	25,700	28.38	729,366.00	
	CONCHO RESOURCES INC	13,900	81.67	1,135,213.00	
	CONOCOPHILLIPS	159,937	57.94	9,266,749.78	
	CONSOL ENERGY INC	32,600	33.04	1,077,104.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,400	74.21	474,944.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	6,700	107.00	716,900.00	
	DENBURY RESOURCES INC	54,800	15.78	864,744.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	52,022	52.92	2,753,004.24	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	10,000	68.93	689,300.00	
	ENERGEN CORP	10,400	44.84	466,336.00	
	ENSCO PLC-CL A	32,600	57.94	1,888,844.00	
	EOG RESOURCES INC	36,979	117.35	4,339,485.65	
	EQT CORPORATION	21,000	58.83	1,235,430.00	
	EXXON MOBIL	638,499	88.60	56,571,011.40	
	FMC TECHNOLOGIES INC	33,600	42.15	1,416,240.00	
	HALLIBURTON CO	129,400	33.78	4,371,132.00	
HELMERICH & PAYNE	13,515	55.46	749,541.90		
HESS CORP	43,100	49.69	2,141,639.00		
HOLLYFRONTIER CORP	27,600	43.64	1,204,464.00		

KINDER MORGAN INC	88,834	33.58	2,983,045.72
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,380	74.08	991,190.40
MARATHON OIL CORP	98,900	30.92	3,057,988.00
MARATHON PETROLEUM CORP	46,188	60.70	2,803,611.60
MURPHY OIL CORP	25,900	56.01	1,450,659.00
NABORS INDUSTRIES LTD	41,300	14.64	604,632.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,472	68.28	3,992,468.16
NEWFIELD EXPLORATION CO	19,400	25.79	500,326.00
NOBLE CORP	35,400	34.85	1,233,690.00
NOBLE ENERGY INC	24,018	101.45	2,436,626.10
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	112,529	75.37	8,481,310.73
OCEANEERING INTL INC	14,451	53.97	779,920.47
PEABODY ENERGY CORP	35,112	26.88	943,810.56
PHILLIPS 66	83,300	52.34	4,359,922.00
PIONEER NATURAL RESOURCES	15,499	102.95	1,595,622.05
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	18,600	44.62	829,932.00
QEP RESOURCES INC	22,162	29.95	663,751.90
RANGE RESOURCES CORP	21,386	64.68	1,383,246.48
ROWAN COMPANIES PLC	17,900	32.70	585,330.00
SCHLUMBERGER	184,395	71.83	13,245,092.85
SOUTHWESTERN ENERGY CO	46,363	34.38	1,593,959.94
SPECTRA ENERGY CORP	91,578	27.32	2,501,910.96
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	22,100	20.80	459,680.00
ULTRA PETROLEUM CORP	22,000	19.75	434,500.00
VALERO ENERGY CORP	77,564	31.86	2,471,189.04
WEATHERFORD INTL LTD	106,348	10.99	1,168,764.52
WHITING PETROLEUM CORP	14,671	43.65	640,389.15
WILLIAMS COS	86,720	31.22	2,707,398.40
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	28,560	83.06	2,372,193.60
AIRGAS INC	9,200	90.99	837,108.00
ALBEMARLE CORP	11,369	59.20	673,044.80
ALCOA	149,600	8.50	1,271,600.00
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,600	26.68	389,528.00

BALL CORP	20,900	44.15	922,735.00
CELANESE CORP-SERIES A	22,500	41.94	943,650.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,632	212.31	1,832,659.92
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	20,000	29.51	590,200.00
CROWN HOLDINGS INC	20,900	37.48	783,332.00
DOW CHEMICAL CO	164,424	30.30	4,982,047.20
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	129,272	43.18	5,581,964.96
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	21,400	61.85	1,323,590.00
ECOLAB INC	41,000	72.72	2,981,520.00
FMC CORP	19,300	53.08	1,024,444.00
FREEPORT-MCMOR-B	130,622	31.70	4,140,717.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,164	64.74	658,017.36
INT'L PAPER CO	58,300	36.04	2,101,132.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	44,400	53.81	2,389,164.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,400	90.90	581,760.00
MEADWESTVACO CORP	21,463	30.69	658,699.47
MONSANTO CO	73,760	90.69	6,689,294.40
MOSAIC CO/THE	41,600	53.60	2,229,760.00
NEWMONT MINING CORP	69,550	44.42	3,089,411.00
NUCOR CORP	44,500	40.72	1,812,040.00
OWENS-ILLINOIS INC	22,600	19.81	447,706.00
PPG INDUSTRIES INC	21,400	121.37	2,597,318.00
PRAXAIR INC	41,026	107.31	4,402,500.06
ROCK-TENN COMPANY -CL A	10,200	64.77	660,654.00
SEALED AIR CORP	25,200	16.51	416,052.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,777	148.94	1,754,066.38
SIGMA-ALDRICH	17,000	73.06	1,242,020.00
UNITED STATES STEEL CORP	20,800	21.77	452,816.00
VULCAN MATERIALS CO	18,200	52.00	946,400.00
3 M COMPANY	91,392	91.51	8,363,281.92
AGCO CORP	14,000	46.60	652,400.00
AMETEK INC	31,923	37.73	1,204,454.79
BOEING CO	98,527	74.64	7,354,055.28

CATERPILLAR	90,376	86.99	7,861,808.24
CUMMINS INC	24,653	101.69	2,506,963.57
DANAHER CORP	82,604	53.50	4,419,314.00
DEERE&CO	51,906	85.43	4,434,329.58
DOVER CORP	24,294	63.73	1,548,256.62
EATON CORP	60,505	52.47	3,174,697.35
EMERSON ELECTRIC CO	100,980	50.85	5,134,833.00
FASTENAL CO	39,400	42.12	1,659,528.00
FLOWSERVE CORP	7,019	141.90	995,996.10
FLUOR CORP	22,020	56.32	1,240,166.40
GENERAL DYNAMICS CORP	41,546	67.19	2,791,475.74
GENERAL ELECTRIC CO	1,463,201	21.46	31,400,293.46
GRAINGER (WW) INC	7,905	191.09	1,510,566.45
HONEYWELL INTL INC	102,242	61.97	6,335,936.74
ILLINOIS TOOL WORKS	58,716	61.17	3,591,657.72
INGERSOLL-RAND PLC	41,968	48.69	2,043,421.92
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	18,500	42.11	779,035.00
JOY GLOBAL INC	14,900	57.43	855,707.00
KBR INC	21,400	28.70	614,180.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	13,700	76.65	1,050,105.00
LOCKHEED MARTIN CORP	38,700	91.90	3,556,530.00
MASCO CORP	51,700	15.99	826,683.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	32,054	67.53	2,164,606.62
PACCAR INC	45,387	43.83	1,989,312.21
PALL CORP	15,011	60.46	907,565.06
PARKER HANNIFIN CORP	20,085	83.81	1,683,323.85
PENTAIR LTD	29,479	48.04	1,416,171.16
PRECISION CASTPARTS CORP	19,872	183.55	3,647,505.60
QUANTA SERVICES INC	29,700	26.02	772,794.00
RAYTHEON COMPANY	46,800	57.40	2,686,320.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,897	80.39	1,519,129.83
ROCKWELL COLLIN	17,716	56.37	998,650.92
ROPER INDUSTRIES INC	13,700	111.77	1,531,249.00

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,900	30.87	398,223.00
SPX CORP	7,200	67.83	488,376.00
STANLEY BLACK&DECKER	21,495	71.19	1,530,229.05
TEXTRON	40,000	23.79	951,600.00
TRANSDIGM GROUP INC	7,000	129.72	908,040.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	120,202	80.99	9,735,159.98
XYLEM INC	26,000	26.38	685,880.00
ADT CORPORATION	32,466	45.55	1,478,826.30
AVERY DENNISON CORP	12,393	33.55	415,785.15
CINTAS CORP	14,472	42.02	608,113.44
DUN & BRADSTREET CORP	5,786	81.05	468,955.30
EQUIFAX INC	15,546	54.33	844,614.18
IHS INC-CLASS A	7,900	91.62	723,798.00
IRON MOUNTAIN INC	20,143	31.34	631,281.62
MANPOWER GROUP	11,600	40.18	466,088.00
NIELSEN HOLDINGS NV	18,500	29.24	540,940.00
PITNEY BOWES INC	28,106	10.93	307,198.58
REPUBLIC SERVICES INC	44,170	29.10	1,285,347.00
ROBERT HALF INTL INC	19,100	29.26	558,866.00
STERICYCLE INC	12,000	94.26	1,131,120.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	64,932	28.66	1,860,951.12
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	20,000	49.49	989,800.00
WASTE MANAGEMENT INC	61,700	34.12	2,105,204.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	21,247	60.60	1,287,568.20
CSX CORP	145,700	19.91	2,900,887.00
DELTA AIR LINES INC	29,800	10.11	301,278.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	27,246	37.35	1,017,638.10
FEDEX CORP	41,030	89.36	3,666,440.80
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	38,300	16.10	616,630.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	11,927	58.47	697,371.69
KANSAS CITY SOUTHERN	14,609	79.78	1,165,506.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	44,098	61.51	2,712,467.98
SOUTHWEST AIRLINES CO	27,700	9.81	271,737.00

UNION PACIFIC CORP	65,750	123.95	8,149,712.50
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,700	20.51	239,967.00
UNITED PARCEL SERVICE B	100,511	73.17	7,354,389.87
AUTOLIV INC	12,900	61.34	791,286.00
BORGWARNER INC	15,800	67.25	1,062,550.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	43,800	33.97	1,487,886.00
FORD MOTOR COMPANY	490,361	11.48	5,629,344.28
GENERAL MOTORS CO	109,800	25.19	2,765,862.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	34,400	12.78	439,632.00
HARLEY-DAVIDSON	30,490	46.46	1,416,565.40
JOHNSON CONTROLS INC	95,442	28.14	2,685,737.88
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,292	52.00	691,184.00
COACH INC	38,661	57.64	2,228,420.04
DR HORTON INC	40,900	18.85	770,965.00
FOSSIL INC	7,400	89.34	661,116.00
GARMIN LTD	16,400	41.69	683,716.00
HASBRO INC	16,400	37.46	614,344.00
LEGGETT & PLATT INC	20,000	26.86	537,200.00
LENNAR CORP-CL A	21,962	36.69	805,785.78
LULULEMON ATHLETICA INC	13,187	72.53	956,453.11
MATTEL INC	47,800	37.08	1,772,424.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,300	82.84	687,572.00
NEWELL RUBBERMAID	40,700	21.91	891,737.00
NIKE B	50,726	98.59	5,001,076.34
POLARIS INDUSTRIES INC	8,947	80.06	716,296.82
PULTE GROUP INC	47,874	16.45	787,527.30
PVH CORP	9,700	112.51	1,091,347.00
RALPH LAUREN CORPORATION	8,106	155.35	1,259,267.10
TOLL BROTHERS INC	21,100	30.77	649,247.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,835	52.16	565,153.60
VF CORP	12,300	152.61	1,877,103.00
WHIRLPOOL CORP	11,000	98.01	1,078,110.00
BLOCK H & R INC	37,024	18.59	688,276.16

CARNIVAL CORPORATION	62,700	37.92	2,377,584.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,139	268.61	1,111,776.79
DARDEN RESTAURANTS INC	18,100	46.66	844,546.00
INT'L GAME TECHNOLOGY	34,330	14.40	494,352.00
LAS VEGAS SANDS CORP	55,663	43.65	2,429,689.95
MARRIOTT INTL A	34,447	35.43	1,220,457.21
MCDONALD'S CORP	140,386	88.48	12,421,353.28
MGM RESORTS INTERNATIONAL	53,700	10.93	586,941.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,900	35.01	696,699.00
STARBUCKS CORP	104,520	53.63	5,605,407.60
STARWOOD HOTELS & RESORTS	25,933	54.30	1,408,161.90
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	20,500	49.64	1,017,620.00
WYNN RESORTS LTD	11,300	110.32	1,246,616.00
YUM BRANDS INC	63,320	66.30	4,198,116.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	28,200	14.35	404,670.00
CBS CORP-CL B	82,053	35.94	2,948,984.82
CHARTER COMMUNICATION-A	5,900	70.43	415,537.00
COMCAST CORP-CL A	291,807	37.04	10,808,531.28
COMCAST CORP-SPECIAL A	80,950	35.96	2,910,962.00
DIRECTV	86,718	50.21	4,354,110.78
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	19,247	61.10	1,175,991.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	13,037	56.86	741,283.82
DISH NETWORK CORPORATION-A	29,900	37.65	1,125,735.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	54,663	10.78	589,267.14
LIBERTY GLOBAL INC-A	19,353	60.05	1,162,147.65
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	14,350	56.40	809,340.00
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	14,800	109.54	1,621,192.00
MCGRAW-HILL COS	35,300	56.53	1,995,509.00
NEWS CORP -CLASS A	215,773	24.86	5,364,116.78
NEWS CORP -CLASS B	61,565	25.53	1,571,754.45
OMNICOM GROUP	36,324	49.82	1,809,661.68
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	11,017	56.83	626,096.11
SIRIUS XM RADIO INC	538,700	2.75	1,484,118.50

THE WALT DISNEY CO	236,115	49.24	11,626,302.60
TIME WARNER CABLE-A	42,180	94.89	4,002,460.20
TIME WARNER INC	131,121	46.79	6,135,151.59
VIACOM INC-CLASS B	63,980	53.54	3,425,489.20
VIRGIN MEDIA INC	34,273	35.53	1,217,719.69
ADVANCE AUTO PARTS	10,450	71.62	748,429.00
AMAZON.COM	50,136	253.19	12,693,933.84
AUTOZONE INC	4,653	359.16	1,671,171.48
BED BATH & BEYOND INC	32,600	58.23	1,898,298.00
BEST BUY COMPANY INC	41,950	11.99	502,980.50
CARMAX INC	32,600	36.24	1,181,424.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,500	50.71	684,585.00
DOLLAR GENERAL CORP	36,350	46.80	1,701,180.00
DOLLAR TREE INC	32,600	39.83	1,298,458.00
EXPEDIA INC	13,225	59.83	791,251.75
FAMILY DOLLAR STORES	12,930	71.00	918,030.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	15,260	27.30	416,598.00
GAP	42,113	31.81	1,339,614.53
GENUINE PARTS CO	21,900	64.05	1,402,695.00
HOME DEPOT	209,021	64.45	13,471,403.45
J.C. PENNEY CO INC	23,000	18.17	417,910.00
KOHL'S CORP	30,174	44.09	1,330,371.66
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	69,335	19.16	1,328,458.60
LIMITED	33,107	51.18	1,694,416.26
LKQ CORP	40,857	21.53	879,651.21
LOWES COMPANIES	162,323	35.11	5,699,160.53
MACY'S INC	55,569	39.41	2,189,974.29
NETFLIX INC	7,600	85.95	653,220.00
NORDSTROM INC	21,656	52.80	1,143,436.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	16,495	90.76	1,497,086.20
PETSMART INC	15,200	70.38	1,069,776.00
PRICELINE.COM INC	6,852	659.10	4,516,153.20
ROSS STORES INC	30,145	55.48	1,672,444.60

SEARS HOLDINGS CORPORATION	5,385	42.96	231,339.60
STAPLES INC	96,650	11.40	1,101,810.00
TARGET (DAYTON HUDSON)	86,543	62.28	5,389,898.04
TIFFANY & CO	17,800	58.42	1,039,876.00
TJX COMPANIES INC	101,708	43.45	4,419,212.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,144	85.88	785,286.72
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	8,400	100.44	843,696.00
URBAN OUTFITTERS INC	16,700	37.35	623,745.00
COSTCO WHOLESALE CORP	59,659	98.56	5,879,991.04
CVS CAREMARK CORPORATION	175,794	46.84	8,234,190.96
KROGER CO	70,608	26.81	1,893,000.48
SAFEWAY INC	34,700	17.94	622,518.00
SYSCO CORP	79,169	31.83	2,519,949.27
WALGREEN CO	123,866	36.10	4,471,562.60
WAL-MART STORES	257,278	72.29	18,598,626.62
WHOLE FOODS MKT INC	24,500	90.59	2,219,455.00
ALTRIA GROUP INC	280,817	33.47	9,398,944.99
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	92,310	27.18	2,508,985.80
BEAM INC	19,900	59.73	1,188,627.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	17,170	68.57	1,177,346.90
BUNGE LIMITED	20,500	72.89	1,494,245.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	26,700	36.63	978,021.00
COCA-COLA CO	562,441	37.71	21,209,650.11
COCA-COLA ENTERPRISES	42,100	32.00	1,347,200.00
CONAGRA	54,303	29.75	1,615,514.25
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20,988	36.00	755,568.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	29,786	45.51	1,355,560.86
GENERAL MILLS INC	90,780	40.94	3,716,533.20
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	18,900	37.85	715,365.00
HEINZ (H.J) CO	44,900	58.25	2,615,425.00
HERSHEY FOODS CORPORATION	21,800	72.27	1,575,486.00
HORMEL FOODS CORP	21,000	31.03	651,630.00
JM SMUCKER CO	14,703	87.80	1,290,923.40

KELLOGG CO	35,100	55.97	1,964,547.00
KRAFT FOODS GROUP INC	76,622	44.67	3,422,704.74
LORILLARD INC	18,387	121.48	2,233,652.76
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,132	64.20	971,474.40
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	28,600	66.82	1,911,052.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	20,900	43.01	898,909.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	236,118	25.59	6,042,259.62
MONSTER BEVERAGE CORP	21,000	52.76	1,107,960.00
PEPSICO INC	215,391	70.26	15,133,371.66
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	233,246	89.47	20,868,519.62
RALCORP HOLDINGS INC	8,000	89.17	713,360.00
REYNOLDS AMERICAN INC	48,100	43.03	2,069,743.00
TYSON FOODS INC	41,500	19.63	814,645.00
AVON PRODUCTS INC	61,940	14.62	905,562.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,500	54.78	1,068,210.00
CLOROX COMPANY	17,400	76.27	1,327,098.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,697	108.37	7,119,583.89
ENERGIZER HOLDINGS INC	8,286	81.41	674,563.26
ESTEE LAUDER CO-CL A	31,691	60.67	1,922,692.97
HERBALIFE LTD	14,770	46.79	691,088.30
KIMBERLY-CLARK CORP	55,047	85.91	4,729,087.77
PROCTER & GAMBLE CO	382,131	70.29	26,859,987.99
AETNA INC	46,486	44.70	2,077,924.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	33,209	42.27	1,403,744.43
BARD C R INC	11,200	97.46	1,091,552.00
BAXTER INTERNATIONAL	76,183	65.07	4,957,227.81
BECTON DICKINSON & CO	27,276	77.63	2,117,435.88
BOSTON SCIENTIFIC CORP	200,386	5.60	1,122,161.60
CARDINAL HEALTH	46,165	40.90	1,888,148.50
CAREFUSION CORP	31,177	27.96	871,708.92
CERNER CORP	20,400	78.11	1,593,444.00
CIGNA CORP	38,698	52.90	2,047,124.20
COVENTRY HEALTH CARE INCON	18,466	44.16	815,458.56

