

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年3月10日提出
【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3番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

### （６）【申込単位】

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

**( 7 ) 【申込期間】**

平成27年 3月11日から平成27年 9月10日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】****< 振替受益権について >**

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

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

**< 受益権の取得申込みの方法 >**

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

**< 申込みコース >**

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< スイッチング >

当ファンドはベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）との間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド  ファン ド・ オブ・ ファン ズ	あり ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ ・ ショ ー ト 型 / 絶対収益追求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	日本  北米  欧州  アジア  オセアニ ア  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

## [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

## [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

## (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

## [ 決算頻度による属性区分 ]

(1) 年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

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

(6) 日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2) 日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3) 北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。



- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1) ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1) 為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2) 為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

#### < ファンドの特色 >

## 1. 国内外の株式・債券・不動産投資信託証券へ分散投資します。

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

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

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

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

### <投資対象とするマザーファンド>

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

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

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

**◆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）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

**日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」**

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

**Jリートマザーファンド(M)「東証REIT指数(配当込み)」**

「東証REIT指数」とは、東証が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

**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」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。

同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

「シティ世界国債インデックス」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

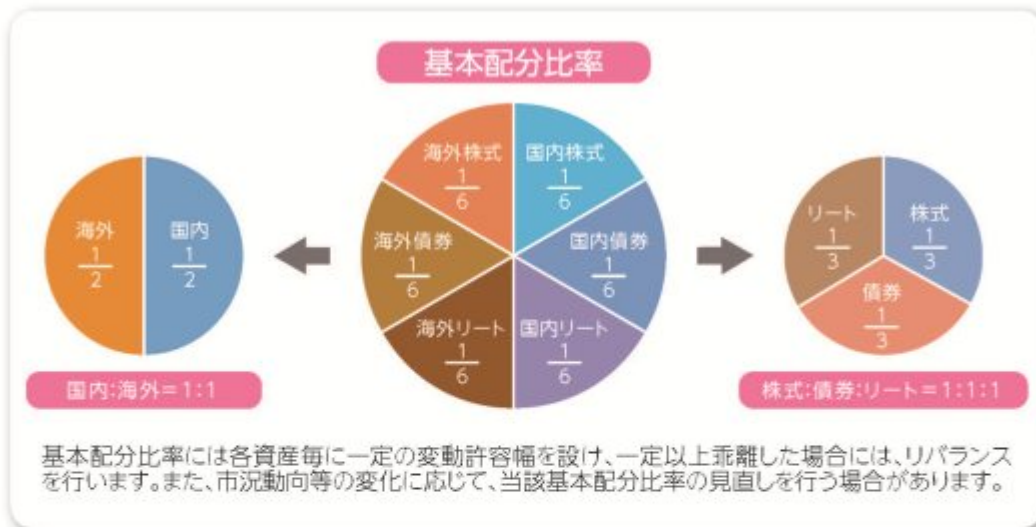
同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

**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」(以下「当インデックス」)とは、S&P Dow Jones Indices LLC (以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）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ます。

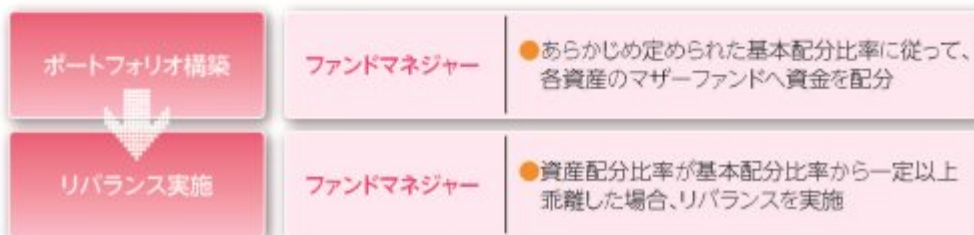
当インデックスはSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC (以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC (以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

## 2. 6つの資産への均等配分を基本配分比率とします。



### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは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、植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。



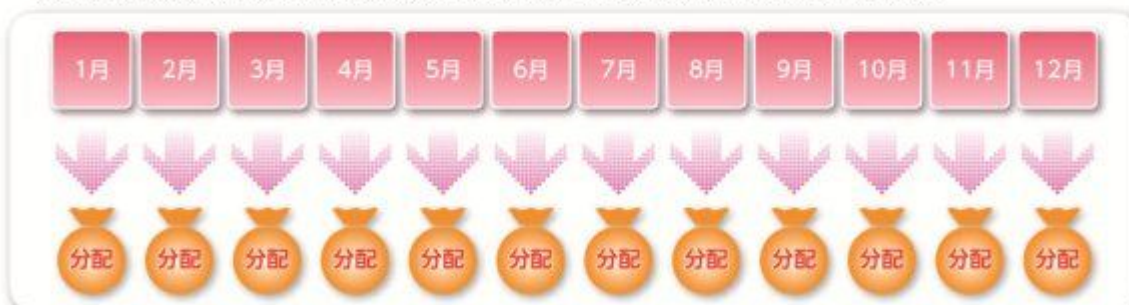
## ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



## 分配方針

- 毎月決算を行い、収益分配を目指します。
- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- 分配金額については、安定した分配を継続的に行うことを目指して、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。



※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

## 【収益分配金に関する留意事項】

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

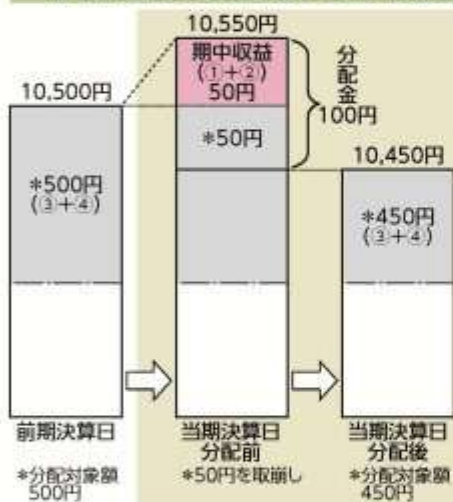
投資信託で分配金が支払われるイメージ



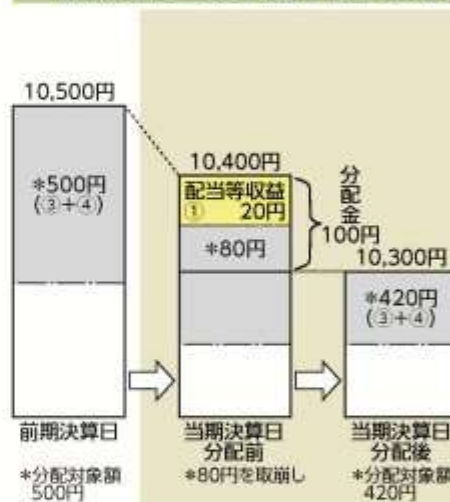
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売却益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(前期決算日から基準価額が上昇した場合)



(前期決算日から基準価額が下落した場合)

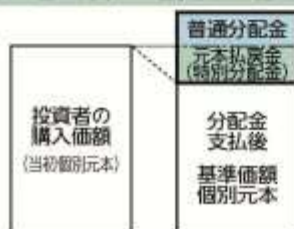


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売却益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

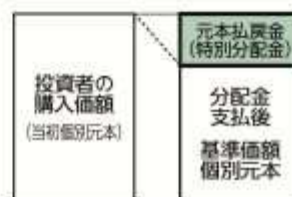
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



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

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

平成19年 8月31日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

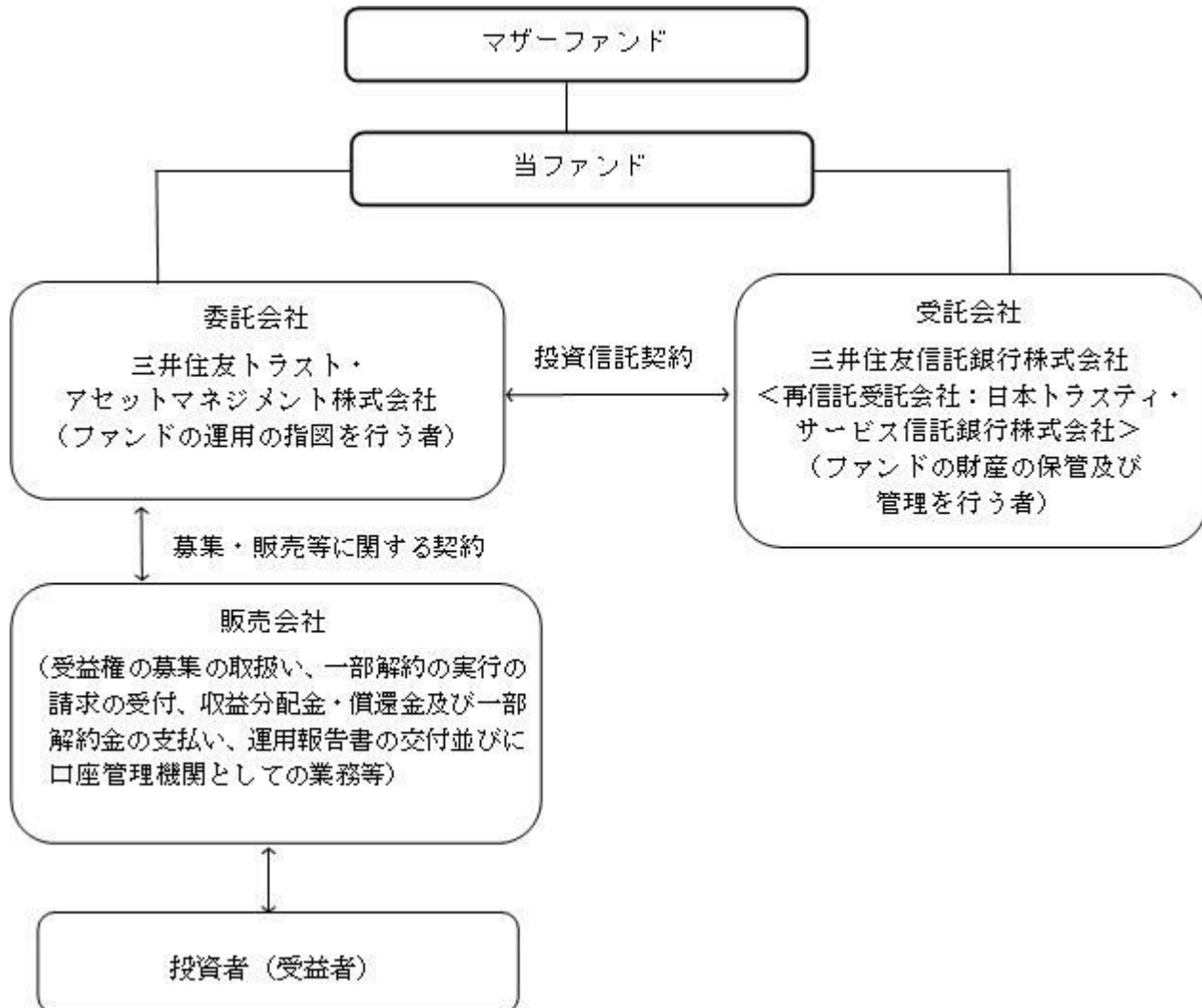
平成24年 4月 1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、

中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンド、中央三井Jリートマザーファンドの名称をJリートマザーファンド（M）に変更

### （３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成26年12月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

## 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 基本方針

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

## 投資対象

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

## 投資態度

- A．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式・債券・不動産投資信託証券（以下これらを「各資産」といいます。）へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、6つの資産への均等配分を基本とします。
- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則として為替ヘッジを行いません。
- E．信託財産の効率的な運用に資するため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

## (2)【投資対象】



## 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条及び第25条に定めるものに限りません。）
- 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド（M）」及び「海外リートマザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．株券又は新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
- 9．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
- 12．外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1．から11．までの証券又は証券の性質を有するもの
- 13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
- 14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16．オプションを表示する証券又は証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 17．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

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

#### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「日本株式マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「日本債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取

引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価

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

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

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総

額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「Jリートマザーファンド（M）」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会

社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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

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

### 3. 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブ（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいいます。）の直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対するエクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として35%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものを除き、新投資口予約権証券に係る取引に限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「海外リートマザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

海外の金融商品取引所等上場（1）の不動産投資信託証券（2）（以下「REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

1：上場に準ずるものを含みます。

2：一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。

#### (2) 投資態度

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

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

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

### 3. 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、ベ

ベンチマークにおける時価の構成割合が10%を超えるREITがある場合には、ベンチマークとの連動性を維持するために、当該REITをベンチマークの構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

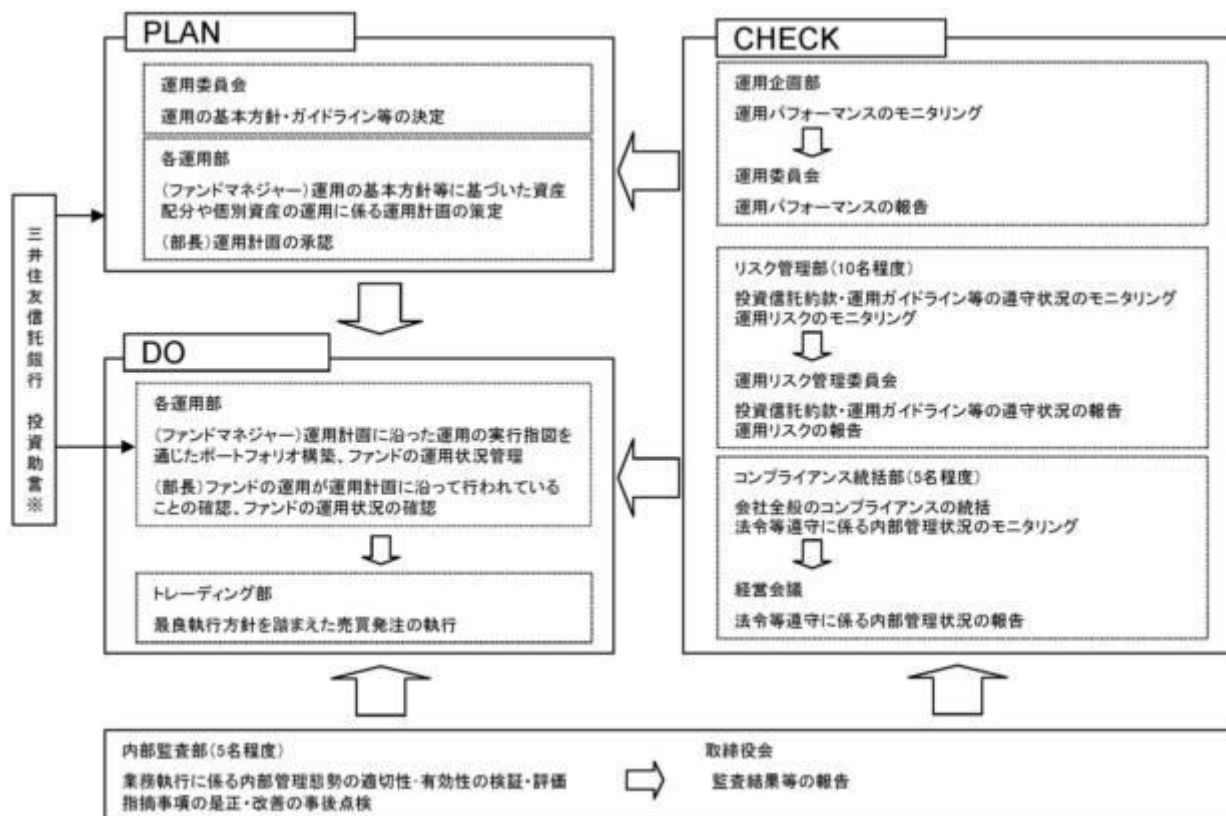
株式への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

### (4) 【配分方針】



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

- ・ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- ・ 分配金額については、安定した分配を継続的に行うことを目指して、上記の範囲内で委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・ 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
- ・ 第1計算期は無分配とし、第2計算期から分配を開始します。  
将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

##### A．株式への投資割合

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

##### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

##### C．新株引受権証券等への投資割合

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

##### D．同一銘柄の株式への投資割合

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

##### E．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

##### F．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

##### G．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で金融商品取引所が有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとして、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

## H．信用取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

## I．先物取引等の運用指図

- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## J．スワップ取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## K．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## L．有価証券の貸付の指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のa．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
  - a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有す

る公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- M．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記N．の規定により借入れた公社債を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記□．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- N．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記□．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- O．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- P．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記□．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- Q．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- R．再投資の指図
- 委託会社は、上記Q．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図

ができます。

#### S．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### T．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### U．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に定める資産への投資等を行うことができます。

ロ．上記イ．の取扱いは、上記H．からN．まで、及びP．からR．までにおける委託会社の指図による取引についても同様とします。

V．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

W．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### A．デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

## B．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

## 3【投資リスク】

### （1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### リートの価格変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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。

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

\*2010年1月～2014年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*各資産クラスの指数

日本株… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※2</sup>

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※3</sup>

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>※5</sup>

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)<sup>※6</sup>

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

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

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

※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の購入水準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （２）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

## （３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.0152%（税抜 0.94%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.162% （税抜 0.15%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.81% （税抜 0.75%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0432% （税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

## （４）【その他の手数料等】

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

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



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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成26年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、平成26年12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	816,071,202	99.53

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,886,872	0.47
合計(純資産総額)		819,958,074	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】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートマザーファンド	121,492,223	1.1596	140,882,382	1.1960	145,304,698	17.72
日本	親投資信託受益証券	Jリートマザーファンド(M)	58,866,328	2.3623	139,059,927	2.4250	142,750,845	17.41
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	64,974,720	2.1520	139,825,598	2.1929	142,483,063	17.38
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	52,801,259	2.5025	132,135,151	2.5104	132,552,280	16.17
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	95,216,722	1.3587	129,370,961	1.3608	129,570,915	15.80
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	95,098,560	1.2881	122,500,061	1.2977	123,409,401	15.05

(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。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.53
合計	99.53

(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。

### 【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
第12特定期間末（平成25年6月10日）	1,113,727,390	1,115,120,751	7,993	8,003
第13特定期間末（平成25年12月10日）	1,045,420,431	1,046,628,716	8,652	8,662
第14特定期間末（平成26年6月10日）	954,452,290	955,507,504	9,045	9,055
第15特定期間末（平成26年12月10日）	831,378,464	832,184,479	10,315	10,325
平成25年12月末日	1,040,582,571		8,884	
平成26年1月末日	989,589,054		8,660	
2月末日	997,586,415		8,767	
3月末日	971,866,704		8,776	
4月末日	962,781,548		8,828	
5月末日	961,239,714		8,966	
6月末日	918,526,562		9,110	
7月末日	898,377,725		9,217	
8月末日	879,262,108		9,300	
9月末日	860,280,060		9,452	
10月末日	855,910,391		9,585	
11月末日	844,324,706		10,279	
12月末日	819,958,074		10,465	

## 【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
第12特定期間	平成24年12月11日～平成25年 6月10日	60
第13特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	60
第14特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	60
第15特定期間	平成26年 6月11日～平成26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
第12特定期間	平成24年12月11日～平成25年 6月10日	24.4
第13特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	9.0
第14特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	5.2
第15特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	14.7

(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
第12特定期間	平成24年12月11日～平成25年 6月10日	2,293,905	219,820,949	1,393,361,465
第13特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	2,597,165	187,672,755	1,208,285,875
第14特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	470,072	153,541,180	1,055,214,767
第15特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	124,890	249,324,474	806,015,183

(注1)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)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)

## 日本株式マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	245,630,493,000	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,857,494,509	1.15
合計(純資産総額)		248,487,987,509	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。

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,153,475,000	0.87

(注1)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。

(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。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,649,300	6,329.40	10,439,079,420	7,558.00	12,465,409,400	5.02

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,466,700	673.89	6,379,514,463	664.50	6,290,622,150	2.53
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	623,900	8,754.40	5,461,870,160	7,210.00	4,498,319,000	1.81
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	892,300	5,315.81	4,743,297,263	4,375.00	3,903,812,500	1.57
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,075,800	4,108.22	4,419,623,076	3,526.00	3,793,270,800	1.53
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	16,330,600	231.46	3,779,880,676	202.50	3,306,946,500	1.33
日本	株式	KDDI	情報・通信業	399,500	6,381.58	2,549,441,210	7,637.00	3,050,981,500	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	461,700	5,799.11	2,677,449,087	6,211.00	2,867,618,700	1.15
日本	株式	キヤノン	電気機器	693,100	3,239.35	2,245,193,485	3,840.50	2,661,850,550	1.07
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,871,000	856.76	2,459,757,960	900.70	2,585,909,700	1.04
日本	株式	ファナック	電気機器	124,500	17,898.54	2,228,368,230	19,945.00	2,483,152,500	1.00
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	742,400	3,238.92	2,404,574,208	3,328.00	2,470,707,200	0.99
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,426,000	1,263.51	1,801,765,260	1,686.50	2,404,949,000	0.97
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	469,000	4,862.00	2,280,278,000	4,996.50	2,343,358,500	0.94
日本	株式	三菱地所	不動産業	877,000	2,845.46	2,495,468,420	2,555.50	2,241,173,500	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	493,600	4,235.64	2,090,711,904	4,358.50	2,151,355,600	0.87
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,456,900	1,255.30	1,828,846,570	1,427.00	2,078,996,300	0.84
日本	株式	三井不動産	不動産業	626,000	3,589.08	2,246,764,080	3,255.00	2,037,630,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	904,200	2,010.21	1,817,631,882	2,217.00	2,004,611,400	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	219,100	8,073.64	1,768,934,524	9,123.00	1,998,849,300	0.80
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	107,100	12,233.91	1,310,251,761	18,140.00	1,942,794,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	485,600	3,296.91	1,600,979,496	3,933.50	1,910,107,600	0.77
日本	株式	ソニー	電気機器	769,000	1,792.45	1,378,394,050	2,472.50	1,901,352,500	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,678,000	957.16	1,606,114,480	1,057.00	1,773,646,000	0.71
日本	株式	信越化学工業	化学	224,600	5,858.38	1,315,792,148	7,866.00	1,766,703,600	0.71
日本	株式	富士重工	輸送用機器	406,800	2,988.24	1,215,616,032	4,300.00	1,749,240,000	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,196,000	1,314.24	1,571,831,040	1,446.00	1,729,416,000	0.70
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	972,100	1,732.74	1,684,396,554	1,768.00	1,718,672,800	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	295,600	5,584.55	1,650,792,980	5,652.00	1,670,731,200	0.67
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,413,600	791.45	1,910,243,720	690.20	1,665,866,720	0.67

(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。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

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	0.44
		建設業	2.69
		食料品	3.93

繊維製品	0.77
パルプ・紙	0.22
化学	5.96
医薬品	4.43
石油・石炭製品	0.49
ゴム製品	0.91
ガラス・土石製品	0.93
鉄鋼	1.58
非鉄金属	0.96
金属製品	0.65
機械	5.21
電気機器	12.90
輸送用機器	11.85
精密機器	1.44
その他製品	1.36
電気・ガス業	2.07
陸運業	3.98
海運業	0.33
空運業	0.62
倉庫・運輸関連業	0.22
情報・通信業	6.65
卸売業	4.13
小売業	4.11
銀行業	8.95
証券、商品先物取引業	1.40
保険業	2.42
その他金融業	1.23
不動産業	3.03
サービス業	2.93
小計	98.85
合計	98.85

(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または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	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	153円		2,118,200,700	2,153,475,000	0.87



(注1)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。

(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。

## 日本債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	286,741,762,750	79.26
	メキシコ	100,828,000	0.03
	小計	286,842,590,750	79.29
地方債証券	日本	21,700,802,782	6.00
特殊債券	日本	30,132,457,410	8.33
	韓国	102,693,000	0.03
	小計	30,235,150,410	8.36
社債券	日本	17,806,254,950	4.92
	オーストラリア	609,523,000	0.17
	アメリカ	308,553,000	0.09
	オランダ	302,579,000	0.08
	スウェーデン	302,215,000	0.08
	フランス	300,942,000	0.08
	ノルウェー	100,919,000	0.03
	韓国	100,343,000	0.03
	小計	19,831,328,950	5.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,143,628,658	0.87
合計(純資産総額)		361,753,501,550	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。

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	日本	1,625,690,000	0.45

(注1)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。

(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。

### 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	5,910,000,000	100.26	5,925,889,800	100.59	5,945,164,500	0.200	2017/9/20	1.64
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,930,000,000	99.87	3,924,891,000	103.15	4,053,991,500	0.600	2023/12/20	1.12
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,975,000,000	100.32	3,987,808,900	101.88	4,049,928,750	0.500	2024/9/20	1.12
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,710,000,000	100.05	3,711,855,000	100.81	3,740,051,000	0.200	2018/12/20	1.03
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	3,630,000,000	100.66	3,654,010,600	102.94	3,736,939,800	0.600	2024/6/20	1.03
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,660,000,000	100.08	3,662,928,000	100.84	3,690,744,000	0.200	2019/3/20	1.02
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	3,580,000,000	99.89	3,576,062,000	103.05	3,689,333,200	0.600	2024/3/20	1.02
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,522,000,000	100.21	3,529,433,100	100.55	3,541,441,440	0.200	2017/6/20	0.98
日本	国債証券	第121回利付国債(5年)	3,400,000,000	99.95	3,398,464,000	100.37	3,412,750,000	0.100	2019/9/20	0.94
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	3,105,000,000	99.87	3,100,963,500	103.31	3,207,775,500	0.600	2023/3/20	0.89
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	3,080,000,000	104.97	3,233,076,000	103.83	3,197,994,800	1.700	2017/3/20	0.88
日本	国債証券	第345回利付国債(2年)	3,190,000,000	100.16	3,195,344,000	100.23	3,197,624,100	0.100	2016/10/15	0.88
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,827,000,000	105.78	2,990,680,800	106.95	3,023,561,310	1.200	2020/12/20	0.84
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,735,000,000	102.04	2,790,794,000	104.95	2,870,382,500	0.800	2022/9/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,735,000,000	101.50	2,776,025,000	104.94	2,870,191,050	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,830,000,000	100.56	2,845,848,000	100.73	2,850,857,100	0.300	2017/3/20	0.79
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	2,640,000,000	100.50	2,653,200,000	101.07	2,668,248,000	0.300	2018/6/20	0.74
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,510,000,000	101.36	2,544,136,000	104.95	2,634,320,300	0.800	2023/9/20	0.73
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	2,535,000,000	100.52	2,548,237,000	100.65	2,551,578,900	0.300	2016/12/20	0.71
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	2,400,000,000	104.60	2,510,400,000	103.39	2,481,384,000	1.700	2016/12/20	0.69
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,300,000,000	106.00	2,438,156,000	106.30	2,445,061,000	1.300	2019/12/20	0.68
日本	国債証券	第119回利付国債(5年)	2,380,000,000	99.73	2,373,574,000	100.40	2,389,520,000	0.100	2019/6/20	0.66
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	2,100,000,000	102.03	2,142,696,400	108.31	2,274,678,000	1.500	2034/6/20	0.63
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	2,260,000,000	100.73	2,276,498,000	100.63	2,274,260,600	0.400	2016/6/20	0.63
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,150,000,000	106.04	2,279,946,000	105.59	2,270,292,500	1.500	2018/9/20	0.63
日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	2,060,000,000	102.29	2,107,196,000	106.23	2,188,420,400	1.400	2034/9/20	0.60
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	2,070,000,000	104.62	2,165,774,000	105.55	2,184,947,100	1.000	2020/9/20	0.60

日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	105.21	2,156,805,000	104.49	2,142,065,500	1.500	2017/12/20	0.59
日本	国債証券	第343回利付国債（2年）	2,050,000,000	100.05	2,051,107,000	100.21	2,054,428,000	0.100	2016/8/15	0.57
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	1,890,000,000	103.71	1,960,119,000	106.31	2,009,429,100	1.000	2022/3/20	0.56

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	79.29
地方債証券	6.00
特殊債券	8.36
社債券	5.48
合計	99.13

(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。

#### 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	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	11円		1,624,443,564	1,625,690,000	0.45

(注1)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。

(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。

#### 外国株式マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	138,968,942,330	56.07
	イギリス	19,260,786,465	7.77
	カナダ	9,964,588,932	4.02
	スイス	9,465,771,891	3.82
	ドイツ	8,763,131,931	3.54

	フランス	8,608,750,535	3.47
	オーストラリア	6,455,336,130	2.60
	オランダ	3,510,595,544	1.42
	スペイン	3,379,196,735	1.36
	アイルランド	3,095,981,792	1.25
	スウェーデン	2,906,803,498	1.17
	香港	2,505,545,134	1.01
	イタリア	1,968,291,926	0.79
	シンガポール	1,500,457,370	0.61
	デンマーク	1,451,422,893	0.59
	ベルギー	1,265,328,242	0.51
	ジャージー	1,248,357,159	0.50
	バミューダ	877,075,993	0.35
	フィンランド	870,396,215	0.35
	キュラソー	856,703,198	0.35
	ノルウェー	564,379,930	0.23
	イスラエル	543,031,176	0.22
	ルクセンブルク	389,996,545	0.16
	オーストリア	212,095,309	0.09
	ケイマン	205,616,851	0.08
	ニュージーランド	166,813,153	0.07
	ポルトガル	143,826,198	0.06
	パナマ	129,109,363	0.05
	リベリア	114,682,904	0.05
	英ヴァージン諸島	114,653,476	0.05
	ガーンジー	59,723,295	0.02
	マン島	40,983,227	0.02
	モーリシャス	19,964,038	0.01
	小計	229,628,339,378	92.64
投資信託受益証券	オーストラリア	126,894,462	0.05
	香港	33,166,400	0.01
	シンガポール	24,690,448	0.01
	小計	184,751,310	0.07
投資証券	アメリカ	3,938,577,170	1.59
	オーストラリア	551,296,815	0.22
	イギリス	325,753,341	0.13

	フランス	299,748,834	0.12
	香港	119,083,020	0.05
	シンガポール	94,879,584	0.04
	カナダ	32,504,082	0.01
	オランダ	28,731,541	0.01
	小計	5,390,574,387	2.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,657,833,577	5.11
合計(純資産総額)		247,861,498,652	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。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,977,548,522	2.82
	買建	カナダ	567,063,360	0.23
	買建	ドイツ	1,995,770,496	0.81
	買建	イギリス	1,452,837,818	0.59
	買建	オーストラリア	670,063,275	0.27

(注1)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。

(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。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,008,454,600	0.40
	売建		978,963,840	0.39

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

(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。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
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	378,834	8,825.46	3,343,386,397	13,731.85	5,202,091,852	2.10
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	269,905	10,825.39	2,921,826,888	11,219.58	3,028,223,034	1.22
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	495,211	4,361.49	2,159,862,281	5,720.09	2,832,655,203	1.14
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	178,351	10,698.81	1,908,143,909	12,697.53	2,264,617,441	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	313,424	5,398.22	1,691,934,526	6,715.84	2,104,905,593	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	634,480	3,007.72	1,908,339,772	3,098.13	1,965,704,695	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	171,235	9,270.29	1,587,398,965	11,167.75	1,912,310,014	0.77
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	203,745	8,099.69	1,650,273,376	8,921.84	1,817,782,328	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	237,643	6,808.66	1,618,031,339	7,589.82	1,803,669,495	0.73
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	145,098	8,696.52	1,261,847,659	11,321.30	1,642,699,438	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	120,007	13,413.59	1,609,725,715	13,660.72	1,639,382,745	0.66
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	400,891	3,717.76	1,490,417,325	3,784.06	1,516,997,401	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	262,409	5,717.68	1,500,372,396	5,732.15	1,504,168,405	0.61
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	44,292	30,303.83	1,342,217,681	32,886.00	1,456,586,712	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	663,543	2,011.97	1,335,034,914	2,183.16	1,448,620,868	0.58
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,210,854	1,174.54	1,422,206,628	1,159.39	1,403,862,879	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	313,197	2,891.99	905,764,002	4,482.04	1,403,764,301	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	328,206	3,857.60	1,266,087,466	4,111.96	1,349,570,108	0.54
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	72,495	13,279.78	962,718,231	18,329.62	1,328,806,346	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	249,545	4,584.51	1,144,043,170	5,166.77	1,289,342,368	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	182,073	6,481.97	1,180,192,361	6,959.35	1,267,110,006	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	191,773	5,816.53	1,115,454,846	6,597.70	1,265,261,010	0.51

アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	225,291	4,429.00	997,815,416	5,498.28	1,238,714,239	0.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	124,805	7,563.30	943,938,530	9,646.41	1,203,920,325	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	102,644	9,108.75	934,959,356	11,512.52	1,181,691,616	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,925	70,023.87	1,255,178,022	64,772.72	1,161,051,015	0.47
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	59,935	21,056.46	1,262,019,440	19,349.48	1,159,711,114	0.47
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	18,082	69,808.09	1,262,269,956	63,931.28	1,156,005,432	0.47
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	95,611	9,222.07	881,731,813	11,729.51	1,121,470,659	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	95,029	9,570.46	909,471,671	11,660.80	1,108,114,306	0.45

(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。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.15
		素材	4.76
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	0.83
		運輸	2.03
		自動車・自動車部品	1.59
		耐久消費財・アパレル	1.58
		消費者サービス	1.57
		メディア	2.98
		小売	3.17
		食品・生活必需品小売り	2.12
		食品・飲料・タバコ	5.83
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	3.26
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.28
		銀行	9.13
		各種金融	3.89
		保険	4.08
		不動産	0.65
		ソフトウェア・サービス	6.80
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.36		

		電気通信サービス	2.99
		公益事業	3.33
		半導体・半導体製造装置	1.75
		小計	92.64
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.17
合計			94.89

(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または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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	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	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	111	アメリカドル	54,548,674.5	6,575,842,710	57,880,950	6,977,548,522	2.82
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	32	カナダドル	5,141,712	532,835,615	5,472,000	567,063,360	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	62	スイスフラン	5,396,914	657,344,125	5,544,660	675,339,588	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	283	ユーロ	8,635,603.5	1,265,461,336	9,010,720	1,320,430,908	0.53
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	50	オーストラリアドル	6,401,700	627,814,719	6,832,500	670,063,275	0.27
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	118	イギリスポンド	7,429,722.5	1,389,580,999	7,767,940	1,452,837,818	0.59

(注1)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。

(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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,075,000.00	714,433,972	732,159,000	0.29
	ユーロ	買建	1,120,000.00	164,505,376	164,113,600	0.06
	イギリスポンド	買建	600,000.00	111,125,820	112,182,000	0.04
	アメリカドル	売建	5,067,000.00	610,667,239	610,776,180	0.24
	カナダドル	売建	361,000.00	37,396,170	37,399,600	0.01
	ユーロ	売建	910,000.00	133,326,830	133,342,300	0.05



イギリスポンド	売建	538,000.00	100,595,024	100,606,000	0.04
スイスフラン	売建	300,000.00	36,540,660	36,540,000	0.01
スウェーデンクローナ	売建	782,000.00	12,047,648	12,050,620	0.00
オーストラリアドル	売建	321,000.00	31,461,980	31,461,210	0.01
香港ドル	売建	1,081,000.00	16,794,091	16,787,930	0.00

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

(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。

## 外国債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	102,832,337,589	38.48
	イタリア	26,066,908,281	9.75
	フランス	26,014,347,991	9.73
	イギリス	21,757,094,704	8.14
	ドイツ	21,678,209,845	8.11
	スペイン	14,137,796,143	5.29
	ベルギー	7,004,373,148	2.62
	オランダ	6,954,501,106	2.60
	カナダ	6,017,613,447	2.25
	オーストリア	4,335,228,736	1.62
	オーストラリア	4,286,137,924	1.60
	メキシコ	2,761,305,599	1.03
	アイルランド	2,180,060,927	0.82
	デンマーク	1,938,232,961	0.73
	フィンランド	1,708,905,518	0.64
	ポーランド	1,622,015,784	0.61
	南アフリカ	1,360,505,146	0.51
	マレーシア	1,282,525,329	0.48
	スウェーデン	1,266,235,835	0.47
	シンガポール	994,468,303	0.37
スイス	871,594,167	0.33	
ノルウェー	708,671,667	0.27	
	小計	257,779,070,150	96.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,482,916,747	3.55
合計(純資産総額)		267,261,986,897	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。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,430,810,805	0.54
	買建	ドイツ	2,279,693,472	0.85

(注1)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。

(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。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		5,052,137,900	1.89

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

(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。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/16	15,000,000	12,057.35	1,808,603,170	12,054.52	1,808,179,370	0.375	2016/3/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	13,000,000	12,468.91	1,620,959,568	12,546.85	1,631,090,942	2.625	2020/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/29/16	12,850,000	12,618.19	1,621,437,996	12,370.26	1,589,579,239	2.625	2016/2/29	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	9,800,000	13,282.19	1,301,655,502	13,183.03	1,291,937,647	3.625	2020/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	9,000,000	12,156.26	1,094,063,580	12,644.09	1,137,968,458	2.750	2024/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/16	9,150,000	12,536.72	1,147,110,716	12,334.94	1,128,647,848	2.250	2016/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/16	9,050,000	12,087.02	1,093,875,408	12,065.59	1,091,936,370	0.625	2016/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 10/15/16	9,000,000	12,069.59	1,086,263,809	12,051.70	1,084,653,331	0.625	2016/10/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	9,000,000	12,050.99	1,084,589,764	12,040.87	1,083,678,580	0.625	2016/12/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 07/31/16	8,500,000	12,351.43	1,049,871,595	12,233.70	1,039,865,008	1.500	2016/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	7,900,000	13,180.93	1,041,294,023	13,115.69	1,036,140,198	3.500	2020/5/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 5.75% 10/25/32	4,250,000	20,634.29	876,957,640	24,367.33	1,035,611,552	5.750	2032/10/25	0.39
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	4,550,000	19,618.77	892,654,272	22,719.26	1,033,726,718	5.500	2029/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	8,550,000	12,063.07	1,031,393,070	12,035.92	1,029,071,897	1.500	2019/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/18	8,520,000	12,033.10	1,025,220,390	12,023.68	1,024,417,979	1.375	2018/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/15/16	8,500,000	12,061.12	1,025,195,340	12,046.52	1,023,954,531	0.625	2016/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	5,950,000	16,559.02	985,261,690	17,188.92	1,022,740,870	3.500	2020/4/25	0.38

フランス	国債証券	FRTR 3.25% 04/25/16	6,600,000	15,615.30	1,030,609,958	15,290.13	1,009,148,589	3.250	2016/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	7,950,000	12,134.39	964,684,029	12,647.39	1,005,467,527	2.750	2023/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,700,000	11,880.75	914,818,509	12,919.80	994,824,982	3.125	2044/8/15	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000	15,984.87	951,100,139	16,623.27	989,085,029	4.250	2019/2/1	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.375% 03/31/16	7,900,000	12,569.92	993,024,264	12,352.84	975,874,616	2.375	2016/3/31	0.37
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	5,550,000	16,300.15	904,658,718	17,469.10	969,535,420	3.250	2021/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,000,000	17,369.38	868,469,310	19,188.82	959,441,342	4.250	2023/10/25	0.36
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 03/07/19	4,500,000	21,181.05	953,147,429	21,309.54	958,929,462	4.500	2019/3/7	0.36
イタリア	国債証券	BTPS 6% 05/01/31	4,450,000	17,846.88	794,186,425	21,108.64	939,334,808	6.000	2031/5/1	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,950,000	11,160.51	887,261,261	11,698.29	930,014,411	1.750	2023/5/15	0.35
イタリア	国債証券	BTPS 5% 03/01/25	4,950,000	16,145.77	799,215,971	18,642.37	922,797,769	5.000	2025/3/1	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 10/25/19	5,350,000	16,729.00	895,001,842	17,180.56	919,160,463	3.750	2019/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	6,500,000	12,273.39	797,770,485	14,136.37	918,864,120	3.625	2044/2/15	0.34

(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。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.45
合計	96.45

(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。

#### 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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	47	アメリカ ドル	5,592,086.32	674,126,005	5,576,476.68	672,244,263	0.25
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	27	アメリカ ドル	3,428,264.25	413,277,256	3,412,547.01	411,382,542	0.15
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	20	アメリカ ドル	2,894,455	348,926,550	2,880,000	347,184,000	0.13
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	27	ユーロ	2,997,648	439,275,338	2,999,430	439,536,472	0.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	33	ユーロ	4,288,152	628,385,794	4,298,910	629,962,272	0.24
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	53	ユーロ	8,220,632	1,204,651,413	8,258,460	1,210,194,728	0.45

(注1)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。

(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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	17,750,000.00	2,107,395,375	2,139,230,000	0.80
	カナダドル	買建	1,950,000.00	198,787,680	201,961,500	0.07
	ユーロ	買建	15,630,000.00	2,289,083,835	2,290,263,900	0.85
	イギリスポンド	買建	2,250,000.00	416,174,400	420,682,500	0.15

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

(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。

## Jリートマザーファンド(M)

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	101,289,064,000	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		971,019,765	0.95
合計(純資産総額)		102,260,083,765	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。

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	14,882	567,216.53	8,441,316,399	604,000	8,988,728,000	8.79
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	13,475	572,926.68	7,720,187,013	580,000	7,815,500,000	7.64
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	23,317	223,914.37	5,221,011,365	254,000	5,922,518,000	5.79
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,449	168,245.31	4,281,674,894	188,900	4,807,316,100	4.70
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	14,846	252,900.97	3,754,567,800	321,000	4,765,566,000	4.66
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,920	240,738.09	4,073,288,482	260,600	4,409,352,000	4.31
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	15,334	186,513.42	2,859,996,782	241,000	3,695,494,000	3.61
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,229	142,475.08	3,024,603,473	168,800	3,583,455,200	3.50
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	3,225	949,226.61	3,061,255,817	1,046,000	3,373,350,000	3.30
日本	投資証券	G L P投資法人	23,174	114,736.86	2,658,911,993	133,600	3,096,046,400	3.03

日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	19,640	130,958.14	2,572,017,869	155,600	3,055,984,000	2.99
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	17,479	153,963.33	2,691,125,045	172,400	3,013,379,600	2.95
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	4,451	561,179.55	2,497,810,177	673,000	2,995,523,000	2.93
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	5,157	561,639.19	2,896,373,302	550,000	2,836,350,000	2.77
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,708	363,757.83	2,440,087,523	418,000	2,803,944,000	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,201	60,642.13	2,134,663,618	77,000	2,710,477,000	2.65
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	9,846	240,311.6	2,366,108,013	269,500	2,653,497,000	2.59
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,668	391,982.7	1,829,775,243	474,500	2,214,966,000	2.17
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,720	449,477.37	1,672,055,835	555,000	2,064,600,000	2.02
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,744	142,163.39	1,669,566,852	170,400	2,001,177,600	1.96
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,287	453,330.23	1,490,096,466	600,000	1,972,200,000	1.93
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	3,262	482,851.21	1,575,060,647	580,000	1,891,960,000	1.85
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	11,724	139,409.21	1,634,433,578	160,500	1,881,702,000	1.84
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,648	174,345.16	1,682,082,103	182,100	1,756,900,800	1.72
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	2,718	496,859.17	1,350,463,244	595,000	1,617,210,000	1.58
日本	投資証券	プレミア投資法人	2,681	465,666.92	1,248,453,012	590,000	1,581,790,000	1.55
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,115	574,323.85	1,214,694,942	677,000	1,431,855,000	1.40
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	3,502	253,108.02	886,384,286	360,500	1,262,471,000	1.23
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,126	142,806.55	1,017,639,475	163,600	1,165,813,600	1.14
日本	投資証券	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	8,499	105,733.91	898,632,501	136,200	1,157,563,800	1.13

(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。

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.05
合計	99.05

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外リートマザーファンド

## 投資状況

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	476,271,545	69.04
	オーストラリア	55,591,530	8.06
	イギリス	42,611,146	6.18
	フランス	29,280,604	4.24
	シンガポール	22,668,942	3.29
	カナダ	15,153,492	2.20
	香港	12,039,304	1.75
	オランダ	6,989,687	1.01
	ベルギー	3,352,057	0.49
	ニュージーランド	2,119,432	0.31
	スペイン	1,657,704	0.24
	アイルランド	1,383,430	0.20
	ドイツ	915,207	0.13
	イタリア	506,901	0.07
	ガーンジー	481,602	0.07
	マン島	476,440	0.07
イスラエル	243,170	0.04	
	小計	671,742,193	97.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,140,949	2.63
合計(純資産総額)		689,883,142	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。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	1,737	20,787.64	36,108,134	22,483.78	39,054,327	5.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	808	21,123.97	17,068,173	22,826.14	18,443,523	2.67
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	2,019	8,094.93	16,343,669	8,889.35	17,947,612	2.60
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	547	30,304.47	16,576,546	31,550.06	17,257,884	2.50
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	1,806	8,103.37	14,634,688	9,236.54	16,681,193	2.42
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	729	18,785.30	13,694,488	20,184.89	14,714,786	2.13

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	2,786	4,984.74	13,887,493	5,245.13	14,612,934	2.12
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1,641	7,805.61	12,809,011	8,770.01	14,391,591	2.09
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	971	12,883.17	12,509,566	14,357.50	13,941,137	2.02
アメリカ	投資証券	HCP INC	2,557	5,204.14	13,306,995	5,374.11	13,741,622	1.99
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	852	14,634.76	12,468,824	15,761.91	13,429,149	1.95
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	4,201	2,723.22	11,440,266	2,910.07	12,225,233	1.77
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	3,478	2,992.05	10,406,353	3,454.96	12,016,361	1.74
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	29,623	347.16	10,284,152	356.97	10,574,665	1.53
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	10,669	753.17	8,035,652	919.89	9,814,377	1.42
香港	投資証券	LINK REIT	13,000	728.82	9,474,738	753.69	9,797,970	1.42
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,334	1,993.73	8,640,868	2,163.93	9,378,503	1.36
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	352	23,436.12	8,249,516	25,496.32	8,974,706	1.30
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	5,685	1,344.74	7,644,879	1,461.63	8,309,419	1.20
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	782	7,970.76	6,233,139	10,126.19	7,918,688	1.15
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	529	13,167.67	6,965,700	14,655.26	7,752,634	1.12
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	1,227	5,380.14	6,601,440	5,975.66	7,332,139	1.06
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	2,283	2,805.19	6,404,268	3,122.24	7,128,085	1.03
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	376	15,096.47	5,676,275	16,537.04	6,217,930	0.90
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	753	8,121.45	6,115,455	8,100.96	6,100,023	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	1,398	3,635.78	5,082,832	3,806.96	5,322,143	0.77
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	12,755	408.95	5,216,182	412.87	5,266,217	0.76
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	5,044	1,584.02	7,989,833	1,022.26	5,156,300	0.75
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	8,507	538.40	4,580,205	591.36	5,030,717	0.73
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	4,357	1,122.17	4,889,338	1,139.01	4,962,678	0.72

(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。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.37
合計	97.37

(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。

#### 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


**運用実績**

 当初設定日：2007年8月31日  
 作成基準日：2014年12月30日

**基準価額・純資産の推移**


基準価額	10,465円
純資産総額	8.20億円

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

**分配の推移(1万口当たり、税引前)**

設定来分配金合計額:1,390円 直近1年間分配金合計額:120円

決算期	2014年8月	2014年9月	2014年10月	2014年11月	2014年12月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位銘柄	国/地域	業種	業種	利率	償還期限	売買投資比率
海外リートマザーファンド	17.7%	SIMON PROPERTY GROUP PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
リートマザーファンド(M)	17.4%	日本ビルファンド投資法人 ジャパニリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.5%
外国株式マザーファンド	17.4%	APPLE INC EXXON MOBIL	アメリカ	株式	テクノロジー/エネルギー	-	-	0.4%
外国債券マザーファンド	16.2%	T 0.375% 03/15/16 T 2.625% 11/15/20	アメリカ	国債証券	-	0.375%	2016/03/15	0.1%
日本株式マザーファンド	15.8%	トヨタ自動車 三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	輸送用機器 銀行業	-	-	0.8%
日本債券マザーファンド	15.1%	第106回利付国債(5年) 第335回利付国債(10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)を再投資したもとして計算しております。  
 ※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】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >



当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

< その他 >

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

< スイッチング >

当ファンドはベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）との間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

### < 問い合わせ先 >

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

#### （照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### < 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約しません。

### < 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

### < 一部解約代金の支払い >

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

### < 受付不可日 >

ありません。

### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

#### （照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）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投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

イ．国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

ハ．公社債等

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

- 1．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- 2．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- 3．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

#### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

#### （照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（平成19年 8月31日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### （4）【計算期間】

原則として、毎月11日から翌月10日までとします。

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

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

#### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

委託会社は上記（1）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ファンドの繰上償還において、上記からまでの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### <投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

##### (1)投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

##### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超

えるときは、当該約款変更を行いません。

委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

#### < 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を經由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎年6月及び12月の決算時並びに償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドの計算期間は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15特定期間(平成26年 6月11日から平成26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。

#### 1【財務諸表】



## 【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14特定期間 （平成26年 6月10日現在）	第15特定期間 （平成26年12月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,007,369	1,572,105
親投資信託受益証券	950,275,952	826,356,702
未収入金	2,000,000	8,410,600
未収利息	5	1
流動資産合計	956,283,326	836,339,408
資産合計	956,283,326	836,339,408
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,055,214	806,015
未払解約金	-	3,444,001
未払受託者報酬	32,840	30,094
未払委託者報酬	738,890	677,082
その他未払費用	4,092	3,752
流動負債合計	1,831,036	4,960,944
負債合計	1,831,036	4,960,944
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,055,214,767	806,015,183
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,762,477	25,363,281
（分配準備積立金）	23,017,695	28,521,694
元本等合計	954,452,290	831,378,464
純資産合計	954,452,290	831,378,464
負債純資産合計	956,283,326	836,339,408

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14特定期間 自 平成25年12月11日 至 平成26年 6月10日	第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日
営業収益		
受取利息	1,061	842
有価証券売買等損益	54,935,404	123,547,550
営業収益合計	54,936,465	123,548,392
営業費用		
受託者報酬	208,865	189,460
委託者報酬	4,699,494	4,262,698
その他費用	26,047	23,620
営業費用合計	4,934,406	4,475,778
営業利益又は営業損失（ ）	50,002,059	119,072,614
経常利益又は経常損失（ ）	50,002,059	119,072,614
当期純利益又は当期純損失（ ）	50,002,059	119,072,614
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（ ）	365,400	4,175,844
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	162,865,444	100,762,477
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,202,189	16,714,055
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	19,202,189	16,714,055
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,705	7,477
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,705	7,477
分配金	6,674,176	5,477,590
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	100,762,477	25,363,281

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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。
-----------------	---------------------------------------

( 貸借対照表に関する注記 )

	第14特定期間 (平成26年 6月10日現在)	第15特定期間 (平成26年12月10日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	1,055,214,767口	806,015,183口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 100,762,477円	元本の欠損 - 円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9045円 (1万口当たり純資産額) (9,045円)	1口当たり純資産額 1.0315円 (1万口当たり純資産額) (10,315円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第14特定期間 自 平成25年12月11日 至 平成26年 6月10日			第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日		
分配金の計算過程 第76期 自 平成25年12月11日 至 平成26年 1月10日			分配金の計算過程 第82期 自 平成26年 6月11日 至 平成26年 7月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,445,254円	費用控除後の配当等収益額	A	1,863,352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	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
収益調整金額	C	18,807,570円	収益調整金額	C	16,348,230円
分配準備積立金額	D	19,948,914円	分配準備積立金額	D	21,888,662円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	41,201,738円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	40,100,244円
当ファンドの期末残存口数	F	1,155,055,758口	当ファンドの期末残存口数	F	1,003,456,535口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	356円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	399円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円

第14特定期間 自 平成25年12月11日 至 平成26年 6月10日			第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日		
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	1,155,055円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	1,003,456円
第77期 自 平成26年 1月11日 至 平成26年 2月10日			第83期 自 平成26年 7月11日 至 平成26年 8月11日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	730,741円	費用控除後の配当等収益額	A	557,078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	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
収益調整金額	C	18,605,532円	収益調整金額	C	15,644,172円
分配準備積立金額	D	21,010,955円	分配準備積立金額	D	21,768,862円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	40,347,228円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	37,970,112円
当ファンドの期末残存口数	F	1,142,647,877口	当ファンドの期末残存口数	F	960,242,476口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	353円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	395円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	1,142,647円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	960,242円
第78期 自 平成26年 2月11日 至 平成26年 3月10日			第84期 自 平成26年 8月12日 至 平成26年 9月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,208,186円	費用控除後の配当等収益額	A	1,767,631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	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
収益調整金額	C	18,463,945円	収益調整金額	C	15,095,332円
分配準備積立金額	D	20,441,861円	分配準備積立金額	D	20,615,581円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	41,113,992円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	37,478,544円
当ファンドの期末残存口数	F	1,133,939,799口	当ファンドの期末残存口数	F	926,540,429口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	362円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	404円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	1,133,939円	収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	926,540円
第79期 自 平成26年 3月11日 至 平成26年 4月10日			第85期 自 平成26年 9月11日 至 平成26年10月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,635,363円	費用控除後の配当等収益額	A	1,774,434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	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
収益調整金額	C	17,923,738円	収益調整金額	C	14,740,417円
分配準備積立金額	D	20,871,451円	分配準備積立金額	D	20,945,607円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	41,430,552円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	37,460,458円
当ファンドの期末残存口数	F	1,100,307,045口	当ファンドの期末残存口数	F	904,583,588口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	376円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	414円

第14特定期間 自 平成25年12月11日 至 平成26年 6月10日			第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日		
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	1,100,307円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	904,583円
第80期 自 平成26年 4月11日 至 平成26年 5月12日			第86期 自 平成26年10月11日 至 平成26年11月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,750,580円	費用控除後の配当等収益額	A	1,149,074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	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
収益調整金額	C	17,709,560円	収益調整金額	C	14,286,935円
分配準備積立金額	D	22,133,549円	分配準備積立金額	D	21,144,315円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	41,593,689円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	36,580,324円
当ファンドの期末残存口数	F	1,087,014,125口	当ファンドの期末残存口数	F	876,754,971口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	382円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	417円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	1,087,014円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	876,754円
第81期 自 平成26年 5月13日 至 平成26年 6月10日			第87期 自 平成26年11月11日 至 平成26年12月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,942,701円	費用控除後の配当等収益額	A	1,300,886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	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	8,338,193円
収益調整金額	C	17,191,484円	収益調整金額	C	13,134,192円
分配準備積立金額	D	22,130,208円	分配準備積立金額	D	19,688,630円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	41,264,393円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	42,461,901円
当ファンドの期末残存口数	F	1,055,214,767口	当ファンドの期末残存口数	F	806,015,183口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	391円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	526円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	1,055,214円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	806,015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

	第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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

	第15特定期間 (平成26年12月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)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についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては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。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第14特定期間	第15特定期間
	自 平成25年12月11日 至 平成26年 6月10日	自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,208,285,875円	1,055,214,767円
期中追加設定元本額	470,072円	124,890円
期中一部解約元本額	153,541,180円	249,324,474円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14特定期間 （平成26年 6月10日現在）	第15特定期間 （平成26年12月10日現在）
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	24,667,063	39,417,334
合計	24,667,063	39,417,334