COVIDIEN PLC	65,986	58.14	3,836,426.04
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,200	106.49	1,405,668.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	17,969	39.27	705,642.63
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,100	91.36	1,470,896.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	112,944	54.00	6,098,976.00
HCA HOLDINGS INC	25,100	33.76	847,376.00
HENRY SCHEIN INC	11,420	79.89	912,343.80
HOLOGIC INC	37,844	19.53	739,093.32
HUMANA INC	21,433	66.65	1,428,509.45
INTUITIVE SURGICAL INC	5,420	518.29	2,809,131.80
LABORATORY CRP OF AMER	12,461	85.00	1,059,185.00
MCKESSON CORP	31,982	95.30	3,047,884.60
MEDTRONIC	142,548	42.56	6,066,842.88
OMNICARE INC	13,706	35.52	486,837.12
PATTERSON COMPANIES INC	9,995	33.26	332,433.70
QUEST DIAGNOSTICS	22,300	58.26	1,299,198.00
RESMED INC	19,483	41.53	809,128.99
ST JUDE MEDICAL INC	44,000	34.96	1,538,240.00
STRYKER CORP	41,058	54.57	2,240,535.06
UNITED HEALTHCARE CORP	143,515	53.87	7,731,153.05
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15,700	70.70	1,109,990.00
WELLPOINT INC	44,680	57.78	2,581,610.40
ZIMMER HOLDINGS INC	23,269	65.49	1,523,886.81
ABBOTT LABORATORIES	217,135	65.53	14,228,856.55
AGILENT TECHNOLOGIES	46,270	37.81	1,749,468.70
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26,194	91.52	2,397,274.88
ALLERGAN INC	42,168	91.79	3,870,600.72
AMGEN	106,785	88.34	9,433,386.90
BIOGEN IDEC INC	31,079	151.31	4,702,563.49
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	232,368	32.56	7,565,902.08
CELGENE CORP	59,853	78.68	4,709,234.04
FOREST LABORATORIES INC	37,300	35.72	1,332,356.00
GILEAD SCIENCES INC	104,786	73.94	7,747,876.84

HOSPIRA INC	20,480	31.55	646,144.00
ILLUMINA INC	17,500	51.58	902,650.00
JOHNSON & JOHNSON	381,642	70.45	26,886,678.90
LIFE TECHNOLOGIES CORP	23,670	50.05	1,184,683.50
LILLY (ELI) & CO	146,433	49.63	7,267,469.79
MERCK & CO	421,522	44.62	18,808,311.64
MYLAN INC	55,664	27.24	1,516,287.36
PERRIGO CO	11,576	102.32	1,184,456.32
PFIZER	1,033,469	25.56	26,415,467.64
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,500	180.87	1,899,135.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49,981	64.28	3,212,778.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29,600	38.89	1,151,144.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	25,600	11.13	284,928.00
WATERS CORP	11,361	85.50	971,365.50
WATSON PHARMACEUTICALS INC	17,900	88.62	1,586,298.00
BB&T CORP	98,000	28.42	2,785,160.00
CIT GROUP INC	27,400	38.47	1,054,078.00
COMERICA INC	24,408	29.13	711,005.04
FIFTH THIRD BANCORP	129,043	14.53	1,874,994.79
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,400	33.01	442,334.00
HUDSON CITY BANCORP INC	66,700	7.99	532,933.00
KEY CORP	133,640	8.10	1,082,484.00
M & T BANK CORP	15,043	97.64	1,468,798.52
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	62,900	12.94	813,926.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	43,500	12.06	524,610.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	74,188	55.80	4,139,690.40
REGIONS FINL CORP	198,037	6.64	1,314,965.68
SUNTRUST BANKS	75,508	27.19	2,053,062.52
US BANCORP	262,450	32.02	8,403,649.00
WELLS FARGO & CO	695,568	33.23	23,113,724.64
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,200	128.62	926,064.00
AMERICAN EXPRESS	141,738	56.61	8,023,788.18
AMERIPRISE FINANCIAL INC	29,110	62.35	1,815,008.50

BANK NEW YORK CO	163,266	24.22	3,954,302.52
BANK OF AMERICA CORP	1,495,102	10.64	15,907,885.28
BLACKROCK INC	18,600	194.76	3,622,536.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	79,844	57.07	4,556,697.08
CITIGROUP	407,072	37.64	15,322,190.08
CME GROUP INC	44,300	54.96	2,434,728.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	70,605	41.15	2,905,395.75
EATON VANCE CORP	13,707	32.18	441,091.26
FRANKLIN RESOURCES INC	20,483	127.68	2,615,269.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	63,400	116.57	7,390,538.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,200	130.72	1,333,344.00
INVESCO LTD	59,093	24.86	1,469,051.98
JPMORGAN CHASE & CO	526,704	42.56	22,416,522.24
LEGG MASON INC	14,708	25.90	380,937.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	29,900	23.20	693,680.00
MOODY'S CORP	26,382	49.36	1,302,215.52
MORGAN STANLEY	202,335	16.97	3,433,624.95
NASDAQ OMX GROUP	14,599	23.74	346,580.26
NORTHERN TRUST CORP	28,528	47.85	1,365,064.80
NYSE EURONEXT	32,434	23.53	763,172.02
PRICE T ROWE GROUP INC	34,312	64.84	2,224,790.08
SCHWAB (CHARLES) CORP	151,700	13.40	2,032,780.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	20,300	22.09	448,427.00
SLM CORP	68,400	16.89	1,155,276.00
STATE STREET CORP	66,452	45.15	3,000,307.80
TD AMERITRADE HOLDING CORP	30,800	16.58	510,664.00
ACE LTD	47,500	80.97	3,846,075.00
AFLAC	63,776	53.58	3,417,118.08
ALLEGHANY CORP	1,800	333.69	600,642.00
ALLSTATE CORP	66,371	41.48	2,753,069.08
AMERICAN INT'L GROUP	152,306	34.13	5,198,203.78
AON PLC	41,727	56.60	2,361,748.20
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,000	44.73	849,870.00

ASSURANT INC	9,608	34.81	334,454.48
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	16,800	35.92	603,456.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	127,728	87.33	11,154,486.24
CHUBB CORPORATION	36,338	77.54	2,817,648.52
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,271	40.50	901,975.50
EVEREST RE GROUP LTD	6,439	108.70	699,919.30
FIDELITY NATIONAL FINL-A	28,165	23.36	657,934.40
HARTFORD FINANCIAL SVCS	54,279	21.89	1,188,167.31
LINCOLN NATIONAL CORP	36,223	25.78	933,828.94
LOEWS CORP	44,590	41.28	1,840,675.20
MARSH & MCLENNAN COS	76,539	35.11	2,687,284.29
METLIFE INC	116,245	32.89	3,823,298.05
PARTNERRE LTD	7,970	81.98	653,380.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38,643	27.66	1,068,865.38
PROGRESSIVE CORP	81,200	21.48	1,744,176.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,628	52.47	3,338,561.16
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,963	80.50	480,021.50
TORCHMARK CORP	12,012	51.77	621,861.24
TRAVELERS COS INC/THE	53,053	73.39	3,893,559.67
UNUM GROUP	35,415	20.83	737,694.45
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,400	34.52	842,288.00
WR BERKLEY CORP	16,550	39.77	658,193.50
XL GROUP PLC	39,748	25.09	997,277.32
CBRE GROUP INC-A	43,700	18.99	829,863.00
WEYERHAEUSER CO	75,412	27.21	2,051,960.52
ACCENTURE PLC-CL A	88,001	69.48	6,114,309.48
ACTIVISION BLIZZARD INC	62,400	11.33	706,992.00
ADOBE SYSTEMS INC	66,753	35.47	2,367,728.91
AKAMAII TECHNOLOGIES, INC	23,068	38.82	895,499.76
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,200	142.96	1,029,312.00
ANSYS INC	13,100	66.29	868,399.00
AUTODESK INC	29,641	33.77	1,000,976.57
AUTOMATIC DATA PROCESS	66,682	57.31	3,821,545.42

BMC SOFTWARE	22,400	40.81	914,144.00
CA INC	46,300	22.03	1,019,989.00
CITRIX SYSTEMS INC	26,100	62.03	1,618,983.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,259	70.32	2,901,332.88
COMPUTER SCIENCES CORP	22,300	38.87	866,801.00
EBAY	160,596	51.75	8,310,843.00
ELECTRONIC ARTS INC	44,610	14.83	661,566.30
EQUINIX INC	6,800	189.69	1,289,892.00
FACEBOOK INC-A	137,460	27.51	3,781,524.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	33,123	36.16	1,197,727.68
FISERV INC	19,200	79.81	1,532,352.00
GOOGLE INC-CL A	36,259	684.68	24,825,812.12
INTL BUSINESS MACHINES CORP	150,353	191.95	28,860,258.35
INTUIT INC	37,577	59.57	2,238,461.89
LINKEDIN CORP - A	11,065	109.70	1,213,830.50
MASTERCARD INC-CLASS A	14,898	476.09	7,092,788.82
MICROSOFT CORP	1,044,998	26.46	27,650,647.08
NUANCE COMMUNICATIONS INC	34,400	21.81	750,264.00
ORACLE CORP	541,558	31.93	17,291,946.94
PAYCHEX INC	42,856	33.19	1,422,390.64
RACKSPACE HOSTING INC	15,200	67.33	1,023,416.00
RED HAT INC	27,100	49.16	1,332,236.00
SAIC INC	38,400	11.31	434,304.00
SALESFORCE.COM INC	18,400	156.70	2,883,280.00
SYMANTEC CORP	95,861	18.94	1,815,607.34
SYNOPSYS INC	21,400	32.92	704,488.00
TERADATA CORP	23,700	58.19	1,379,103.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	23,175	22.18	514,021.50
VERIFONE SYSTEMS INC	15,600	32.56	507,936.00
VERISIGN INC	22,200	36.28	805,416.00
VISA INC-CLASS A SHARES	72,962	148.55	10,838,505.10
VMWARE INC-CLASS A	11,600	91.80	1,064,880.00

WESTERN UNION CO	85,948	13.00	1,117,324.00
YAHOO	155,709	19.21	2,991,169.89
AMPHENOL CORPORATION	21,253	61.63	1,309,822.39
APPLE INC	129,638	533.08	69,107,425.04
ARROW ELECTRONICS INC	15,700	38.99	612,143.00
AVNET INC	17,669	30.25	534,487.25
CISCO SYSTEMS	742,664	19.34	14,363,121.76
CORNING	205,013	12.54	2,570,863.02
DELL INC	198,790	10.46	2,079,343.40
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	4,659	33.83	157,613.97
EMC CORP	290,556	24.91	7,237,749.96
F5 NETWORKS INC	11,200	92.37	1,034,544.00
FLEXTRONICS INTL LTD	97,300	5.94	577,962.00
FLIR SYSTEMS INC	21,700	19.96	433,132.00
HARRIS CORP	14,375	48.49	697,043.75
HEWLETT-PACKARD CO	269,558	13.93	3,754,942.94
JUNIPER NETWORKS INC	74,300	19.29	1,433,247.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	35,123	54.60	1,917,715.80
NETAPP INC	50,960	33.44	1,704,102.40
QUALCOMM	236,274	63.85	15,086,094.90
SANDISK CORP	31,847	42.25	1,345,535.75
SEAGATE TECHNOLOGY	49,409	28.33	1,399,756.97
TE CONNECTIVITY LTD	60,032	35.89	2,154,548.48
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,600	57.28	1,008,128.00
WESTERN DIGITAL CORP	30,177	37.60	1,134,655.20
XEROX CORP	174,547	7.09	1,237,538.23
AT&T INC	797,034	33.75	26,899,897.50
CENTURYLINK INC	87,167	37.94	3,307,115.98
CROWN CASTLE INTL CORP	41,100	68.45	2,813,295.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	143,885	4.71	677,698.35
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	21,320	19.76	421,283.20
METROPCS COMMUNICATIONS INC	45,100	10.52	474,452.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	17,000	69.08	1,174,360.00

SPRINT NEXTEL CORPORATION	420,438	5.69	2,392,292.22
VERIZON COMMUNICATIONS	393,454	44.41	17,473,292.14
WINDSTREAM CORP	83,800	8.36	700,568.00
AES CORP	91,500	10.86	993,690.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,160	44.55	541,728.00
AMEREN CORPORATION	34,800	29.74	1,034,952.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	67,900	43.27	2,938,033.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	25,400	37.76	959,104.00
CALPINE CORP	44,000	17.38	764,720.00
CENTERPOINT ENERGY INC	58,200	19.84	1,154,688.00
CMS ENERGY CORP	37,700	24.67	930,059.00
CONSOLIDATED EDISON INC	41,100	56.03	2,302,833.00
DOMINION RESOURCES	80,200	51.69	4,145,538.00
DTE ENERGY COMPANY	23,900	61.05	1,459,095.00
DUKE ENERGY CORP	96,013	64.32	6,175,556.16
EDISON INTL	43,400	44.98	1,952,132.00
ENTERGY CORP	24,900	63.94	1,592,106.00
EXELON CORP	116,403	29.57	3,442,036.71
FIRSTENERGY CORP	58,675	41.45	2,432,078.75
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	11,300	53.37	603,081.00
MDU RESOURCES GROUP INC	19,763	20.76	410,279.88
NEXTERA ENERGY INC	55,594	69.37	3,856,555.78
NISOURCE INC	40,400	24.44	987,376.00
NORTHEAST UTILITIES	44,048	39.27	1,729,764.96
NRG ENERGY INC	32,900	21.88	719,852.00
OGE ENERGY CORP	11,744	56.67	665,532.48
ONEOK INC	27,700	43.00	1,191,100.00
PEPCO HOLDINGS INC	32,600	19.51	636,026.00
PG&E CORP	59,200	40.77	2,413,584.00
PINNACLE WEST CAPITAL	15,700	51.34	806,038.00
PPL CORPORATION	81,400	28.98	2,358,972.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	71,000	30.06	2,134,260.00
SCANA CORP	17,700	45.90	812,430.00

	SEMPRA ENERGY	32,100	71.34	2,290,014.00
	SOUTHERN CO	121,832	43.73	5,327,713.36
	WISCONSIN ENERGY CORP	32,400	37.79	1,224,396.00
	XCEL ENERGY INC	68,300	27.12	1,852,296.00
	ALTERA CORPORATION	42,305	31.58	1,335,991.90
	ANALOG DEVICES	41,900	41.28	1,729,632.00
	APPLIED MATERIALS	170,583	10.97	1,871,295.51
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	32,500	34.25	1,113,125.00
	BROADCOM CORP-CL A	69,835	34.24	2,391,150.40
	CREE INC	15,500	32.74	507,470.00
	INTEL CORP	695,505	20.15	14,014,425.75
	KLA-TENCOR CORP	23,461	47.21	1,107,593.81
	LAM RESEARCH CORP	25,894	35.46	918,201.24
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	32,725	33.67	1,101,850.75
	LSI CORP	79,800	6.96	555,408.00
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	69,000	8.80	607,200.00
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	38,562	29.50	1,137,579.00
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	24,324	30.84	750,152.16
	MICRON TECHNOLOGY	138,800	6.45	895,260.00
	NVIDIA CORP	87,700	11.97	1,049,769.00
	TEXAS INSTRUMENTS	157,221	29.85	4,693,046.85
	XILINX INC	34,929	34.87	1,217,974.23
	アメリカドル小計	41,889,905		1,796,296,466.53 (148,284,273,312)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,554	24.75	929,461.50
	ATHABASCA OIL CORPORATION	44,900	10.25	460,225.00
	BAYTEX ENERGY CORP	16,900	44.99	760,331.00
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	15.42	337,698.00
	CAMECO CORP	55,500	18.45	1,023,975.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	150,876	27.86	4,203,405.36
	CANADIAN OIL SANDS LTD	68,000	20.00	1,360,000.00
	CENOVUS ENERGY INC	102,955	33.43	3,441,785.65
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	47,668	36.47	1,738,451.96

ENBRIDGE	104,540	41.56	4,344,682.40
ENCANA CORP	103,240	21.09	2,177,331.60
ENERPLUS CORP	27,500	12.83	352,825.00
HUSKY ENERGY INC	47,800	28.75	1,374,250.00
IMPERIAL OIL	41,600	42.75	1,778,400.00
MEG ENERGY CORP	18,100	34.72	628,432.00
NEXEN INC	72,003	23.29	1,676,949.87
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	41,300	22.59	932,967.00
PEMBINA PIPELINE CORP	41,000	27.70	1,135,700.00
PENGROWTH ENERGY CORP	71,600	4.91	351,556.00
PENN WEST PETROLEUM LTD	67,778	11.09	751,658.02
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	26,400	19.37	511,368.00
SUNCOR ENERGY	214,631	32.24	6,919,703.44
TALISMAN ENERGY INC	144,600	11.02	1,593,492.00
TOURMALINE OIL CORP	18,600	31.57	587,202.00
TRANSCANADA CORP	96,582	45.86	4,429,250.52
VERMILION ENERGY INC	13,100	49.57	649,367.00
AGNICO-EAGLE MINES	24,000	53.10	1,274,400.00
AGRIUM INC	20,652	98.74	2,039,178.48
BARRICK GOLD CORP	137,214	33.27	4,565,109.78
CENTERRA GOLD INC	24,700	8.29	204,763.00
ELDORADO GOLD CORP	94,900	13.41	1,272,609.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	66,800	19.99	1,335,332.00
FRANCO-NEVADA CORP	20,300	55.54	1,127,462.00
GOLDCORP INC	110,828	36.91	4,090,661.48
IAMGOLD CORP	54,000	10.64	574,560.00
INMET MINING CORPORATION	7,300	66.76	487,348.00
KINROSS GOLD CORP	159,720	9.61	1,534,909.20
NEW GOLD INC	64,800	10.75	696,600.00
OSISKO MINING CORP	56,500	7.57	427,705.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,500	18.13	407,925.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	117,940	39.04	4,604,377.60
SILVER WHEATON CORP	49,600	35.41	1,756,336.00