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	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	98,393,667	133,687,475	
	日本債券マザーファンド	95,910,185	123,541,909	
	外国株式マザーファンド	67,005,775	144,196,427	
	外国債券マザーファンド	54,513,933	136,421,117	
	Jリートマザーファンド(M)	60,669,734	143,320,112	
	海外リートマザーファンド	125,206,677	145,189,662	
合計		501,699,971	826,356,702	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「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26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

#### 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,206,735,523
株式	247,338,748,740
派生商品評価勘定	16,828,920
未収入金	1,711,347,531
未収配当金	71,042,615
未収利息	2,709
差入委託証拠金	13,970,000
流動資産合計	251,358,676,038
資産合計	251,358,676,038
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,622,080



	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
前受金	8,209,000
未払金	5,700,000
未払解約金	1,049,182,845
流動負債合計	1,071,713,925
負債合計	1,071,713,925
純資産の部	
元本等	
元本	184,209,623,849
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,077,338,264
元本等合計	250,286,962,113
純資産合計	250,286,962,113
負債純資産合計	251,358,676,038

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	184,209,623,849口

2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	有価証券	5,050,700,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3587円 (13,587円)

(注) 担保資産の有価証券は、「株式」であります。上記金額には、約定未受渡株式を含んでおります。

## (金融商品に関する注記)

### 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

### 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>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>
----------------------------	---

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	210,678,487,456円
期中追加設定元本額	8,957,254,139円
期中一部解約元本額	35,426,117,746円
期末元本額	184,209,623,849円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	1,276,304,585円
D C 日本株式インデックスファンド	350,399,608円
D C 日本株式インデックスファンド L	47,977,469,555円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,381,425,471円
D C バランスファンド 3 0	1,381,842,960円
D C バランスファンド 5 0	2,165,466,614円
D C バランスファンド 7 0	1,218,261,417円
ベスタ・世界 6 資産ファンド ( 毎月決算型 )	98,393,667円
ベスタ・世界 6 資産ファンド ( 1 年決算型 )	53,310,431円
新生・4 分散ファンド	104,456,189円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	696,848,538円

4資産インデックスバランスオープン（分配型）	21,810,820円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	77,279,010円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	32,607,142円
日本株式インデックスe	1,859,987,414円
インデックスコレクション（国内株式）	5,777,430,713円
インデックスコレクション（バランス株式30）	918,833,303円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,032,443,686円
インデックスコレクション（バランス株式70）	994,134,757円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	10,068,583,243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）	7,834,678,900円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,575,549,645円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	13,868,767,379円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	5,598,239,875円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,865,202,000円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	648,603,080円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,477,260,228円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,893,679,844円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,508,615,323円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	25,454,329,255円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,903,753,155円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	8,518,033,648円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,474,102,620円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	107,017,088円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	1,468,546,408円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	608,824,655円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	5,338,839,215円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	182,321,023円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	154,885,661円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	111,770,232円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	2,037,840,908円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,882,674,949円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	59,809,210円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	916,604,924円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	14,436,753,652円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	301,565,184円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	102,475,916円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	31,946,030円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	348,304,811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）	9,390,286円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,949,622円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

平成26年12月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	19,442,400,489
合計	19,442,400,489

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(平成26年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,265,113,160	-	2,273,320,000	8,206,840
合計		2,265,113,160	-	2,273,320,000	8,206,840

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	57,000	270.00	15,390,000	
日本水産	165,900	383.00	63,539,700	
マルハニチロ	25,900	1,764.00	45,687,600	
サカタのタネ	19,900	1,826.00	36,337,400	
ホクト	15,000	1,987.00	29,805,000	
住石ホールディングス	37,400	121.00	4,525,400	
日鉄鉱業	37,000	428.00	15,836,000	

三井松島産業	88,000	128.00	11,264,000
国際石油開発帝石	711,000	1,245.00	885,195,000
日本海洋掘削	4,000	4,100.00	16,400,000
石油資源開発	19,200	3,535.00	67,872,000
K&Oエナジーグループ	7,500	1,463.00	10,972,500
ショーボンドホールディングス	12,000	4,595.00	55,140,000
ミライト・ホールディングス	41,500	1,340.00	55,610,000
タマホーム	9,000	588.00	5,292,000
サンヨーホームズ	1,400	623.00	872,200
ダイセキ環境ソリューション	1,600	1,817.00	2,907,200
安藤・間	90,100	719.00	64,781,900
東急建設	48,400	532.00	25,748,800
コムシスホールディングス	60,100	1,741.00	104,634,100
ミサワホーム	17,100	1,061.00	18,143,100
高松コンストラクショングループ	10,200	2,398.00	24,459,600
東建コーポレーション	5,200	4,900.00	25,480,000
ヤマウラ	7,800	385.00	3,003,000
大成建設	682,000	624.00	425,568,000
大林組	405,000	722.00	292,410,000
清水建設	413,000	791.00	326,683,000
飛鳥建設	87,900	276.00	24,260,400
長谷工コーポレーション	169,200	975.00	164,970,000
松井建設	16,000	555.00	8,880,000
銭高組	19,000	364.00	6,916,000
鹿島建設	594,000	467.00	277,398,000
不動テトラ	103,600	239.00	24,760,400
鉄建建設	82,000	460.00	37,720,000
日鉄住金テックスエンジ	26,000	513.00	13,338,000
西松建設	146,000	480.00	70,080,000
三井住友建設	544,300	129.00	70,214,700
大豊建設	38,000	490.00	18,620,000
前田建設工業	90,000	926.00	83,340,000
佐田建設	46,000	140.00	6,440,000
ナカノフドー建設	12,500	382.00	4,775,000
奥村組	128,000	535.00	68,480,000
大和小田急建設	8,200	853.00	6,994,600
東鉄工業	16,200	2,529.00	40,969,800
イチケン	16,000	334.00	5,344,000
戸田建設	169,000	458.00	77,402,000
熊谷組	170,000	361.00	61,370,000
青木あすなろ建設	8,600	835.00	7,181,000
北野建設	30,000	379.00	11,370,000

植木組	21,000	268.00	5,628,000
三井ホーム	18,000	485.00	8,730,000
矢作建設工業	16,700	923.00	15,414,100
ピーエス三菱	15,000	466.00	6,990,000
東日本ハウス	16,800	526.00	8,836,800
大東建託	51,300	13,070.00	670,491,000
新日本建設	17,700	440.00	7,788,000
N I P P O	31,000	1,952.00	60,512,000
東亜道路工業	25,000	460.00	11,500,000
前田道路	42,000	1,728.00	72,576,000
日本道路	40,000	591.00	23,640,000
東亜建設工業	101,000	190.00	19,190,000
若築建設	78,000	199.00	15,522,000
東洋建設	35,900	484.00	17,375,600
五洋建設	149,800	359.00	53,778,200
大林道路	16,000	756.00	12,096,000
世紀東急工業	19,600	631.00	12,367,600
福田組	21,000	960.00	20,160,000
住友林業	99,600	1,206.00	120,117,600
日本基礎技術	16,200	402.00	6,512,400
日成ビルド工業	39,000	289.00	11,271,000
巴コーポレーション	16,800	447.00	7,509,600
パナホーム	51,000	773.00	39,423,000
大和ハウス工業	395,300	2,234.00	883,100,200
ライト工業	21,600	932.00	20,131,200
積水ハウス	415,200	1,524.50	632,972,400
日特建設	18,100	507.00	9,176,700
北陸電気工事	7,000	624.00	4,368,000
ユアテック	21,000	707.00	14,847,000
西部電気工業	11,000	467.00	5,137,000
四電工	11,000	411.00	4,521,000
中電工	19,500	1,806.00	35,217,000
関電工	61,000	662.00	40,382,000
きんでん	90,000	1,172.00	105,480,000
東京エネシス	15,000	828.00	12,420,000
トーエネック	19,000	589.00	11,191,000
住友電設	10,700	1,430.00	15,301,000
日本電設工業	22,000	1,517.00	33,374,000
協和エクシオ	57,300	1,342.00	76,896,600
新日本空調	11,500	898.00	10,327,000
N D S	22,000	304.00	6,688,000
九電工	25,000	1,351.00	33,775,000

三機工業	27,700	771.00	21,356,700
日揮	136,000	2,548.00	346,528,000
中外炉工業	40,000	278.00	11,120,000
ヤマト	14,000	424.00	5,936,000
太平電業	18,000	925.00	16,650,000
高砂熱学工業	37,600	1,528.00	57,452,800
三晃金属工業	16,000	249.00	3,984,000
朝日工業社	16,000	414.00	6,624,000
明星工業	24,000	739.00	17,736,000
大気社	19,300	2,736.00	52,804,800
ダイダシ	18,000	667.00	12,006,000
日比谷総合設備	16,200	1,602.00	25,952,400
東芝プラントシステム	21,900	1,881.00	41,193,900
OSJBホールディングス	18,300	272.00	4,977,600
東洋エンジニアリング	66,000	435.00	28,710,000
千代田化工建設	97,000	1,006.00	97,582,000
新興プラントテック	27,700	809.00	22,409,300
日本製粉	83,000	526.00	43,658,000
日清製粉グループ本社	148,000	1,165.00	172,420,000
日東富士製粉	11,000	316.00	3,476,000
昭和産業	56,000	477.00	26,712,000
鳥越製粉	10,800	792.00	8,553,600
中部飼料	13,000	656.00	8,528,000
フィード・ワンホールディングス	81,700	110.00	8,987,000
東洋精糖	21,000	101.00	2,121,000
日本甜菜製糖	69,000	203.00	14,007,000
三井製糖	53,000	414.00	21,942,000
塩水港精糖	14,600	266.00	3,883,600
森永製菓	122,000	286.00	34,892,000
中村屋	31,000	444.00	13,764,000
江崎グリコ	31,200	4,240.00	132,288,000
名糖産業	6,000	1,148.00	6,888,000
不二家	77,000	208.00	16,016,000
山崎製パン	99,000	1,518.00	150,282,000
第一屋製パン	18,000	137.00	2,466,000
モロゾフ	21,000	362.00	7,602,000
亀田製菓	7,500	3,640.00	27,300,000
寿スピリッツ	3,200	2,160.00	6,912,000
カルビー	50,000	4,075.00	203,750,000
森永乳業	121,000	398.00	48,158,000
六甲バター	6,100	1,179.00	7,191,900
ヤクルト本社	72,400	6,170.00	446,708,000



明治ホールディングス	40,000	10,510.00	420,400,000
雪印メグミルク	31,800	1,464.00	46,555,200
プリマハム	76,000	267.00	20,292,000
日本ハム	99,000	2,467.00	244,233,000
伊藤ハム	74,000	648.00	47,952,000
丸大食品	70,000	414.00	28,980,000
米久	4,300	1,831.00	7,873,300
S Foods	8,500	2,241.00	19,048,500
サッポロホールディングス	221,000	522.00	115,362,000
アサヒグループホールディングス	271,300	3,720.00	1,009,236,000
キリンホールディングス	577,500	1,508.50	871,158,750
宝ホールディングス	105,900	769.00	81,437,100
オエノンホールディングス	35,000	224.00	7,840,000
養命酒製造	8,000	908.00	7,264,000
コカ・コーラウエスト	45,700	1,703.00	77,827,100
コカ・コーライーストジャパン	41,100	1,875.00	77,062,500
サントリー食品インターナショナル	80,900	4,220.00	341,398,000
ダイトードリンコ	6,800	4,825.00	32,810,000
伊藤園	36,700	2,135.00	78,354,500
キーコーヒー	11,900	1,645.00	19,575,500
ユニカフェ	3,700	711.00	2,630,700
ジャパンフーズ	1,800	1,121.00	2,017,800
日清オイリオグループ	65,000	410.00	26,650,000
不二製油	36,100	1,573.00	56,785,300
かどや製油	1,300	2,599.00	3,378,700
J - オイルミルズ	57,000	386.00	22,002,000
キッコーマン	110,000	2,931.00	322,410,000
味の素	311,000	2,255.50	701,460,500
キューピー	68,700	2,038.00	140,010,600
ハウス食品グループ本社	50,000	2,083.00	104,150,000
カゴメ	52,200	1,827.00	95,369,400
焼津水産化学工業	6,300	1,000.00	6,300,000
アリアケジャパン	12,300	2,810.00	34,563,000
ニチレイ	144,000	504.00	72,576,000
東洋水産	70,500	4,035.00	284,467,500
イトアンド	1,200	1,701.00	2,041,200
日清食品ホールディングス	57,100	5,730.00	327,183,000
永谷園	13,000	1,058.00	13,754,000
フジッコ	13,000	1,818.00	23,634,000
ロック・フィールド	7,000	1,933.00	13,531,000
日本たばこ産業	748,000	3,625.50	2,711,874,000
ケンコーマヨネーズ	4,400	1,315.00	5,786,000

わらべや日洋	7,900	1,973.00	15,586,700
なとり	6,200	1,201.00	7,446,200
ミヨシ油脂	47,000	138.00	6,486,000
片倉工業	15,800	1,240.00	19,592,000
グンゼ	102,000	314.00	32,028,000
東洋紡	501,000	165.00	82,665,000
ユニチカ	367,000	61.00	22,387,000
富士紡ホールディングス	61,000	328.00	20,008,000
日清紡ホールディングス	80,000	1,283.00	102,640,000
倉敷紡績	131,000	184.00	24,104,000
シキボウ	72,000	127.00	9,144,000
日本毛織	40,000	772.00	30,880,000
トーア紡コーポレーション	57,000	81.00	4,617,000
ダイドーリミテッド	14,600	516.00	7,533,600
帝国繊維	13,200	2,601.00	34,333,200
帝人	516,000	322.00	166,152,000
東レ	976,000	940.50	917,928,000
サカイオーベックス	33,000	174.00	5,742,000
住江織物	39,000	309.00	12,051,000
日本フェルト	7,500	501.00	3,757,500
イチカワ	9,000	276.00	2,484,000
日本バイリーン	14,000	622.00	8,708,000
芦森工業	35,000	189.00	6,615,000
アツギ	106,000	114.00	12,084,000
ダイニック	24,000	178.00	4,272,000
セーレン	31,400	928.00	29,139,200
東海染工	18,000	122.00	2,196,000
小松精練	22,400	561.00	12,566,400
ワコールホールディングス	75,000	1,224.00	91,800,000
ホギメディカル	8,000	5,790.00	46,320,000
レナウン	30,300	111.00	3,363,300
クラウディア	2,400	1,337.00	3,208,800
T S Iホールディングス	56,400	713.00	40,213,200
三陽商会	70,000	312.00	21,840,000
オンワードホールディングス	91,000	749.00	68,159,000
ルック	26,000	236.00	6,136,000
ゴールドウイン	31,000	631.00	19,561,000
デサント	29,000	1,212.00	35,148,000
キング	6,400	425.00	2,720,000
ヤマトインターナショナル	8,500	411.00	3,493,500
特種東海製紙	73,000	241.00	17,593,000
王子ホールディングス	517,000	415.00	214,555,000

日本製紙	60,900	1,697.00	103,347,300
三菱製紙	192,000	88.00	16,896,000
北越紀州製紙	78,300	502.00	39,306,600
中越パルプ工業	48,000	182.00	8,736,000
巴川製紙所	19,000	185.00	3,515,000
大王製紙	56,000	1,037.00	58,072,000
レンゴー	112,000	479.00	53,648,000
トモク	40,000	283.00	11,320,000
ザ・パック	8,900	2,280.00	20,292,000
クラレ	214,800	1,464.00	314,467,200
旭化成	787,000	1,075.50	846,418,500
共和レザー	8,300	748.00	6,208,400
コープケミカル	19,000	110.00	2,090,000
昭和電工	840,000	175.00	147,000,000
住友化学	929,000	502.00	466,358,000
日本化成	24,000	150.00	3,600,000
住友精化	26,000	821.00	21,346,000
日産化学工業	84,300	2,166.00	182,593,800
ラサ工業	48,000	137.00	6,576,000
クレハ	88,000	539.00	47,432,000
多木化学	8,000	738.00	5,904,000
テイカ	21,000	452.00	9,492,000
石原産業	211,000	99.00	20,889,000
片倉チッカリン	8,000	255.00	2,040,000
日本曹達	81,000	674.00	54,594,000
東ソー	315,000	558.00	175,770,000
トクヤマ	196,000	264.00	51,744,000
セントラル硝子	129,000	439.00	56,631,000
東亜合成	158,000	476.00	75,208,000
ダイソー	50,000	384.00	19,200,000
関東電化工業	30,000	635.00	19,050,000
電気化学工業	261,000	430.00	112,230,000
信越化学工業	226,200	8,105.00	1,833,351,000
日本カーバイド工業	43,000	247.00	10,621,000
堺化学工業	51,000	373.00	19,023,000
エア・ウォーター	111,000	1,952.00	216,672,000
大陽日酸	162,000	1,318.00	213,516,000
日本化学工業	47,000	274.00	12,878,000
日本パーカラライジング	29,800	2,524.00	75,215,200
高圧ガス工業	19,000	576.00	10,944,000
チタン工業	15,000	231.00	3,465,000
四国化成工業	18,000	782.00	14,076,000

戸田工業	25,000	498.00	12,450,000	
ステラ ケミファ	6,400	1,348.00	8,627,200	
保土谷化学工業	38,000	193.00	7,334,000	
日本触媒	99,000	1,472.00	145,728,000	
大日精化工業	52,000	635.00	33,020,000	
カネカ	170,000	627.00	106,590,000	
三菱瓦斯化学	217,000	631.00	136,927,000	
三井化学	573,000	345.00	197,685,000	
J S R	124,600	2,131.00	265,522,600	
東京応化工業	26,100	3,630.00	94,743,000	
大阪有機化学工業	9,000	507.00	4,563,000	
三菱ケミカルホールディングス	788,700	616.40	486,154,680	
日本合成化学工業	29,000	699.00	20,271,000	
ダイセル	177,000	1,388.00	245,676,000	
住友ベークライト	118,000	460.00	54,280,000	
積水化学工業	299,000	1,472.00	440,128,000	
日本ゼオン	109,000	1,095.00	119,355,000	
アイカ工業	37,900	2,479.00	93,954,100	
宇部興産	635,000	187.00	118,745,000	
積水樹脂	18,800	1,617.00	30,399,600	
タキロン	26,000	520.00	13,520,000	
旭有機材工業	44,000	300.00	13,200,000	
日立化成	62,300	2,199.00	136,997,700	
ニチバン	13,000	403.00	5,239,000	
リケンテクノス	20,400	438.00	8,935,200	
大倉工業	30,000	357.00	10,710,000	
積水化成成品工業	36,000	405.00	14,580,000	
群栄化学工業	34,000	337.00	11,458,000	
タイガースポリマー	6,200	702.00	4,352,400	
ミライアル	4,500	1,789.00	8,050,500	
ダイキョーニシカワ	3,000	3,510.00	10,530,000	
日本化薬	82,000	1,478.00	121,196,000	
カーリットホールディングス	10,700	613.00	6,559,100	
日本精化	10,400	878.00	9,131,200	
A D E K A	58,100	1,402.00	81,456,200	
日油	105,000	731.00	76,755,000	
ハリマ化成グループ	11,500	456.00	5,244,000	
花王	347,400	4,481.00	1,556,699,400	
第一工業製薬	24,000	381.00	9,144,000	
三洋化成工業	40,000	835.00	33,400,000	
大日本塗料	72,000	161.00	11,592,000	
日本ペイントホールディングス	109,000	3,400.00	370,600,000	

関西ペイント	153,000	1,963.00	300,339,000
神東塗料	11,000	209.00	2,299,000
中国塗料	36,000	1,012.00	36,432,000
日本特殊塗料	9,700	765.00	7,420,500
藤倉化成	17,100	576.00	9,849,600
太陽ホールディングス	10,300	4,180.00	43,054,000
D I C	505,000	289.00	145,945,000
サカタインクス	25,800	1,348.00	34,778,400
東洋インキＳＣホールディングス	125,000	578.00	72,250,000
T & K T O K A	4,200	2,347.00	9,857,400
富士フィルムホールディングス	288,700	3,770.50	1,088,543,350
資生堂	224,400	1,868.00	419,179,200
ライオン	145,000	664.00	96,280,000
高砂香料工業	41,000	543.00	22,263,000
マンダム	12,600	3,945.00	49,707,000
ミルボン	7,400	3,430.00	25,382,000
ファンケル	29,300	1,655.00	48,491,500
コーセー	20,400	4,700.00	95,880,000
コタ	3,600	1,370.00	4,932,000
ドクターシーラボ	8,600	3,685.00	31,691,000
シーボン	1,200	2,375.00	2,850,000
ポーラ・オルビスホールディングス	15,000	4,685.00	70,275,000
ノエビアホールディングス	8,400	2,116.00	17,774,400
アジュバンコスメジャパン	2,300	924.00	2,125,200
エステー	8,300	1,014.00	8,416,200
アグロ カネショウ	3,400	1,218.00	4,141,200
コニシ	9,900	1,882.00	18,631,800
長谷川香料	16,000	1,629.00	26,064,000
星光P M C	6,900	968.00	6,679,200
小林製薬	20,700	7,110.00	147,177,000
荒川化学工業	10,600	1,201.00	12,730,600
メック	9,800	1,087.00	10,652,600
日本高純度化学	3,500	2,397.00	8,389,500
J C U	3,400	5,460.00	18,564,000
新田ゼラチン	7,700	798.00	6,144,600
アース製薬	9,100	4,170.00	37,947,000
イハラケミカル工業	19,400	1,216.00	23,590,400
北興化学工業	13,000	382.00	4,966,000
大成ラミック	3,500	2,723.00	9,530,500
クミアイ化学工業	26,000	677.00	17,602,000
日本農薬	28,800	1,407.00	40,521,600
アキレス	107,000	149.00	15,943,000

有沢製作所	21,100	895.00	18,884,500
日東電工	97,500	6,564.00	639,990,000
レック	4,400	1,299.00	5,715,600
きもと	22,600	290.00	6,554,000
藤森工業	10,800	3,420.00	36,936,000
前澤化成工業	8,800	1,185.00	10,428,000
J S P	8,800	1,923.00	16,922,400
エフピコ	11,200	3,675.00	41,160,000
天馬	10,000	1,637.00	16,370,000
信越ポリマー	24,700	506.00	12,498,200
東リ	33,000	250.00	8,250,000
ニフコ	28,100	3,925.00	110,292,500
日本バルカー工業	52,000	316.00	16,432,000
ユニ・チャーム	255,400	2,898.50	740,276,900
協和発酵キリン	151,000	1,246.00	188,146,000
武田薬品工業	472,600	5,022.00	2,373,397,200
アステラス製薬	1,436,800	1,713.50	2,461,956,800
大日本住友製薬	89,300	1,199.00	107,070,700
塩野義製薬	197,000	3,200.00	630,400,000
田辺三菱製薬	147,000	1,801.00	264,747,000
わかもと製薬	14,000	263.00	3,682,000
あすか製薬	14,900	1,296.00	19,310,400
日本新薬	29,000	3,785.00	109,765,000
バイオフェルミン製薬	2,000	2,898.00	5,796,000
中外製薬	125,600	3,150.00	395,640,000
科研製薬	43,000	2,460.00	105,780,000
エーザイ	166,400	4,637.00	771,596,800
ロート製薬	57,300	1,496.00	85,720,800
小野薬品工業	57,300	10,600.00	607,380,000
久光製薬	35,600	3,670.00	130,652,000
有機合成薬品工業	8,000	292.00	2,336,000
持田製薬	9,000	6,500.00	58,500,000
参天製薬	46,300	6,440.00	298,172,000
扶桑薬品工業	42,000	298.00	12,516,000
日本ケミファ	16,000	543.00	8,688,000
ツムラ	39,700	2,735.00	108,579,500
日医工	29,500	1,892.00	55,814,000
キッセイ薬品工業	23,400	3,170.00	74,178,000
生化学工業	24,100	1,990.00	47,959,000
栄研化学	10,600	1,825.00	19,345,000
日水製薬	5,100	1,264.00	6,446,400
鳥居薬品	8,600	3,055.00	26,273,000

JCRファーマ	9,700	2,323.00	22,533,100
東和薬品	6,400	5,310.00	33,984,000
富士製薬工業	3,600	2,043.00	7,354,800
沢井製薬	20,000	6,940.00	138,800,000
ゼリア新薬工業	25,800	1,967.00	50,748,600
第一三共	424,300	1,725.00	731,917,500
キョーリン製薬ホールディングス	33,600	2,313.00	77,716,800
大幸薬品	5,500	2,236.00	12,298,000
ダイト	4,700	1,891.00	8,887,700
大塚ホールディングス	250,400	3,681.50	921,847,600
大正製薬ホールディングス	30,300	7,430.00	225,129,000
日本コークス工業	113,100	111.00	12,554,100
昭和シェル石油	112,800	1,003.00	113,138,400
コスモ石油	349,000	162.00	56,538,000
ニチレキ	15,000	842.00	12,630,000
東燃ゼネラル石油	190,000	1,042.00	197,980,000
ユシロ化学工業	7,400	1,564.00	11,573,600
ピーピー・カストロール	5,200	1,317.00	6,848,400
富士石油	29,200	331.00	9,665,200
MORESCO	3,300	1,747.00	5,765,100
出光興産	59,800	2,001.00	119,659,800
JXホールディングス	1,399,900	444.10	621,695,590
横浜ゴム	141,000	1,104.00	155,664,000
東洋ゴム工業	57,100	2,379.00	135,840,900
ブリヂストン	395,300	4,223.50	1,669,549,550
住友ゴム工業	98,400	1,786.00	175,742,400
藤倉ゴム工業	10,500	862.00	9,051,000
オカモト	43,000	426.00	18,318,000
フコク	5,300	1,302.00	6,900,600
ニッタ	12,500	2,752.00	34,400,000
住友理工	23,300	986.00	22,973,800
三ツ星ベルト	32,000	877.00	28,064,000
バンドー化学	46,000	432.00	19,872,000
日東紡績	93,000	415.00	38,595,000
旭硝子	621,000	596.00	370,116,000
日本板硝子	608,000	115.00	69,920,000
石塚硝子	16,000	162.00	2,592,000
日本山村硝子	50,000	168.00	8,400,000
日本電気硝子	242,000	551.00	133,342,000
オハラ	4,800	595.00	2,856,000
住友大阪セメント	234,000	360.00	84,240,000
太平洋セメント	787,000	383.00	301,421,000