SINO-FOREST CORPORATION	34,700	-	-
TECK RESOURCES LTD-CL B	80,845	34.60	2,797,237.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	57,700	7.18	414,286.00
YAMANA GOLD INC	105,300	17.67	1,860,651.00
BOMBARDIER B	206,640	3.34	690,177.60
CAE INC	37,000	10.00	370,000.00
FINNING INTERNATIONAL INC	24,700	22.12	546,364.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,405	37.75	732,538.75
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,700	21.02	266,954.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,260	90.67	5,463,774.20
CP RAILWAY LIMITED	24,010	97.70	2,345,777.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	31,100	46.62	1,449,882.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,200	35.06	567,972.00
TIM HORTONS INC	19,879	46.75	929,343.25
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	49,448	21.86	1,080,933.28
THOMSON REUTERS CORP	52,353	27.74	1,452,272.22
CANADIAN TIRE CORP -CL A	11,300	66.59	752,467.00
DOLLARAMA INC	9,280	59.18	549,190.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	17,800	48.27	859,206.00
EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	56.85	238,770.00
LOBLAW COMPANIES LTD	16,200	38.71	627,102.00
METRO INC	12,331	61.60	759,589.60
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,227	41.97	1,142,717.19
WESTON (GEORGE) LTD	7,500	67.79	508,425.00
SAPUTO INC	16,627	48.81	811,563.87
VITERRA INC	44,300	16.20	717,660.00
CATAMARAN CORPORATION	28,996	48.86	1,416,744.56
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	39,084	57.17	2,234,432.28
BANK MONTREAL	88,673	59.54	5,279,590.42
BANK NOVA SCOTIA	158,659	55.53	8,810,334.27
CANADIAN IMPERIAL BANK	55,621	80.10	4,455,242.10
NATIONAL BANK OF CANADA	21,477	77.19	1,657,809.63
ROYAL BANK OF CANADA	200,109	58.48	11,702,374.32

TORONTO-DOMINION BANK	126,497	80.36	10,165,298.92
CI FINANCIAL CORP	21,900	24.71	541,149.00
IGM FINANCIAL INC	14,400	40.18	578,592.00
ONEX CORP	13,300	40.80	542,640.00
GREAT-WEST LIFECO INC	41,000	23.45	961,450.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	13,200	29.19	385,308.00
INTACT FINANCIAL CORP	18,200	63.45	1,154,790.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	253,300	12.93	3,275,169.00
POWER CORP OF CANADA	49,000	24.40	1,195,600.00
POWER FINANCIAL CORP	35,600	26.51	943,756.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	82,900	27.03	2,240,787.00
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	75,964	34.87	2,648,864.68
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	38,825	16.51	641,000.75
CGI GROUP INC - CL A	26,923	22.60	608,459.80
OPEN TEXT CORP	8,200	54.73	448,786.00
RESEARCH IN MOTION	67,800	11.88	805,464.00
BCE INC	35,792	42.64	1,526,170.88
BELL ALIANT INC	10,600	27.44	290,864.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	52,268	44.25	2,312,859.00
TELUS CORPORATION -NON VOTE	21,100	63.91	1,348,501.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	8,000	68.49	547,920.00
FORTIS INC	26,600	33.31	886,046.00
TRANSALTA CORP	32,000	14.77	472,640.00
カナダドル小計	5,393,374		168,863,241.83 (14,120,344,281)
オーストラリア ドル			
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	19,071	18.15	346,138.65
ORIGIN ENERGY LIMITED	144,284	11.14	1,607,323.76
SANTOS	133,857	11.04	1,477,781.28
WHITEHAVEN COAL LTD	64,057	3.00	192,171.00
WOODSIDE PETROLEUM LTD	89,710	34.22	3,069,876.20
WORLEYPARSONS LTD	28,853	23.05	665,061.65
ALUMINA LIMITED	342,052	0.93	318,108.36

AMCOR	157,574	7.99	1,259,016.26
BHP BILLITON LTD	447,132	34.74	15,533,365.68
BORAL LIMITED	106,955	4.12	440,654.60
FORTESCUE METALS GROUP LTD	196,413	3.79	744,405.27
ILUKA RESOURCES LTD	60,132	8.29	498,494.28
INCITEC PIVOT LTD	205,854	3.20	658,732.80
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	61,288	9.44	578,558.72
NEWCREST MINING LIMITED	103,730	24.34	2,524,788.20
ORICA LTD	51,165	23.86	1,220,796.90
OZ MINERALS LTD	43,221	7.12	307,733.52
RIO TINTO LTD	59,518	60.17	3,581,198.06
SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	23,001	8.91	204,938.91
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	21,263	16.88	358,919.44
ALS LTD	47,312	9.34	441,894.08
BRAMBLES LTD	216,844	7.44	1,613,319.36
ASCIANO GROUP	119,058	4.42	526,236.36
AURIZON HOLDINGS LTD	245,294	3.61	885,511.34
QANTAS AIRWAYS LIMITED	159,503	1.34	214,531.53
TOLL HOLDINGS LIMITED	95,498	4.62	441,200.76
TRANSURBAN GROUP	183,977	6.31	1,160,894.87
CROWN LTD	56,156	10.16	570,544.96
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	107,048	3.46	370,386.08
FLIGHT CENTRE LTD	7,684	26.83	206,161.72
TABCORP HOLDINGS	107,693	2.94	316,617.42
TATTS GROUP LTD	191,046	2.98	569,317.08
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	76,332	1.78	136,252.62
METCASH LTD	116,059	3.30	382,994.70
WESFARMERS LIMITED	138,507	36.20	5,013,953.40
WOOLWORTHS LTD	169,358	29.64	5,019,771.12
COCA-COLA AMATIL LIMITED	75,149	13.90	1,044,571.10
TREASURY WINE ESTATES LTD	83,390	5.08	423,621.20
COCHLEAR LIMITED	8,173	75.36	615,917.28
RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,865	26.42	498,413.30

SONIC HEALTHCARE LTD	53,206	13.20	702,319.20
CSL LIMITED	69,734	54.77	3,819,331.18
AUST AND NZ BANKING GROUP	375,622	24.89	9,349,231.58
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	56,379	8.37	471,892.23
COMMONWEALTH BANK OF AUST	220,492	60.88	13,423,552.96
NATIONAL AUSTRALIA BANK	313,899	24.50	7,690,525.50
WESTPAC BANKING	428,248	25.75	11,027,386.00
ASX LTD	25,153	30.12	757,608.36
MACQUARIE GROUP LIMITED	43,546	33.73	1,468,806.58
AMP LTD	405,794	4.79	1,943,753.26
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	291,427	4.77	1,390,106.79
QBE INSURANCE GROUP	165,642	10.50	1,739,241.00
SUNCORP GROUP LIMITED	180,348	10.20	1,839,549.60
COMPUTERSHARE LIMITED	63,842	8.61	549,679.62
TELSTRA CORP	610,468	4.36	2,661,640.48
AGL ENERGY LTD	75,980	14.34	1,089,553.20
SP AUSNET	219,745	1.05	230,732.25
オーストラリアドル小計	8,181,601		116,195,083.61 (10,054,360,584)
イギリスポンド			
AMEC PLC	39,419	10.62	418,629.78
BG GROUP	470,590	10.68	5,025,901.20
BP PLC	2,645,025	4.26	11,269,129.01
PETROFAC LTD	33,540	16.86	565,484.40
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	518,090	20.92	10,841,033.25
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	362,577	21.63	7,844,353.39
TULLOW OIL PLC	122,740	12.45	1,528,113.00
ANGLO AMERICAN PLC	191,417	18.11	3,466,561.87
ANTOFAGASTA PLC	55,277	13.47	744,581.19
BHP BILLITTON PLC	293,026	20.18	5,914,729.81
CRODA INTERNATIONAL PLC	18,967	23.47	445,155.49
EURASIAN NATURAL RESOURCES	37,931	2.83	107,344.73
EVRAZ PLC	49,067	2.42	118,938.40
FRESNILLO PLC	25,751	19.69	507,037.19

GLENCORE INTERNATIONAL PLC	516,315	3.45	1,782,319.38
JOHNSON MATTHEY PLC	28,725	24.43	701,751.75
KAZAKHMYS PLC	30,523	7.45	227,548.96
RANDGOLD RESOURCES LTD	12,225	63.90	781,177.50
REXAM	112,386	4.50	505,849.38
RIO TINTO PLC REG	185,913	32.56	6,053,327.28
VEDANTA RESOURCES PLC	15,317	11.11	170,171.87
XSTRATA PLC	288,804	10.35	2,989,121.40
BAE SYSTEMS PLC	455,314	3.38	1,540,782.57
BALFOUR BEATTY PLC	96,376	2.59	249,710.21
BUNZL PLC	41,997	10.39	436,348.83
COBHAM PLC	154,900	2.13	330,711.50
IMI PLC	45,008	10.90	490,587.20
INVENSYS PLC	117,088	3.22	377,960.06
MEGGITT PLC	111,766	3.85	430,746.16
MELROSE INDUSTRIES PLC	168,671	2.24	377,991.71
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	255,729	8.96	2,292,610.48
SMITHS GROUP PLC	50,869	11.31	575,328.39
WEIR GROUP PLC/THE	27,080	18.35	496,918.00
WOLSELEY LTD	40,010	28.45	1,138,284.50
AGGREKO PLC	37,597	22.44	843,676.68
BABCOCK INTL GROUP PLC	51,575	10.02	516,781.50
CAPITA GROUP PLC	91,659	7.59	696,150.10
EXPERIAN PLC	135,753	10.51	1,426,764.03
G4S PLC	202,593	2.49	504,861.75
INTERTEK GROUP PLC	21,053	31.30	658,958.90
SERCO GROUP PLC	60,711	5.45	330,874.95
NEW GKN	223,982	2.23	500,375.78
BURBERRY GROUP PLC	61,504	13.05	802,627.20
CARNIVAL PLC	25,959	24.59	638,331.81
COMPASS GROUP PLC	255,085	7.29	1,859,569.65
INTERCONTINENTAL HOTELS	35,422	16.50	584,463.00
TUI TRAVEL PLC	64,426	2.86	184,580.49

WHITBREAD PLC	22,963	24.28	557,541.64
BRITISH SKY BROADCASTING	145,748	7.61	1,109,871.02
ITV PLC	469,551	1.01	478,002.91
PEARSON	114,381	11.77	1,346,264.37
REED ELSEVIER PLC	170,671	6.47	1,104,241.37
WPP PLC	169,696	8.69	1,475,506.72
KINGFISHER PLC	332,135	2.71	901,082.25
MARKS & SPENCER GROUP PLC	225,245	3.93	886,564.32
NEXT PLC	23,211	37.04	859,735.44
MORRISON SUPERMARKETS	305,203	2.69	821,301.27
SAINSBURY (J) PLC	175,257	3.43	601,306.76
TESCO	1,108,645	3.36	3,733,362.03
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	47,144	14.85	700,088.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	269,959	32.63	8,810,111.96
DIAGEO	347,734	18.78	6,532,183.19
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	137,194	24.98	3,427,106.12
SABMILLER PLC	131,862	28.00	3,692,136.00
TATE & LYLE	59,590	7.59	452,288.10
UNILEVER PLC	177,449	24.16	4,287,167.84
RECKITT BENCKISER PLC	89,698	39.62	3,553,834.76
SMITH & NEPHEW PLC	125,689	6.66	837,088.74
ASTRAZENECA	173,514	30.00	5,206,287.57
GLAXOSMITHKLINE	690,405	13.49	9,313,563.45
SHIRE PLC	75,561	19.00	1,435,659.00
BARCLAYS	1,604,841	2.51	4,036,977.53
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	2,536,299	6.43	16,323,620.36
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,789,097	0.46	2,706,113.39
ROYAL BANK OF SCOTLAND	292,179	2.99	873,615.21
STANDARD CHARTERED PLC	331,191	14.85	4,919,842.30
3I GROUP PLC	139,438	2.13	297,142.37
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	107,828	3.40	367,585.65
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32,783	7.35	240,955.05
ICAP PLC	76,978	3.00	231,164.93

	INVESTEC PLC	76,017	3.95	300,267.15
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,415	9.77	209,224.55
	SCHRODERS PLC	15,842	16.41	259,967.22
	ADMIRAL GROUP PLC	29,167	11.30	329,587.10
	AVIVA PIC	409,016	3.66	1,498,225.60
	LEGAL & GENERAL GROUP	823,352	1.47	1,210,327.44
	OLD MUTUAL PLC	682,223	1.74	1,190,479.13
	PRUDENTIAL	351,008	9.08	3,187,152.64
	RESOLUTION LTD	197,641	2.45	485,011.01
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	507,007	1.21	617,534.52
	STANDARD LIFE PLC	330,492	3.30	1,090,954.09
	SAGE GROUP PLC	177,633	2.95	524,194.98
	BT GROUP PLC	1,094,166	2.35	2,572,384.26
	INMARSAT PLC	62,828	6.00	376,968.00
	VODAFONE GROUP PLC	6,812,395	1.61	11,025,861.30
	CENTRICA PLC	708,352	3.37	2,387,146.24
	NATIONAL GRID PLC	500,345	7.07	3,537,439.15
	SEVERN TRENT PLC	34,121	15.50	528,875.50
	SSE PLC	132,425	14.33	1,897,650.25
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	95,572	6.89	658,968.94
	ARM HOLDINGS PLC	185,242	7.54	1,396,724.68
	イギリス債券小計	38,631,150		207,698,511.45 (27,476,436,079)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	49,132	43.09	2,117,097.88
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	952	221.60	210,963.20
	GIVAUDAN-REG	1,165	935.50	1,089,857.50
	HOLCIM LTD	32,095	65.60	2,105,432.00
	SIKA AG-BR	302	2,098.00	633,596.00
	SYNGENTA AG	12,862	374.80	4,820,677.60
	ABB LTD	303,240	18.58	5,634,199.20
	GEBERIT AG-REG	4,852	198.20	961,666.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,093	129.20	399,615.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,982	131.40	917,434.80

	SULZER AG-REG	3,362	144.00	484,128.00
	ADECCO	19,027	46.89	892,176.03
	SGS SA	725	2,101.00	1,523,225.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,982	111.50	778,493.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	71,889	72.85	5,237,113.65
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	4,323	457.60	1,978,204.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	6,086	79.45	483,532.70
	ARYZTA AG	12,226	46.35	566,675.10
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	254	940.00	238,760.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	126	3,036.00	382,536.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	12	35,820.00	429,840.00
	NESTLE SA - REGISTERED	446,233	60.95	27,197,901.35
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,888	105.00	723,240.00
	ACTELION LTD-REG	13,949	46.80	652,813.20
	LONZA GROUP AG-REG	7,504	47.45	356,064.80
	NOVARTIS	318,313	58.25	18,541,732.25
	ROCHE HOLDING GENUSS	97,200	185.00	17,982,000.00
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	441	504.50	222,484.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG	175,043	22.79	3,989,229.97
	JULIUS BAER GROUP LTD	28,965	32.59	943,969.35
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,789	63.70	241,359.30
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,924	200.40	385,569.60
	UBS AG-REG	504,352	14.99	7,560,236.48
	BALOISE HOLDING AG	6,659	79.35	528,391.65
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,377	122.70	537,057.90
	SWISS RE LTD	49,366	67.00	3,307,522.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,278	240.10	4,868,747.80
	SWISS PRIME SITE-REG	6,859	74.30	509,623.70
	SWISSCOM	3,268	393.30	1,285,304.40
	スイスフラン小計	2,235,095		121,718,472.71 (10,742,872,401)
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	82,000	31.40	2,574,800.00
	HUTCHISON WHAMPOA	299,000	80.10	23,949,900.00

NWS HOLDINGS LTD	213,500	12.80	2,732,800.00
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	166,000	13.64	2,264,240.00
MTR CORP	208,000	30.65	6,375,200.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	31,500	48.85	1,538,775.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	107,000	25.95	2,776,650.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	292,000	28.20	8,234,400.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	139,200	14.38	2,001,696.00
SANDS CHINA LTD	338,800	31.95	10,824,660.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.88	3,422,400.00
SJM HOLDINGS LTD	243,000	17.34	4,213,620.00
WYNN MACAU LTD	223,600	21.00	4,695,600.00
LI & FUNG	774,400	12.96	10,036,224.00
BANK EAST ASIA	172,964	29.95	5,180,271.80
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	519,000	24.00	12,456,000.00
HANG SENG BANK	107,200	118.00	12,649,600.00
WING HANG BANK LIMITED	18,000	79.55	1,431,900.00
FIRST PACIFIC CO	304,000	8.50	2,584,000.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	144,000	127.40	18,345,600.00
AIA GROUP LTD	1,507,200	30.00	45,216,000.00
CHEUNG KONG HOLDINGS	195,000	118.50	23,107,500.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	314,000	29.15	9,153,100.00
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	136,585	55.60	7,594,126.00
HYSAN DEVELOPMENT CO	92,000	37.55	3,454,600.00
KERRY PROPERTIES LTD	88,000	40.00	3,520,000.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	518,000	12.42	6,433,560.00
SINO LAND CO	370,600	13.92	5,158,752.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	214,000	114.40	24,481,600.00
SWIRE PACIFIC A	95,500	95.85	9,153,675.00
SWIRE PROPERTIES LTD	157,000	25.40	3,987,800.00
WHARF HOLDINGS	201,000	60.30	12,120,300.00
WHEELLOCK & CO LTD	129,000	39.40	5,082,600.00
PCCW LTD	622,000	3.28	2,040,160.00
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	46.80	3,322,800.00

	CLP HOLDINGS	253,000	67.00	16,951,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	697,370	21.05	14,679,638.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	194,500	67.10	13,050,950.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	29,600	91.00	2,693,600.00	
	香港ドル小計	10,498,519		349,490,098.30 (3,722,069,546)	
シンガポール ドル	FRASER AND NEAVE LTD	120,500	9.45	1,138,725.00	
	KEPPEL CORP LTD	201,500	10.73	2,162,095.00	
	NOBLE GROUP LTD	554,145	1.07	592,935.15	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	142,000	5.08	721,360.00	
	SEBACORP MARINE LTD	117,400	4.51	529,474.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	216,000	3.73	805,680.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	272,000	0.92	251,600.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	272,000	1.75	476,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES	77,600	10.83	840,408.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	783,400	1.24	975,333.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	226,250	4.01	907,262.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,000	48.28	724,200.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	232,800	1.46	339,888.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	936,720	0.65	608,868.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	276,000	3.17	874,920.00	
	DBS GROUP	255,000	14.79	3,771,450.00	
	OCBC BANK	362,000	9.60	3,475,200.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	173,000	19.73	3,413,290.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	121,000	6.97	843,370.00	
	CAPITALAND LTD	335,000	3.69	1,236,150.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	196,000	1.95	383,180.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	72,000	12.00	864,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	290,000	2.75	797,500.00	
	KEPPEL LAND LTD	105,000	3.74	392,700.00	
UOL GROUP LIMITED	67,400	5.84	393,616.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,117,880	3.35	3,744,898.00		
STARHUB LTD	87,000	3.80	330,600.00		