デイ・シイ	14,400	491.00	7,070,400
日本ヒューム	13,200	964.00	12,724,800
日本コンクリート工業	22,800	568.00	12,950,400
三谷セキサン	6,300	2,027.00	12,770,100
ジャパンパイル	17,100	773.00	13,218,300
東海カーボン	109,000	366.00	39,894,000
日本カーボン	67,000	226.00	15,142,000
東洋炭素	7,000	1,968.00	13,776,000
ノリタケカンパニーリミテド	71,000	262.00	18,602,000
TOTO	185,000	1,397.00	258,445,000
日本碍子	159,000	2,492.00	396,228,000
日本特殊陶業	108,700	3,530.00	383,711,000
MARUWA	3,700	3,550.00	13,135,000
品川リフラクトリーズ	34,000	269.00	9,146,000
黒崎播磨	29,000	247.00	7,163,000
ヨータイ	7,000	366.00	2,562,000
イソライト工業	9,100	212.00	1,929,200
東京窯業	15,000	219.00	3,285,000
ニッカトー	4,500	400.00	1,800,000
フジインコーポレーテッド	12,700	1,804.00	22,910,800
ニチアス	56,000	687.00	38,472,000
ニチハ	17,300	1,160.00	20,068,000
新日鐵住金	5,331,000	309.90	1,652,076,900
神戸製鋼所	2,181,000	198.00	431,838,000
合同製鐵	66,000	185.00	12,210,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	321,700	2,639.00	848,966,300
日新製鋼	54,000	1,157.00	62,478,000
東京製鐵	63,900	658.00	42,046,200
共英製鋼	13,500	2,043.00	27,580,500
大和工業	28,700	3,515.00	100,880,500
東京鐵鋼	25,000	517.00	12,925,000
大阪製鐵	6,800	2,051.00	13,946,800
淀川製鋼所	90,000	449.00	40,410,000
東洋鋼鈹	30,000	622.00	18,660,000
丸一鋼管	38,700	2,575.00	99,652,500
モリ工業	20,000	417.00	8,340,000
大同特殊鋼	213,000	415.00	88,395,000
日本高周波鋼業	54,000	114.00	6,156,000
日本冶金工業	101,400	255.00	25,857,000
山陽特殊製鋼	75,000	380.00	28,500,000
愛知製鋼	75,000	409.00	30,675,000
日立金属	128,000	1,983.00	253,824,000



日本金属	33,000	152.00	5,016,000
大太平洋金属	81,000	381.00	30,861,000
新日本電工	77,200	307.00	23,700,400
栗本鐵工所	66,000	227.00	14,982,000
虹技	18,000	220.00	3,960,000
日本鑄鉄管	15,000	232.00	3,480,000
三菱製鋼	84,000	243.00	20,412,000
日亜鋼業	18,000	338.00	6,084,000
日本精線	10,000	710.00	7,100,000
シンニッタン	13,100	524.00	6,864,400
新家工業	25,000	182.00	4,550,000
大紀アルミニウム工業所	21,000	333.00	6,993,000
日本軽金属ホールディングス	305,800	175.00	53,515,000
三井金属鉱業	343,000	290.00	99,470,000
東邦亜鉛	71,000	384.00	27,264,000
三菱マテリアル	787,000	384.00	302,208,000
住友金属鉱山	348,000	1,814.50	631,446,000
D O W Aホールディングス	151,000	932.00	140,732,000
古河機械金属	197,000	208.00	40,976,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,400	2,328.00	28,867,200
東邦チタニウム	21,300	811.00	17,274,300
U A C J	144,000	344.00	49,536,000
古河電気工業	370,000	201.00	74,370,000
住友電気工業	475,100	1,555.00	738,780,500
フジクラ	175,000	448.00	78,400,000
昭和電線ホールディングス	138,000	104.00	14,352,000
東京特殊電線	1,800	1,602.00	2,883,600
タツタ電線	25,000	494.00	12,350,000
沖電線	15,000	321.00	4,815,000
カナレ電気	2,100	1,929.00	4,050,900
平河ヒューテック	3,600	1,113.00	4,006,800
リョービ	70,000	309.00	21,630,000
アーレスティ	11,000	690.00	7,590,000
アサヒホールディングス	19,000	1,756.00	33,364,000
稲葉製作所	5,400	1,363.00	7,360,200
宮地エンジニアリンググループ	36,000	205.00	7,380,000
トーカロ	8,600	1,963.00	16,881,800
アルファC o	4,800	1,125.00	5,400,000
S U M C O	87,700	1,672.00	146,634,400
川田テクノロジーズ	2,600	4,270.00	11,102,000
東洋製罐グループホールディングス	90,200	1,458.00	131,511,600
ホッカシホールディングス	35,000	281.00	9,835,000

コロナ	6,600	1,150.00	7,590,000
横河ブリッジホールディングス	24,400	1,323.00	32,281,200
駒井ハルテック	26,000	296.00	7,696,000
高田機工	12,000	242.00	2,904,000
三和ホールディングス	122,300	862.00	105,422,600
文化シャッター	36,000	991.00	35,676,000
三協立山	15,700	2,231.00	35,026,700
東洋シャッター	4,300	785.00	3,375,500
L I X I Lグループ	187,300	2,567.00	480,799,100
日本フィルコン	10,500	486.00	5,103,000
ノーリツ	24,700	1,980.00	48,906,000
長府製作所	13,500	2,985.00	40,297,500
リンナイ	23,400	8,330.00	194,922,000
ダイニチ工業	6,500	759.00	4,933,500
日東精工	19,000	368.00	6,992,000
三洋工業	18,000	204.00	3,672,000
岡部	25,400	1,212.00	30,784,800
東プレ	24,400	1,623.00	39,601,200
高周波熱錬	19,900	841.00	16,735,900
サンコール	8,000	679.00	5,432,000
モリテック スチール	7,600	318.00	2,416,800
パイオラックス	6,400	5,020.00	32,128,000
日本発條	109,700	1,023.00	112,223,100
中央発條	18,000	315.00	5,670,000
アドバネクス	31,000	198.00	6,138,000
三益半導体工業	10,700	1,125.00	12,037,500
日本ドライケミカル	1,300	2,289.00	2,975,700
日本製鋼所	181,000	415.00	75,115,000
三浦工業	56,300	1,212.00	68,235,600
タクマ	43,000	828.00	35,604,000
ツガミ	37,000	660.00	24,420,000
オークマ	82,000	966.00	79,212,000
東芝機械	69,000	476.00	32,844,000
アマダ	188,000	1,065.00	200,220,000
アイダエンジニアリング	27,600	1,089.00	30,056,400
滝澤鉄工所	40,000	214.00	8,560,000
富士機械製造	41,200	1,094.00	45,072,800
牧野フライス製作所	63,000	908.00	57,204,000
オーエスジー	57,500	1,870.00	107,525,000
ダイジェット工業	16,000	239.00	3,824,000
旭ダイヤモンド工業	34,600	1,286.00	44,495,600
D M G 森精機	79,600	1,550.00	123,380,000

ディスコ	14,200	9,310.00	132,202,000
日東工器	7,400	2,239.00	16,568,600
パンチ工業	3,900	1,397.00	5,448,300
豊和工業	7,700	753.00	5,798,100
大阪機工	49,000	160.00	7,840,000
東洋機械金属	8,800	470.00	4,136,000
津田駒工業	31,000	165.00	5,115,000
島精機製作所	17,800	2,134.00	37,985,200
日阪製作所	16,000	969.00	15,504,000
やまびこ	5,200	5,240.00	27,248,000
ペガサスミシン製造	14,300	661.00	9,452,300
ナプテスコ	76,800	2,939.00	225,715,200
三井海洋開発	12,700	2,080.00	26,416,000
レオン自動機	10,000	546.00	5,460,000
S M C	38,600	31,950.00	1,233,270,000
新川	10,500	648.00	6,804,000
ホソカワミクロン	21,000	705.00	14,805,000
ユニオンツール	6,200	2,762.00	17,124,400
オイレス工業	15,800	2,036.00	32,168,800
日精エー・エス・ビー機械	4,400	2,751.00	12,104,400
サトーホールディングス	15,700	2,744.00	43,080,800
日本エアテック	4,000	759.00	3,036,000
日精樹脂工業	9,200	1,275.00	11,730,000
ワイエイシイ	5,300	660.00	3,498,000
小松製作所	625,100	2,750.00	1,719,025,000
住友重機械工業	345,000	674.00	232,530,000
日立建機	56,300	2,610.00	146,943,000
日工	18,000	407.00	7,326,000
巴工業	4,700	1,710.00	8,037,000
井関農機	130,000	226.00	29,380,000
T O W A	11,500	692.00	7,958,000
丸山製作所	32,000	236.00	7,552,000
北川鉄工所	59,000	226.00	13,334,000
クボタ	608,000	1,802.50	1,095,920,000
荏原実業	3,800	1,493.00	5,673,400
三菱化工機	42,000	485.00	20,370,000
月島機械	22,200	1,211.00	26,884,200
帝国電機製作所	8,400	1,422.00	11,944,800
新東工業	29,700	828.00	24,591,600
澁谷工業	10,700	2,497.00	26,717,900
アイチ コーポレーション	17,900	580.00	10,382,000
小森コーポレーション	30,700	1,318.00	40,462,600

鶴見製作所	9,400	1,907.00	17,925,800
住友精密工業	20,000	520.00	10,400,000
酒井重工業	24,000	307.00	7,368,000
荏原製作所	261,000	514.00	134,154,000
石井鐵工所	22,000	227.00	4,994,000
西島製作所	12,600	843.00	10,621,800
北越工業	11,000	1,206.00	13,266,000
ダイキン工業	175,400	7,897.00	1,385,133,800
オルガノ	22,000	476.00	10,472,000
トーヨーカネツ	73,000	252.00	18,396,000
栗田工業	71,300	2,546.00	181,529,800
椿本チエイン	64,000	986.00	63,104,000
大同工業	28,000	257.00	7,196,000
日本コンベヤ	39,000	258.00	10,062,000
木村化工機	12,800	511.00	6,540,800
アネスト岩田	19,000	801.00	15,219,000
ダイフク	59,600	1,362.00	81,175,200
サムコ	1,600	1,076.00	1,721,600
加藤製作所	26,000	980.00	25,480,000
油研工業	27,000	251.00	6,777,000
タダノ	58,000	1,579.00	91,582,000
フジテック	35,100	1,221.00	42,857,100
C K D	33,800	1,102.00	37,247,600
キトー	14,500	1,190.00	17,255,000
平和	26,900	2,302.00	61,923,800
理想科学工業	7,400	3,685.00	27,269,000
S A N K Y O	36,500	4,060.00	148,190,000
日本金銭機械	11,100	1,718.00	19,069,800
マースエンジニアリング	6,800	2,057.00	13,987,600
福島工業	6,700	1,968.00	13,185,600
オーイズミ	5,400	888.00	4,795,200
ダイコク電機	5,000	1,763.00	8,815,000
アマノ	40,200	1,231.00	49,486,200
サンデン	77,000	659.00	50,743,000
マックス	19,000	1,229.00	23,351,000
グローリー	38,600	3,000.00	115,800,000
新晃工業	8,500	1,017.00	8,644,500
大和冷機工業	17,500	779.00	13,632,500
セガサミーホールディングス	129,600	1,576.00	204,249,600
日本ピストンリング	54,000	251.00	13,554,000
リケン	51,000	464.00	23,664,000
T P R	14,400	2,925.00	42,120,000

ホシザキ電機	26,400	5,820.00	153,648,000
大豊工業	9,800	1,288.00	12,622,400
日本精工	248,000	1,453.00	360,344,000
NTN	284,000	529.00	150,236,000
ジェイテクト	128,900	2,001.00	257,928,900
不二越	114,000	684.00	77,976,000
日本トムソン	45,000	576.00	25,920,000
THK	80,200	2,878.00	230,815,600
ユーシン精機	5,400	2,247.00	12,133,800
前澤給装工業	4,600	1,408.00	6,476,800
イーグル工業	17,100	2,198.00	37,585,800
前澤工業	11,400	328.00	3,739,200
日本ピラー工業	13,200	917.00	12,104,400
キッツ	54,200	484.00	26,232,800
日立工機	32,300	985.00	31,815,500
マキタ	78,600	5,730.00	450,378,000
日立造船	94,400	684.00	64,569,600
三菱重工業	2,019,000	695.60	1,404,416,400
IHI	868,000	593.00	514,724,000
イビデン	79,000	1,783.00	140,857,000
コニカミノルタ	287,000	1,380.00	396,060,000
ブラザー工業	155,700	2,190.00	340,983,000
ミネベア	179,000	1,562.00	279,598,000
日立製作所	2,892,000	888.00	2,568,096,000
東芝	2,536,000	519.90	1,318,466,400
三菱電機	1,205,000	1,464.50	1,764,722,500
富士電機	335,000	498.00	166,830,000
東洋電機製造	25,000	406.00	10,150,000
安川電機	141,600	1,564.00	221,462,400
シンフォニアテクノロジー	84,000	175.00	14,700,000
明電舎	111,000	386.00	42,846,000
オリジン電気	18,000	501.00	9,018,000
山洋電気	27,000	817.00	22,059,000
デンヨー	10,900	1,726.00	18,813,400
東芝テック	86,000	821.00	70,606,000
芝浦メカトロニクス	20,000	354.00	7,080,000
マブチモーター	18,400	9,720.00	178,848,000
日本電産	130,200	7,777.00	1,012,565,400
東光高岳	6,100	1,718.00	10,479,800
ダイヘン	66,000	530.00	34,980,000
ヤーマン	1,500	1,410.00	2,115,000
JVCケンウッド	89,900	258.00	23,194,200

第一精工	4,400	2,648.00	11,651,200
日新電機	28,000	673.00	18,844,000
大崎電気工業	19,000	807.00	15,333,000
オムロン	135,900	5,430.00	737,937,000
日東工業	19,300	2,355.00	45,451,500
I D E C	14,300	967.00	13,828,100
不二電機工業	1,100	1,489.00	1,637,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	232,000	527.00	122,264,000
サクサホールディングス	30,000	282.00	8,460,000
メルコホールディングス	6,700	1,672.00	11,202,400
テクノメディカ	2,700	2,363.00	6,380,100
日本電気	1,559,000	377.00	587,743,000
富士通	1,161,000	669.30	777,057,300
沖電気工業	416,000	239.00	99,424,000
岩崎通信機	53,000	92.00	4,876,000
電気興業	34,000	514.00	17,476,000
サンケン電気	61,000	965.00	58,865,000
ナカヨ	12,000	367.00	4,404,000
アイホン	7,000	1,937.00	13,559,000
ルネサスエレクトロニクス	62,300	866.00	53,951,800
セイコーエプソン	82,200	5,680.00	466,896,000
ワコム	94,900	440.00	41,756,000
アルバック	22,200	1,650.00	36,630,000
アクセル	5,600	1,475.00	8,260,000
E I Z O	11,100	2,335.00	25,918,500
ジャパンディスプレイ	186,600	359.00	66,989,400
日本信号	33,200	1,240.00	41,168,000
京三製作所	28,000	369.00	10,332,000
能美防災	15,900	1,598.00	25,408,200
ホーチキ	9,000	931.00	8,379,000
エレコム	3,800	2,460.00	9,348,000
日本無線	26,000	361.00	9,386,000
パナソニック	1,467,900	1,480.00	2,172,492,000
シャープ	1,018,000	276.00	280,968,000
アンリツ	75,400	896.00	67,558,400
富士通ゼネラル	37,000	1,212.00	44,844,000
日立国際電気	31,000	1,692.00	52,452,000
ソニー	774,000	2,504.00	1,938,096,000
T D K	72,700	7,410.00	538,707,000
帝国通信工業	28,000	211.00	5,908,000
ミツミ電機	42,500	1,036.00	44,030,000
タムラ製作所	46,000	442.00	20,332,000

アルプス電気	95,100	2,268.00	215,686,800
池上通信機	41,000	138.00	5,658,000
パイオニア	181,000	244.00	44,164,000
日本電波工業	11,300	974.00	11,006,200
鈴木	1,400	835.00	1,169,000
日本トリム	3,100	2,507.00	7,771,700
ローランド ディー・ジー	4,800	4,080.00	19,584,000
フォスター電機	12,300	2,070.00	25,461,000
クラリオン	63,000	386.00	24,318,000
SMK	35,000	492.00	17,220,000
ヨコオ	9,400	697.00	6,551,800
東光	28,000	331.00	9,268,000
ホシデン	38,100	707.00	26,936,700
ヒロセ電機	19,500	14,290.00	278,655,000
日本航空電子工業	35,000	2,775.00	97,125,000
TOA	12,900	1,217.00	15,699,300
日立マクセル	18,000	2,025.00	36,450,000
古野電気	14,600	969.00	14,147,400
ユニデン	33,000	230.00	7,590,000
アルパイン	28,700	2,000.00	57,400,000
スミダコーポレーション	11,200	863.00	9,665,600
アイコム	6,700	2,828.00	18,947,600
リオン	3,400	1,407.00	4,783,800
船井電機	12,200	1,503.00	18,336,600
横河電機	120,600	1,446.00	174,387,600
新電元工業	46,000	722.00	33,212,000
アズビル	39,300	2,887.00	113,459,100
東亜ディーケーケー	4,800	571.00	2,740,800
日本光電工業	25,700	6,020.00	154,714,000
チノー	4,300	1,221.00	5,250,300
共和電業	14,700	470.00	6,909,000
日本電子材料	5,200	702.00	3,650,400
堀場製作所	22,300	4,215.00	93,994,500
アドバンテスト	82,100	1,515.00	124,381,500
小野測器	6,100	985.00	6,008,500
エスペック	13,300	1,170.00	15,561,000
パナソニック デバイスSUNX	10,600	835.00	8,851,000
キーエンス	27,300	53,200.00	1,452,360,000
日置電機	6,300	1,760.00	11,088,000
シスメックス	93,200	5,200.00	484,640,000
メガチップス	11,500	1,404.00	16,146,000
OBARA GROUP	7,800	5,120.00	39,936,000

澤藤電機	8,000	224.00	1,792,000	
コーセル	17,500	1,241.00	21,717,500	
新日本無線	9,000	487.00	4,383,000	
オブテックス	8,300	1,975.00	16,392,500	
千代田インテグレ	5,300	2,092.00	11,087,600	
レーザーテック	12,300	1,310.00	16,113,000	
スタンレー電気	86,700	2,547.00	220,824,900	
岩崎電気	42,000	249.00	10,458,000	
ウシオ電機	73,100	1,281.00	93,641,100	
岡谷電機産業	6,400	395.00	2,528,000	
ハリオス テクノ ホールディング	11,100	436.00	4,839,600	
日本セラミック	6,900	1,811.00	12,495,900	
遠藤照明	5,500	1,346.00	7,403,000	
日本デジタル研究所	10,200	1,684.00	17,176,800	
古河電池	9,000	1,073.00	9,657,000	
双信電機	5,900	420.00	2,478,000	
山一電機	14,400	819.00	11,793,600	
図研	8,700	1,158.00	10,074,600	
日本電子	52,000	606.00	31,512,000	
カシオ計算機	120,700	1,901.00	229,450,700	
ファナック	125,400	20,115.00	2,522,421,000	
日本シイエムケイ	30,700	310.00	9,517,000	
エンプラス	5,500	4,280.00	23,540,000	
大真空	23,000	331.00	7,613,000	
ローム	59,400	7,830.00	465,102,000	
浜松ホトニクス	50,100	5,980.00	299,598,000	
三井ハイテック	15,900	832.00	13,228,800	
新光電気工業	45,500	800.00	36,400,000	
京セラ	197,700	5,635.00	1,114,039,500	
太陽誘電	63,100	1,367.00	86,257,700	
村田製作所	126,400	13,005.00	1,643,832,000	
ユーシン	17,300	689.00	11,919,700	
双葉電子工業	20,600	1,766.00	36,379,600	
北陸電気工業	52,000	177.00	9,204,000	
ニチコン	37,900	1,001.00	37,937,900	
日本ケミコン	98,000	367.00	35,966,000	
K O A	16,700	1,166.00	19,472,200	
市光工業	31,000	245.00	7,595,000	
小糸製作所	72,200	3,680.00	265,696,000	
ミツバ	22,300	2,170.00	48,391,000	
スター精密	22,900	1,655.00	37,899,500	
S C R E E Nホールディングス	114,000	731.00	83,334,000	



キヤノン電子	11,100	2,011.00	22,322,100	
キヤノン	698,300	3,792.50	2,648,302,750	
リコー	362,200	1,265.50	458,364,100	
MUTOHホールディングス	16,000	489.00	7,824,000	
東京エレクトロン	101,300	8,596.00	870,774,800	
トヨタ紡織	43,200	1,490.00	64,368,000	
鬼怒川ゴム工業	28,000	520.00	14,560,000	
ユニプレス	23,100	2,098.00	48,463,800	
豊田自動織機	110,000	6,040.00	664,400,000	
モリタホールディングス	21,100	1,140.00	24,054,000	
三櫻工業	15,400	773.00	11,904,200	
デンソー	297,800	5,690.00	1,694,482,000	
東海理化電機製作所	32,000	2,524.00	80,768,000	
三井造船	466,000	220.00	102,520,000	
川崎重工業	875,000	539.00	471,625,000	
名村造船所	34,700	1,304.00	45,248,800	
サノヤスホールディングス	15,200	384.00	5,836,800	
日本車輛製造	44,000	357.00	15,708,000	
ニチユ三菱フォークリフト	13,900	772.00	10,730,800	
近畿車輛	18,000	306.00	5,508,000	
日産自動車	1,690,700	1,091.00	1,844,553,700	
いすゞ自動車	380,800	1,489.00	567,011,200	
トヨタ自動車	1,661,800	7,523.00	12,501,721,400	代用有価証券 500,000株
日野自動車	171,900	1,607.00	276,243,300	
三菱自動車工業	441,500	1,189.00	524,943,500	
エフテック	5,400	1,207.00	6,517,800	
レシップホールディングス	4,000	847.00	3,388,000	
GMB	1,700	1,333.00	2,266,100	
武蔵精密工業	12,900	2,282.00	29,437,800	
日産車体	52,900	1,427.00	75,488,300	
新明和工業	49,000	1,110.00	54,390,000	
極東開発工業	22,400	1,446.00	32,390,400	
日信工業	22,100	1,733.00	38,299,300	
トピー工業	103,000	225.00	23,175,000	
ティラド	47,000	242.00	11,374,000	
曙ブレーキ工業	52,700	419.00	22,081,300	
タチエス	19,100	1,629.00	31,113,900	
NOK	58,700	3,030.00	177,861,000	
フタバ産業	38,000	603.00	22,914,000	
カヤバ工業	136,000	500.00	68,000,000	
シロキ工業	27,000	245.00	6,615,000	
大同メタル工業	17,000	1,275.00	21,675,000	

プレス工業	61,000	423.00	25,803,000
カルソニックカンセイ	93,000	682.00	63,426,000
太平洋工業	25,300	871.00	22,036,300
ケーヒン	28,000	1,773.00	49,644,000
河西工業	15,300	993.00	15,192,900
アイシン精機	110,600	4,400.00	486,640,000
富士機工	14,000	558.00	7,812,000
マツダ	359,000	2,989.50	1,073,230,500
ダイハツ工業	143,800	1,676.00	241,008,800
今仙電機製作所	9,800	1,517.00	14,866,600
本田技研工業	1,083,900	3,610.00	3,912,879,000
スズキ	251,800	3,799.50	956,714,100
富士重工業	409,900	4,275.00	1,752,322,500
安永	4,100	571.00	2,341,100
ヤマハ発動機	183,200	2,446.00	448,107,200
ショーワ	28,500	1,130.00	32,205,000
T B K	14,000	675.00	9,450,000
エクセディ	16,400	3,030.00	49,692,000
豊田合成	39,100	2,472.00	96,655,200
愛三工業	18,700	976.00	18,251,200
盟和産業	10,000	150.00	1,500,000
ヨロズ	11,300	2,048.00	23,142,400
エフ・シー・シー	17,700	2,104.00	37,240,800
シマノ	52,100	16,350.00	851,835,000
テイ・エス テック	25,500	2,815.00	71,782,500
テルモ	184,600	2,780.00	513,188,000
クリエートメディック	4,000	1,047.00	4,188,000
日機装	39,100	1,222.00	47,780,200
島津製作所	144,000	1,215.00	174,960,000
J M S	22,000	288.00	6,336,000
ショットモリテックス	2,600	234.00	608,400
長野計器	7,700	687.00	5,289,900
ブイ・テクノロジー	2,300	2,434.00	5,598,200
東京計器	42,000	293.00	12,306,000
愛知時計電機	16,000	309.00	4,944,000
オーバル	8,900	346.00	3,079,400
東京精密	21,600	2,396.00	51,753,600
マニー	3,300	7,140.00	23,562,000
ニコン	224,900	1,766.00	397,173,400
トプコン	36,400	2,544.00	92,601,600
オリンパス	179,400	4,370.00	783,978,000
理研計器	10,600	1,118.00	11,850,800

タムロン	9,300	2,308.00	21,464,400
HOYA	286,600	4,115.50	1,179,502,300
ノーリツ鋼機	10,900	610.00	6,649,000
エー・アンド・デイ	11,000	502.00	5,522,000
シチズンホールディングス	148,300	951.00	141,033,300
リズム時計工業	53,000	159.00	8,427,000
大研医器	8,400	1,156.00	9,710,400
松風	5,900	1,474.00	8,696,600
セイコーホールディングス	85,000	673.00	57,205,000
ニプロ	77,000	1,067.00	82,159,000
パラマウントベッドホールディングス	12,700	3,305.00	41,973,500
SHO-BI	4,000	401.00	1,604,000
前田工織	11,900	1,248.00	14,851,200
永大産業	17,000	455.00	7,735,000
アートネイチャー	8,700	1,361.00	11,840,700
ダンロップスポーツ	7,400	1,417.00	10,485,800
バンダイナムコホールディングス	132,800	2,584.00	343,155,200
共立印刷	21,800	290.00	6,322,000
フランスベッドホールディングス	80,000	180.00	14,400,000
パイロットコーポレーション	10,500	6,610.00	69,405,000
萩原工業	2,300	1,708.00	3,928,400
トッパン・フォームズ	21,500	1,188.00	25,542,000
フジシールインターナショナル	14,600	3,530.00	51,538,000
タカラトミー	43,200	647.00	27,950,400
廣濟堂	11,200	426.00	4,771,200
アーク	38,000	146.00	5,548,000
タカノ	5,300	590.00	3,127,000
プロネクサス	12,200	767.00	9,357,400
ホクシン	9,000	131.00	1,179,000
ウッドワン	20,000	271.00	5,420,000
大建工業	49,000	260.00	12,740,000
凸版印刷	340,000	765.00	260,100,000
大日本印刷	367,000	1,050.00	385,350,000
図書印刷	19,000	341.00	6,479,000
共同印刷	37,000	382.00	14,134,000
日本写真印刷	20,200	1,848.00	37,329,600
光村印刷	11,000	262.00	2,882,000
宝印刷	6,800	800.00	5,440,000
アシックス	119,700	2,924.00	350,002,800
ツツミ	6,000	2,385.00	14,310,000
小松ウオール工業	3,700	2,699.00	9,986,300
ヤマハ	88,500	1,795.00	158,857,500

河合楽器製作所	4,200	2,468.00	10,365,600
クリナップ	12,300	841.00	10,344,300
ピジョン	22,700	6,740.00	152,998,000
兼松日産農林	19,000	173.00	3,287,000
キングジム	10,000	746.00	7,460,000
リンテック	28,600	2,676.00	76,533,600
T A S A K I	2,300	1,439.00	3,309,700
イトーキ	25,400	604.00	15,341,600
任天堂	74,200	13,530.00	1,003,926,000
三菱鉛筆	9,900	3,675.00	36,382,500
タカラスタンド	50,000	853.00	42,650,000
コクヨ	62,600	896.00	56,089,600
ナカバヤシ	25,000	204.00	5,100,000
グローブライド	58,000	170.00	9,860,000
岡村製作所	46,200	808.00	37,329,600
美津濃	65,000	585.00	38,025,000
アデランス	13,900	1,268.00	17,625,200
東京電力	1,021,700	440.00	449,548,000
中部電力	368,500	1,398.50	515,347,250
関西電力	491,500	1,233.00	606,019,500
中国電力	166,500	1,573.00	261,904,500
北陸電力	118,000	1,566.00	184,788,000
東北電力	300,900	1,415.00	425,773,500
四国電力	108,500	1,478.00	160,363,000
九州電力	266,000	1,223.00	325,318,000
北海道電力	112,700	948.00	106,839,600
沖縄電力	7,900	3,740.00	29,546,000
電源開発	81,000	4,000.00	324,000,000
東京瓦斯	1,464,000	635.30	930,079,200
大阪瓦斯	1,247,000	446.90	557,284,300
東邦瓦斯	306,000	615.00	188,190,000
北海道瓦斯	24,000	287.00	6,888,000
西部瓦斯	136,000	266.00	36,176,000
静岡瓦斯	34,200	737.00	25,205,400
S B S ホールディングス	8,800	1,033.00	9,090,400
東武鉄道	644,000	501.00	322,644,000
相鉄ホールディングス	206,000	461.00	94,966,000
東京急行電鉄	654,000	711.00	464,994,000
京浜急行電鉄	330,000	874.00	288,420,000
小田急電鉄	386,000	1,034.00	399,124,000
京王電鉄	337,000	843.00	284,091,000
京成電鉄	181,000	1,366.00	247,246,000