シンガポールドル小計		7,624,595		31,594,702.65 (2,136,749,740)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	83,334	8.24	686,672.16
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	129,773	2.69	349,738.23
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	3.67	320,288.24
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	276,416	2.28	631,610.56
	CONTACT ENERGY LTD	56,144	5.32	298,686.08
ニュージーランドドル小計		632,939		2,286,995.27 (157,368,144)
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	31,960	153.10	4,893,076.00
	BOLIDEN AB	33,839	120.90	4,091,135.10
	ALFA LAVAL AB	43,219	131.70	5,691,942.30
	ASSA ABLOY B	46,485	241.00	11,202,885.00
	ATLAS COPCO A	90,412	175.80	15,894,429.60
	ATLAS COPCO B	54,699	156.50	8,560,393.50
	SANDVIK AB	134,174	101.90	13,672,330.60
	SCANIA AB-B SHS	45,957	138.20	6,351,257.40
	SKANSKA B	54,735	107.40	5,878,539.00
	SKF AB-B	54,945	160.70	8,829,661.50
	VOLVO B	195,080	95.15	18,561,862.00
	SECURITAS B	34,345	53.00	1,820,285.00
	ELECTROLUX AB-SER B	30,949	173.70	5,375,841.30
	HUSQVARNA AB-B SHS	58,160	39.90	2,320,584.00
	HENNES & MAURITZ B	130,151	214.10	27,865,329.10
	SWEDISH MATCH AB	28,876	224.90	6,494,212.40
	SCA SV CELLULOSA B	81,154	136.90	11,109,982.60
	ELEKTA AB-B SHS	51,436	102.40	5,267,046.40
	GETINGE AB-B SHS	25,919	219.50	5,689,220.50
	NORDEA BANK AB	369,004	61.45	22,675,295.80
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	197,717	55.15	10,904,092.55
	SVENSKA HANDELSBK A	69,202	238.40	16,497,756.80
SWEDBANK AB-A	110,004	125.20	13,772,500.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	101.00	1,679,731.00	

	INVESTOR AB-B SHS	63,847	159.50	10,183,596.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	29,534	131.10	3,871,907.40	
	RATOS AB-B SHS	29,254	65.70	1,921,987.80	
	ERICSSON (LM) B	422,147	64.80	27,355,125.60	
	HEXAGON AB-B SHS	34,114	172.50	5,884,665.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	8,871	538.00	4,772,598.00	
	TELE2 AB-B SHS	45,587	117.60	5,361,031.20	
	TELIASONERA AB	303,483	44.72	13,571,759.76	
	スウェーデンクローナ小計	2,925,890		308,022,061.51 (3,804,072,459)	
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	23,626	113.40	2,679,188.40	
	SEADRILL LTD	49,333	209.00	10,310,597.00	
	STATOIL ASA	156,438	136.40	21,338,143.20	
	SUBSEA 7 SA	36,328	130.60	4,744,436.80	
	NORSK HYDRO	130,509	27.04	3,528,963.36	
	YARA INTERNATIONAL ASA	26,210	282.20	7,396,462.00	
	ORKLA	99,079	46.73	4,629,961.67	
	DNB ASA	136,989	71.05	9,733,068.45	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	28,723	79.50	2,283,478.50	
	TELENOR ASA	95,402	113.40	10,818,586.80	
	ノルウェークローネ小計	782,637		77,462,886.18 (1,124,761,107)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S	34,221	158.20	5,413,762.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	79	38,740.00	3,060,460.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	185	41,040.00	7,592,400.00	
	DSV A/S	26,634	139.00	3,702,126.00	
	CARLSBERG AS-B	14,995	564.50	8,464,677.50	
	COLOPLAST-B	3,281	1,370.00	4,494,970.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,846	494.00	1,899,924.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	56,218	928.50	52,198,413.00	
	DANSKE BANK A/S	91,424	98.50	9,005,264.00	
	TRYG A/S	2,274	418.00	950,532.00	
	TDC A/S	72,506	40.06	2,904,590.36	

デンマーククローネ小計		305,663		99,687,119.06 (1,424,528,931)
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	63,861	47.44	3,029,565.84
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	327	2,648.00	865,896.00
	DELEK GROUP LTD	633	821.90	520,262.70
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	129,799	161.80	21,001,478.20
	BANK HAPOALIM BM	151,941	16.05	2,438,653.05
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	155,420	12.60	1,958,292.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,485	37.63	733,220.55
	NICE SYSTEMS LTD	9,047	129.20	1,168,872.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	269,518	4.72	1,272,124.96
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	5,152	264.30	1,361,673.60
イスラエルシェケル小計		805,183		34,350,039.30 (738,869,345)
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	19,704	23.37	460,581.00
	ENI	352,492	17.81	6,277,882.52
	FUGRO NV-CVA	9,936	45.86	455,664.96
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,226	11.74	390,239.37
	NESTE OIL OYJ	18,111	10.05	182,015.55
	OMV AG	21,217	27.22	577,632.82
	REPSOL SA	110,001	15.85	1,744,065.85
	SAIPEM	37,114	29.64	1,100,058.96
	TECHNIP S.A.	14,002	88.56	1,240,017.12
	TENARIS SA	66,193	15.01	993,556.93
	TOTAL SA	295,140	38.27	11,296,483.50
	AIR LIQUIDE	43,001	94.63	4,069,184.63
	AKZO NOBEL	32,898	45.00	1,480,410.00
	ARCELORMITTAL	124,917	12.16	1,519,615.30
	ARKEMA	8,747	80.30	702,384.10
	BASF SE	127,522	70.01	8,927,815.22
	CRH	101,224	14.42	1,459,650.08
HEIDELBERGCEMENT AG	19,712	43.20	851,558.40	
IMERYS SA	5,070	46.00	233,220.00	

K+S AG	24,147	34.59	835,365.46
KONINKLIJKE DSM NV	21,617	44.82	968,873.94
LAFARGE (FRANCE)	26,172	45.60	1,193,443.20
LANXESS	10,844	68.03	737,717.32
LINDE AG	25,389	133.70	3,394,509.30
SALZGITTER AG	5,476	36.70	200,969.20
SOLVAY SA	7,799	106.75	832,543.25
STORA ENSO OYJ R	79,401	5.22	414,870.22
THYSSEN KRUPP	54,089	16.22	877,594.02
UMICORE	14,302	39.29	561,997.09
UPM KYMMENE CORP	75,394	8.99	677,792.06
VOESTALPINE AG	15,781	25.01	394,761.71
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,336	16.07	326,799.52
ALSTOM RGPT	28,901	29.77	860,527.27
ANDRITZ AG	10,205	49.48	504,943.40
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	32.92	342,697.20
BOUYGUES ORD	27,132	19.94	541,012.08
BRENNTAG AG	6,789	102.20	693,835.80
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	57,794	29.79	1,721,972.23
FERROVIAL SA	56,551	11.42	645,812.42
FIAT INDUSTRIAL	119,961	8.23	987,878.83
FINMECCANICA SPA	56,730	4.09	232,139.16
GEA GROUP AG	22,145	25.07	555,285.87
HOCHTIEF AG	4,512	41.58	187,608.96
KONE OYJ-B	20,541	59.40	1,220,135.40
LEGRAND SA	33,229	31.60	1,050,036.40
MAN SE	5,929	81.88	485,466.52
METSO OYJ	18,354	29.81	547,132.74
PHILIPS ELECTRS (KON.)	142,088	20.14	2,862,362.76
PRYSMIAN SPA	28,555	14.24	406,623.20
REXEL SA	15,749	14.89	234,502.61
SAFRAN SA	32,152	32.24	1,036,741.24
SAINT-GOBAIN	55,302	31.16	1,723,486.83

SCHNEIDER ELECTRIC	71,692	53.98	3,869,934.16
SIEMENS	114,402	80.70	9,232,241.40
THALES SA	13,117	27.90	365,964.30
VALLOUREC	12,975	39.83	516,859.12
VINCI S.A.	64,494	34.50	2,225,043.00
WARTSILA OYJ	21,786	32.88	716,323.68
ZARDOYA OTIS SA	22,525	10.54	237,413.50
ZODIAC AEROSPACE	4,111	88.96	365,714.56
BUREAU VERITAS SA	7,847	86.60	679,550.20
EDENRED	23,749	23.80	565,226.20
RANDSTAD HOLDING NV	17,186	26.12	448,984.25
SOCIETE BIC SA	4,132	94.13	388,945.16
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	51,396	11.35	583,601.58
ADP	4,277	60.67	259,485.59
ATLANTIA SPA	46,386	13.03	604,409.58
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	32,986	13.30	438,713.80
DEUTSCHE POST AG-REG	125,525	16.54	2,076,811.12
FRAPORT AG	5,277	44.23	233,428.09
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	81,054	5.79	469,707.93
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	133,230	2.11	281,115.30
TNT EXPRESS	46,960	7.76	364,832.24
VOPAK	8,861	57.19	506,760.59
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	45,315	69.04	3,128,547.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	8,926	47.54	424,342.04
CONTINENTAL AG	15,477	85.57	1,324,366.89
DAIMLER AG	125,086	38.80	4,853,336.80
FIAT ORD	122,692	3.61	443,408.88
MICHELIN	25,234	70.90	1,789,090.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,817	32.27	510,414.59
PEUGEOT SA	33,785	4.53	153,046.05
PIRELLI & CO	34,162	8.86	302,675.32
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	21,465	56.50	1,212,772.50
RENAULT SA	26,945	38.41	1,035,092.17

VOLKSWAGEN AG-PFD	19,827	166.50	3,301,195.50
VOLKSWAGEN STAMM	4,136	156.90	648,938.40
ADIDAS AG	28,228	67.65	1,909,624.20
CHRISTIAN DIOR	7,643	128.15	979,450.45
HUGO BOSS AG	3,036	81.00	245,916.00
LUXOTTICA GROUP SPA	23,232	31.55	732,969.60
LVMH	35,054	138.15	4,842,710.10
ACCOR	20,706	25.92	536,803.05
OPAP SA	31,301	5.24	164,017.24
SODEXO	13,216	63.42	838,158.72
AXEL SPRINGER AG	5,908	32.53	192,187.24
EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,513	24.18	447,644.34
JC DECAUX SA	10,079	18.54	186,915.05
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	12,753	55.92	713,147.76
LAGADERE S.C.A	16,950	24.57	416,461.50
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	12,819	23.35	299,323.65
PUBLICIS GROUPE	24,836	45.36	1,126,685.14
REED ELSEVIER NV	96,429	11.28	1,088,201.26
SES	39,594	21.88	866,316.72
WOLTERS KLUWER	38,268	14.93	571,341.24
INDITEX	29,869	100.80	3,010,795.20
PPR	10,595	142.00	1,504,490.00
AHOLD (KON.)	138,510	10.15	1,405,876.50
CARREFOUR	80,942	19.18	1,552,467.56
CASINO GUICHARD PERRACHON	7,755	68.68	532,613.40
COLRUYT SA	10,925	35.40	386,745.00
DELHAIZE GROUP	14,283	28.50	407,065.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	86,188	4.62	398,447.12
JERONIMO MARTINS	31,632	14.52	459,296.64
KESKO OYJ-B SHS	9,158	24.88	227,851.04
METRO STAMM	18,173	21.34	387,902.68
ANHEUSER-BUSCH INBEV	110,501	67.59	7,468,762.59

COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	29,529	16.98	501,402.42
DANONE (GROUPE)	79,637	49.38	3,932,475.06
DE MASTER BLENDERS1753 NV	82,926	8.81	731,324.39
HEINEKEN HOLDING NV	14,132	42.25	597,077.00
HEINEKEN NV	32,297	51.00	1,647,147.00
KERRY GROUP PLC-A	20,926	40.69	851,583.57
PERNOD-RICARD	28,848	88.31	2,547,566.88
REMY COINTREAU	3,268	87.86	287,126.48
SUEDZUCKER AG	12,035	30.31	364,780.85
UNILEVER NV-CVA	225,343	29.50	6,647,618.50
BEIERSDORF AG	13,270	61.97	822,341.90
HENKEL AG & CO KGAA	18,209	51.30	934,121.70
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	23,826	62.03	1,477,926.78
LOREAL	33,111	105.05	3,478,310.55
CELESIO AG	12,054	13.35	160,981.17
ESSILOR INTERNATIONAL	28,183	76.95	2,168,681.85
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	29,463	53.91	1,588,350.33
FRESENIUS SE&CO KGAA	17,372	87.48	1,519,702.56
BAYER	114,418	71.90	8,226,654.20
ELAN CORPORATION PLC	71,914	7.68	552,299.52
GRIFOLS SA	20,907	24.95	521,734.18
MERCK KGAA	9,059	104.20	943,947.80
ORION OYJ-CLASS B	13,536	21.52	291,294.72
QIAGEN N.V.	33,623	13.83	465,006.09
SANOFI	165,200	71.30	11,778,760.00
UCB (GROUPE)	15,422	45.04	694,606.88
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	941,085	0.20	193,110.64
BANCO BILBAO VIZCAYA	754,431	6.57	4,956,611.67
BANCO DE SABADELL SA	393,486	2.18	857,799.48
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	294,300	0.83	245,740.50
BANCO POPOLARE SPA	253,270	1.14	289,234.34
BANCO POPULAR ESPANOL	752,305	0.55	413,767.75
BANCO SANTANDER SA	1,429,803	5.84	8,361,487.94

BANKIA SA	124,412	0.67	83,978.10
BNP PARIBAS	139,425	44.03	6,138,882.75
CAIXABANK	113,827	2.70	307,902.03
CAIXABANK-RTS	113,827	0.06	6,829.62
COMMERZBANK AG	509,696	1.40	714,084.09
CREDIT AGRICOLE SA	140,063	6.10	855,644.86
ERSTE GROUP BANK AG	30,420	22.22	676,084.50
INTESA SANPAOLO	1,354,305	1.28	1,736,219.01
INTESA SANPAOLO-RNC	134,006	1.04	140,572.29
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	126,938	-	-
KBC GROEP NV	23,136	23.46	542,886.24
NATIXIS	129,620	2.55	331,049.48
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,024	31.92	224,241.20
SOCIETE GENERALE	97,908	29.27	2,866,256.70
UNICREDIT SPA	547,032	3.64	1,995,572.73
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	99,300	3.07	305,446.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	128,139	34.55	4,427,202.45
DEUTSCHE BOERSE	27,054	44.61	1,207,014.21
EURAZEO	4,516	36.91	166,685.56
EXOR SPA	9,213	18.79	173,112.27
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,587	59.20	685,950.40
ING GROEP	526,219	7.20	3,791,407.89
MEDIOBANCA	74,203	4.19	311,355.78
OKO BANK-A	19,424	11.02	214,052.48
WENDEL	4,607	74.29	342,254.03
AEGON	240,916	4.61	1,111,586.42
AGEAS	32,738	21.46	702,721.17
ALLIANZ SE-REG	63,080	102.80	6,484,624.00
ASSICURAZIONI GENERALI	157,905	12.99	2,051,185.95
AXA	241,924	12.91	3,123,238.84
CNP ASSURANCES	21,876	11.47	251,027.10
DELTA LLOYD NV	15,951	12.00	191,491.75
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	8,453	57.45	485,624.85

MAPFRE SA	107,919	2.13	230,083.30
MUENCHENER RUECKVERSICH.	24,582	133.40	3,279,238.80
SAMPO OYJ-A SHS	55,764	24.64	1,374,024.96
SCOR SE	19,882	20.55	408,674.51
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	5,519	37.75	208,369.84
IMMOFINANZ AG	134,041	3.28	440,458.72
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	40,982	17.82	730,504.15
ATOS	7,956	55.35	440,364.60
CAP GEMINI SA	21,253	32.65	693,910.45
DASSAULT SYSTEMES SA	8,810	85.60	754,136.00
SAP AG	127,575	61.23	7,811,417.25
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	13,939	16.18	225,533.02
GEMALTO	11,104	74.59	828,247.36
NOKIA CORP	524,945	2.91	1,531,789.51
BELGACOM	21,846	22.25	486,073.50
DEUTSCHE TELEKOM	393,729	8.41	3,313,229.53
ELISA A	19,870	16.44	326,662.80
FRANCE TELECOM	259,913	8.17	2,123,489.21
ILIAD SA	2,797	137.80	385,426.60
KPN (KON.)	140,464	4.48	630,402.43
PORTUGAL TELECOM	90,409	3.58	324,116.26
TELECOM ITALIA ORD	1,316,483	0.70	929,436.99
TELECOM ITALIA RNC	865,439	0.62	542,197.53
TELEFONICA	565,154	10.00	5,651,540.00
TELEKOM AUSTRIA AG	31,911	5.00	159,778.37
TELENET GROUP HOLDING NV	8,307	35.18	292,240.26
VIVENDI	180,662	16.52	2,985,439.55
ZIGGO NV	15,750	24.50	385,875.00
ACCIONA SA	3,118	56.06	174,795.08
E.ON SE	247,147	13.89	3,434,107.56
ELECTRICITE DE FRANCE	34,519	13.92	480,504.48
ENAGAS	25,715	15.85	407,582.75

ENEL	897,347	2.95	2,648,968.34	
ENEL GREEN POWER SPA	251,326	1.31	330,996.34	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	274,095	2.10	576,695.88	
FORTUM OYJ	62,263	14.11	878,530.93	
GAS NATURAL SDG SA	49,847	12.51	623,835.20	
GDF SUEZ	174,636	15.21	2,656,213.56	
IBERDROLA SA	544,206	3.80	2,071,248.03	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,170	35.68	541,341.45	
RWE AG-NON VTG PFD	5,510	28.84	158,908.40	
RWE STAMM	66,304	31.53	2,090,896.64	
SNAM SPA	230,794	3.34	772,236.72	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	39,337	8.29	326,221.74	
TERNA SPA	183,137	2.88	527,434.56	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,661	8.52	414,591.72	
VERBUND AG	9,545	18.13	173,050.85	
ASML HOLDING NV	45,316	48.85	2,213,686.60	
INFINEON TECHNOLOGIES	152,333	5.81	885,511.72	
STMICROELECTRONICS	91,539	5.00	457,695.00	
ユーロ小計	24,688,736		322,712,427.00 (34,388,236,221)	
合計	144,595,287		258,174,942,150 (258,174,942,150)	

(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	合計金額に対する比率
アメリカドル	株式 576銘柄	100.0%	57.4%
カナダドル	株式 98銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	100.0%	3.9%
イギリスポンド	株式 101銘柄	100.0%	10.6%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%	4.2%

香港ドル	株式	39銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	株式	27銘柄	100.0%	0.8%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	1.5%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%	0.3%
ユーロ	株式	233銘柄	100.0%	13.3%