富士急行	33,000	1,126.00	37,158,000
新京成電鉄	15,000	386.00	5,790,000
東日本旅客鉄道	220,800	8,681.00	1,916,764,800
西日本旅客鉄道	115,900	5,481.00	635,247,900
東海旅客鉄道	107,900	16,740.00	1,806,246,000
西武ホールディングス	96,000	2,401.00	230,496,000
鴻池運輸	7,400	2,140.00	15,836,000
西日本鉄道	156,000	480.00	74,880,000
ハマキョウレックス	3,800	3,760.00	14,288,000
サカイ引越センター	2,100	3,530.00	7,413,000
近畿日本鉄道	1,212,000	389.00	471,468,000
阪急阪神ホールディングス	808,000	633.00	511,464,000
南海電気鉄道	264,000	476.00	125,664,000
京阪電気鉄道	270,000	586.00	158,220,000
神戸電鉄	29,000	349.00	10,121,000
名糖運輸	4,900	678.00	3,322,200
名古屋鉄道	433,000	441.00	190,953,000
山陽電気鉄道	44,000	432.00	19,008,000
日本通運	477,000	574.00	273,798,000
ヤマトホールディングス	221,100	2,476.50	547,554,150
山九	146,000	481.00	70,226,000
丸運	6,500	251.00	1,631,500
丸全昭和運輸	40,000	375.00	15,000,000
センコー	49,000	567.00	27,783,000
トナミホールディングス	25,000	304.00	7,600,000
日本梱包運輸倉庫	39,400	1,838.00	72,417,200
日本石油輸送	14,000	229.00	3,206,000
福山通運	73,000	623.00	45,479,000
セイノーホールディングス	93,000	1,117.00	103,881,000
神奈川中央交通	14,000	575.00	8,050,000
日立物流	25,100	1,486.00	37,298,600
日本郵船	1,020,000	338.00	344,760,000
商船三井	633,000	375.00	237,375,000
川崎汽船	529,000	299.00	158,171,000
N S ユナイテッド海運	61,000	326.00	19,886,000
飯野海運	63,400	663.00	42,034,200
共栄タンカー	23,000	231.00	5,313,000
日本航空	231,600	3,720.00	861,552,000
A N A ホールディングス	2,370,000	296.00	701,520,000
パスコ	12,000	346.00	4,152,000
トランコム	3,500	4,770.00	16,695,000
日新	45,000	278.00	12,510,000

三菱倉庫	79,000	1,810.00	142,990,000
三井倉庫ホールディングス	70,000	431.00	30,170,000
住友倉庫	88,000	654.00	57,552,000
澁澤倉庫	30,000	343.00	10,290,000
東陽倉庫	21,000	316.00	6,636,000
乾汽船	8,000	995.00	7,960,000
日本トランスシティ	27,000	376.00	10,152,000
ケイヒン	22,000	168.00	3,696,000
中央倉庫	7,000	900.00	6,300,000
安田倉庫	9,400	1,055.00	9,917,000
東洋埠頭	38,000	204.00	7,752,000
宇徳	9,700	600.00	5,820,000
上組	144,000	1,058.00	152,352,000
サンリツ	2,900	527.00	1,528,300
キムラユニティ	2,900	991.00	2,873,900
キューソー流通システム	3,300	1,386.00	4,573,800
郵船ロジスティクス	11,100	1,345.00	14,929,500
近鉄エクスプレス	10,800	4,320.00	46,656,000
東海運	6,500	270.00	1,755,000
エーアイティー	4,700	797.00	3,745,900
NEC ネットエスアイ	14,900	2,357.00	35,119,300
システナ	11,600	862.00	9,999,200
デジタルアーツ	6,300	1,034.00	6,514,200
新日鉄住金ソリューションズ	9,900	3,270.00	32,373,000
キューブシステム	5,100	580.00	2,958,000
コア	5,000	819.00	4,095,000
ソフトクリエイトホールディングス	3,900	907.00	3,537,300
ITホールディングス	39,400	1,958.00	77,145,200
ネオス	3,200	726.00	2,323,200
電算システム	4,100	1,615.00	6,621,500
グリー	71,900	751.00	53,996,900
コーエーテクモホールディングス	26,900	1,734.00	46,644,600
三菱総合研究所	4,600	2,848.00	13,100,800
ボルテージ	2,100	1,293.00	2,715,300
電算	1,200	2,159.00	2,590,800
AGS	1,900	908.00	1,725,200
ヒト・コミュニケーションズ	1,700	1,627.00	2,765,900
ブレインパッド	1,300	1,181.00	1,535,300
KLab	12,500	1,293.00	16,162,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,800	863.00	6,731,400
イーブックイニシアティブジャパン	2,700	1,172.00	3,164,400
ネクソン	112,600	1,179.00	132,755,400

アイスタイル	3,900	492.00	1,918,800
エムアップ	3,100	660.00	2,046,000
エイチーム	1,400	5,210.00	7,294,000
e n i s h	2,600	1,655.00	4,303,000
コロプラ	20,800	2,745.00	57,096,000
モバイルクリエイト	5,100	826.00	4,212,600
オルトプラス	2,200	837.00	1,841,400
ブロードリーフ	9,800	1,685.00	16,513,000
ハーツユナイテッドグループ	3,600	1,802.00	6,487,200
ベリサーブ	1,400	1,090.00	1,526,000
ティーガイア	11,800	1,197.00	14,124,600
豆蔵ホールディングス	9,300	654.00	6,082,200
テクマトリックス	5,100	639.00	3,258,900
GMOペイメントゲートウェイ	10,300	2,154.00	22,186,200
ザッパラス	6,600	565.00	3,729,000
インターネットイニシアティブ	19,200	2,479.00	47,596,800
GMOクラウド	2,000	1,123.00	2,246,000
ビットアイル	13,300	450.00	5,985,000
SRAホールディングス	6,100	1,399.00	8,533,900
システムインテグレータ	1,300	568.00	738,400
パイブドピッツ	1,100	1,677.00	1,844,700
朝日ネット	12,100	509.00	6,158,900
コムチュア	2,000	1,844.00	3,688,000
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,500	3,265.00	8,162,500
フェイス	3,600	1,140.00	4,104,000
野村総合研究所	67,300	3,810.00	256,413,000
サイバネットシステム	9,700	547.00	5,305,900
CEホールディングス	1,400	1,322.00	1,850,800
インテージホールディングス	6,800	1,687.00	11,471,600
東邦システムサイエンス	3,500	611.00	2,138,500
ソースネクスト	5,900	825.00	4,867,500
ティー・ワイ・オー	11,700	178.00	2,082,600
クレスコ	2,700	1,495.00	4,036,500
フジ・メディア・ホールディングス	123,800	1,491.00	184,585,800
オービック	41,000	3,685.00	151,085,000
ジャストシステム	16,200	783.00	12,684,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,600	1,009.00	2,623,400
ヤフー	851,900	417.00	355,242,300
トレンドマイクロ	63,000	3,550.00	223,650,000
インフォメーション・ディベロプメント	2,300	888.00	2,042,400
日本オラクル	19,000	4,475.00	85,025,000
アルファシステムズ	3,900	1,574.00	6,138,600

フューチャーアーキテクト	12,500	673.00	8,412,500	
C A C Holdings	8,100	1,194.00	9,671,400	
ソフトバンク・テクノロジー	3,200	1,297.00	4,150,400	
トーセ	2,900	715.00	2,073,500	
オービックビジネスコンサルタント	7,500	3,460.00	25,950,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	13,500	4,450.00	60,075,000	
アイティフォー	14,300	445.00	6,363,500	
東計電算	2,100	1,789.00	3,756,900	
エクスネット	1,100	1,416.00	1,557,600	
大塚商会	32,000	3,975.00	127,200,000	
サイボウズ	15,800	402.00	6,351,600	
ソフトブレーン	16,200	198.00	3,207,600	
アグレックス	2,900	1,428.00	4,141,200	
電通国際情報サービス	7,300	1,213.00	8,854,900	
E Mシステムズ	1,400	1,701.00	2,381,400	
ウェザーニューズ	3,500	2,829.00	9,901,500	
C I J	10,000	498.00	4,980,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,200	1,373.00	1,647,600	
日本エンタープライズ	7,400	433.00	3,204,200	
WOWOW	2,800	4,755.00	13,314,000	
日本コロムビア	4,000	440.00	1,760,000	
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,200	486.00	3,013,200	
ネットワンシステムズ	48,200	688.00	33,161,600	
アルゴグラフィックス	4,900	1,817.00	8,903,300	
マーベラス	20,000	1,999.00	39,980,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	23,600	1,779.00	41,984,400	
日本ユニシス	32,800	1,044.00	34,243,200	
兼松エレクトロニクス	7,500	1,644.00	12,330,000	
東京放送ホールディングス	71,200	1,378.00	98,113,600	
日本テレビホールディングス	108,500	1,809.00	196,276,500	
朝日放送	11,700	921.00	10,775,700	
テレビ朝日ホールディングス	32,500	1,909.00	62,042,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	90,200	685.00	61,787,000	
テレビ東京ホールディングス	9,700	2,480.00	24,056,000	
コネクシオ	8,400	1,130.00	9,492,000	
クロップス	900	523.00	470,700	
日本電信電話	465,200	6,446.00	2,998,679,200	代用有価証券 200,000株
K D D I	402,600	7,718.00	3,107,266,800	
光通信	10,700	7,550.00	80,785,000	
N T T ドコモ	979,500	1,851.00	1,813,054,500	
G M O インターネット	39,700	1,018.00	40,414,600	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	31,000	2,004.00	62,124,000	



学研ホールディングス	40,000	251.00	10,040,000	
ゼンリン	15,700	1,359.00	21,336,300	
昭文社	7,100	845.00	5,999,500	
インプレスホールディングス	8,400	126.00	1,058,400	
アイネット	5,300	905.00	4,796,500	
松竹	78,000	1,081.00	84,318,000	
東宝	84,800	2,678.00	227,094,400	
東映	44,000	683.00	30,052,000	
AOI Pro.	5,500	741.00	4,075,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	73,400	4,325.00	317,455,000	
D T S	12,300	2,432.00	29,913,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	43,200	2,348.00	101,433,600	
シーイーシー	7,700	1,123.00	8,647,100	
カプコン	30,400	1,776.00	53,990,400	
ジャステック	6,800	781.00	5,310,800	
S C S K	28,300	2,985.00	84,475,500	
日本システムウエア	4,500	677.00	3,046,500	
アイネス	16,200	888.00	14,385,600	
T K C	10,000	1,932.00	19,320,000	
富士ソフト	16,400	2,617.00	42,918,800	
N S D	25,200	1,734.00	43,696,800	
コナミ	48,300	2,180.00	105,294,000	
福井コンピュータホールディングス	3,200	791.00	2,531,200	
J B C Cホールディングス	9,900	754.00	7,464,600	
ミロク情報サービス	7,800	593.00	4,625,400	
ソフトバンク	628,700	7,421.00	4,665,582,700	
ハウスイ	10,000	128.00	1,280,000	
高千穂交易	4,600	1,020.00	4,692,000	
伊藤忠食品	2,900	3,680.00	10,672,000	
エレマテック	5,600	2,500.00	14,000,000	
J A L U X	3,400	1,540.00	5,236,000	
あらた	27,000	318.00	8,586,000	
トーメンデバイス	1,800	1,802.00	3,243,600	
東京エレクトロン デバイス	2,400	1,532.00	3,676,800	
双日	795,700	168.00	133,677,600	
アルフレッサ ホールディングス	140,700	1,361.00	191,492,700	
横浜冷凍	29,500	797.00	23,511,500	
山下医科器械	1,000	1,636.00	1,636,000	
ラサ商事	5,600	526.00	2,945,600	
アルコニックス	6,700	1,968.00	13,185,600	
神戸物産	1,900	6,930.00	13,167,000	
あい ホールディングス	19,100	2,244.00	42,860,400	

ディーブイエックス	3,500	1,064.00	3,724,000
ダイワボウホールディングス	108,000	214.00	23,112,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,400	892.00	19,980,800
八洲電機	9,300	543.00	5,049,900
U K C ホールディングス	7,700	1,752.00	13,490,400
T O K A I ホールディングス	58,200	518.00	30,147,600
三洋貿易	7,100	1,319.00	9,364,900
ウイン・パートナーズ	3,900	1,524.00	5,943,600
ミタチ産業	2,800	762.00	2,133,600
シップヘルスケアホールディングス	21,800	2,658.00	57,944,400
スターティア	1,000	1,688.00	1,688,000
富士興産	4,600	623.00	2,865,800
協栄産業	15,000	231.00	3,465,000
小野建	10,400	986.00	10,254,400
佐島電機	9,500	727.00	6,906,500
エコートレーディング	2,800	657.00	1,839,600
伯東	7,700	1,203.00	9,263,100
コンドーテック	8,700	778.00	6,768,600
中山福	6,900	851.00	5,871,900
ナガイレーベン	17,200	1,910.00	32,852,000
三菱食品	13,100	2,620.00	34,322,000
松田産業	8,700	1,286.00	11,188,200
メディカルホールディングス	118,900	1,314.00	156,234,600
アドヴァン	6,100	1,181.00	7,204,100
S P K	2,600	2,037.00	5,296,200
アズワン	8,500	2,994.00	25,449,000
スズデン	3,900	667.00	2,601,300
尾家産業	3,900	836.00	3,260,400
シモジマ	7,300	1,013.00	7,394,900
ドウシシャ	15,400	1,672.00	25,748,800
小津産業	2,400	1,766.00	4,238,400
高速	7,100	900.00	6,390,000
黒田電気	20,000	1,522.00	30,440,000
丸文	10,600	811.00	8,596,600
ハピネット	7,200	1,595.00	11,484,000
橋本総業	2,200	1,898.00	4,175,600
エクセル	5,400	1,509.00	8,148,600
マルカキカイ	3,900	1,405.00	5,479,500
ガリバーインターナショナル	36,100	829.00	29,926,900
日本エム・ディ・エム	10,000	560.00	5,600,000
進和	7,100	1,285.00	9,123,500
エスケイジャパン	3,100	250.00	775,000

ダイトエレクトロン	5,500	568.00	3,124,000
シークス	7,600	2,198.00	16,704,800
田中商事	3,700	691.00	2,556,700
オーハシテクニカ	6,500	1,491.00	9,691,500
マクニカ	6,100	3,260.00	19,886,000
白銅	3,900	1,063.00	4,145,700
伊藤忠商事	995,100	1,295.00	1,288,654,500
丸紅	1,040,000	714.60	743,184,000
高島	22,000	243.00	5,346,000
長瀬産業	72,500	1,391.00	100,847,500
蝶理	7,600	1,744.00	13,254,400
豊田通商	132,400	2,725.00	360,790,000
三共生興	20,300	461.00	9,358,300
兼松	237,000	174.00	41,238,000
ツカモトコーポレーション	21,000	134.00	2,814,000
三井物産	1,007,800	1,598.50	1,610,968,300
日本紙パルプ商事	62,000	317.00	19,654,000
日立ハイテクノロジーズ	41,200	3,535.00	145,642,000
カメイ	15,500	799.00	12,384,500
東都水産	20,000	196.00	3,920,000
OUGホールディングス	19,000	227.00	4,313,000
スターゼン	46,000	392.00	18,032,000
山善	45,700	818.00	37,382,600
椿本興業	14,000	299.00	4,186,000
住友商事	701,600	1,235.50	866,826,800
内田洋行	29,000	357.00	10,353,000
三菱商事	911,100	2,170.00	1,977,087,000
第一実業	29,000	607.00	17,603,000
キャノンマーケティングジャパン	33,900	2,088.00	70,783,200
西華産業	39,000	272.00	10,608,000
佐藤商事	10,700	746.00	7,982,200
菱洋エレクトロ	13,800	1,213.00	16,739,400
東京産業	11,900	480.00	5,712,000
ユアサ商事	10,400	2,387.00	24,824,800
神鋼商事	30,000	263.00	7,890,000
小林産業	8,900	263.00	2,340,700
阪和興業	119,000	429.00	51,051,000
カナデン	12,000	805.00	9,660,000
菱電商事	18,000	812.00	14,616,000
フルサト工業	6,600	1,610.00	10,626,000
岩谷産業	132,000	867.00	114,444,000
すてきナイスグループ	51,000	194.00	9,894,000

昭光通商	42,000	185.00	7,770,000
ニチモウ	19,000	202.00	3,838,000
極東貿易	14,000	227.00	3,178,000
イワキ	18,000	223.00	4,014,000
三愛石油	30,000	746.00	22,380,000
稲畑産業	28,600	1,079.00	30,859,400
G S I クレオス	32,000	139.00	4,448,000
明和産業	9,500	465.00	4,417,500
ワキタ	25,300	1,123.00	28,411,900
東邦ホールディングス	41,000	1,673.00	68,593,000
サンゲツ	22,600	2,894.00	65,404,400
ミツウロコグループホールディングス	19,200	536.00	10,291,200
シナネン	26,000	440.00	11,440,000
伊藤忠エネクス	26,300	837.00	22,013,100
サンリオ	33,300	3,160.00	105,228,000
サンワテクノス	7,600	1,171.00	8,899,600
リョーサン	20,100	2,615.00	52,561,500
新光商事	14,000	1,206.00	16,884,000
トーホー	26,000	426.00	11,076,000
三信電気	15,200	817.00	12,418,400
東陽テクニカ	17,500	1,052.00	18,410,000
モスフードサービス	15,600	2,164.00	33,758,400
加賀電子	10,800	1,413.00	15,260,400
ソーダニッカ	12,000	477.00	5,724,000
立花エレテック	7,300	1,525.00	11,132,500
フォーバル	2,400	1,170.00	2,808,000
P a l t a c	19,100	1,359.00	25,956,900
ヤマタネ	59,000	179.00	10,561,000
丸紅建材リース	10,000	305.00	3,050,000
日鉄住金物産	78,000	421.00	32,838,000
トラスコ中山	14,800	3,170.00	46,916,000
オートバックスセブン	43,800	1,706.00	74,722,800
加藤産業	17,100	2,298.00	39,295,800
イノテック	11,000	487.00	5,357,000
イエローハット	11,200	2,396.00	26,835,200
富士エレクトロニクス	6,100	1,356.00	8,271,600
J K ホールディングス	11,500	566.00	6,509,000
日伝	4,900	2,436.00	11,936,400
北沢産業	10,100	178.00	1,797,800
杉本商事	6,400	1,148.00	7,347,200
因幡電機産業	17,600	3,895.00	68,552,000
バイテック	4,100	948.00	3,886,800

ミスミグループ本社	44,400	3,745.00	166,278,000
江守グループホールディングス	5,100	1,113.00	5,676,300
アルテック	6,500	209.00	1,358,500
タキヒヨー	20,000	405.00	8,100,000
スズケン	49,200	2,989.00	147,058,800
ジェコス	8,200	1,781.00	14,604,200
ルネサスイーストン	5,500	716.00	3,938,000
ローソン	45,000	7,240.00	325,800,000
サンエー	9,000	3,915.00	35,235,000
ダイユーエイト	2,400	770.00	1,848,000
カワチ薬品	9,200	1,764.00	16,228,800
エービーシー・マート	16,900	5,630.00	95,147,000
ハードオフコーポレーション	5,800	878.00	5,092,400
アスクル	12,400	1,935.00	23,994,000
ゲオホールディングス	22,400	976.00	21,862,400
アダストリアホールディングス	10,000	2,723.00	27,230,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	134.00	2,010,000
くらコーポレーション	7,000	2,931.00	20,517,000
キャンドウ	5,700	1,591.00	9,068,700
パル	6,900	3,060.00	21,114,000
エディオン	54,500	826.00	45,017,000
サーラコーポレーション	10,200	600.00	6,120,000
ワッツ	4,700	839.00	3,943,300
あみやき亭	2,100	3,875.00	8,137,500
ひらまつ	16,400	616.00	10,102,400
ゲンキー	1,200	6,920.00	8,304,000
サッポロドラッグストアー	1,000	1,821.00	1,821,000
大黒天物産	2,800	3,320.00	9,296,000
ハニーズ	9,400	984.00	9,249,600
アルペン	10,600	1,765.00	18,709,000
クオール	9,300	761.00	7,077,300
ジェイアイエヌ	8,100	2,929.00	23,724,900
ビックカメラ	51,600	1,101.00	56,811,600
D C Mホールディングス	57,500	752.00	43,240,000
MonotaRO	23,200	2,571.00	59,647,200
きちり	2,400	736.00	1,766,400
アーランドサービス	1,400	3,505.00	4,907,000
J.フロント リテイリング	150,400	1,441.00	216,726,400
ドトール・日レスホールディングス	20,800	1,670.00	34,736,000
マツモトキヨシホールディングス	26,600	3,260.00	86,716,000
ブロンコビリー	2,100	3,050.00	6,405,000
スタートトゥデイ	37,000	2,350.00	86,950,000

物語コーポレーション	2,900	3,495.00	10,135,500
ココカラファイン	12,400	2,868.00	35,563,200
三越伊勢丹ホールディングス	236,300	1,471.00	347,597,300
ウエルシアホールディングス	10,700	3,535.00	37,824,500
クリエイティブSDホールディングス	5,000	3,970.00	19,850,000
丸善CHホールディングス	11,100	356.00	3,951,600
エー・ピーカンパニー	1,700	1,798.00	3,056,600
チムニー	2,200	2,310.00	5,082,000
ネクステージ	1,100	534.00	587,400
ジョイフル本田	6,500	4,175.00	27,137,500
キリン堂ホールディングス	3,800	710.00	2,698,000
すかいらーく	43,600	1,209.00	52,712,400
ブックオフコーポレーション	6,800	822.00	5,589,600
あさひ	7,900	1,159.00	9,156,100
日本調剤	1,500	4,180.00	6,270,000
コスモス薬品	6,700	15,770.00	105,659,000
トーエル	6,300	655.00	4,126,500
一六堂	2,700	430.00	1,161,000
セブン&アイ・ホールディングス	497,300	4,351.50	2,164,000,950
薬王堂	1,700	1,695.00	2,881,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	8,300	1,553.00	12,889,900
ツルハホールディングス	23,500	6,710.00	157,685,000
サンマルクホールディングス	4,300	6,620.00	28,466,000
フェリシモ	3,000	1,035.00	3,105,000
トリドール	12,200	1,590.00	19,398,000
クスリのアオキ	5,300	5,850.00	31,005,000
メディカルシステムネットワーク	10,400	352.00	3,660,800
総合メディカル	2,900	5,860.00	16,994,000
はるやま商事	5,000	699.00	3,495,000
カッパ・クリエイティブホールディングス	19,200	1,063.00	20,409,600
ライトオン	8,900	709.00	6,310,100
良品計画	14,700	13,550.00	199,185,000
三城ホールディングス	14,700	470.00	6,909,000
コナカ	14,000	631.00	8,834,000
ハウスオブローゼ	1,300	1,390.00	1,807,000
G-7ホールディングス	2,500	939.00	2,347,500
イオン北海道	8,200	677.00	5,551,400
コジマ	17,500	295.00	5,162,500
ヒマラヤ	2,800	958.00	2,682,400
コーナン商事	18,200	1,328.00	24,169,600
エコス	4,100	866.00	3,550,600
ワタミ	14,000	1,169.00	16,366,000

マルシェ	2,900	865.00	2,508,500
ドンキホーテホールディングス	41,100	7,950.00	326,745,000
西松屋チェーン	23,400	1,067.00	24,967,800
ゼンショーホールディングス	61,100	973.00	59,450,300
幸楽苑	7,400	1,488.00	11,011,200
ハークスレイ	3,300	928.00	3,062,400
サイゼリヤ	17,600	1,587.00	27,931,200
ポプラ	5,000	556.00	2,780,000
ユニテッドアローズ	15,600	3,160.00	49,296,000
ハイデイ日高	7,500	3,710.00	27,825,000
京都きもの友禅	7,400	1,006.00	7,444,400
コロワイド	39,400	1,441.00	56,775,400
壱番屋	4,800	5,210.00	25,008,000
トップカルチャー	4,800	514.00	2,467,200
P L A N T	3,000	1,277.00	3,831,000
スギホールディングス	21,300	4,815.00	102,559,500
スクロール	15,400	287.00	4,419,800
ヨンドシーホールディングス	9,100	1,912.00	17,399,200
ファミリーマート	40,200	4,470.00	179,694,000
木曽路	14,500	1,904.00	27,608,000
サトレストランシステムズ	11,100	883.00	9,801,300
千趣会	21,400	860.00	18,404,000
タカキュー	8,300	212.00	1,759,600
ケーヨー	21,300	530.00	11,289,000
上新電機	26,000	930.00	24,180,000
日本瓦斯	19,100	2,298.00	43,891,800
ベスト電器	38,300	132.00	5,055,600
マルエツ	28,000	533.00	14,924,000
ロイヤルホールディングス	19,800	1,716.00	33,976,800
東天紅	9,000	179.00	1,611,000
いなげや	13,300	1,180.00	15,694,000
島忠	28,800	2,985.00	85,968,000
チヨダ	14,000	2,196.00	30,744,000
ライフコーポレーション	7,900	1,683.00	13,295,700
カスミ	24,400	1,023.00	24,961,200
リンガーハット	11,600	1,745.00	20,242,000
MrMax	11,900	282.00	3,355,800
テンアライド	9,500	352.00	3,344,000
AOKIホールディングス	27,300	1,180.00	32,214,000
オークワ	19,000	935.00	17,765,000
コメリ	20,400	2,530.00	51,612,000
青山商事	29,900	2,551.00	76,274,900

しまむら	13,800	9,610.00	132,618,000
C F S コーポレーション	7,900	647.00	5,111,300
はせがわ	4,200	562.00	2,360,400
高島屋	173,000	964.00	166,772,000
松屋	24,800	1,616.00	40,076,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	56,200	1,894.00	106,442,800
近鉄百貨店	45,000	312.00	14,040,000
ニッセンホールディングス	25,000	346.00	8,650,000
パルコ	11,400	961.00	10,955,400
丸井グループ	143,400	1,028.00	147,415,200
アクシアル リテイリング	9,200	2,673.00	24,591,600
ダイエー	134,000	138.00	18,492,000
イオン	474,900	1,206.00	572,729,400
ユニーグループ・ホールディングス	114,800	588.00	67,502,400
イズミ	26,600	3,870.00	102,942,000
東武ストア	16,000	282.00	4,512,000
平和堂	24,100	2,169.00	52,272,900
フジ	13,400	2,063.00	27,644,200
ヤオコー	6,700	7,090.00	47,503,000
ゼビオ	16,100	1,983.00	31,926,300
ケーズホールディングス	27,400	2,933.00	80,364,200
O l y m p i c グループ	7,000	918.00	6,426,000
日産東京販売ホールディングス	18,600	288.00	5,356,800
アインファーマシーズ	13,100	3,310.00	43,361,000
元気寿司	3,700	2,164.00	8,006,800
ヤマダ電機	469,900	379.00	178,092,100
アークランドサカモト	8,500	2,403.00	20,425,500
ニトリホールディングス	51,400	6,680.00	343,352,000
グルメ杵屋	8,000	881.00	7,048,000
愛眼	9,500	255.00	2,422,500
ケーユーホールディングス	5,300	617.00	3,270,100
吉野家ホールディングス	33,500	1,338.00	44,823,000
松屋フーズ	5,700	2,142.00	12,209,400
サガミチェーン	15,000	1,051.00	15,765,000
関西スーパーマーケット	8,900	787.00	7,004,300
王将フードサービス	8,700	4,175.00	36,322,500
プレナス	13,300	2,049.00	27,251,700
ミニストップ	8,800	1,574.00	13,851,200
アークス	20,700	2,444.00	50,590,800
バロー	25,600	2,043.00	52,300,800
藤久	900	1,698.00	1,528,200
ベルク	5,300	3,580.00	18,974,000



大庄	6,400	1,329.00	8,505,600
ファーストリテイリング	23,800	42,405.00	1,009,239,000
サンドラッグ	25,100	4,810.00	120,731,000
サクスパー ホールディングス	8,900	1,437.00	12,789,300
ヤマザワ	2,500	1,632.00	4,080,000
やまや	2,000	1,578.00	3,156,000
ペルーナ	29,700	490.00	14,553,000
島根銀行	2,500	1,381.00	3,452,500
じもとホールディングス	85,300	222.00	18,936,600
足利ホールディングス	74,800	466.00	34,856,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,300	3,250.00	49,725,000
新生銀行	1,131,000	212.00	239,772,000
あおぞら銀行	802,000	378.00	303,156,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,538,200	680.40	6,489,791,280
りそなホールディングス	1,390,700	623.00	866,406,100
三井住友トラスト・ホールディングス	2,627,000	479.60	1,259,909,200
三井住友フィナンシャルグループ	899,000	4,392.00	3,948,408,000
第四銀行	150,000	403.00	60,450,000
北越銀行	128,000	219.00	28,032,000
西日本シティ銀行	417,000	359.00	149,703,000
千葉銀行	458,000	783.00	358,614,000
横浜銀行	821,000	674.90	554,092,900
常陽銀行	432,000	596.00	257,472,000
群馬銀行	282,000	739.00	208,398,000
武蔵野銀行	19,000	3,945.00	74,955,000
千葉興業銀行	24,700	856.00	21,143,200
筑波銀行	49,400	373.00	18,426,200
七十七銀行	201,000	638.00	128,238,000
青森銀行	93,000	342.00	31,806,000
秋田銀行	79,000	337.00	26,623,000
山形銀行	72,000	517.00	37,224,000
岩手銀行	8,300	5,100.00	42,330,000
東邦銀行	106,000	407.00	43,142,000
東北銀行	64,000	155.00	9,920,000
みちのく銀行	59,000	222.00	13,098,000
ふくおかフィナンシャルグループ	482,000	647.00	311,854,000
静岡銀行	348,000	1,112.00	386,976,000
十六銀行	149,000	434.00	64,666,000
スルガ銀行	125,500	2,180.00	273,590,000
八十二銀行	215,000	748.00	160,820,000
山梨中央銀行	76,000	499.00	37,924,000
大垣共立銀行	149,000	358.00	53,342,000

福井銀行	102,000	266.00	27,132,000
北國銀行	132,000	384.00	50,688,000
清水銀行	4,000	2,981.00	11,924,000
滋賀銀行	119,000	644.00	76,636,000
南都銀行	115,000	415.00	47,725,000
百五銀行	114,000	506.00	57,684,000
京都銀行	227,000	1,030.00	233,810,000
紀陽銀行	46,700	1,525.00	71,217,500
三重銀行	53,000	272.00	14,416,000
ほくほくフィナンシャルグループ	809,000	243.00	196,587,000
広島銀行	351,000	572.00	200,772,000
山陰合同銀行	73,000	881.00	64,313,000
中国銀行	85,500	1,659.00	141,844,500
鳥取銀行	38,000	242.00	9,196,000
伊予銀行	127,100	1,272.00	161,671,200
百十四銀行	130,000	394.00	51,220,000
四国銀行	92,000	254.00	23,368,000
阿波銀行	97,000	638.00	61,886,000
鹿児島銀行	83,000	742.00	61,586,000
大分銀行	73,000	434.00	31,682,000
宮崎銀行	79,000	373.00	29,467,000
肥後銀行	97,000	651.00	63,147,000
佐賀銀行	72,000	267.00	19,224,000
十八銀行	73,000	350.00	25,550,000
沖縄銀行	9,400	5,000.00	47,000,000
琉球銀行	24,500	1,753.00	42,948,500
セブン銀行	400,900	494.00	198,044,600
みずほフィナンシャルグループ	16,431,700	205.00	3,368,498,500
高知銀行	46,000	159.00	7,314,000
山口フィナンシャルグループ	119,000	1,197.00	142,443,000
長野銀行	39,000	203.00	7,917,000
名古屋銀行	107,000	448.00	47,936,000
北洋銀行	179,100	456.00	81,669,600
愛知銀行	4,300	6,010.00	25,843,000
第三銀行	67,000	196.00	13,132,000
中京銀行	49,000	215.00	10,535,000
東日本銀行	52,000	346.00	17,992,000
大光銀行	42,000	226.00	9,492,000
愛媛銀行	70,000	247.00	17,290,000
トマト銀行	46,000	178.00	8,188,000
みなと銀行	108,000	217.00	23,436,000
京葉銀行	98,000	686.00	67,228,000

関西アーバン銀行	16,600	1,282.00	21,281,200
栃木銀行	60,000	550.00	33,000,000
北日本銀行	3,700	2,846.00	10,530,200
東和銀行	162,000	105.00	17,010,000
福島銀行	146,000	95.00	13,870,000
大東銀行	76,000	143.00	10,868,000
トモニホールディングス	91,200	521.00	47,515,200
フィデアホールディングス	68,400	231.00	15,800,400
池田泉州ホールディングス	98,100	556.00	54,543,600
F P G	10,700	1,509.00	16,146,300
S B Iホールディングス	143,100	1,384.00	198,050,400
ジャフコ	16,500	4,415.00	72,847,500
大和証券グループ本社	1,113,000	959.70	1,068,146,100
野村ホールディングス	2,431,800	715.80	1,740,682,440
岡三証券グループ	101,000	944.00	95,344,000
丸三証券	38,100	829.00	31,584,900
東洋証券	48,000	353.00	16,944,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	136,500	865.00	118,072,500
光世証券	29,000	250.00	7,250,000
水戸証券	38,000	440.00	16,720,000
いちよし証券	25,000	1,348.00	33,700,000
松井証券	60,500	1,107.00	66,973,500
だいこう証券ビジネス	6,100	756.00	4,611,600
マネックスグループ	140,100	290.00	40,629,000
カブドットコム証券	52,900	593.00	31,369,700
極東証券	16,300	1,934.00	31,524,200
岩井コスモホールディングス	12,300	1,303.00	16,026,900
マネースクウェアHD	3,700	1,567.00	5,797,900
マネーパートナーズグループ	12,100	496.00	6,001,600
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	264,100	3,064.50	809,334,450
アニコム ホールディングス	4,900	1,425.00	6,982,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	379,000	2,874.00	1,089,246,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	113,900	1,777.00	202,400,300
第一生命保険	761,600	1,788.50	1,362,121,600
東京海上ホールディングス	489,300	3,859.00	1,888,208,700
T & Dホールディングス	433,300	1,453.50	629,801,550
全国保証	30,900	3,545.00	109,540,500
クレディセゾン	97,100	2,182.00	211,872,200
アクリーティブ	8,100	218.00	1,765,800
芙蓉総合リース	12,500	4,095.00	51,187,500
興銀リース	22,300	2,357.00	52,561,100
東京センチュリーリース	27,900	2,920.00	81,468,000

日本証券金融	56,200	619.00	34,787,800
アイフル	198,800	411.00	81,706,800
ポケットカード	8,900	593.00	5,277,700
リコーリース	9,300	3,060.00	28,458,000
イオンフィナンシャルサービス	77,900	2,473.00	192,646,700
アコム	238,800	336.00	80,236,800
ジャックス	66,000	582.00	38,412,000
オリエントコーポレーション	274,700	202.00	55,489,400
日立キャピタル	23,300	2,692.00	62,723,600
アプラスフィナンシャル	57,000	135.00	7,695,000
オリックス	841,600	1,575.50	1,325,940,800
三菱UFJリース	301,500	559.00	168,538,500
日本取引所グループ	174,500	2,886.00	503,607,000
イー・ギャランティ	3,500	1,841.00	6,443,500
アサックス	2,100	1,439.00	3,021,900
NECキャピタルソリューション	4,800	1,975.00	9,480,000
日本駐車場開発	129,700	123.00	15,953,100
ヒューリック	200,700	1,117.00	224,181,900
東京建物不動産販売	6,100	397.00	2,421,700
三栄建築設計	4,800	886.00	4,252,800
野村不動産ホールディングス	71,500	2,099.00	150,078,500
プレサンスコーポレーション	3,100	3,735.00	11,578,500
常和ホールディングス	4,400	3,400.00	14,960,000
日本管理センター	2,800	2,527.00	7,075,600
エストラスト	1,300	660.00	858,000
フージャースホールディングス	17,800	491.00	8,739,800
オープンハウス	7,500	2,145.00	16,087,500
東急不動産ホールディングス	311,700	803.00	250,295,100
飯田グループホールディングス	77,100	1,333.00	102,774,300
パーク24	59,800	1,903.00	113,799,400
パラカ	4,500	851.00	3,829,500
三井不動産	630,000	3,301.00	2,079,630,000
三菱地所	884,000	2,570.00	2,271,880,000
平和不動産	22,500	1,762.00	39,645,000
東京建物	259,000	928.00	240,352,000
ダイビル	30,700	1,140.00	34,998,000
京阪神ビルディング	19,800	619.00	12,256,200
住友不動産	285,000	4,110.00	1,171,350,000
大京	190,000	196.00	37,240,000
テーオーシー	41,100	674.00	27,701,400
東京楽天地	20,000	501.00	10,020,000
レオパレス21	130,100	697.00	90,679,700

スターツコーポレーション	13,700	1,563.00	21,413,100
フジ住宅	15,300	669.00	10,235,700
空港施設	14,500	712.00	10,324,000
明和地所	6,800	512.00	3,481,600
住友不動産販売	8,600	2,633.00	22,643,800
ゴールドクレスト	10,700	2,115.00	22,630,500
日本エスリード	4,700	1,194.00	5,611,800
日神不動産	16,000	472.00	7,552,000
タカラレーベン	53,600	517.00	27,711,200
サンヨーハウジング名古屋	6,700	1,177.00	7,885,900
イオンモール	76,700	2,011.00	154,243,700
ファースト住建	4,500	1,167.00	5,251,500
トーセイ	16,300	673.00	10,969,900
穴吹興産	11,000	262.00	2,882,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	73,900	1,184.00	87,497,600
サンフロンティア不動産	12,900	1,083.00	13,970,700
エフ・ジェー・ネクスト	6,900	540.00	3,726,000
ランドビジネス	6,000	408.00	2,448,000
グランディハウス	10,600	288.00	3,052,800
日本空港ビルデング	41,100	4,690.00	192,759,000
日本工営	42,000	461.00	19,362,000
ネクスト	15,400	953.00	14,676,200
日本M & Aセンター	19,500	3,420.00	66,690,000
ノバレーゼ	3,200	901.00	2,883,200
アコーディア・ゴルフ	47,700	1,048.00	49,989,600
タケエイ	9,300	964.00	8,965,200
トラスト・テック	2,200	1,775.00	3,905,000
パソナグループ	9,400	535.00	5,029,000
C D S	2,900	1,008.00	2,923,200
リンクアンドモチベーション	17,000	161.00	2,737,000
G C Aサヴィアン	8,500	1,165.00	9,902,500
エス・エム・エス	7,100	2,593.00	18,410,300
テンプホールディングス	24,800	3,495.00	86,676,000
リニカル	3,300	923.00	3,045,900
クックパッド	6,400	3,705.00	23,712,000
エスクリ	5,400	981.00	5,297,400
アイ・ケイ・ケイ	3,200	892.00	2,854,400
学情	4,700	1,127.00	5,296,900
スタジオアリス	5,800	1,614.00	9,361,200
シミックホールディングス	4,800	1,700.00	8,160,000
総合警備保障	42,000	2,714.00	113,988,000
カカクコム	83,700	1,844.00	154,342,800

アイロムホールディングス	3,100	2,252.00	6,981,200
ルネサンス	6,500	1,167.00	7,585,500
ディップ	3,100	4,285.00	13,283,500
オプト	5,600	780.00	4,368,000
ツクイ	15,500	950.00	14,725,000
総合臨床ホールディングス	5,700	492.00	2,804,400
キャリアデザインセンター	3,900	898.00	3,502,200
エムスリー	108,900	1,986.00	216,275,400
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	750.00	6,225,000
アウトソーシング	5,400	1,675.00	9,045,000
ディー・エヌ・エー	62,100	1,417.00	87,995,700
博報堂D Yホールディングス	174,400	1,140.00	198,816,000
ぐるなび	15,600	1,702.00	26,551,200
一休	9,900	1,376.00	13,622,400
ファンコミュニケーションズ	22,500	1,367.00	30,757,500
ジェイコムホールディングス	2,600	774.00	2,012,400
P G Mホールディングス	17,800	1,102.00	19,615,600
W D Bホールディングス	1,600	1,727.00	2,763,200
ティア	4,200	610.00	2,562,000
バリューコマース	8,800	644.00	5,667,200
J Pホールディングス	31,600	371.00	11,723,600
イーピーエス	14,900	1,203.00	17,924,700
プレステージ・インターナショナル	9,600	1,031.00	9,897,600
アミューズ	3,900	3,050.00	11,895,000
ドリームインキュベータ	4,500	2,361.00	10,624,500
クイック	5,300	814.00	4,314,200
T A C	11,100	226.00	2,508,600
ケネディクス	181,800	537.00	97,626,600
電通	140,200	4,770.00	668,754,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	1,024.00	6,348,800
ぴあ	3,700	2,009.00	7,433,300
イオンファンタジー	4,100	1,503.00	6,162,300
ネクシィーズ	5,700	619.00	3,528,300
みらかホールディングス	33,100	4,870.00	161,197,000
アルプス技研	5,100	1,504.00	7,670,400
ダイオーズ	2,400	902.00	2,164,800
日本空調サービス	6,200	776.00	4,811,200
オリエンタルランド	34,000	25,955.00	882,470,000
ダスキン	35,700	1,757.00	62,724,900
明光ネットワークジャパン	12,500	1,233.00	15,412,500
ファルコホールディングス	6,000	1,263.00	7,578,000
秀英予備校	2,500	330.00	825,000

田谷	2,100	771.00	1,619,100
ラウンドワン	35,800	715.00	25,597,000
リゾートトラスト	46,700	2,548.00	118,991,600
ビー・エム・エル	7,400	3,345.00	24,753,000
ワタベウェディング	4,100	524.00	2,148,400
もしもしホットライン	23,500	1,122.00	26,367,000
早稲田アカデミー	1,900	793.00	1,506,700
ユー・エス・エス	152,300	1,759.00	267,895,700
東京個別指導学院	6,100	371.00	2,263,100
サイバーエージェント	23,100	4,525.00	104,527,500
楽天	546,300	1,593.00	870,255,900
テー・オー・ダブリュー	4,100	841.00	3,448,100
セントラルスポーツ	4,300	1,784.00	7,671,200
フルキャストホールディングス	13,000	476.00	6,188,000
リゾートソリューション	12,000	237.00	2,844,000
リブセンス	8,400	781.00	6,560,400
ジャパンマテリアル	5,600	1,659.00	9,290,400
ウチヤマホールディングス	5,500	607.00	3,338,500
サクセスホールディングス	1,300	1,406.00	1,827,800
アサンテ	3,100	1,234.00	3,825,400
E R Iホールディングス	2,900	1,098.00	3,184,200
リクルートホールディングス	142,700	3,625.00	517,287,500
リロ・ホールディング	4,300	8,100.00	34,830,000
東祥	2,700	2,338.00	6,312,600
エイチ・アイ・エス	20,500	3,330.00	68,265,000
共立メンテナンス	6,400	5,300.00	33,920,000
イチネンホールディングス	14,200	987.00	14,015,400
建設技術研究所	7,500	1,572.00	11,790,000
スペース	6,800	1,231.00	8,370,800
燦ホールディングス	2,500	1,624.00	4,060,000
スバル興業	9,000	454.00	4,086,000
東京テアトル	48,000	142.00	6,816,000
よみうりランド	27,000	485.00	13,095,000
東京都競馬	86,000	303.00	26,058,000
カナモト	17,600	3,830.00	67,408,000
東京ドーム	89,000	473.00	42,097,000
西尾レントオール	10,100	4,055.00	40,955,500
トランス・コスモス	16,500	2,015.00	33,247,500
乃村工藝社	24,700	935.00	23,094,500
藤田観光	46,000	360.00	16,560,000
K N T - C Tホールディングス	46,000	166.00	7,636,000
日本管財	5,800	2,796.00	16,216,800

トーカイ	5,600	3,655.00	20,468,000
白洋舎	17,000	243.00	4,131,000
セコム	122,200	6,792.00	829,982,400
セントラル警備保障	5,600	1,171.00	6,557,600
丹青社	15,500	861.00	13,345,500
メイテック	17,000	3,330.00	56,610,000
アサツー ディ・ケイ	23,700	3,045.00	72,166,500
応用地質	13,200	1,750.00	23,100,000
船井総研ホールディングス	14,100	1,003.00	14,142,300
進学会	5,300	443.00	2,347,900
ベネッセホールディングス	46,000	3,615.00	166,290,000
イオンディライト	12,200	2,709.00	33,049,800
ナック	6,700	1,049.00	7,028,300
ニチイ学館	24,700	910.00	22,477,000
ダイセキ	20,300	2,052.00	41,655,600
ステップ	4,200	846.00	3,553,200
合 計	198,165,600		247,338,748,740

(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。

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

## 日本債券マザーファンド

### 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,932,813,574
国債証券	283,980,993,880
地方債証券	22,049,274,046
特殊債券	30,525,928,371
社債券	20,506,716,800
派生商品評価勘定	348,380



	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
未収入金	1,699,506,300
未収利息	1,264,814,242
前払費用	35,747,853
流動資産合計	361,996,143,446
資産合計	361,996,143,446
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	251,620
前受金	100,000
未払金	50,000
未払解約金	845,597,156
流動負債合計	845,998,776
負債合計	845,998,776
純資産の部	
元本等	
元本	280,376,950,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,773,194,494
元本等合計	361,150,144,670
純資産合計	361,150,144,670
負債純資産合計	361,996,143,446

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年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、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発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>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	280,376,950,176口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 106,616,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2881円 (1万口当たり純資産額) (12,881円)

(注) 担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	平成26年12月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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> <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>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	282,952,145,016円
期中追加設定元本額	25,954,723,110円
期中一部解約元本額	28,529,917,950円
期末元本額	280,376,950,176円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	2,747,767,123円
D C 日本債券インデックスファンド	2,580,912,434円
D C 日本債券インデックスファンド L	28,645,884,398円

区分	平成26年12月10日現在
D C バランスファンド 3 0	4,343,513,815円
D C バランスファンド 5 0	3,020,611,149円
D C バランスファンド 7 0	773,759,532円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	95,910,185円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	54,354,769円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	350,321,496円
新生・4分散ファンド	105,159,157円
4 資産インデックスバランスオープン（分配型）	21,779,529円
4 資産インデックスバランスオープン（成長型）	75,985,259円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	143,550,015円
日本債券インデックス e	1,876,886,452円
インデックスコレクション（国内債券）	5,098,811,952円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	2,861,785,367円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	1,430,270,539円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	634,065,879円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,123,437,896円
日本債券パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	4,942,756,096円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	3,855,391,396円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	14,162,065,353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）	6,876,558,389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）	750,492,204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）	3,936,764,800円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	10,627,752,815円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	2,257,424,592円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	25,493,398,930円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	228,009,745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）	22,559,988,551円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	5,518,030,489円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	453,324,940円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	2,265,409,334円
V A バランス株式 4 0（適格機関投資家専用）	659,979,626円
バランスファンド V A（適格機関投資家専用）	5,402,824,301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）	771,966,626円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	1,476,136,847円
バランス V A 2 0（適格機関投資家専用）	478,154,950円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	4,315,967,014円
バランスファンド V A 2（適格機関投資家専用）	6,456,198,906円
バランス V A 2 0 L（適格機関投資家専用）	460,403,774円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	3,112,631,922円
バランスファンド V A 3（適格機関投資家専用）	47,824,130,223円
世界バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	1,009,989,467円
国内バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	260,555,977円
国内バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	102,873,354円

区分	平成26年12月10日現在
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	1,106,291,358円
私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	11,617,244円
世界バランスV A 20（適格機関投資家専用）	15,094,007円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26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	5,880,716,380	
地方債証券	261,480,628	
特殊債券	397,940,546	
社債券	173,414,750	
合計	6,713,552,304	

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（平成26年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引	1,471,303,240			1,471,400,000	96,760
	買建					
合計		1,471,303,240	-	-	1,471,400,000	96,760

## (注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第336回利付国債(2年)	620,000,000	620,706,800	
	第337回利付国債(2年)	1,120,000,000	1,121,377,600	
	第338回利付国債(2年)	1,080,000,000	1,081,414,800	
	第339回利付国債(2年)	680,000,000	680,952,000	
	第340回利付国債(2年)	1,670,000,000	1,672,488,300	
	第341回利付国債(2年)	1,150,000,000	1,151,817,000	
	第342回利付国債(2年)	1,510,000,000	1,512,385,800	
	第343回利付国債(2年)	2,050,000,000	2,053,423,500	
	第344回利付国債(2年)	1,470,000,000	1,472,572,500	
	第345回利付国債(2年)	3,190,000,000	3,195,869,600	
	第95回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,007,670,000	
	第96回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,720,944,000	
	第97回利付国債(5年)	2,260,000,000	2,273,740,800	
	第98回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,305,928,000	
	第99回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,893,329,200	
	第100回利付国債(5年)	1,150,000,000	1,156,106,500	
	第101回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,270,180,800	
	第102回利付国債(5年)	2,535,000,000	2,550,362,100	
	第103回利付国債(5年)	2,830,000,000	2,848,593,100	
	第104回利付国債(5年)	200,000,000	200,860,000	
	第105回利付国債(5年)	3,522,000,000	3,538,835,160	
	第106回利付国債(5年)	5,910,000,000	5,941,086,600	
	第107回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,719,798,300	
	第108回利付国債(5年)	880,000,000	882,384,800	
	第109回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,283,763,200	
	第110回利付国債(5年)	370,000,000	373,503,900	
	第111回利付国債(5年)	1,450,000,000	1,468,473,000	
	第112回利付国債(5年)	660,000,000	668,817,600	
	第113回利付国債(5年)	2,640,000,000	2,666,004,000	
	第114回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,313,468,000	
	第115回利付国債(5年)	2,170,000,000	2,184,300,300	
	第116回利付国債(5年)	3,710,000,000	3,734,560,200	
	第117回利付国債(5年)	3,660,000,000	3,683,350,800	
	第118回利付国債(5年)	1,720,000,000	1,730,853,200	
	第119回利付国債(5年)	2,380,000,000	2,384,284,000	
	第120回利付国債(5年)	1,340,000,000	1,347,959,600	
	第121回利付国債(5年)	3,400,000,000	3,404,012,000	
	第1回利付国債(40年)	270,000,000	340,556,400	
	第2回利付国債(40年)	500,000,000	604,530,000	
	第3回利付国債(40年)	510,000,000	616,518,600	
第4回利付国債(40年)	825,000,000	998,159,250		

第5回利付国債（40年）	730,000,000	842,420,000	
第6回利付国債（40年）	670,000,000	752,537,300	
第7回利付国債（40年）	540,000,000	573,058,800	
第277回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,122,396,000	
第278回利付国債（10年）	800,000,000	818,312,000	
第279回利付国債（10年）	1,130,000,000	1,158,735,900	
第280回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,183,223,500	
第281回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,030,410,000	
第282回利付国債（10年）	1,900,000,000	1,957,247,000	
第283回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,341,470,000	
第284回利付国債（10年）	2,400,000,000	2,482,224,000	
第285回利付国債（10年）	3,080,000,000	3,198,025,600	
第286回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,463,322,000	
第287回利付国債（10年）	1,450,000,000	1,519,237,500	
第288回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,151,678,000	
第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	2,142,270,500	
第290回利付国債（10年）	900,000,000	940,869,000	
第291回利付国債（10年）	820,000,000	854,554,800	
第292回利付国債（10年）	1,080,000,000	1,139,626,800	
第293回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,275,144,000	
第294回利付国債（10年）	900,000,000	953,190,000	
第295回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,146,745,400	
第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	2,269,518,500	
第297回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,213,043,000	
第298回利付国債（10年）	1,360,000,000	1,429,088,000	
第299回利付国債（10年）	1,140,000,000	1,200,944,400	
第300回利付国債（10年）	850,000,000	902,683,000	
第301回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,810,347,000	
第302回利付国債（10年）	870,000,000	922,556,700	
第303回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,743,746,400	
第304回利付国債（10年）	740,000,000	783,290,000	
第305回利付国債（10年）	2,300,000,000	2,440,944,000	
第306回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,465,256,100	
第307回利付国債（10年）	970,000,000	1,032,351,600	
第308回利付国債（10年）	970,000,000	1,035,319,800	
第309回利付国債（10年）	1,040,000,000	1,098,604,000	
第310回利付国債（10年）	2,220,000,000	2,336,683,200	
第311回利付国債（10年）	840,000,000	874,498,800	
第312回利付国債（10年）	2,327,000,000	2,480,954,320	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,762,032,400	
第314回利付国債（10年）	1,020,000,000	1,083,199,200	
第315回利付国債（10年）	1,450,000,000	1,551,819,000	

第316回利付国債(10年)	570,000,000	606,331,800	
第317回利付国債(10年)	790,000,000	841,444,800	
第318回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,661,688,000	
第319回利付国債(10年)	740,000,000	789,121,200	
第320回利付国債(10年)	1,850,000,000	1,959,945,500	
第321回利付国債(10年)	1,890,000,000	2,002,625,100	
第322回利付国債(10年)	810,000,000	852,452,100	
第323回利付国債(10年)	840,000,000	883,890,000	
第324回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,828,470,000	
第325回利付国債(10年)	2,945,000,000	3,075,522,400	
第326回利付国債(10年)	900,000,000	932,580,000	
第327回利付国債(10年)	1,860,000,000	1,941,970,200	
第328回利付国債(10年)	3,105,000,000	3,190,449,600	
第329回利付国債(10年)	3,335,000,000	3,480,739,500	
第330回利付国債(10年)	2,510,000,000	2,618,381,800	
第331回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,610,254,800	
第332回利付国債(10年)	3,930,000,000	4,026,481,500	
第333回利付国債(10年)	3,580,000,000	3,663,628,800	
第334回利付国債(10年)	3,630,000,000	3,711,892,800	
第335回利付国債(10年)	3,975,000,000	4,019,917,500	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	64,229,500	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	122,837,000	
第3回利付国債(30年)	200,000,000	242,716,000	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	247,630,800	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	215,508,600	
第6回利付国債(30年)	270,000,000	331,479,000	
第7回利付国債(30年)	390,000,000	471,927,300	
第8回利付国債(30年)	270,000,000	304,484,400	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	190,992,600	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	171,433,100	
第11回利付国債(30年)	280,000,000	309,416,800	
第12回利付国債(30年)	370,000,000	433,640,000	
第13回利付国債(30年)	350,000,000	403,357,500	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	427,091,000	
第15回利付国債(30年)	500,000,000	618,450,000	
第16回利付国債(30年)	250,000,000	309,100,000	
第17回利付国債(30年)	420,000,000	511,686,000	
第18回利付国債(30年)	540,000,000	647,929,800	
第19回利付国債(30年)	300,000,000	360,267,000	
第20回利付国債(30年)	370,000,000	457,974,900	
第21回利付国債(30年)	410,000,000	492,319,800	
第22回利付国債(30年)	600,000,000	742,860,000	