(注)組入株式時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する株式の比率であります。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	667,000.00	526,930.00	
		アメリカドル小計	667,000.00	526,930.00 (43,498,071)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	110,865.00	624,169.95	
		LEND LEASE GROUP	78,014.00	694,324.60	
		SYDNEY AIRPORT	16,013.00	56,846.15	
	オーストラリアドル小計	204,892.00	1,375,340.70 (119,008,230)		
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	276,000.00	2,150,040.00	
香港ドル小計	276,000.00	2,150,040.00 (22,897,926)			
投資信託受益証券合計				185,404,227 (185,404,227)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	47,300.00	1,471,503.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	54,127.00	4,083,882.15	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	136,700.00	1,975,315.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,429.00	1,795,054.43	
		BOSTON PROPERTIES	21,100.00	2,223,940.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,600.00	774,764.00	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,700.00	1,035,101.00	
	DUKE REALTY CORP	37,800.00	510,300.00	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	42,200.00	2,325,642.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,266.00	861,482.52	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	59,197.00	1,195,779.40	
	HCP INC	62,218.00	2,822,830.66	
	HEALTH CARE REIT INC	35,019.00	2,092,385.25	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	100,781.00	1,520,785.29	
	KIMCO REALTY CORP	57,100.00	1,119,160.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,700.00	589,176.00	
	MACERICH CO/THE	17,326.00	1,003,175.40	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	23,200.00	1,002,240.00	
	PROLOGIS INC	64,540.00	2,273,744.20	
	PUBLIC STORAGE	20,500.00	2,917,560.00	
	RAYONIER INC	17,500.00	882,875.00	
	REALTY INCOME CORP	19,200.00	780,288.00	
	REGENCY CENTERS CORP	10,977.00	515,589.69	
	SIMON PROPERTY GROUP	41,940.00	6,527,961.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,700.00	968,248.00	
	UDR INC	32,900.00	757,687.00	
	VENTAS INC	41,300.00	2,694,412.00	
	VORNADO REALTY TRUST	22,189.00	1,698,346.06	
	アメリカドル小計	1,043,509.00	48,419,227.05 (3,997,007,192)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	12,000.00	284,880.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20,000.00	551,800.00	
	カナダドル小計	32,000.00	836,680.00 (69,963,181)	
オーストラリアドル	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	186,565.00	423,502.55	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	282,061.00	550,018.95	
	DEXUS PROPERTY GROUP	662,270.00	678,826.75	
	GOODMAN GROUP	236,897.00	1,082,619.29	

	GPT GROUP	200,567.00	722,041.20	
	MIRVAC GROUP	490,720.00	736,080.00	
	STOCKLAND	288,918.00	990,988.74	
	WESTFIELD GROUP	293,727.00	3,104,694.39	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	406,709.00	1,216,059.91	
オーストラリアドル小計		3,048,434.00	9,504,831.78 (822,453,093)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	118,377.00	656,992.35	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	78,831.00	276,302.65	
	HAMMERSON PLC	101,570.00	488,450.13	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	109,231.00	888,048.03	
	SEGRO PLC	106,565.00	259,166.08	
イギリスポンド小計		514,574.00	2,568,959.24 (339,847,617)	
香港ドル	LINK REIT	317,500.00	13,176,250.00	
香港ドル小計		317,500.00	13,176,250.00 (140,327,062)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	271,000.00	647,690.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	254,000.00	414,020.00	
	CAPITAMALL TRUST	286,600.00	601,860.00	
シンガポールドル小計		811,600.00	1,663,570.00 (112,507,239)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584.00	0.00	
	CORIO NV	9,339.00	323,129.40	
	FONCIERE DES REGIONS	3,754.00	237,515.58	
	GECINA SA	3,161.00	272,320.15	
	ICADE	3,280.00	227,304.00	
	KLEPIERRE	13,981.00	415,235.70	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,445.00	2,235,122.00	
ユーロ小計		1,651,544.00	3,710,626.83 (395,404,395)	

投資証券合計		5,877,509,779 (5,877,509,779)	
合計		6,062,914,006 (6,062,914,006)	

(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	組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券 1銘柄	1.1%	-	66.6%
	投資証券 28銘柄	-	98.9%	
カナダドル	投資証券 2銘柄	-	100.0%	1.2%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 3銘柄	12.6%	-	15.5%
	投資証券 9銘柄	-	87.4%	
イギリスポンド	投資証券 5銘柄	-	100.0%	5.6%
香港ドル	投資信託受益証券 1銘柄	14.0%	-	2.7%
	投資証券 1銘柄	-	86.0%	
シンガポールドル	投資証券 3銘柄	-	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 7銘柄	-	100.0%	6.5%

(注1)組入投資信託受益証券時価比率は、通貨ごと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2)組入投資証券時価比率は、通貨ごと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(デリバティブ取引に関する注記)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△](#)

「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12月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	429,554,279
コール・ローン	3,846,483,926
国債証券	403,491,205,276
派生商品評価勘定	17,671,238
未収入金	139,132,740
未収利息	3,960,156,090
前払費用	137,495,386
差入委託証拠金	147,104,112
流動資産合計	412,168,803,047
資産合計	412,168,803,047
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,994,632
未払金	1,884,280
未払解約金	140,489,695
流動負債合計	150,368,607
負債合計	150,368,607
純資産の部	
元本等	
元本	249,377,455,574
剰余金	
剰余金又は欠損金()	162,640,978,866
元本等合計	412,018,434,440
純資産合計	412,018,434,440
負債純資産合計	412,168,803,047

(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12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</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>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>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>

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月10日現在
<p>1. 特定期間の期首元本額</p> <p>特定期間中の追加設定元本額</p> <p>特定期間中の一部解約元本額</p> <p>計算日の元本額</p>	<p>261,445,732,569円</p> <p>4,418,685,679円</p> <p>16,486,962,674円</p> <p>249,377,455,574円</p>
<p>計算日の元本額の内訳</p> <p>外国債券インデックスファンド</p> <p>DC外国債券インデックスファンド</p> <p>DC外国債券インデックスファンドL</p> <p>物価連動債組入世界債券ファンド</p> <p>DCバランスファンド30</p> <p>DCバランスファンド50</p> <p>DCバランスファンド70</p> <p>ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)</p> <p>ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)</p> <p>新生・4分散ファンド</p> <p>グローバル・インデックス・バランス・ファンド</p> <p>4資産インデックスバランスオープン(分配型)</p> <p>4資産インデックスバランスオープン(成長型)</p> <p>外国債券インデックスe</p> <p>インデックスコレクション(外国債券)</p> <p>インデックスコレクション(バランス株式30)</p> <p>インデックスコレクション(バランス株式50)</p> <p>インデックスコレクション(バランス株式70)</p> <p>外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)</p>	<p>5,551,787,565円</p> <p>1,922,798,066円</p> <p>9,153,196,754円</p> <p>75,109,584円</p> <p>116,288,051円</p> <p>180,303,887円</p> <p>35,002,249円</p> <p>105,928,835円</p> <p>69,064,997円</p> <p>97,984,000円</p> <p>447,884,288円</p> <p>24,210,640円</p> <p>84,903,798円</p> <p>832,424,461円</p> <p>1,109,959,920円</p> <p>141,597,254円</p> <p>155,743,811円</p> <p>48,076,727円</p> <p>357,918,781円</p>

外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	15,967,237,061円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	7,550,484,157円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	23,829,812,506円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	82,647,486,094円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	4,467,393,167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）	8,728,224,013円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	7,199,213,537円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,976,394,181円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	18,430,509,421円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	712,885,340円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	30,741,798,309円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	5,169,264,408円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	467,578,742円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	2,537,167,966円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,526,990,414円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	358,448,945円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	144,572,884円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	3,599,598,502円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	6,374,478,276円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	46,785,484円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	887,326,019円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	293,658,291円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	4,023,762,858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）	64,799,122円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,734,045円
2. 計算日における受益権総数	249,377,455,574口
3. 1口当たり純資産額	1.6522円
（1万口当たり純資産額）	（16,522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12月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び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。</p> <p>これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年12月10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)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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	8,738,187,522	
合計	8,738,187,522	

(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12月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

. 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12月10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	2,598,624,605	-	2,608,207,601	9,582,996
	合計	2,598,624,605	-	2,608,207,601	9,582,996

(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12月10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				
	アメリカドル	1,638,042,150	-	1,642,546,000	4,503,850
	カナダドル	157,412,340	-	158,840,000	1,427,660
	イギリスポンド	277,025,700	-	277,788,000	762,300
	ユーロ	1,605,000,200	-	1,598,400,000	6,600,200
	計	3,677,480,390	-	3,677,574,000	93,610
	合計	3,677,480,390	-	3,677,574,000	93,610

(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12月10日現在	
該当事項はありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年12月10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12月10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	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 07/31/14	1,000,000.00	998,085.90	
		T 0.125% 12/31/13	1,000,000.00	999,101.60	
		T 0.25% 01/15/15	9,000,000.00	8,996,484.60	
		T 0.25% 01/31/14	10,000,000.00	10,003,910.00	
		T 0.25% 02/15/15	15,000,000.00	14,992,968.00	
		T 0.25% 02/28/14	9,000,000.00	9,003,168.00	
		T 0.25% 03/31/14	8,000,000.00	8,002,496.00	
		T 0.25% 04/30/14	17,600,000.00	17,604,804.80	
		T 0.25% 05/15/15	20,090,000.00	20,070,380.10	
		T 0.25% 05/31/14	15,000,000.00	15,003,510.00	
		T 0.25% 06/30/14	1,000,000.00	1,000,195.00	
		T 0.25% 07/15/15	10,000,000.00	9,987,109.00	
		T 0.25% 08/15/15	5,000,000.00	4,992,773.50	
		T 0.25% 08/31/14	1,000,000.00	1,000,117.00	
		T 0.25% 09/15/14	18,000,000.00	18,002,106.00	
		T 0.25% 09/15/15	18,000,000.00	17,969,765.40	
		T 0.25% 09/30/14	9,000,000.00	9,001,053.00	
		T 0.25% 10/15/15	5,000,000.00	4,990,820.50	
		T 0.25% 10/31/14	5,000,000.00	5,000,780.00	
		T 0.25% 11/30/13	12,400,000.00	12,405,815.60	
		T 0.25% 12/15/14	6,100,000.00	6,099,047.18	
		T 0.375% 03/15/15	15,300,000.00	15,332,267.70	
		T 0.375% 04/15/15	23,700,000.00	23,749,983.30	
		T 0.375% 06/15/15	6,000,000.00	6,012,186.00	
T 0.375% 11/15/14	10,000,000.00	10,023,830.00			
T 0.375% 11/15/15	6,000,000.00	6,010,080.00			

T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,986,998.78	
T 0.5% 08/15/14	20,150,000.00	20,235,798.70	
T 0.5% 10/15/14	5,100,000.00	5,123,505.90	
T 0.625% 05/31/17	14,000,000.00	14,056,322.00	
T 0.625% 07/15/14	2,000,000.00	2,012,188.00	
T 0.625% 08/31/17	16,500,000.00	16,534,155.00	
T 0.625% 09/30/17	12,000,000.00	12,013,128.00	
T 0.75% 06/15/14	10,000,000.00	10,078,520.00	
T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	4,034,844.00	
T 0.75% 12/15/13	2,000,000.00	2,011,094.00	
T 0.875% 01/31/17	13,000,000.00	13,203,125.00	
T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,094,218.00	
T 0.875% 04/30/17	7,000,000.00	7,104,727.00	
T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,970,703.00	
T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,032,812.00	
T 0.875% 12/31/16	9,500,000.00	9,650,660.50	
T 1% 03/31/17	10,000,000.00	10,204,300.00	
T 1% 05/15/14	5,600,000.00	5,661,471.20	
T 1% 08/31/16	21,000,000.00	21,444,612.00	
T 1% 09/30/16	10,000,000.00	10,210,940.00	
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	5,001,170.00	
T 1% 10/31/16	9,000,000.00	9,190,548.00	
T 1.125% 05/31/19	12,000,000.00	12,150,936.00	
T 1.25% 01/31/19	30,050,000.00	30,766,031.40	
T 1.25% 02/15/14	25,000,000.00	25,300,775.00	
T 1.25% 03/15/14	15,100,000.00	15,294,065.20	
T 1.25% 04/15/14	5,110,000.00	5,179,664.63	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	2,042,344.00	
T 1.25% 08/31/15	11,990,000.00	12,295,373.31	
T 1.25% 09/30/15	21,980,000.00	22,553,546.12	
T 1.25% 10/31/15	10,000,000.00	10,265,620.00	
T 1.375% 02/28/19	15,000,000.00	15,458,205.00	
T 1.375% 09/30/18	10,520,000.00	10,867,654.44	

T 1.375% 11/30/15	4,550,000.00	4,690,053.55	
T 1.375% 11/30/18	9,000,000.00	9,288,981.00	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,818,226.10	
T 1.5% 06/30/16	21,960,000.00	22,807,524.24	
T 1.5% 07/31/16	9,950,000.00	10,338,666.90	
T 1.5% 08/31/18	6,500,000.00	6,760,507.00	
T 1.5% 12/31/13	40,120,000.00	40,668,520.64	
T 1.625% 08/15/22	10,000,000.00	10,039,840.00	
T 1.75% 01/31/14	18,900,000.00	19,230,012.90	
T 1.75% 03/31/14	13,000,000.00	13,257,465.00	
T 1.75% 05/15/22	31,900,000.00	32,510,597.90	
T 1.75% 05/31/16	10,960,000.00	11,472,040.24	
T 1.75% 07/31/15	22,000,000.00	22,833,602.00	
T 1.75% 10/31/18	16,630,000.00	17,535,553.39	
T 1.875% 02/28/14	2,000,000.00	2,040,078.00	
T 1.875% 04/30/14	6,880,000.00	7,036,409.92	
T 1.875% 06/30/15	23,900,000.00	24,861,592.60	
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,121,016.00	
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,282,930.33	
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,198,596.20	
T 11.25% 02/15/15	2,550,000.00	3,158,215.80	
T 2% 01/31/16	3,000,000.00	3,154,686.00	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	6,267,654.00	
T 2% 04/30/16	6,090,000.00	6,422,568.81	
T 2% 11/15/21	24,320,000.00	25,484,709.12	
T 2% 11/30/13	6,500,000.00	6,613,243.00	
T 2.125% 05/31/15	6,950,000.00	7,262,750.00	
T 2.125% 08/15/21	22,400,000.00	23,770,252.80	
T 2.125% 11/30/14	21,400,000.00	22,187,455.80	
T 2.125% 12/31/15	11,000,000.00	11,595,551.00	
T 2.25% 01/31/15	14,900,000.00	15,529,763.40	
T 2.25% 03/31/16	9,150,000.00	9,716,869.95	
T 2.25% 05/31/14	7,930,000.00	8,163,871.56	

T 2.25% 07/31/18	15,000,000.00	16,236,330.00	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,159,532.00	
T 2.375% 02/28/15	15,500,000.00	16,219,293.00	
T 2.375% 03/31/16	7,900,000.00	8,419,978.00	
T 2.375% 05/31/18	8,080,000.00	8,796,469.76	
T 2.375% 06/30/18	4,960,000.00	5,402,139.36	
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,165,234.00	
T 2.375% 08/31/14	26,000,000.00	26,950,612.00	
T 2.375% 09/30/14	22,150,000.00	23,000,515.70	
T 2.375% 10/31/14	15,950,000.00	16,588,000.00	
T 2.5% 03/31/15	12,820,000.00	13,476,525.02	
T 2.5% 04/30/15	4,930,000.00	5,190,363.16	
T 2.5% 06/30/17	8,200,000.00	8,919,738.60	
T 2.625% 01/31/18	12,250,000.00	13,468,299.25	
T 2.625% 02/29/16	12,850,000.00	13,783,629.60	
T 2.625% 04/30/16	13,580,000.00	14,603,280.16	
T 2.625% 04/30/18	5,600,000.00	6,168,310.40	
T 2.625% 06/30/14	13,000,000.00	13,481,910.00	
T 2.625% 07/31/14	28,200,000.00	29,299,348.80	
T 2.625% 08/15/20	15,000,000.00	16,607,820.00	
T 2.625% 11/15/20	15,000,000.00	16,598,430.00	
T 2.625% 12/31/14	3,480,000.00	3,649,650.00	
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,228,282.00	
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	320,971.13	
T 2.75% 05/31/17	9,900,000.00	10,871,823.60	
T 2.75% 08/15/42	12,150,000.00	12,016,160.46	
T 2.75% 11/15/42	800,000.00	790,187.52	
T 2.75% 11/30/16	15,500,000.00	16,891,977.50	
T 2.75% 12/31/17	11,000,000.00	12,159,730.00	
T 2.875% 03/31/18	4,800,000.00	5,347,123.20	
T 3% 02/28/17	31,550,000.00	34,836,879.00	
T 3% 05/15/42	16,080,000.00	16,773,450.00	
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,127,568.81	

T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,387,032.00	
T 3.125% 01/31/17	5,000,000.00	5,540,430.00	
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	4,066,000.00	
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,451,441.10	
T 3.125% 05/15/19	15,520,000.00	17,685,521.12	
T 3.125% 05/15/21	9,190,000.00	10,522,550.00	
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,543,992.80	
T 3.125% 11/15/41	17,770,000.00	19,031,954.32	
T 3.25% 03/31/17	15,300,000.00	17,082,801.90	
T 3.25% 05/31/16	12,000,000.00	13,178,436.00	
T 3.25% 06/30/16	9,000,000.00	9,904,221.00	
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,924,761.16	
T 3.25% 12/31/16	9,800,000.00	10,894,464.00	
T 3.375% 11/15/19	10,390,000.00	12,041,843.76	
T 3.5% 02/15/18	6,850,000.00	7,836,557.55	
T 3.5% 02/15/39	16,320,000.00	18,849,600.00	
T 3.5% 05/15/20	26,650,000.00	31,215,891.20	
T 3.625% 02/15/20	22,030,000.00	25,957,530.43	
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	6,195,918.24	
T 3.625% 08/15/19	1,400,000.00	1,643,140.80	
T 3.75% 08/15/41	12,440,000.00	14,949,384.36	
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,906,643.12	
T 3.875% 05/15/18	2,040,000.00	2,384,329.56	
T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	6,030,476.73	
T 4% 02/15/14	4,000,000.00	4,177,812.00	
T 4.0% 02/15/15	10,020,000.00	10,830,597.96	
T 4.0% 08/15/18	6,000,000.00	7,091,250.00	
T 4.125% 05/15/15	4,040,000.00	4,415,122.08	
T 4.25% 05/15/39	5,510,000.00	7,178,929.41	
T 4.25% 08/15/14	12,550,000.00	13,394,677.75	
T 4.25% 08/15/15	10,500,000.00	11,602,090.50	
T 4.25% 11/15/14	9,230,000.00	9,939,916.22	
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,588,518.00	