第23回利付国債(30年)	370,000,000	458,145,100
第24回利付国債(30年)	420,000,000	520,086,000
第25回利付国債(30年)	400,000,000	480,408,000
第26回利付国債(30年)	810,000,000	988,621,200
第27回利付国債(30年)	670,000,000	832,475,000
第28回利付国債(30年)	820,000,000	1,021,326,400
第29回利付国債(30年)	710,000,000	871,617,300
第30回利付国債(30年)	890,000,000	1,076,018,900
第31回利付国債(30年)	1,040,000,000	1,237,412,800
第32回利付国債(30年)	990,000,000	1,199,979,000
第33回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,492,959,000
第34回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,383,392,800
第35回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,494,077,000
第36回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,472,230,400
第37回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,668,004,400
第38回利付国債(30年)	885,000,000	976,464,750
第39回利付国債(30年)	540,000,000	608,677,200
第40回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,158,717,000
第41回利付国債(30年)	685,000,000	738,841,000
第42回利付国債(30年)	820,000,000	883,910,800
第43回利付国債(30年)	1,155,000,000	1,244,269,950
第44回利付国債(30年)	980,000,000	1,055,077,800
第31回利付国債(20年)	280,000,000	292,457,200
第32回利付国債(20年)	80,000,000	83,762,400
第33回利付国債(20年)	430,000,000	458,960,500
第34回利付国債(20年)	70,000,000	75,540,500
第35回利付国債(20年)	270,000,000	290,144,700
第37回利付国債(20年)	410,000,000	445,112,400
第39回利付国債(20年)	640,000,000	694,041,600
第40回利付国債(20年)	450,000,000	488,583,000
第41回利付国債(20年)	620,000,000	658,291,200
第42回利付国債(20年)	380,000,000	421,271,800
第43回利付国債(20年)	340,000,000	385,859,200
第44回利付国債(20年)	370,000,000	417,082,500
第45回利付国債(20年)	270,000,000	302,942,700
第46回利付国債(20年)	290,000,000	324,002,500
第47回利付国債(20年)	470,000,000	527,429,300
第48回利付国債(20年)	230,000,000	263,292,500
第49回利付国債(20年)	280,000,000	314,913,200
第50回利付国債(20年)	590,000,000	656,209,800
第51回利付国債(20年)	240,000,000	269,464,800
第52回利付国債(20年)	430,000,000	487,052,400
第53回利付国債(20年)	350,000,000	397,698,000

第54回利付国債(20年)	280,000,000	320,107,200	
第55回利付国債(20年)	490,000,000	554,601,600	
第56回利付国債(20年)	410,000,000	464,849,800	
第57回利付国債(20年)	360,000,000	405,493,200	
第58回利付国債(20年)	250,000,000	282,310,000	
第59回利付国債(20年)	440,000,000	490,943,200	
第60回利付国債(20年)	570,000,000	622,280,400	
第61回利付国債(20年)	390,000,000	413,524,800	
第62回利付国債(20年)	250,000,000	260,925,000	
第63回利付国債(20年)	570,000,000	642,903,000	
第64回利付国債(20年)	410,000,000	466,867,000	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	421,999,800	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	373,480,800	
第67回利付国債(20年)	310,000,000	354,088,200	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	269,042,500	
第69回利付国債(20年)	530,000,000	615,192,200	
第70回利付国債(20年)	490,000,000	583,624,300	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	468,828,000	
第72回利付国債(20年)	710,000,000	827,015,100	
第73回利付国債(20年)	540,000,000	625,055,400	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	361,822,700	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	421,192,800	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	390,881,000	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	336,260,800	
第78回利付国債(20年)	200,000,000	230,286,000	
第79回利付国債(20年)	570,000,000	662,402,700	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	293,052,500	
第81回利付国債(20年)	340,000,000	395,362,200	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	569,268,750	
第83回利付国債(20年)	420,000,000	493,806,600	
第84回利付国債(20年)	690,000,000	803,574,000	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	423,702,000	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	287,769,600	
第87回利付国債(20年)	540,000,000	641,687,400	
第88回利付国債(20年)	530,000,000	636,344,500	
第89回利付国債(20年)	480,000,000	571,060,800	
第90回利付国債(20年)	620,000,000	738,413,800	
第91回利付国債(20年)	510,000,000	613,428,000	
第92回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,335,027,200	
第93回利付国債(20年)	500,000,000	585,000,000	
第94回利付国債(20年)	560,000,000	662,418,400	
第95回利付国債(20年)	590,000,000	712,613,800	

第96回利付国債(20年)	300,000,000	355,092,000
第97回利付国債(20年)	720,000,000	861,775,200
第98回利付国債(20年)	450,000,000	532,921,500
第99回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,268,442,200
第100回利付国債(20年)	920,000,000	1,102,261,200
第101回利付国債(20年)	440,000,000	538,661,200
第102回利付国債(20年)	500,000,000	612,550,000
第103回利付国債(20年)	300,000,000	363,552,000
第104回利付国債(20年)	440,000,000	522,209,600
第105回利付国債(20年)	930,000,000	1,103,947,200
第106回利付国債(20年)	310,000,000	372,148,800
第107回利付国債(20年)	630,000,000	747,866,700
第108回利付国債(20年)	810,000,000	940,110,300
第109回利付国債(20年)	900,000,000	1,043,487,000
第110回利付国債(20年)	565,000,000	670,655,000
第111回利付国債(20年)	320,000,000	384,278,400
第112回利付国債(20年)	930,000,000	1,103,789,100
第113回利付国債(20年)	1,610,000,000	1,910,474,300
第114回利付国債(20年)	700,000,000	830,382,000
第115回利付国債(20年)	450,000,000	540,279,000
第116回利付国債(20年)	600,000,000	720,168,000
第117回利付国債(20年)	890,000,000	1,055,317,500
第118回利付国債(20年)	500,000,000	585,260,000
第119回利付国債(20年)	480,000,000	547,780,800
第120回利付国債(20年)	500,000,000	555,990,000
第121回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,154,860,000
第122回利付国債(20年)	610,000,000	695,430,500
第123回利付国債(20年)	980,000,000	1,160,104,400
第124回利付国債(20年)	400,000,000	467,500,000
第125回利付国債(20年)	300,000,000	359,424,000
第126回利付国債(20年)	530,000,000	618,875,700
第127回利付国債(20年)	760,000,000	875,922,800
第128回利付国債(20年)	770,000,000	886,477,900
第129回利付国債(20年)	450,000,000	511,186,500
第130回利付国債(20年)	980,000,000	1,111,770,800
第131回利付国債(20年)	500,000,000	559,510,000
第133回利付国債(20年)	1,380,000,000	1,563,319,200
第134回利付国債(20年)	350,000,000	395,895,500
第135回利付国債(20年)	880,000,000	981,543,200
第136回利付国債(20年)	290,000,000	318,907,200
第137回利付国債(20年)	500,000,000	556,740,000
第138回利付国債(20年)	540,000,000	583,729,200
第139回利付国債(20年)	540,000,000	592,720,200

	第140回利付国債（20年）	1,550,000,000	1,722,825,000	
	第141回利付国債（20年）	990,000,000	1,098,335,700	
	第142回利付国債（20年）	600,000,000	675,354,000	
	第143回利付国債（20年）	1,170,000,000	1,276,458,300	
	第144回利付国債（20年）	440,000,000	472,520,400	
	第145回利付国債（20年）	1,460,000,000	1,613,387,600	
	第146回利付国債（20年）	1,760,000,000	1,940,910,400	
	第147回利付国債（20年）	1,590,000,000	1,723,178,400	
	第148回利付国債（20年）	1,540,000,000	1,637,928,600	
	第149回利付国債（20年）	2,100,000,000	2,229,612,000	
	第150回利付国債（20年）	2,060,000,000	2,146,417,000	
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,782,000	
	国債証券合計	264,574,000,000	283,980,993,880	
地方債証券	第3回東京都公募公債（7年）	100,000,000	102,018,000	
	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,043,000	
	第4回東京都公募公債（7年）	100,000,000	101,849,000	
	第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	242,874,000	
	第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	237,712,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,677,000	
	第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	238,816,000	
	第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,599,000	
	第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,964,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	104,922,000	
	第647回東京都公募公債	100,000,000	104,872,000	
	第657回東京都公募公債	100,000,000	105,771,000	
	第673回東京都公募公債	100,000,000	106,110,000	
	第681回東京都公募公債	100,000,000	106,789,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	106,369,000	
	第686回東京都公募公債	100,000,000	105,353,000	
	第692回東京都公募公債	100,000,000	107,353,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	106,750,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	105,724,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	105,584,000	
	第714回東京都公募公債	200,000,000	207,384,000	
	第722回東京都公募公債	200,000,000	208,138,000	
	平成17年度第12回北海道公募公債	200,000,000	203,634,000	
	平成19年度第14回北海道公募公債（10年）	100,000,000	105,087,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	106,816,000	
	平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	106,781,000	
	平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	107,008,000	
	平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	104,603,000	

平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	106,533,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,923,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,471,000	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	106,873,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	106,276,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	106,532,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	105,819,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	105,379,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	105,617,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	104,812,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	103,051,000	
第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,589,000	
第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,457,000	
第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,878,000	
第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,010,000	
第309回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,740,000	
第324回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,543,000	
第331回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,135,000	
第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,753,000	
第335回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,877,000	
第339回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,715,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	137,485,400	
第363回大阪府公募公債（10年）	114,000,000	118,176,960	
第371回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	203,908,000	
第376回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,833,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	105,979,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	106,240,000	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	110,000,000	113,074,500	
平成18年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	103,441,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	106,538,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	106,735,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	106,661,000	
平成22年度第20回兵庫県公募公債（5年）	100,000,000	100,613,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	105,127,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,215,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,012,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	106,872,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,850,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,501,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,053,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,207,000	
	129,000,000	133,186,050	

平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)			
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,515,000	
平成20年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,986,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,639,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,983,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,336,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	116,940,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,657,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,118,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,571,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,694,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	105,956,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,689,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	290,006,400	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	104,375,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	105,220,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	105,138,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	106,590,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,574,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	105,901,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,607,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	105,011,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,175,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	122,986,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,256,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	200,000,000	233,318,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,143,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	113,140,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	119,725,000	
第8回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	118,471,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	103,861,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	106,986,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,890,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	105,175,000	

平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	106,565,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,026,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	143,384,137	
平成18年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	103,294,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	145,550,312	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,778,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,603,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,931,000	
第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,859,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,468,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,799,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,578,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,553,000	
第72回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,916,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,562,000	
第76回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,990,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,754,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,150,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,987,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,674,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,891,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,678,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,082,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,497,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,890,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,745,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,746,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,052,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,201,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,825,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,618,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,605,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,909,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,870,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,771,000	
第103回共同発行市場公募地方債	277,400,000	292,942,722	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,113,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,631,000	
第111回共同発行市場公募地方債	400,000,000	419,568,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,169,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,280,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,814,000	

第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,071,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,292,000	
平成23年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	100,686,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	104,047,000	
平成18年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,635,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	105,872,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	206,536,000	
平成21年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	212,400,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	106,777,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	114,149,000	
第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	105,863,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	102,695,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	116,476,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	105,093,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	106,860,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	117,072,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	105,960,000	
平成22年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,769,000	
平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	106,038,000	
平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	104,830,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,673,000	
平成23年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	105,878,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,448,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	110,893,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	105,583,000	
平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,774,000	
第79回川崎市公募公債	100,000,000	105,010,000	
平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	105,175,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	104,687,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	105,784,000	
平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	160,459,565	
平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	107,653,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	104,127,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	104,090,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,676,000	
地方債証券合計	20,657,830,000	22,049,274,046	
特殊債券			
第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,761,000	
第36回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	102,736,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	236,544,000	



第16回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,903,000	
第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	201,556,000	
第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,961,000	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,573,000	
第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,519,000	
第41回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,185,000	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,855,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	180,054,000	
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	104,225,940	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,716,000	
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	103,470,000	
第21回道路債券	100,000,000	125,385,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	244,902,000	
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	129,696,250	
第27回道路債券	100,000,000	117,692,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,562,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	193,000,000	200,349,440	
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,375,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,893,000	
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	103,935,000	
第33回道路債券	100,000,000	127,933,000	
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	104,077,000	
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,024,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,955,000	
第38回道路債券	100,000,000	116,718,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,308,000	
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	210,096,000	
第42回道路債券	100,000,000	116,580,000	
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	120,260,000	
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	209,828,000	
	100,000,000	105,991,000	

第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,519,000	
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	104,566,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,651,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,808,000	
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	104,441,000	
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	104,545,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,281,000	
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	211,464,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,825,000	
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	106,020,000	
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	105,498,000	
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	212,020,000	
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	106,101,000	
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,948,000	
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	105,168,000	
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	105,234,000	
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	211,536,000	
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	106,303,000	
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	116,568,000	
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	105,762,000	
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	235,822,000	
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	105,378,000	
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	106,455,000	
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	105,523,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,280,000	
	200,000,000	238,626,000	

第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	106,750,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,563,000	
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	106,292,000	
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	106,949,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,769,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,516,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,566,000	
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	106,627,000	
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	116,268,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	177,862,500	
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	115,427,000	
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	107,342,000	
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	106,206,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,648,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	132,057,500	
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	315,030,000	
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	105,575,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,008,000	
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	104,530,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,290,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,951,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,818,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,472,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	215,376,590	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,940,000	
	100,000,000	102,477,000	

第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,011,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,028,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,327,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	112,332,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	212,106,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	119,519,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,564,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,071,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,948,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,338,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,791,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	236,748,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,415,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,771,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,987,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	117,721,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,273,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,899,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,633,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,149,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,566,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,510,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	116,564,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	345,093,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	420,380,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	239,096,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	112,595,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,520,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,256,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	326,925,000	
第24回政府保証地方公共団体金融機構債券	181,000,000	192,053,670	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	119,372,000	
第25回公営企業債券（20年）	100,000,000	122,165,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,205,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,581,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,008,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	227,754,520	

第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,959,000	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,138,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,051,000	
第864回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,838,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,740,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,908,000	
第877回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,648,000	
第879回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,180,000	
第884回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,534,000	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,696,000	
第886回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,156,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	209,144,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	109,132,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	107,893,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	104,602,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	105,855,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	106,341,000	
第49回都市再生債券	100,000,000	107,766,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	107,131,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	103,056,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,306,000	24,527,234	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,000,000	194,304,600	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	55,596,000	59,931,376	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,656,000	31,172,569	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,866,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	71,931,000	76,712,972	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,662,000	26,228,283	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	25,428,000	27,595,737	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,956,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,089,000	17,857,492	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	102,676,000	111,373,683	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,626,000	28,802,409	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,992,000	81,578,171	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,406,000	28,607,996	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,808,000	40,303,272	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,143,000	29,363,568	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,170,000	21,586,413	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,709,000	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,972,000	23,050,166	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,224,000	43,283,035	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,709,000	

第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	132,798,000	140,217,424	
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,917,000	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,222,000	25,697,604	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	44,524,000	46,755,097	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,756,000	54,318,563	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,178,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,845,000	53,361,697	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,352,000	29,983,374	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,552,000	52,886,722	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,234,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,300,000	102,096,724	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,034,000	33,992,238	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	104,697,000	111,573,498	
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,437,000	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,383,000	39,675,699	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	120,402,000	127,683,912	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,593,000	43,317,196	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,509,000	66,802,118	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,109,000	72,870,500	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,107,000	38,636,295	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,329,000	73,965,723	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,395,000	40,011,154	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	107,904,000	115,218,812	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,842,000	155,483,952	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,804,000	80,299,849	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,731,000	40,768,722	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,630,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,996,000	38,249,928	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,786,000	83,673,173	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,696,000	85,484,500	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,059,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,790,000	259,950,397	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	316,420,000	338,797,222	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,887,000	36,846,351	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,049,000	84,430,655	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,024,000	84,010,414	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	103,941,000	113,078,453	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,282,000	87,376,901	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,308,000	39,292,154	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,072,000	88,455,514	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,477,000	88,857,977	

第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,125,000	90,316,703
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,095,000	90,453,989
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,261,000	93,653,863
第67回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,987,000
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,837,000	95,515,071
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,797,000	285,329,969
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,388,000	93,717,480
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,994,000	94,361,005
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,169,000	97,096,073
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,649,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,935,000
第19回政府保証国民生活債券	125,000,000	129,200,000
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	103,821,000
い第731号商工債	100,000,000	100,760,000
い第734号商工債	200,000,000	201,300,000
い第740号商工債	200,000,000	201,298,000
い第741号商工債	200,000,000	201,348,000
い第758号商工債	100,000,000	100,891,000
い第773号商工債	100,000,000	99,998,000
い第730号農林債	100,000,000	100,669,000
い第732号農林債	200,000,000	201,218,000
い第736号農林債	100,000,000	100,578,000
い第745号農林債	120,000,000	120,518,400
い第749号農林債	100,000,000	100,345,000
い第751号農林債	100,000,000	100,363,000
い第765号農林債	100,000,000	100,393,000
い第766号農林債	400,000,000	401,512,000
第257回信金中金債（5年）	100,000,000	100,773,000
第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,631,000
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,746,000
第266回信金中金債（5年）	100,000,000	100,670,000
第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,696,000
第275回信金中金債（5年）	100,000,000	100,460,000
第278回信金中金債（5年）	100,000,000	100,498,000
第280回信金中金債（5年）	100,000,000	100,196,000
第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,576,000
第159号商工債（3年）	100,000,000	100,141,000
第167号商工債（3年）	200,000,000	200,228,000
第168号商工債（3年）	100,000,000	100,117,000
第5回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	103,346,000
第21回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,579,000
第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	106,504,000
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	106,347,000

	第 8 回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	103,267,000	
	第 1 0 回政府保証中日本高速道路債券	172,000,000	177,866,920	
	第 2 0 回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,415,000	
	第 3 回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	103,460,000	
	第 2 0 回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,054,000	
	第 2 1 回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,321,000	
	第 4 7 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,400,000	
	特殊債券合計	28,499,267,000	30,525,928,371	
社債券	第 2 回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ円貨社債	100,000,000	100,927,000	
	第 4 回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,409,000	
	第 5 回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,679,000	
	第 7 回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,290,000	
	第 4 回スヴェンスカ・ハンデルスバンケン A B 円貨社債	100,000,000	100,210,000	
	第 1 2 回株式会社ポスコ円貨社債（ 2 0 1 3 ）	100,000,000	100,352,000	
	第 1 3 回 J P モルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	100,271,000	
	第 1 7 回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	107,799,000	
	第 2 5 回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,554,000	
	第 4 回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,392,000	
	第 6 回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,264,000	
	第 6 回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,314,000	
	第 8 回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	204,558,000	
	第 9 回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	201,652,000	
	第 9 回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,228,000	
	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	100,870,000	
	第 2 0 回第ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	100,352,000	
	第 2 1 回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,278,000	
	第 3 回株式会社ケーティー円貨社債	100,000,000	100,225,000	
	第 2 0 回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	103,676,000	
	第 2 0 回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,629,000	
	第 5 回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,564,000	
	第 3 回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,090,000	
	第 8 回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,682,000	



第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	102,360,000	
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	101,808,000	
第9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	102,504,000	
第29回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	104,822,000	
第29回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,568,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,773,000	
第37回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,789,000	
第9回宇部興産株式会社無担保社債	100,000,000	101,409,000	
第13回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,343,000	
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	103,025,000	
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	100,570,000	
第2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	101,609,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	103,144,000	
第3回出光興産株式会社無担保社債	100,000,000	101,725,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,482,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	104,531,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	106,274,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,663,000	
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,357,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	102,176,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,683,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,473,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,964,000	
第55回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,729,000	
第1回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	100,630,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	101,656,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,746,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	101,516,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,264,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,343,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	300,000,000	304,965,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,459,000	
第56回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,644,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,588,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	107,244,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,578,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,816,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,937,000	
第92回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,142,000	

第58回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	103,651,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	115,082,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	109,444,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,278,000	
第75回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,583,000	
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	114,830,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,780,000	
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	105,816,000	
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	107,433,000	
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	108,169,000	
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	107,666,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	228,498,000	
第83回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,556,000	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,056,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,323,000	
第139回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,010,000	
第140回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,279,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,130,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,447,000	
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	106,432,000	
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	215,350,000	
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	216,104,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	115,610,000	
第52回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,473,000	
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	109,362,000	
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	104,079,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,700,000	
第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,499,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,009,000	

第63回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	101,583,000	
第9回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	101,779,000	
第42回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,881,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,831,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,461,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,934,000	
第6回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,489,000	
第12回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,551,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	104,538,000	
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	107,759,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,930,000	
第41回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,873,000	
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	100,554,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	104,718,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	110,337,000	
第78回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,572,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,800,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	119,200,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,609,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,207,000	
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	104,607,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	104,627,000	
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,053,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,830,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,403,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,598,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,942,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,910,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,472,000	
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,835,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,053,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,606,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,197,000	

第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,188,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,717,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,602,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,572,000	
第25回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,863,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,955,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	103,200,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	119,152,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,262,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	109,062,000	
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,861,000	
第19回株式会社商船三井無担保社債	100,000,000	99,006,000	
第12回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	101,569,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,890,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,962,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,752,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,283,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	106,733,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	106,471,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,578,000	
第515回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,115,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,192,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,156,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,381,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,838,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,088,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,065,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,101,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,378,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	110,322,000	
第478回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,068,000	
第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	108,596,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,368,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,355,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,212,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,248,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,982,000	
第354回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,850,000	
第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,719,000	

第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,272,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,200,000	
第383回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,080,000	
第416回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,107,000	
第459回東北電力株式会社社債	173,000,000	175,525,800	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,918,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,626,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,174,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,482,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,086,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,902,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,420,000	
第396回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,489,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,956,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,600,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,691,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	102,445,000	
第29回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,569,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,955,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,593,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,129,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,730,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,232,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	104,861,000	
社債券合計	19,673,000,000	20,506,716,800	
合計		357,062,913,097	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,479,969,700
コール・ローン	1,481,917,021
株式	238,096,572,317
投資信託受益証券	200,254,146
投資証券	5,593,662,231
派生商品評価勘定	45,543,983
未収入金	69,167,319
未収配当金	480,242,447
未収利息	1,819
前払金	6,396,135
差入委託証拠金	903,283,057
流動資産合計	248,357,010,175
資産合計	248,357,010,175
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,944,381
未払金	33,707,249
未払解約金	1,093,239,575
流動負債合計	1,143,891,205
負債合計	1,143,891,205
純資産の部	
元本等	
元本	114,877,145,982
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	132,335,972,988
元本等合計	247,213,118,970
純資産合計	247,213,118,970
負債純資産合計	248,357,010,175

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(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> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

	平成26年12月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</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</p> <p>株式及び投資証券は、原則として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>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成26年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	114,877,145,982口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1520円 (21,520円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成26年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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引



平成26年12月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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> <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>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	139,044,492,301円
期中追加設定元本額	4,787,288,937円
期中一部解約元本額	28,954,635,256円
期末元本額	114,877,145,982円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,560,641,456円
DC外国株式インデックスファンド	4,569,353,747円
DC外国株式インデックスファンドL	17,455,098,590円
DCバランスファンド30	436,372,175円
DCバランスファンド50	937,401,758円

区分	平成26年12月10日現在
DCバランスファンド70	593,911,129円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	67,005,775円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	35,731,572円
新生・4分散ファンド	66,909,978円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	457,747,721円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	14,494,839円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	49,790,274円
外国株式インデックスe	6,431,165,244円
インデックスコレクション（外国株式）	2,987,125,851円
インデックスコレクション（バランス株式30）	292,856,591円
インデックスコレクション（バランス株式50）	439,063,982円
インデックスコレクション（バランス株式70）	482,699,922円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,579,830,551円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,256,441,747円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	4,193,420,305円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,034,387,219円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	8,853,126,969円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	3,534,948,455円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,177,610,852円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	208,434,132円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	7,818,664,250円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,760,015,254円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	855,511,177円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	16,023,212,531円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,400,564,028円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	16,132,797,060円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,193,073,199円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	67,571,028円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	946,328,016円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	387,248,322円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	345,140,764円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	880,097,272円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	72,088,176円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,286,518,625円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	41,213,889円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	263,757,666円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	659,555,594円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	28,218,297円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26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	23,274,950,769	
投資信託受益証券	45,581,339	
投資証券	885,448,524	
合計	24,205,980,632	

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(平成26年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,387,543,098	-	2,381,146,963	6,396,135
	合計	2,387,543,098	-	2,381,146,963	6,396,135

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(平成26年12月10日現在)

区分	種類	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	1,010,808,848	-	1,039,937,600	29,128,752
	アメリカドル	738,727,440	-	762,027,200	23,299,760
	ユーロ	161,563,808	-	165,614,400	4,050,592
	イギリスポンド	110,517,600	-	112,296,000	1,778,400
	売建	1,291,774,185	-	1,285,907,200	5,866,985
	アメリカドル	804,901,720	-	800,315,000	4,586,720
	カナダドル	68,035,505	-	67,795,000	240,505
	ユーロ	207,516,420	-	207,032,000	484,420
	スイスフラン	90,070,375	-	89,819,200	251,175
	スウェーデンク ローナ	22,277,720	-	22,204,000	73,720

ノルウェークローネ	6,715,360	-	6,712,000	3,360
デンマーククローネ	21,945,830	-	21,857,000	88,830
香港ドル	30,819,200	-	30,800,000	19,200
シンガポールドル	27,356,535	-	27,237,000	119,535
イスラエルシェケル	12,135,520	-	12,136,000	480
合計	2,302,583,033	-	2,325,844,800	34,995,737

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)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	33,583	78.41	2,633,243.03	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,927	39.19	114,709.13	
	APACHE CORP	24,940	58.84	1,467,469.60	
	BAKER HUGHES	28,473	56.71	1,614,703.83	
	CABOT OIL & GAS CORP	29,277	30.36	888,849.72	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,176	49.02	694,907.52	
	CHENIERE ENERGY INC	15,269	67.81	1,035,390.89	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	36,868	18.35	676,527.80	
	CHEVRON CORP	126,609	107.01	13,548,429.09	
	CIMAREX ENERGY CO	6,062	103.59	627,962.58	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	21,037	8.12	170,820.44	
	CONCHO RESOURCES INC	7,341	90.72	665,975.52	
	CONOCOPHILLIPS	81,824	64.96	5,315,287.04	
	CONSOL ENERGY INC	15,447	36.10	557,636.70	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,754	36.18	244,359.72	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,033	115.87	351,433.71	
	DENBURY RESOURCES INC	24,897	7.00	174,279.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,300	57.20	1,447,160.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,327	32.76	141,752.52	
	ENERGEN CORP	5,192	57.76	299,889.92	