T 4.25% 11/15/40	14,120,000.00	18,419,977.72	
T 4.375% 02/15/38	2,150,000.00	2,846,062.50	
T 4.375% 05/15/40	11,800,000.00	15,687,545.40	
T 4.375% 05/15/41	3,350,000.00	4,459,164.90	
T 4.375% 11/15/39	5,800,000.00	7,705,392.80	
T 4.5% 02/15/16	2,420,000.00	2,737,436.24	
T 4.5% 02/15/36	5,620,000.00	7,538,701.72	
T 4.5% 05/15/17	15,530,000.00	18,223,492.14	
T 4.5% 05/15/38	1,500,000.00	2,023,008.00	
T 4.5% 08/15/39	7,450,000.00	10,081,362.35	
T 4.5% 11/15/15	2,160,000.00	2,422,152.72	
T 4.625% 02/15/17	18,500,000.00	21,658,727.00	
T 4.625% 02/15/40	14,700,000.00	20,276,812.50	
T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,847,262.60	
T 4.75% 02/15/37	3,500,000.00	4,868,829.00	
T 4.75% 02/15/41	7,900,000.00	11,120,482.40	
T 4.75% 05/15/14	9,300,000.00	9,901,226.40	
T 4.75% 08/15/17	19,000,000.00	22,668,634.00	
T 4.875% 08/15/16	750,000.00	871,728.75	
T 5.0% 05/15/37	1,250,000.00	1,798,926.25	
T 5.125% 05/15/16	2,000,000.00	2,321,954.00	
T 5.25% 02/15/29	1,600,000.00	2,254,124.80	
T 5.25% 11/15/28	3,350,000.00	4,708,843.75	
T 5.375% 02/15/31	5,980,000.00	8,694,824.32	
T 5.5% 08/15/28	2,250,000.00	3,233,144.25	
T 6.0% 02/15/26	1,440,000.00	2,113,424.64	
T 6.125% 08/15/29	1,200,000.00	1,850,062.80	
T 6.125% 11/15/27	2,700,000.00	4,074,891.30	
T 6.25% 05/15/30	3,520,000.00	5,540,423.68	
T 6.25% 08/15/23	7,950,000.00	11,533,708.95	
T 6.5% 11/15/26	1,150,000.00	1,772,437.50	
T 6.875% 08/15/25	4,240,000.00	6,620,361.44	
T 7.125% 02/15/23	1,450,000.00	2,210,456.85	

	T 7.25% 05/15/16	1,670,000.00	2,060,492.76	
	T 7.25% 08/15/22	1,000,000.00	1,521,875.00	
	T 7.5% 11/15/16	8,250,000.00	10,510,689.75	
	T 7.5% 11/15/24	2,690,000.00	4,338,676.79	
	T 8.0% 11/15/21	6,100,000.00	9,520,288.30	
	T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,672,526.50	
	T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,812,500.00	
	アメリカドル小計	1,883,630,000.00	2,034,918,729.38 (167,982,541,110)	
カナダドル	CAN 0.75% 05/01/14	3,340,000.00	3,326,038.80	
	CAN 1% 02/01/14	1,390,000.00	1,389,235.50	
	CAN 1% 02/01/15	3,850,000.00	3,844,533.00	
	CAN 1% 11/01/14	2,100,000.00	2,097,543.00	
	CAN 1.25% 02/01/16	850,000.00	851,870.00	
	CAN 1.5% 03/01/17	3,930,000.00	3,968,631.90	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,190,000.00	1,154,740.30	
	CAN 1.5% 08/01/15	1,400,000.00	1,413,370.00	
	CAN 1.5% 09/01/17	2,000,000.00	2,019,560.00	
	CAN 2% 03/01/14	3,380,000.00	3,418,836.20	
	CAN 2% 06/01/16	1,200,000.00	1,232,760.00	
	CAN 2% 12/01/14	8,360,000.00	8,510,898.00	
	CAN 2.25% 08/01/14	3,800,000.00	3,873,378.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	4,080,000.00	4,220,066.40	
	CAN 2.75% 06/01/22	4,500,000.00	4,908,780.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	4,910,000.00	5,180,639.20	
	CAN 3% 12/01/15	2,210,000.00	2,328,831.70	
	CAN 3.0% 06/01/14	8,100,000.00	8,329,473.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	3,560,000.00	4,023,903.60	
	CAN 3.5% 06/01/20	4,280,000.00	4,874,278.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,410,000.00	3,074,509.30	
	CAN 3.75% 06/01/19	7,070,000.00	8,071,677.60	
	CAN 4% 06/01/16	5,650,000.00	6,187,993.00	
	CAN 4% 06/01/17	4,950,000.00	5,536,080.00	

	CAN 4.0% 06/01/41	5,590,000.00	7,553,375.70	
	CAN 4.25% 06/01/18	3,150,000.00	3,632,674.50	
	CAN 4.5% 06/01/15	3,100,000.00	3,357,796.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,790,000.00	2,950,369.20	
	CAN 5% 06/01/37	4,700,000.00	7,020,531.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	4,250,000.00	6,366,372.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	4,520,000.00	7,085,009.60	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,690,000.00	2,946,802.30	
	CAN 9% 06/01/25	860,000.00	1,535,220.40	
	カナダドル小計	119,160,000.00	136,285,777.70 (11,396,216,731)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	970,000.00	925,603.10	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,200,000.00	1,151,076.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	3,290,000.00	3,512,272.40	
	ACGB 4.5% 04/15/20	6,760,000.00	7,472,436.40	
	ACGB 4.5% 10/21/14	3,850,000.00	3,978,821.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,820,000.00	2,088,158.80	
	ACGB 4.75% 06/15/16	4,580,000.00	4,906,599.80	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,600,000.00	2,752,568.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	6,430,000.00	7,324,605.90	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,190,000.00	3,606,518.30	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,400,000.00	5,320,216.00	
	ACGB 5.5% 12/15/13	3,060,000.00	3,142,987.20	
	ACGB 5.75% 05/15/21	5,340,000.00	6,438,010.80	
	ACGB 5.75% 07/15/22	4,680,000.00	5,722,704.00	
	ACGB 6% 02/15/17	6,320,000.00	7,158,095.20	
	ACGB 6.25% 04/15/15	4,850,000.00	5,244,305.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	5,150,000.00	5,420,838.50	
	オーストラリアドル小計	68,490,000.00	76,165,816.40 (6,590,628,093)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	4,580,000.00	4,632,807.40	
	UKT 1.75% 01/22/17	9,820,000.00	10,280,852.60	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,060,000.00	3,062,448.00	

UKT 2% 01/22/16	6,060,000.00	6,357,970.20	
UKT 2.25% 03/07/14	9,400,000.00	9,631,992.00	
UKT 2.75% 01/22/15	10,690,000.00	11,246,735.20	
UKT 3.75% 07/22/52	3,970,000.00	4,408,685.00	
UKT 3.75% 09/07/19	6,980,000.00	8,176,930.40	
UKT 3.75% 09/07/20	8,920,000.00	10,508,652.00	
UKT 3.75% 09/07/21	8,140,000.00	9,638,167.00	
UKT 4% 01/22/60	2,550,000.00	3,022,132.50	
UKT 4% 03/07/22	5,100,000.00	6,164,778.00	
UKT 4% 09/07/16	5,690,000.00	6,434,707.20	
UKT 4.25% 03/07/36	8,070,000.00	9,870,255.60	
UKT 4.25% 06/07/32	6,820,000.00	8,432,452.60	
UKT 4.25% 09/07/39	6,130,000.00	7,463,581.50	
UKT 4.25% 12/07/27	5,500,000.00	6,861,415.00	
UKT 4.25% 12/07/40	5,650,000.00	6,873,507.50	
UKT 4.25% 12/07/46	6,050,000.00	7,380,576.50	
UKT 4.25% 12/07/49	5,820,000.00	7,113,087.60	
UKT 4.25% 12/07/55	5,920,000.00	7,310,016.00	
UKT 4.5% 03/07/19	5,090,000.00	6,167,298.50	
UKT 4.5% 09/07/34	3,980,000.00	5,051,018.00	
UKT 4.5% 12/07/42	5,170,000.00	6,567,089.10	
UKT 4.75% 03/07/20	2,870,000.00	3,572,432.50	
UKT 4.75% 09/07/15	5,090,000.00	5,708,078.70	
UKT 4.75% 12/07/30	5,280,000.00	6,946,262.40	
UKT 4.75% 12/07/38	5,360,000.00	7,051,884.00	
UKT 5% 03/07/18	7,020,000.00	8,525,930.40	
UKT 5% 03/07/25	5,580,000.00	7,425,473.40	
UKT 5.0% 09/07/14	10,490,000.00	11,354,690.70	
UKT 6.0% 12/07/28	3,500,000.00	5,224,205.00	
UKT 8% 06/07/21	5,970,000.00	9,140,368.50	
UKT 8% 12/07/15	3,080,000.00	3,786,490.40	
UKT 8.75% 08/25/17	1,920,000.00	2,638,656.00	

イギリスポンド小計		205,320,000.00	244,031,627.40 (32,282,943,988)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	1,620,000.00	1,871,667.00
	SWISS 2.5% 03/12/16	2,390,000.00	2,602,949.00
	SWISS 3% 01/08/18	2,260,000.00	2,607,362.00
	SWISS 3% 05/12/19	1,960,000.00	2,326,422.00
	SWISS 3.75% 06/10/15	1,150,000.00	1,267,185.00
	SWISS 4% 02/11/23	1,510,000.00	2,043,301.80
	SWISS 4% 04/08/28	1,870,000.00	2,748,301.60
	SWISS 4.25% 01/06/14	1,710,000.00	1,792,302.30
	SWISS 4.25% 06/05/17	1,870,000.00	2,234,986.60
スイスフラン小計		16,340,000.00	19,494,477.30 (1,720,582,566)
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/14	820,000.00	820,164.00
	SIGB 1.125% 04/01/16	780,000.00	801,138.00
	SIGB 1.375% 10/01/14	1,540,000.00	1,571,339.00
	SIGB 2.25% 06/01/21	670,000.00	726,983.50
	SIGB 2.375% 04/01/17	1,510,000.00	1,639,784.50
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,290,000.00	1,427,449.50
	SIGB 2.75% 04/01/42	680,000.00	729,334.00
	SIGB 2.875% 07/01/15	2,190,000.00	2,335,635.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	930,000.00	1,043,181.00
	SIGB 3% 09/01/24	1,150,000.00	1,321,350.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,610,000.00	1,879,755.50
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,710,000.00	1,979,410.50
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,790,000.00	2,150,327.00
	SIGB 3.625% 07/01/14	2,110,000.00	2,221,197.00
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,740,000.00	1,961,328.00
	SIGB 4% 09/01/18	1,390,000.00	1,660,077.00
シンガポールドル小計		21,910,000.00	24,268,453.50 (1,641,275,510)
マレーシアリンギット	MGS 3.197% 10/15/15	2,960,000.00	2,967,696.00
	MGS 3.418% 08/15/22	1,800,000.00	1,788,246.00

	MGS 3.434% 08/15/14	2,280,000.00	2,294,774.40	
	MGS 3.492% 03/31/20	4,750,000.00	4,755,415.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,680,000.00	1,634,087.28	
	MGS 3.58% 09/28/18	6,570,000.00	6,643,452.60	
	MGS 3.741% 02/27/15	5,080,000.00	5,147,005.20	
	MGS 3.814% 02/15/17	3,530,000.00	3,608,895.50	
	MGS 3.835% 08/12/15	5,230,000.00	5,323,669.30	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,590,000.00	1,622,881.20	
	MGS 4.16% 07/15/21	4,610,000.00	4,836,581.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	9,470,000.00	9,871,149.20	
	MGS 4.262% 09/15/16	8,060,000.00	8,372,002.60	
	MGS 4.378% 11/29/19	9,560,000.00	10,123,275.20	
	MGS 4.392% 04/15/26	3,910,000.00	4,204,032.00	
	MGS 5.094% 04/30/14	4,530,000.00	4,658,787.90	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,810,000.00	2,126,623.30	
マレーシアリングット小計		77,420,000.00	79,978,574.18 (2,161,021,074)	
スウェーデンク ローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,050,000.00	9,004,840.50	
	SGB 3% 07/12/16	16,150,000.00	17,403,401.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	14,440,000.00	18,354,395.20	
	SGB 3.5% 06/01/22	22,720,000.00	26,847,315.20	
	SGB 3.75% 08/12/17	20,170,000.00	22,784,838.80	
	SGB 4.25% 03/12/19	22,490,000.00	26,743,758.60	
	SGB 4.5% 08/12/15	21,350,000.00	23,470,909.00	
	SGB 5% 12/01/20	20,200,000.00	25,852,566.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	26,600,000.00	28,839,454.00	
スウェーデンクローナ小計		173,170,000.00	199,301,478.80 (2,461,373,263)	
ノルウェークロー ネ	NGB 3.75% 05/25/21	12,050,000.00	13,762,305.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	16,200,000.00	18,106,416.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	13,650,000.00	15,942,927.00	
	NGB 5% 05/15/15	21,600,000.00	23,410,728.00	

ノルウェークローネ小計		63,500,000.00	71,222,376.00 (1,034,148,899)
デンマーククローネ	DGB 2% 11/15/14	12,170,000.00	12,695,500.60
	DGB 2.5% 11/15/16	11,250,000.00	12,365,775.00
	DGB 3% 11/15/21	27,620,000.00	32,352,134.60
	DGB 4% 11/15/15	30,820,000.00	34,575,417.00
	DGB 4% 11/15/17	18,960,000.00	22,497,936.00
	DGB 4% 11/15/19	34,880,000.00	42,925,072.00
	DGB 4.5% 11/15/39	38,200,000.00	57,871,090.00
	DGB 7% 11/10/24	8,180,000.00	13,389,678.40
デンマーククローネ小計		182,080,000.00	228,672,603.60 (3,267,731,505)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	24,960,000.00	35,876,505.60
	MBONO 10% 12/05/24	30,920,000.00	43,353,241.20
	MBONO 5% 06/15/17	12,330,000.00	12,301,394.40
	MBONO 6% 06/18/15	36,300,000.00	37,330,920.00
	MBONO 6.25% 06/16/16	25,960,000.00	27,074,722.40
	MBONO 6.5% 06/09/22	9,450,000.00	10,239,358.50
	MBONO 6.5% 06/10/21	30,530,000.00	33,110,090.30
	MBONO 7% 06/19/14	30,450,000.00	31,466,421.00
	MBONO 7.25% 12/15/16	25,290,000.00	27,391,599.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	36,430,000.00	42,258,071.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	14,430,000.00	16,784,976.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	9,020,000.00	10,502,437.00
	MBONO 7.75% 12/14/17	22,600,000.00	25,298,666.00
	MBONO 8% 06/11/20	38,260,000.00	44,960,856.40
	MBONO 8% 12/07/23	10,140,000.00	12,297,690.60
	MBONO 8% 12/17/15	29,700,000.00	32,297,265.00
	MBONO 8% 12/19/13	35,830,000.00	37,020,272.60
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,540,000.00	47,098,434.80
	MBONO 8.5% 11/18/38	36,630,000.00	46,098,855.00
	MBONO 8.5% 12/13/18	17,750,000.00	20,831,577.50
MBONO 9.5% 12/18/14	38,070,000.00	41,551,882.20	

メキシコペソ小計		552,590,000.00	635,145,236.90 (4,083,983,873)
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/14	6,470,000.00	6,233,715.60
	POLGB 0% 07/25/14	1,950,000.00	1,850,608.50
	POLGB 4% 10/25/23	1,350,000.00	1,357,803.00
	POLGB 4.75% 04/25/17	4,720,000.00	4,990,125.60
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,540,000.00	5,822,540.00
	POLGB 5% 04/25/16	8,760,000.00	9,225,418.80
	POLGB 5.25% 10/25/17	9,170,000.00	9,935,511.60
	POLGB 5.25% 10/25/20	8,760,000.00	9,676,296.00
	POLGB 5.5% 04/25/15	9,600,000.00	10,073,088.00
	POLGB 5.5% 10/25/19	9,740,000.00	10,863,509.00
	POLGB 5.75% 04/25/14	12,190,000.00	12,575,813.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	2,970,000.00	3,529,845.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	9,560,000.00	10,996,868.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	6,220,000.00	7,108,216.00
POLGB 6.25% 10/24/15	11,650,000.00	12,577,340.00	
ポーランドズロチ小計		108,650,000.00	116,816,698.60 (3,023,216,159)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	41,950,000.00	53,400,252.50
	SAGB 13.5% 09/15/15	19,400,000.00	23,341,886.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	21,150,000.00	16,941,361.50
	SAGB 6.5% 02/28/41	13,800,000.00	11,232,096.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	30,000,000.00	30,429,300.00
	SAGB 7% 02/28/31	13,650,000.00	12,504,355.50
	SAGB 7.25% 01/15/20	30,350,000.00	31,753,687.50
	SAGB 7.75% 02/28/23	5,100,000.00	5,416,710.00
	SAGB 8% 12/21/18	28,750,000.00	31,400,462.50
	SAGB 8.25% 09/15/17	29,000,000.00	31,769,210.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	5,400,000.00	5,618,052.00
	SAGB 8.75% 12/21/14	15,400,000.00	16,479,078.00
南アフリカランド小計		253,950,000.00	270,286,451.50 (2,573,127,018)

ユーロ	BGB 2.75% 03/28/16	1,740,000.00	1,876,938.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,890,000.00	2,084,821.20	
	BGB 3.25% 09/28/16	4,600,000.00	5,073,938.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,780,000.00	1,917,469.40	
	BGB 3.5% 06/28/17	3,670,000.00	4,112,895.60	
	BGB 3.75% 09/28/15	5,300,000.00	5,823,110.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	7,500,000.00	8,652,225.00	
	BGB 4% 03/28/14	5,630,000.00	5,917,130.00	
	BGB 4% 03/28/18	4,590,000.00	5,316,367.50	
	BGB 4% 03/28/22	5,340,000.00	6,266,917.20	
	BGB 4% 03/28/32	2,330,000.00	2,693,083.90	
	BGB 4.0% 03/28/17	5,110,000.00	5,825,553.30	
	BGB 4.0% 03/28/19	3,420,000.00	3,995,312.40	
	BGB 4.25% 03/28/41	4,080,000.00	4,909,586.40	
	BGB 4.25% 09/28/14	4,250,000.00	4,569,175.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	3,560,000.00	4,246,296.80	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,500,000.00	4,163,355.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	2,500,000.00	3,053,875.00	
	BGB 5% 03/28/35	5,930,000.00	7,776,305.50	
	BGB 5.5% 03/28/28	4,970,000.00	6,740,314.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	2,380,000.00	2,903,005.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	2,010,000.00	2,372,161.80	
	BKO 0% 06/13/14	3,100,000.00	3,103,100.00	
	BKO 0.25% 03/14/14	2,810,000.00	2,820,959.00	
	BKO 0.25% 12/13/13	1,310,000.00	1,313,903.80	
	BTNS 0.75% 09/25/14	470,000.00	476,100.60	
	BTNS 1% 07/25/17	3,890,000.00	3,955,079.70	
	BTNS 1.75% 02/25/17	8,340,000.00	8,773,096.20	
	BTNS 2% 07/12/15	9,390,000.00	9,846,166.20	
	BTNS 2.25% 02/25/16	7,740,000.00	8,242,713.00	
	BTNS 2.5% 01/12/14	13,190,000.00	13,548,108.50	
	BTNS 2.5% 01/15/15	5,600,000.00	5,888,008.00	
BTNS 2.5% 07/25/16	5,310,000.00	5,727,790.80		

BTNS 3% 07/12/14	12,730,000.00	13,329,964.90	
BTPS 2.5% 03/01/15	2,000,000.00	2,014,760.00	
BTPS 3% 04/01/14	240,000.00	244,068.00	
BTPS 3% 04/15/15	13,970,000.00	14,198,688.90	
BTPS 3% 06/15/15	8,510,000.00	8,653,819.00	
BTPS 3% 11/01/15	8,200,000.00	8,333,086.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	8,620,000.00	8,829,035.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	2,919,285.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	5,240,000.00	5,130,379.20	
BTPS 3.75% 04/15/16	5,330,000.00	5,520,014.50	
BTPS 3.75% 08/01/15	9,130,000.00	9,437,681.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	8,430,000.00	8,719,823.40	
BTPS 3.75% 08/01/21	14,100,000.00	13,698,573.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	8,210,000.00	8,392,508.30	
BTPS 4% 02/01/17	9,650,000.00	10,022,297.00	
BTPS 4% 02/01/37	8,620,000.00	7,328,120.60	
BTPS 4% 09/01/20	5,250,000.00	5,268,532.50	
BTPS 4.25% 02/01/15	12,230,000.00	12,788,666.40	
BTPS 4.25% 02/01/19	9,520,000.00	9,820,641.60	
BTPS 4.25% 03/01/20	10,310,000.00	10,536,510.70	
BTPS 4.25% 07/01/14	5,490,000.00	5,693,569.20	
BTPS 4.25% 08/01/14	4,170,000.00	4,330,878.60	
BTPS 4.25% 09/01/19	11,730,000.00	12,054,334.50	
BTPS 4.5% 02/01/18	6,360,000.00	6,685,504.80	
BTPS 4.5% 02/01/20	5,620,000.00	5,827,097.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	11,620,000.00	12,131,047.60	
BTPS 4.5% 03/01/26	5,600,000.00	5,471,368.00	
BTPS 4.5% 07/15/15	1,410,000.00	1,484,095.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,130,000.00	6,423,504.40	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,160,000.00	3,359,332.80	
BTPS 4.75% 08/01/23	8,530,000.00	8,717,489.40	
BTPS 4.75% 09/01/21	9,980,000.00	10,378,202.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	8,560,000.00	9,145,760.80	

BTPS 5% 03/01/22	8,340,000.00	8,761,837.20	
BTPS 5% 03/01/25	8,470,000.00	8,672,856.50	
BTPS 5% 08/01/34	7,520,000.00	7,358,320.00	
BTPS 5% 09/01/40	6,140,000.00	5,978,395.20	
BTPS 5.0% 08/01/39	6,830,000.00	6,658,430.40	
BTPS 5.25% 08/01/17	11,070,000.00	12,017,038.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	9,580,000.00	9,746,692.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,450,000.00	2,653,668.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	5,250,000.00	5,593,612.50	
BTPS 6% 05/01/31	10,070,000.00	11,053,637.60	
BTPS 6% 11/15/14	2,700,000.00	2,905,551.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	8,310,000.00	9,539,713.80	
BTPS 7.25% 11/01/26	4,000,000.00	4,924,920.00	
BTPS 9% 11/01/23	3,920,000.00	5,321,321.60	
DBR 1.5% 09/04/22	4,000,000.00	4,074,920.00	
DBR 1.75% 07/04/22	8,740,000.00	9,130,940.20	
DBR 2% 01/04/22	5,690,000.00	6,097,802.30	
DBR 2.25% 09/04/20	13,530,000.00	14,882,323.50	
DBR 2.25% 09/04/21	3,820,000.00	4,187,293.00	
DBR 2.5% 01/04/21	5,000,000.00	5,593,000.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,100,000.00	2,223,795.00	
DBR 3% 07/04/20	6,720,000.00	7,765,632.00	
DBR 3.25% 01/04/20	8,050,000.00	9,421,559.00	
DBR 3.25% 07/04/15	7,850,000.00	8,514,895.00	
DBR 3.25% 07/04/21	4,250,000.00	5,009,177.50	
DBR 3.25% 07/04/42	5,460,000.00	6,699,583.80	
DBR 3.5% 01/04/16	11,440,000.00	12,674,376.00	
DBR 3.5% 07/04/19	6,060,000.00	7,165,041.00	
DBR 3.75% 01/04/15	11,140,000.00	12,021,731.00	
DBR 3.75% 01/04/17	7,400,000.00	8,484,692.00	
DBR 3.75% 01/04/19	9,190,000.00	10,936,100.00	
DBR 4% 07/04/16	7,600,000.00	8,665,520.00	
DBR 4.0% 01/04/18	5,820,000.00	6,889,599.60	

DBR 4.0% 01/04/37	8,200,000.00	10,991,690.00	
DBR 4.25% 01/04/14	13,440,000.00	14,056,224.00	
DBR 4.25% 07/04/14	4,610,000.00	4,920,253.00	
DBR 4.25% 07/04/17	7,010,000.00	8,289,184.80	
DBR 4.25% 07/04/18	8,830,000.00	10,673,085.90	
DBR 4.25% 07/04/39	4,690,000.00	6,634,239.50	
DBR 4.75% 07/04/28	7,140,000.00	9,859,269.00	
DBR 4.75% 07/04/34	6,630,000.00	9,611,842.50	
DBR 4.75% 07/04/40	5,470,000.00	8,356,354.90	
DBR 5.5% 01/04/31	5,330,000.00	8,088,275.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,910,000.00	2,848,001.00	
DBR 6% 06/20/16	1,850,000.00	2,235,873.00	
DBR 6.25% 01/04/24	3,730,000.00	5,579,632.40	
DBR 6.25% 01/04/30	3,550,000.00	5,721,002.50	
DBR 6.5% 07/04/27	3,850,000.00	6,174,437.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	1,400,000.00	1,437,030.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	11,690,000.00	12,568,503.50	
FRTR 3% 04/25/22	7,900,000.00	8,685,497.00	
FRTR 3% 10/25/15	14,210,000.00	15,365,273.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	9,300,000.00	10,236,789.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,669,912.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	11,320,000.00	12,236,127.60	
FRTR 3.5% 04/25/20	9,960,000.00	11,454,996.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	10,610,000.00	11,951,422.30	
FRTR 3.75% 04/25/17	10,840,000.00	12,344,917.20	
FRTR 3.75% 04/25/21	12,220,000.00	14,268,072.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	14,900,000.00	17,377,572.00	
FRTR 4% 04/25/14	8,560,000.00	9,028,232.00	
FRTR 4% 04/25/18	9,810,000.00	11,449,054.80	
FRTR 4% 04/25/55	5,360,000.00	6,310,596.00	
FRTR 4% 04/25/60	3,130,000.00	3,688,392.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,960,000.00	4,253,950.80	
FRTR 4% 10/25/38	8,690,000.00	10,229,259.70	

FRTR 4.25% 04/25/19	10,400,000.00	12,420,720.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	8,230,000.00	9,635,519.40	
FRTR 4.25% 10/25/18	8,470,000.00	10,063,037.60	
FRTR 4.25% 10/25/23	13,500,000.00	16,317,855.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	7,680,000.00	9,781,478.40	
FRTR 4.75% 04/25/35	6,920,000.00	8,989,772.00	
FRTR 5% 10/25/16	11,210,000.00	13,192,488.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	9,360,000.00	12,960,792.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	7,730,000.00	11,238,105.90	
FRTR 6.0% 10/25/25	5,040,000.00	7,118,647.20	
FRTR 8.5% 04/25/23	4,090,000.00	6,585,595.30	
FRTR 8.5% 10/25/19	4,010,000.00	5,946,629.50	
IRISH 4% 01/15/14	3,620,000.00	3,711,767.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,670,000.00	2,695,845.60	
IRISH 4.5% 02/18/15	200,000.00	212,696.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,900,000.00	3,915,405.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	3,090,000.00	3,216,782.70	
IRISH 4.6% 04/18/16	3,590,000.00	3,837,889.50	
IRISH 5% 10/18/20	3,460,000.00	3,566,498.80	
IRISH 5.4% 03/13/25	4,110,000.00	4,212,462.30	
IRISH 5.5% 10/18/17	810,000.00	892,198.80	
IRISH 5.9% 10/18/19	2,220,000.00	2,430,789.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	3,320,000.00	3,374,879.60	
NETHER 1% 01/15/14	5,690,000.00	5,754,012.50	
NETHER 2.25% 07/15/22	4,830,000.00	5,140,086.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	4,140,000.00	4,501,008.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,510,000.00	2,590,771.80	
NETHER 2.75% 01/15/15	5,740,000.00	6,069,648.20	
NETHER 3.25% 07/15/15	5,040,000.00	5,453,532.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	4,210,000.00	4,855,729.80	
NETHER 3.5% 07/15/20	5,450,000.00	6,375,846.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	3,940,000.00	4,727,212.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	4,320,000.00	5,582,217.60	

NETHER 3.75% 07/15/14	6,000,000.00	6,359,700.00	
NETHER 4% 01/15/37	4,480,000.00	5,844,697.60	
NETHER 4% 07/15/16	5,650,000.00	6,410,772.50	
NETHER 4% 07/15/19	6,780,000.00	8,096,879.40	
NETHER 4.0% 07/15/18	5,150,000.00	6,074,579.50	
NETHER 4.5% 07/15/17	5,310,000.00	6,286,933.80	
NETHER 5.5% 01/15/28	4,410,000.00	6,346,210.50	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,120,000.00	1,739,752.00	
OBL 0.5% 04/07/17	4,860,000.00	4,924,249.20	
OBL 0.5% 10/13/17	1,800,000.00	1,818,180.00	
OBL 0.75% 02/24/17	6,570,000.00	6,729,651.00	
OBL 1.25% 10/14/16	5,620,000.00	5,868,966.00	
OBL 1.75% 10/09/15	6,930,000.00	7,280,658.00	
OBL 2% 02/26/16	6,180,000.00	6,578,610.00	
OBL 2.25% 04/10/15	9,650,000.00	10,173,512.50	
OBL 2.25% 04/11/14	10,940,000.00	11,275,858.00	
OBL 2.5% 02/27/15	6,970,000.00	7,368,684.00	
OBL 2.5% 10/10/14	4,000,000.00	4,188,720.00	
OBL 2.75% 04/08/16	540,000.00	589,086.00	
RAGB 1.95% 06/18/19	850,000.00	898,790.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	580,000.00	641,480.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	3,270,000.00	3,646,050.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	2,650,000.00	2,818,010.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	990,000.00	1,143,331.20	
RAGB 3.5% 07/15/15	4,730,000.00	5,148,605.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	5,190,000.00	6,043,132.20	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,300,000.00	2,705,720.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	4,410,000.00	5,239,873.80	
RAGB 4% 09/15/16	4,360,000.00	4,959,718.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	4,300,000.00	5,515,094.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	3,600,000.00	3,846,960.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	2,530,000.00	2,973,256.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	4,260,000.00	5,130,658.80	

RAGB 4.65% 01/15/18	3,960,000.00	4,746,574.80	
RAGB 4.85% 03/15/26	3,580,000.00	4,715,755.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,540,000.00	3,825,316.20	
RFGB 1.625% 09/15/22	1,200,000.00	1,208,136.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	2,010,000.00	2,117,193.30	
RFGB 1.875% 04/15/17	1,830,000.00	1,948,126.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	1,090,000.00	1,184,753.70	
RFGB 3.125% 09/15/14	2,110,000.00	2,228,582.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	2,520,000.00	2,922,015.60	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,920,000.00	2,248,704.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	2,050,000.00	2,376,729.00	
RFGB 4% 07/04/25	2,100,000.00	2,596,503.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,750,000.00	1,939,752.50	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,800,000.00	2,192,940.00	
SPGB 3% 04/30/15	5,360,000.00	5,330,144.80	
SPGB 3.15% 01/31/16	9,820,000.00	9,671,521.60	
SPGB 3.25% 04/30/16	4,310,000.00	4,234,704.30	
SPGB 3.3% 10/31/14	12,470,000.00	12,552,302.00	
SPGB 3.4% 04/30/14	6,380,000.00	6,435,697.40	
SPGB 3.75% 10/31/15	1,850,000.00	1,860,045.50	
SPGB 3.8% 01/31/17	7,790,000.00	7,678,603.00	
SPGB 4% 04/30/20	8,910,000.00	8,365,420.80	
SPGB 4% 07/30/15	5,250,000.00	5,331,900.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	5,570,000.00	5,438,993.60	
SPGB 4.2% 01/31/37	5,890,000.00	4,547,256.70	
SPGB 4.25% 01/31/14	4,840,000.00	4,930,508.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	6,770,000.00	6,819,421.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	4,550,000.00	4,399,304.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,420,000.00	7,631,470.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	5,950,000.00	5,884,847.50	
SPGB 4.65% 07/30/25	5,400,000.00	4,867,992.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	3,590,000.00	2,951,877.50	
SPGB 4.75% 07/30/14	3,920,000.00	4,034,777.60	

	SPGB 4.8% 01/31/24	5,410,000.00	5,044,825.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	7,220,000.00	7,065,853.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	4,380,000.00	3,703,859.40	
	SPGB 5.5% 04/30/21	8,080,000.00	8,177,364.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	6,340,000.00	6,645,588.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	5,600,000.00	5,507,040.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,045,396.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,900,000.00	1,915,827.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	5,660,000.00	5,760,748.00	
	ユーロ小計	1,386,070,000.00	1,532,211,106.30 (163,272,415,487)	
	国債証券合計		403,491,205,276 (403,491,205,276)	
	合計		403,491,205,276 (403,491,205,276)	

(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	合計金額に対する比率
アメリカドル	国債証券 198銘柄	100.0%	41.6%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.8%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.6%
イギリスポンド	国債証券 35銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券 21銘柄	100.0%	1.0%

ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.7%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券	240銘柄	100.0%	40.5%

(注)組入債券時価比率は、通貨ごと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(デリバティブ取引に関する注記)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12月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	162,893,212
投資証券	11,937,002,280
未収入金	204,356,228
未収配当金	133,656,995
未収利息	322
流動資産合計	12,437,909,037
資産合計	12,437,909,037
負債の部	
流動負債	
未払解約金	46,255,192
流動負債合計	46,255,192
負債合計	46,255,192
純資産の部	
元本等	
元本	9,929,998,825
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,461,655,020
元本等合計	12,391,653,845
純資産合計	12,391,653,845
負債純資産合計	12,437,909,037

(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12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月10日現在
1. 特定期間の期首元本額	13,664,535,069円
特定期間中の追加設定元本額	712,899,577円

特定期間中の一部解約元本額	4,447,435,821円
計算日の元本額	9,929,998,825円
計算日の元本額の内訳	
Jリートファンド	6,663,231,073円
3資産バランスオープン	2,123,548,231円
3資産バランスオープンアルファ	308,636,208円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	141,690,447円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	90,572,759円
Jリートアクティブファンド（1年決算型）	602,320,107円
2. 計算日における受益権総数	9,929,998,825口
3. 1口当たり純資産額	1.2479円
(1万口当たり純資産額)	(12,479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12月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年12月10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。

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>4. 金銭債権の計算日後の償還予定額</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>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>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>
---	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		1,166,966,800
合計		1,166,966,800

(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24年8月16日から平成24年12月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成24年12月10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。	

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年12月10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12月10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	579	330,609,000	
	森ヒルズリート投資法人	888	370,740,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	369	164,020,500	
	産業ファンド投資法人	473	306,031,000	
	大和ハウスリート投資法人	352	177,056,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,482	592,288,200	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	586	297,102,000	
	日本ビルファンド投資法人	1,962	1,689,282,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,916	1,540,464,000	
	日本リテールファンド投資法人	6,182	925,445,400	
	オリックス不動産投資法人	717	292,894,500	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,454	595,585,800	
	プレミア投資法人	590	173,991,000	
	東急リアル・エステート投資法人	694	303,278,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	184	91,816,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	821	394,901,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,367	592,767,700	
	森トラスト総合リート投資法人	649	441,320,000	
	フロンティア不動産投資法人	745	523,735,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	490	349,370,000	
	福岡リート投資法人	306	183,294,000	
	ケネディクス不動産投資法人	733	196,590,600	
	積水ハウス・S I 投資法人	535	200,357,500	
	大和証券オフィス投資法人	906	240,452,400	
	阪急リート投資法人	137	54,252,000	
	トップリート投資法人	466	169,857,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	535	332,235,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,341	152,057,180	
ジャパンエクセレント投資法人	553	255,209,500		
	投資証券 小計	41,012	11,937,002,280	
	合計	41,012	11,937,002,280	

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12月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,486,326
コール・ローン	5,344,358
投資証券	772,802,465
未収入金	12,855,778
未収配当金	1,111,748
未収利息	10
流動資産合計	795,600,685
資産合計	795,600,685
負債の部	
流動負債	
未払金	2,561,270
未払株式払込金	153,766
未払解約金	1,265,993
流動負債合計	3,981,029
負債合計	3,981,029
純資産の部	
元本等	
元本	1,240,071,299
剰余金	
剰余金又は欠損金()	448,451,643
元本等合計	791,619,656
純資産合計	791,619,656
負債純資産合計	795,600,685

(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12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が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	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 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>

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月10日現在
1. 特定期間の期首元本額 特定期間中の追加設定元本額 特定期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	1,779,657,313円 1,212,970円 540,798,984円 1,240,071,299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 ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型) ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	778,605,002円 275,040,099円 186,426,198円
2. 計算日における受益権総数	1,240,071,299口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 448,451,643円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6384円 (6,384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12月10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。</p> <p>これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年12月10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	<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	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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	7,878,510	
合計	7,878,510	

(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24年9月11日から平成24年12月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成24年12月10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。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年12月10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12月10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	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	645.00	16,434.60	
		AGREE REALTY CORP	148.00	3,873.16	
		ALEXANDER'S INC	31.00	14,002.39	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	857.00	60,101.41	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	500.00	13,560.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,287.00	57,824.91	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	156.00	1,992.12	
		AMERICAN REALTY CAPITAL TRUST	2,217.00	26,138.43	
		APARTMENT INVEST & MGMT	2,036.00	51,856.92	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	847.00	7,953.33	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	692.00	10,788.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,522.00	203,445.74	
		BIOMED REALTY TRUST INC	2,157.00	41,824.23	
		BOSTON PROPERTIES	2,059.00	217,018.60	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	2,006.00	24,212.42	
		BRE PROPERTIES-CL A	1,074.00	52,497.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,142.00	76,274.18	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	600.00	6,840.00	
		CAPLEASE INC	1,000.00	5,070.00	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	2,218.00	49,794.10	
		CEDAR REALTY TRUST INC	763.00	4,120.20	
		CHATHAM LODGING TRUST	200.00	2,880.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	500.00	9,405.00	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	1,158.00	23,808.48	
		COMMONWEALTH REIT	1,171.00	18,173.92	
		CORESITE REALTY CORP	300.00	7,740.00	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	1,008.00	25,079.04	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,268.00	10,397.60	
		CUBESMART	1,586.00	22,045.40	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,496.00	22,094.72	
		DDR CORPORATION	3,319.00	51,676.83	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	2,800.00	24,752.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,666.00	109,839.38	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	1,818.00	42,268.50	
		DUKE REALTY CORP	3,773.00	50,935.50	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	885.00	21,160.35	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	400.00	21,048.00			
EDUCATION REALTY TRUST INC	1,550.00	15,965.00			
EPR PROPERTIES	655.00	30,372.35			
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	543.00	36,435.30			
EQUITY ONE INC	900.00	19,260.00			

EQUITY RESIDENTIAL PPTY	4,371.00	240,885.81	
ESSEX PROPERTY TRUST	497.00	70,882.14	
EXCEL TRUST INC	476.00	5,935.72	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,355.00	47,736.65	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	876.00	91,296.72	
FELCOR LODGING TRUST INC	1,547.00	6,466.46	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	1,300.00	17,485.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	800.00	9,480.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	985.00	11,623.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	6,148.00	124,189.60	
GETTY REALTY CORP	400.00	6,700.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	200.00	3,556.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	1,960.00	20,952.40	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	500.00	11,515.00	
GYRODYNE CO OF AMERICA INC	17.00	1,880.54	
HCP INC	6,167.00	279,796.79	
HEALTH CARE REIT INC	3,477.00	207,750.75	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,091.00	26,522.21	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	802.00	8,011.98	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,416.00	11,379.36	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,039.00	33,892.18	
HOME PROPERTIES INC	700.00	41,916.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,729.00	39,317.46	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	9,869.00	148,923.21	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	390.00	7,757.10	
INLAND REAL ESTATE CORP	1,200.00	9,960.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,300.00	11,167.00	
KILROY REALTY CORPORATION	1,034.00	47,936.24	
KIMCO REALTY CORP	5,558.00	108,936.80	
KITE REALTY GROUP TRUST	1,000.00	5,340.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,207.00	29,643.92	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	1,877.00	18,113.05	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,605.00	56,624.40	
LTC PROPERTIES INC	426.00	14,070.78	
MACERICH CO/THE	1,818.00	105,262.20	
MACK-CALI REALTY CORP	1,167.00	30,213.63	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,897.00	22,308.72	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	575.00	36,092.75	
MISSION WEST PROPERTIES	300.00	2,736.00	
MONMOUTH REIT -CL A	566.00	5,784.52	
MPG OFFICE TRUST INC	900.00	2,592.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,513.00	46,842.48	
NATL HEALTH INVESTORS INC	339.00	19,224.69	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1,520.00	35,233.60	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	200.00	3,896.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	298.00	3,969.36	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	800.00	17,160.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	719.00	12,215.81	

PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	2,363.00	42,061.40	
POST PROPERTIES	758.00	36,853.96	
PROLOGIS INC	6,292.00	221,667.16	
PS BUSINESS PARKS INC	251.00	16,335.08	
PUBLIC STORAGE	1,968.00	280,085.76	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	700.00	9,541.00	
REALTY INCOME CORP	1,822.00	74,046.08	
REGENCY CENTERS CORP	1,228.00	57,679.16	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	623.00	7,986.86	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	452.00	5,505.36	
RLJ LODGING TRUST	1,492.00	28,124.20	
ROUSE PROPERTIES INC	300.00	4,617.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	518.00	11,442.62	
SAUL CENTERS INC	200.00	8,502.00	
SELECT INCOME REIT	118.00	2,853.24	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	2,410.00	55,189.00	
SIMON PROPERTY GROUP	4,143.00	644,857.95	
SL GREEN REALTY CORP	1,231.00	93,851.44	
SOVRAN SELF STORAGE INC	400.00	24,308.00	
STAG INDUSTRIAL INC	463.00	8,338.63	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	2,487.00	15,419.40	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	500.00	4,340.00	
SUN COMMUNITIES INC	341.00	13,513.83	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,913.00	19,589.12	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,313.00	43,394.65	
TAUBMAN CENTERS INC	843.00	65,863.59	
TERRENO REALTY CORP	200.00	3,018.00	
UDR INC	3,417.00	78,693.51	
UMH PROPERTIES INC	200.00	2,036.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	173.00	8,477.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	329.00	6,247.71	
VENTAS INC	4,034.00	263,178.16	
VORNADO REALTY TRUST	2,309.00	176,730.86	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	928.00	24,842.56	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	1,561.00	42,412.37	
WHITESTONE REIT	227.00	3,114.44	
WINTHROP REALTY TRUST	400.00	4,540.00	
アメリカドル小計	178,791.00	6,041,392.64 (498,716,962)	
カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	400.00	12,960.00	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	800.00	12,640.00	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	358.00	22,775.96	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	200.00	5,984.00	
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	743.00	21,175.50	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	645.00	15,473.55	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	466.00	19,721.12	
CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	1,170.00	12,203.10	

	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	800.00	17,864.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	300.00	4,470.00	
	DUNDEE INTERNATIONAL REIT	395.00	4,092.20	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	700.00	25,627.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	1,300.00	30,862.00	
	INVEST REAL ESTATE INVESTME	641.00	2,730.66	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	301.00	1,577.24	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	400.00	7,324.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	200.00	6,038.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	300.00	3,789.00	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	610.00	16,189.40	
	RETROCOM MID-MARKET REIT	283.00	1,567.82	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,997.00	55,097.23	
	カナダドル小計	13,009.00	300,161.78 (25,099,528)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	3,734.00	7,654.70	
	ALE PROPERTY GROUP	2,422.00	5,594.82	
	ASPEN GROUP	16,189.00	3,642.52	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	915.00	2,726.70	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	3,560.00	10,751.20	
	BWP TRUST	5,406.00	11,785.08	
	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	19,494.00	44,251.38	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	32,069.00	62,534.55	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	1,523.00	3,731.35	
	CHARTER HALL GROUP	3,086.00	10,029.50	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	3,741.00	13,617.24	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	32,833.00	33,982.15	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	14,291.00	12,290.26	
	DEXUS PROPERTY GROUP	66,088.00	67,740.20	
	GOODMAN GROUP	19,986.00	91,336.02	
	GPT GROUP	22,252.00	80,107.20	
	INVESTA OFFICE FUND	8,590.00	25,941.80	
	MIRVAC GROUP	46,644.00	69,966.00	
	STOCKLAND	30,318.00	103,990.74	
	WESTFIELD GROUP	28,400.00	300,188.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	38,371.00	114,729.29	
	オーストラリアドル小計	399,912.00	1,076,590.70 (93,157,393)	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	1,738.00	5,881.39	
	BRITISH LAND CO PLC	12,141.00	67,382.55	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	8,472.00	29,694.36	
	DERWENT LONDON PLC	1,198.00	25,301.76	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	4,374.00	21,200.77	
	HAMMERSON PLC	9,735.00	46,815.61	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	9,680.00	7,419.72	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,655.00	86,625.15	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY	7,593.00	8,116.91	
	METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	2,658.00	2,658.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	971.00	3,311.11	
	SEGRO PLC	10,380.00	25,244.16	
	SHAFTESBURY PLC	3,518.00	19,630.44	
	WORKSPACE GROUP PLC	1,615.00	4,807.85	
	イギリス債券小計	84,728.00	354,089.78 (46,842,536)	
香港ドル	CHAMPION REIT	37,000.00	141,710.00	
	FORTUNE REIT	16,000.00	107,200.00	
	LINK REIT	31,000.00	1,286,500.00	
	PROSPERITY REIT	15,000.00	36,300.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	13,000.00	29,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,000.00	48,580.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	10,000.00	36,900.00	
	香港ドル小計	136,000.00	1,686,830.00 (17,964,739)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	6,000.00	8,520.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	7,000.00	6,370.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	25,000.00	59,750.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	9,000.00	11,520.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	9,000.00	10,665.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	15,000.00	9,900.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	28,000.00	45,640.00	
	CAPITAMALL TRUST	34,000.00	71,400.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	6,000.00	9,420.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	9,000.00	17,280.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	10,000.00	9,850.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000.00	7,210.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	7,000.00	13,895.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	6,000.00	7,440.00	
	KEPPEL REIT	9,000.00	11,250.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	20,000.00	9,400.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	16,000.00	18,720.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	15,000.00	20,475.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	20,000.00	22,100.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	5,000.00	10,750.00	
SABANA SHARIAH COMP IND REI	8,000.00	8,800.00		
STARHILL GLOBAL REIT	21,000.00	15,750.00		
SUNTEC REIT	29,000.00	46,400.00		
	シンガポールドル小計	321,000.00	452,505.00 (30,602,913)	
ニュージーランドドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	3,736.00	6,071.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	12,456.00	12,767.40	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	13,283.00	15,474.69	

	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	4,343.00	5,472.18	
ニュージーランドドル小計		33,818.00	39,785.27 (2,737,624)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	1,553.00	11,156.75	
イスラエルシェケル小計		1,553.00	11,156.75 (239,981)	
ユーロ	AEDIFICA	148.00	6,264.84	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	920.00	8,694.00	
	ALTAREA	46.00	5,253.20	
	ANF IMMOBILIER	172.00	4,518.44	
	BEFIMMO S.C.A.	224.00	10,539.20	
	BENI STABILI SPA	12,459.00	5,513.10	
	BGP HOLDINGS PLC	900,544.00	0.00	
	COFINIMMO	208.00	17,763.20	
	CORIO NV	1,314.00	45,464.40	
	EUROCOMMERCIAL	497.00	15,036.73	
	FONCIERE DES REGIONS	518.00	32,773.86	
	GECINA SA	368.00	31,703.20	
	HAMBORNER REIT AG	689.00	5,134.42	
	ICADE	318.00	22,037.40	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,765.00	2,068.22	
	KLEPIERRE	1,367.00	40,599.90	
	MERCIALYS	772.00	12,529.56	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	866.00	5,220.24	
	SILIC	116.00	9,868.12	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	87.00	3,931.53	
UNIBAIL-RODAMCO SE	1,247.00	223,961.20		
VASTNED RETAIL NV	288.00	9,455.04		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	143.00	6,286.28		
WERELDHAVE NV	303.00	14,430.37		
ユーロ小計		926,379.00	539,046.45 (57,440,789)	
投資証券合計			772,802,465 (772,802,465)	
合計			772,802,465 (772,802,465)	

(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	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 126銘柄	100.0%	64.5%
カナダドル	投資証券 21銘柄	100.0%	3.2%
オーストラリアドル	投資証券 21銘柄	100.0%	12.1%
イギリスポンド	投資証券 14銘柄	100.0%	6.1%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.3%

シンガポールドル	投資証券	23銘柄	100.0%	4.0%
ニュージーランドドル	投資証券	4銘柄	100.0%	0.4%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%
ユーロ	投資証券	24銘柄	100.0%	7.4%

(注)組入投資証券時価比率は、通貨ごと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。

[次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書(平成24年12月28日現在)

資産総額	1,077,298,729 円
負債総額	5,489,882 円
純資産総額(-)	1,071,808,847 円
発行済口数	1,568,726,654 口
1口当たり純資産額(/)	0.6832 円
1万口当たり純資産額	6,832 円

(参考情報)

日本株式マザーファンド

資産総額	274,631,758,832 円
負債総額	358,587,746 円
純資産総額(-)	274,273,171,086 円
発行済口数	343,697,622,061 口
1口当たり純資産額(/)	0.7980 円
1万口当たり純資産額	7,980 円

日本債券マザーファンド

資産総額	345,710,845,000 円
負債総額	7,718,864,241 円
純資産総額(-)	337,991,980,759 円
発行済口数	276,925,410,801 口
1口当たり純資産額(/)	1.2205 円
1万口当たり純資産額	12,205 円

外国株式マザーファンド

資産総額	285,448,230,228 円
負債総額	57,243,418 円
純資産総額(-)	285,390,986,810 円
発行済口数	248,210,143,923 口
1口当たり純資産額(/)	1.1498 円
1万口当たり純資産額	11,498 円

外国債券マザーファンド

資産総額	433,643,317,644 円
負債総額	1,622,563 円
純資産総額(-)	433,641,695,081 円
発行済口数	247,284,743,584 口
1口当たり純資産額(/)	1.7536 円
1万口当たり純資産額	17,536 円

Jリートマザーファンド(M)

資産総額	13,091,029,854 円
負債総額	131,610,045 円

純資産総額(-)	12,959,419,809 円
発行済口数	9,780,607,126 口
1口当たり純資産額(/)	1.3250 円
1万口当たり純資産額	13,250 円

海外リートマザーファンド

資産総額	837,751,889 円
負債総額	6,172,095 円
純資産総額(-)	831,579,794 円
発行済口数	1,223,108,434 口
1口当たり純資産額(/)	0.6799 円
1万口当たり純資産額	6,799 円

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

原届出書の「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」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部____は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

（1）資本金の額（平成24年6月29日現在）

（中略）

（2）委託会社の機構

（中略）

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。

< 訂正後 >

（1）資本金の額（平成24年12月28日現在）

（中略）

（2）委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は平成25年3月8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

[次へ](#)

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部 は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

（前略）

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	<u>296</u>	<u>3,576,425</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	<u>635</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>301</u>	<u>3,577,060</u>

< 訂正後 >

（前略）

平成24年12月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>303</u>	<u>3,840,872</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	<u>710</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>308</u>	<u>3,841,582</u>

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

- (イ) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度の中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

[次へ](#)

(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

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

(3)株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

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

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

(単位：千円)

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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

(3)移転関連費用引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更

1. 耐用年数の変更

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

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

2. 資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

2関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

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

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

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

2. 自己株式の種類及び株式数

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

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

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

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

(1) 配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

(3) 1株当たり配当額 10,000円

(4) 基準日 平成24年3月31日

(5) 効力発生日 平成24年6月29日

(リ - 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 "

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](#)

中間貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

第27期中間会計期間末

（平成24年9月30日）

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

中間損益計算書

（単位：千円）

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

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

第27期中間会計期間

（自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日）

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

（単位：千円）

第27期中間会計期間
（自 平成24年4月1日
至 平成24年9月30日）

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

重要な会計方針

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

に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第27期中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 16,512千円
	器具備品 213,925千円
	計 230,438千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第27期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 33,259千円
	無形固定資産 34,512千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 2,688千円
3	特別損失の主要項目
	統合関連損失 484,725千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ・ス取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

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

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（企業結合等関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

関連情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 木村 充男

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅則

印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

科目	第25期 平成23年3月31日		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>定率法を採用しております。</p> <p>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>
(1) 有形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>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>
(2) 無形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>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>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>(1) 貸倒引当金</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> <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。</p>

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 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)				
1. 発行済株式に関する事項	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
	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 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. 発行済株式に関する事項	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
	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)																																																
<p>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</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>58,149</td> <td>56,200</td> <td>1,949</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>58,149</td> <td>56,200</td> <td>1,949</td> </tr> </tbody> </table> <p>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>986</td> <td>1,000</td> <td>13</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>986</td> <td>1,000</td> <td>13</td> </tr> </tbody> </table>	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額		千円	千円	千円	その他	58,149	56,200	1,949	計	58,149	56,200	1,949	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額		千円	千円	千円	その他	986	1,000	13	計	986	1,000	13	<p>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</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>52,728</td> <td>50,200</td> <td>2,528</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>52,728</td> <td>50,200</td> <td>2,528</td> </tr> </tbody> </table>	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額		千円	千円	千円	その他	52,728	50,200	2,528	計	52,728	50,200	2,528
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																																														
	千円	千円	千円																																														
その他	58,149	56,200	1,949																																														
計	58,149	56,200	1,949																																														
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																																														
	千円	千円	千円																																														
その他	986	1,000	13																																														
計	986	1,000	13																																														
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																																														
	千円	千円	千円																																														
その他	52,728	50,200	2,528																																														
計	52,728	50,200	2,528																																														
<p>2．当事業年度中に売却したその他有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>売却額</th> <th>売却益の合計額</th> <th>売却損の合計額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>128,650</td> <td>67,194</td> <td>344</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>128,650</td> <td>67,194</td> <td>344</td> </tr> </tbody> </table>	区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額		千円	千円	千円	その他	128,650	67,194	344	計	128,650	67,194	344	<p>2．当事業年度中に売却したその他有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>売却額</th> <th>売却益の合計額</th> <th>売却損の合計額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>7,151</td> <td>153</td> <td>2</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>7,151</td> <td>153</td> <td>2</td> </tr> </tbody> </table>	区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額		千円	千円	千円	その他	7,151	153	2	計	7,151	153	2																
区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額																																														
	千円	千円	千円																																														
その他	128,650	67,194	344																																														
計	128,650	67,194	344																																														
区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額																																														
	千円	千円	千円																																														
その他	7,151	153	2																																														
計	7,151	153	2																																														
<p>3．時価評価されていない有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額（千円）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>10,000</td> </tr> </tbody> </table>	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	<p>3．時価評価されていない有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額（千円）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>10,000</td> </tr> </tbody> </table>	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																																								
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																																																
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																																																
<p>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。</p>	<p>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。</p>																																																

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> <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> <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> <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> <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。

[次へ](#)

5 その他

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「5 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

（2）訴訟事件その他の重要事項

<訂正前>

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。

<訂正後>

平成25年3月8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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

<訂正前>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

(中略)

(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
----	-----------------------------	-------

(中略)

3 資本関係

(中略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成24年3月末日現在）

(後略)

<訂正後>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 受託会社

(中略)

資本金の額：342,037百万円（平成24年9月末日現在）

(中略)

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年9月末日現在）	事業の内容
----	-----------------------------	-------

(中略)

3 資本関係

(中略)

(参考)再信託受託会社

(中略)

資本金の額：51,000百万円（平成24年9月末日現在）

(後略)

独立監査人の監査報告書

平成25年2月8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

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タ・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成24年6月12日から平成24年12月10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12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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