ENSCO PLC-CL A	14,447	29.75	429,798.25
EOG RESOURCES INC	36,176	89.15	3,225,090.40
EQT CORPORATION	10,610	79.74	846,041.40
EXXON MOBIL	284,697	91.38	26,015,611.86
FMC TECHNOLOGIES INC	16,145	46.02	742,992.90
HALLIBURTON CO	56,320	39.50	2,224,640.00
HELMERICH & PAYNE	6,971	64.53	449,838.63
HESS CORP	18,250	72.18	1,317,285.00
HOLLYFRONTIER CORP	13,027	38.19	497,501.13
KINDER MORGAN INC	119,260	40.65	4,847,919.00
MARATHON OIL CORP	44,185	27.78	1,227,459.30
MARATHON PETROLEUM CORP	18,331	88.76	1,627,059.56
MURPHY OIL CORP	11,818	46.85	553,673.30
NABORS INDUSTRIES LTD	18,183	11.52	209,468.16
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,354	64.93	1,841,025.22
NOBLE CORP PLC	19,072	16.21	309,157.12
NOBLE ENERGY INC	23,626	47.89	1,131,449.14
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,782	77.45	4,010,515.90
OCEANEERING INTL INC	7,007	62.90	440,740.30
ONEOK INC	14,414	48.42	697,925.88
PHILLIPS 66	37,127	68.81	2,554,708.87
PIONEER NATURAL RESOURCES	9,460	136.33	1,289,681.80
QEP RESOURCES INC	11,102	21.94	243,577.88
RANGE RESOURCES CORP	11,401	55.54	633,211.54
SCHLUMBERGER	86,422	85.47	7,386,488.34
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,661	29.73	733,171.53
SPECTRA ENERGY CORP	44,770	36.38	1,628,732.60
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	12,437	18.53	230,457.61
TESORO CORP	8,908	76.93	685,292.44
VALERO ENERGY CORP	34,927	48.59	1,697,102.93
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	53,271	11.82	629,663.22
WHITING PETROLEUM CORP	8,824	33.55	296,045.20
WILLIAMS COS	47,459	47.23	2,241,488.57
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,244	144.77	2,062,103.88
AIRGAS INC	4,848	114.16	553,447.68
ALBEMARLE CORP	5,066	62.34	315,814.44
ALCOA	78,228	16.04	1,254,777.12
ASHLAND INC	4,810	118.15	568,301.50
AVERY DENNISON CORP	5,057	49.74	251,535.18
BALL CORP	9,241	68.32	631,345.12
CELANESE CORP-SERIES A	10,588	62.54	662,173.52
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,280	260.71	855,128.80

CROWN HOLDINGS INC	8,563	50.70	434,144.10
DOW CHEMICAL CO	79,702	48.18	3,840,042.36
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	61,176	72.16	4,414,460.16
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,333	79.46	821,060.18
ECOLAB INC	17,989	105.45	1,896,940.05
FMC CORP	9,759	56.34	549,822.06
FREEMPORT-MCMORAN INC	68,536	25.13	1,722,309.68
INT'L PAPER CO	28,062	55.25	1,550,425.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,286	103.12	545,092.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,100	78.69	2,289,879.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,792	114.76	435,169.92
MEADWESTVACO CORP	11,465	45.06	516,612.90
MONSANTO CO	34,925	120.30	4,201,477.50
MOSAIC CO/THE	22,328	45.37	1,013,021.36
NEWMONT MINING CORP	32,164	20.01	643,601.64
NUCOR CORP	21,794	54.62	1,190,388.28
OWENS-ILLINOIS INC	13,348	25.85	345,045.80
PPG INDUSTRIES INC	9,163	225.69	2,067,997.47
PRAXAIR INC	19,431	127.70	2,481,338.70
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,993	59.36	533,824.48
SEALED AIR CORP	13,273	41.57	551,758.61
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,544	249.58	1,383,671.52
SIGMA-ALDRICH	8,219	136.26	1,119,962.03
VULCAN MATERIALS CO	8,240	66.03	544,087.20
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,689	61.49	165,346.61
3 M COMPANY	41,105	160.83	6,610,917.15
AGCO CORP	5,330	43.98	234,413.40
AMETEK INC	15,850	51.07	809,459.50
B/E AEROSPACE INC	7,111	78.46	557,929.06
BOEING CO	45,693	129.66	5,924,554.38
CATERPILLAR	39,411	95.45	3,761,779.95
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,184	43.88	271,353.92
CUMMINS INC	11,419	149.22	1,703,943.18
DANAHER CORP	41,955	84.36	3,539,323.80
DEERE&CO	22,351	89.20	1,993,709.20
DOVER CORP	11,111	73.57	817,436.27
EATON CORP	31,337	68.50	2,146,584.50
EMERSON ELECTRIC CO	46,180	63.63	2,938,433.40
FASTENAL CO	18,943	46.56	882,080.79
FLOWSERVE CORP	9,725	60.03	583,791.75
FLUOR CORP	11,394	60.51	689,450.94
GENERAL DYNAMICS CORP	19,051	145.02	2,762,776.02

GENERAL ELECTRIC CO	670,310	25.58	17,146,529.80
GRAINGER (WW) INC	4,137	249.46	1,032,016.02
HONEYWELL INTL INC	49,571	99.32	4,923,391.72
ILLINOIS TOOL WORKS	25,016	95.99	2,401,285.84
INGERSOLL-RAND PLC	17,449	62.96	1,098,589.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,309	44.40	368,919.60
JOY GLOBAL INC	6,783	50.74	344,169.42
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,641	125.10	705,689.10
LOCKHEED MARTIN CORP	17,856	190.62	3,403,710.72
MASCO CORP	22,774	24.91	567,300.34
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,250	147.55	1,955,037.50
PACCAR INC	23,128	70.52	1,630,986.56
PALL CORP	7,574	97.40	737,707.60
PARKER HANNIFIN CORP	9,776	128.54	1,256,607.04
PENTAIR PLC	12,386	62.75	777,221.50
PRECISION CASTPARTS CORP	9,507	241.89	2,299,648.23
QUANTA SERVICES INC	13,788	29.74	410,055.12
RAYTHEON COMPANY	20,377	108.53	2,211,515.81
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,960	111.06	995,097.60
ROCKWELL COLLIN	8,790	84.96	746,798.40
ROPER INDUSTRIES INC	6,612	156.07	1,031,934.84
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,324	52.99	547,068.76
SNAP-ON INC	3,400	136.27	463,318.00
SPX CORP	3,122	84.69	264,402.18
STANLEY BLACK&DECKER	9,733	95.56	930,085.48
TEXTRON	18,196	41.84	761,320.64
TRANSDIGM GROUP INC	3,340	195.01	651,333.40
UNITED RENTALS INC	6,841	109.31	747,789.71
UNITED TECHNOLOGIES CORP	57,804	114.99	6,646,881.96
WABTEC CORP	5,705	87.32	498,160.60
XYLEM INC	12,576	38.12	479,397.12
ADT CORPORATION	13,286	32.70	434,452.20
CINTAS CORP	6,681	73.41	490,452.21
DUN & BRADSTREET CORP	2,153	120.66	259,780.98
EQUIFAX INC	8,955	81.33	728,310.15
IHS INC-CLASS A	4,962	118.87	589,832.94
MANPOWER GROUP	4,737	69.26	328,084.62
NIELSEN NV	20,944	45.17	946,040.48
REPUBLIC SERVICES INC	18,812	39.35	740,252.20
ROBERT HALF INTL INC	10,224	56.54	578,064.96
STERICYCLE INC	5,487	130.98	718,687.26
TOWERS WATSON & CO-CL A	4,516	116.17	524,623.72

TYCO INTERNATIONAL PLC	31,428	43.36	1,362,718.08
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,783	63.30	682,563.90
WASTE MANAGEMENT INC	29,972	48.94	1,466,829.68
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,242	48.31	591,411.02
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,284	73.25	753,303.00
CSX CORP	66,722	36.20	2,415,336.40
DELTA AIR LINES INC	14,444	46.33	669,190.52
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,483	44.67	557,615.61
FEDEX CORP	18,037	178.77	3,224,474.49
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	30,752	23.59	725,439.68
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,540	80.43	526,012.20
KANSAS CITY SOUTHERN	7,293	115.25	840,518.25
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,689	104.08	2,153,311.12
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,790	40.73	480,206.70
UNION PACIFIC CORP	60,068	116.06	6,971,492.08
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,600	62.52	350,112.00
UNITED PARCEL SERVICE B	47,135	110.03	5,186,264.05
AUTOLIV INC	6,782	104.65	709,736.30
BORGWARNER INC	15,095	55.97	844,867.15
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,748	72.84	1,438,444.32
FORD MOTOR COMPANY	240,102	15.43	3,704,773.86
GENERAL MOTORS CO	84,751	32.81	2,780,680.31
HARLEY-DAVIDSON	15,384	68.96	1,060,880.64
JOHNSON CONTROLS INC	44,172	48.17	2,127,765.24
TESLA MOTORS INC	5,805	216.89	1,259,046.45
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,435	102.84	764,615.40
COACH INC	18,301	34.04	622,966.04
DR HORTON INC	18,907	24.63	465,679.41
FOSSIL GROUP INC	3,522	107.53	378,720.66
GARMIN LTD	8,731	56.05	489,372.55
HANESBRANDS INC	6,058	109.60	663,956.80
HASBRO INC	7,737	56.37	436,134.69
JARDEN CORP	10,738	45.25	485,894.50
LEGGETT & PLATT INC	8,421	41.92	353,008.32
LENNAR CORP-CL A	10,875	45.82	498,292.50
LULULEMON ATHLETICA INC	8,662	47.73	413,437.26
MATTEL INC	21,443	30.77	659,908.32
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	14,584	76.32	1,113,050.88
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,404	157.60	694,070.40
NEWELL RUBBERMAID	19,943	36.35	724,928.05
NIKE B	46,076	97.03	4,470,754.28
POLARIS INDUSTRIES INC	4,196	150.33	630,784.68



PULTE GROUP INC	21,322	21.22	452,452.84
PVH CORP	5,545	122.40	678,708.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,257	182.44	776,647.08
TOLL BROTHERS INC	10,714	34.79	372,740.06
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,981	68.34	750,441.54
VF CORP	23,770	73.18	1,739,488.60
WHIRLPOOL CORP	5,052	187.43	946,896.36
BLOCK H & R INC	19,171	32.34	619,990.14
CARNIVAL CORPORATION	26,660	43.97	1,172,240.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,059	657.09	1,352,948.31
DARDEN RESTAURANTS INC	8,333	57.90	482,480.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,600	26.23	619,028.00
LAS VEGAS SANDS CORP	26,408	56.11	1,481,752.88
MARRIOTT INTL A	15,752	78.37	1,234,484.24
MCDONALD'S CORP	65,213	91.36	5,957,859.68
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,881	21.51	556,700.31
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	4,497	44.70	201,015.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,385	79.18	901,464.30
STARBUCKS CORP	49,737	83.03	4,129,663.11
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,452	81.39	1,013,468.28
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,559	83.89	718,014.51
WYNN RESORTS LTD	5,694	156.63	891,851.22
YUM BRANDS INC	29,004	75.22	2,181,680.88
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,555	20.76	322,921.80
CBS CORP-CL B	31,953	52.48	1,676,893.44
CHARTER COMMUNICATION-A	5,112	165.91	848,131.92
COMCAST CORP-CL A	143,585	56.19	8,068,041.15
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,110	55.90	1,571,349.00
DIRECTV	31,807	83.88	2,667,971.16
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	11,585	34.64	401,304.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,891	33.96	641,538.36
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,120	71.44	1,080,172.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS	27,042	20.43	552,468.06
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,326	48.87	700,111.62
LIBERTY GLOBAL PLC-C	40,996	47.11	1,931,321.56
LIBERTY MEDIA CORP	6,970	35.02	244,089.40
LIBERTY MEDIA CORP-C	13,940	34.37	479,117.80
NEWS CORP-CLASS A	24,731	15.69	388,029.39
OMNICOM GROUP	16,460	78.16	1,286,513.60
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	5,844	78.06	456,182.64
SIRIUS XM HOLDINGS INC	164,803	3.49	575,162.47
THE WALT DISNEY CO	108,878	92.94	10,119,121.32

TIME WARNER CABLE-A	18,586	146.75	2,727,495.50
TIME WARNER INC	57,020	83.92	4,785,118.40
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	91,070	37.11	3,379,607.70
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	31,113	35.76	1,112,600.88
VIACOM INC-CLASS B	24,208	74.61	1,806,158.88
ADVANCE AUTO PARTS	4,975	158.25	787,293.75
AMAZON.COM	26,136	312.50	8,167,500.00
AUTONATION INC	4,738	59.97	284,137.86
AUTOZONE INC	2,248	605.81	1,361,860.88
BED BATH & BEYOND INC	14,016	72.04	1,009,712.64
BEST BUY COMPANY INC	20,110	36.47	733,411.70
CARMAX INC	14,272	59.45	848,470.40
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,631	47.85	269,443.35
DOLLAR GENERAL CORP	19,865	69.20	1,374,658.00
DOLLAR TREE INC	13,138	68.10	894,763.49
EXPEDIA INC	7,328	90.70	664,649.60
FAMILY DOLLAR STORES	7,207	79.75	574,758.25
FOOT LOCKER INC	8,427	56.49	476,041.23
GAMESTOP CORP-CLASS A	8,269	35.57	294,128.33
GAP	17,058	40.22	686,072.76
GENUINE PARTS CO	9,920	102.79	1,019,676.80
HOME DEPOT	89,652	99.64	8,932,925.28
KOHL'S CORP	14,347	56.80	814,909.60
L BRANDS INC	16,388	82.55	1,352,829.40
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	31,830	28.64	911,611.20
LKQ CORP	22,443	29.43	660,497.49
LOWES COMPANIES	65,480	65.84	4,311,203.20
MACY'S INC	23,107	61.36	1,417,845.52
NETFLIX INC	3,785	343.78	1,301,207.30
NORDSTROM INC	10,255	74.64	765,433.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,788	192.54	1,306,961.52
PETSMART INC	5,925	78.82	467,008.50
PRICELINE GROUP INC/THE	3,472	1,135.18	3,941,344.96
ROSS STORES INC	13,784	89.86	1,238,630.24
SIGNET JEWELERS LTD	4,556	128.10	583,623.60
STAPLES INC	43,633	14.46	630,933.18
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,644	73.60	2,917,798.40
TIFFANY & CO	8,396	106.21	891,739.16
TJX COMPANIES INC	45,829	65.42	2,998,133.18
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,156	78.27	716,640.12
TRIPADVISOR INC	8,703	74.06	644,544.18
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,428	127.53	564,702.84

URBAN OUTFITTERS INC	6,908	31.19	215,460.52
COSTCO WHOLESALE CORP	29,078	143.04	4,159,317.12
CVS HEALTH CORP	77,193	91.25	7,043,861.25
KROGER CO	30,367	61.49	1,867,266.83
SAFEWAY INC	16,147	34.86	562,884.42
SYSCO CORP	40,635	39.97	1,624,180.95
WAL-MART STORES	107,520	83.56	8,984,371.20
WALGREEN CO	60,466	68.59	4,147,362.94
WHOLE FOODS MKT INC	25,178	48.15	1,212,320.70
ALTRIA GROUP INC	132,572	50.70	6,721,400.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,010	53.04	2,281,250.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,275	90.36	747,729.00
BUNGE LIMITED	9,479	92.91	880,693.89
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,766	44.24	609,007.84
COCA-COLA CO	263,545	42.04	11,079,431.80
COCA-COLA ENTERPRISES	16,189	43.73	707,944.97
CONAGRA	29,581	36.98	1,093,905.38
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,167	93.45	1,043,556.15
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,915	71.25	991,443.75
GENERAL MILLS INC	40,409	52.28	2,112,582.52
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,879	99.00	1,077,021.00
HORMEL FOODS CORP	9,594	52.28	501,574.32
JM SMUCKER CO	6,477	101.20	655,472.40
KELLOGG CO	17,577	65.82	1,156,918.14
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,528	132.99	1,134,138.72
KRAFT FOODS GROUP INC	39,109	60.30	2,358,272.70
LORILLARD INC	23,894	64.06	1,530,649.64
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,415	73.24	543,074.60
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	13,413	102.54	1,375,369.02
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,510	73.60	773,536.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	111,750	38.56	4,309,080.00
MONSTER BEVERAGE CORP	9,429	106.41	1,003,339.89
PEPSICO INC	100,629	97.13	9,774,094.77
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	104,081	86.56	9,009,251.36
REYNOLDS AMERICAN INC	21,169	66.64	1,410,702.16
TYSON FOODS INC	20,639	41.20	850,326.80
AVON PRODUCTS INC	33,623	10.13	340,600.99
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,234	77.22	713,049.48
CLOROX COMPANY	8,923	99.12	884,447.76
COLGATE-PALMOLIVE CO	60,586	69.33	4,200,427.38
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,039	128.18	517,719.02
ESTEE LAUDER CO-CL A	15,042	74.64	1,122,734.88

HERBALIFE LTD	6,196	41.93	259,798.28
KIMBERLY-CLARK CORP	24,719	113.70	2,810,550.30
PROCTER & GAMBLE CO	180,735	90.71	16,394,471.85
ABBOTT LABORATORIES	99,723	45.44	4,531,413.12
AETNA INC	23,337	89.56	2,090,061.72
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,211	92.09	1,400,780.99
ANTHEM INC	18,162	126.66	2,300,398.92
BARD C R INC	5,264	170.10	895,406.40
BAXTER INTERNATIONAL	35,586	73.79	2,625,890.94
BECTON DICKINSON & CO	12,587	139.45	1,755,257.15
BOSTON SCIENTIFIC CORP	91,223	13.04	1,189,547.92
CARDINAL HEALTH	22,096	81.29	1,796,183.84
CAREFUSION CORP	13,307	59.14	786,975.98
CERNER CORP	21,436	64.21	1,376,405.56
CIGNA CORP	17,382	104.39	1,814,506.98
COVIDIEN PLC	30,037	103.29	3,102,521.73
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,118	75.15	835,517.70
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,379	55.30	518,658.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,008	133.48	935,427.84
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	49,217	85.68	4,216,912.56
HCA HOLDINGS INC	21,051	73.88	1,555,247.88
HENRY SCHEIN INC	6,087	135.37	824,027.62
HOLOGIC INC	15,643	26.97	421,969.92
HUMANA INC	10,199	143.45	1,463,046.55
INTUITIVE SURGICAL INC	2,373	514.93	1,221,928.89
LABORATORY CRP OF AMER	6,250	104.79	654,937.50
MCKESSON CORP	15,377	210.29	3,233,629.33
MEDTRONIC	64,841	74.72	4,844,919.52
OMNICARE INC	6,575	70.96	466,562.00
PATTERSON COMPANIES INC	6,178	48.34	298,644.52
QUEST DIAGNOSTICS	10,623	64.85	688,901.55
RESMED INC	9,584	54.45	521,848.80
ST JUDE MEDICAL INC	19,644	68.98	1,355,043.12
STRYKER CORP	22,352	94.41	2,110,252.32
THE COOPER COS INC	2,821	162.28	457,791.88
UNITEDHEALTH GROUP INC	64,648	101.02	6,530,740.96
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,993	107.30	643,048.90
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,582	88.85	673,660.70
ZIMMER HOLDINGS INC	11,607	113.73	1,320,064.11
ABBVIE INC	106,181	69.14	7,341,354.34
ACTAVIS PLC	17,624	263.73	4,647,977.52
AGILENT TECHNOLOGIES	23,746	41.40	983,084.40

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,184	199.77	2,633,833.60
ALLERGAN INC	19,820	212.40	4,209,768.00
AMGEN	50,765	169.39	8,599,083.35
BIOGEN IDEC INC	15,769	347.61	5,481,462.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,908	94.19	933,234.52
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	110,568	59.97	6,630,762.96
CELGENE CORP	53,394	118.68	6,336,799.92
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,127	71.91	728,232.57
GILEAD SCIENCES INC	101,048	105.90	10,701,488.44
HOSPIRA INC	12,349	60.36	745,385.64
ILLUMINA INC	8,973	187.31	1,680,732.63
INCYTE CORP	9,207	78.89	726,340.23
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,645	178.19	649,502.55
JOHNSON & JOHNSON	188,351	108.05	20,351,325.55
LILLY (ELI) & CO	67,107	72.21	4,845,796.47
MALLINCKRODT PLC	7,494	96.72	724,819.68
MEDIVATION INC	4,520	110.77	500,680.40
MERCK & CO	192,573	60.01	11,556,305.73
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,856	292.68	543,214.08
MYLAN INC	26,029	56.59	1,472,981.11
PERRIGO CO PLC	9,260	159.12	1,473,451.20
PFIZER	422,891	31.95	13,511,367.45
PHARMACYCLICS INC	4,351	139.70	607,834.70
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	3,098	57.79	179,033.42
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,286	432.67	2,287,093.62
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	3,581	107.98	386,694.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26,526	128.29	3,403,020.54
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,873	120.30	1,909,521.90
WATERS CORP	5,406	115.55	624,663.30
ZOETIS INC	34,546	43.82	1,513,805.72
BANK OF AMERICA CORP	701,543	17.56	12,319,095.08
BB&T CORP	49,472	38.93	1,925,944.96
CIT GROUP INC	11,889	48.49	576,497.61
CITIGROUP	201,958	55.85	11,279,354.30
COMERICA INC	11,538	47.56	548,747.28
FIFTH THIRD BANCORP	52,995	20.69	1,096,466.55
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,475	52.26	442,903.50
HUDSON CITY BANCORP INC	29,661	10.04	297,796.44
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,106	10.45	502,948.23
JPMORGAN CHASE & CO	251,143	62.45	15,683,880.35
KEY CORP	59,570	13.82	823,257.40
M & T BANK CORP	8,096	127.80	1,034,668.80

NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,332	16.00	533,312.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,983	14.89	297,546.87
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,928	90.82	3,262,980.96
REGIONS FINL CORP	92,527	10.45	966,907.15
SUNTRUST BANKS	36,433	41.69	1,518,891.77
US BANCORP	120,011	45.21	5,425,697.31
WELLS FARGO & CO	331,424	54.83	18,171,977.92
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,662	206.09	754,701.58
ALLY FINANCIAL INC	22,000	23.30	512,600.00
AMERICAN EXPRESS	63,010	93.36	5,882,613.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,241	135.46	1,658,165.86
BANK NEW YORK CO	75,913	41.24	3,130,652.12
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	76,995	150.46	11,584,667.70
BLACKROCK INC	8,897	362.74	3,227,297.78
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,544	83.27	3,126,288.88
CME GROUP INC	21,371	88.58	1,893,043.18
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	30,998	64.66	2,004,330.68
EATON VANCE CORP	6,907	41.84	288,988.88
FRANKLIN RESOURCES INC	27,813	57.91	1,610,650.83
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,496	196.89	5,216,797.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7,571	224.47	1,699,462.37
INVESCO LTD	29,729	41.09	1,221,564.61
LEGG MASON INC	6,654	54.84	364,905.36
LEUCADIA NATIONAL CORP	19,913	23.07	459,392.91
MCGRAW-HILL FINANCIAL	18,221	91.81	1,672,870.01
MOODY'S CORP	12,794	96.05	1,228,863.70
MORGAN STANLEY	98,053	38.10	3,735,819.30
NASDAQ OMX GROUP	8,655	46.41	401,678.55
NAVIENT CORP	27,834	21.49	598,152.66
NORTHERN TRUST CORP	15,436	68.38	1,055,513.68
PRICE T ROWE GROUP INC	17,257	84.73	1,462,185.61
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,478	57.54	487,824.12
SCHWAB (CHARLES) CORP	78,458	30.23	2,371,785.34
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,464	40.64	384,616.96
STATE STREET CORP	28,123	79.60	2,238,590.80
SYNCHRONY FINANCIAL	8,888	29.52	262,373.76
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,077	36.70	736,825.90
VOYA FINANCIAL INC	11,960	42.21	504,831.60
ACE LTD	22,408	116.06	2,600,672.48
AFLAC	29,888	59.79	1,787,003.52
ALLEGHANY CORP	1,222	457.59	559,174.98
ALLSTATE CORP	28,979	68.83	1,994,624.57

AMERICAN INT'L GROUP	96,411	55.59	5,359,487.49
AON PLC	18,377	97.19	1,786,060.63
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,819	58.26	513,794.94
ASSURANT INC	4,557	68.40	311,698.80
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,257	50.70	317,229.90
CHUBB CORPORATION	15,604	104.10	1,624,376.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,224	52.12	584,994.88
EVEREST RE GROUP LTD	3,246	172.26	559,155.96
FNF GROUP	18,784	32.51	610,667.84
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	34,828	8.47	294,993.16
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,330	41.55	1,260,211.50
LINCOLN NATIONAL CORP	17,924	57.41	1,029,016.84
LOEWS CORP	24,236	41.04	994,645.44
MARSH & MCLENNAN COS	36,434	58.08	2,116,086.72
METLIFE INC	63,585	56.21	3,574,112.85
PARTNERRE LTD	3,278	116.10	380,575.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,543	53.11	1,037,928.73
PROGRESSIVE CORP	37,570	26.83	1,008,003.10
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,389	88.17	2,679,398.13
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,261	97.88	319,186.68
TORCHMARK CORP	8,328	54.21	451,460.88
TRAVELERS COS INC/THE	22,525	105.02	2,365,575.50
UNUM GROUP	16,383	33.78	553,417.74
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,670	44.00	513,480.00
WR BERKLEY CORP	7,937	53.42	423,994.54
XL GROUP PLC	17,146	35.96	616,570.16
CBRE GROUP INC-A	19,188	33.56	643,949.28
REALOGY HOLDINGS CORP	9,607	45.36	435,773.52
WEYERHAEUSER CO	35,200	36.15	1,272,480.00
ACCENTURE PLC-CL A	41,666	85.18	3,549,109.88
ACTIVISION BLIZZARD INC	34,687	20.97	727,386.39
ADOBE SYSTEMS INC	31,066	71.56	2,223,238.29
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,725	62.40	731,640.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,681	277.09	1,019,968.29
ANSYS INC	6,178	83.21	514,071.38
AUTODESK INC	15,113	60.17	909,349.21
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,283	85.25	2,752,287.16
CA INC	21,103	30.80	649,972.40
CITRIX SYSTEMS INC	11,197	64.28	719,743.16
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,334	52.60	2,121,568.40
COMPUTER SCIENCES CORP	9,681	63.91	618,712.71
EBAY	74,347	55.40	4,118,823.80

ELECTRONIC ARTS INC	21,739	45.58	990,863.62
EQUINIX INC	3,785	229.86	870,020.10
FACEBOOK INC-A	131,759	76.84	10,124,361.56
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	20,157	61.35	1,236,631.95
FIREEYE INC	2,504	30.10	75,370.40
FISERV INC	17,033	70.47	1,200,315.51
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,107	148.70	759,410.90
GOOGLE INC-CL A	19,025	536.11	10,199,492.75
GOOGLE INC-CL C	19,080	533.37	10,176,699.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	63,290	162.99	10,315,637.10
INTUIT INC	18,671	92.72	1,731,175.12
LINKEDIN CORP - A	7,087	215.47	1,527,035.89
MASTERCARD INC-CLASS A	66,971	87.84	5,882,732.64
MICROSOFT CORP	523,211	47.59	24,899,611.49
NETSUITE INC	2,299	106.35	244,498.65
NUANCE COMMUNICATIONS INC	18,716	14.50	271,475.58
ORACLE CORP	238,131	41.87	9,970,544.97
PAYCHEX INC	21,799	46.71	1,018,231.29
RACKSPACE HOSTING INC	8,782	47.74	419,252.68
RED HAT INC	12,513	59.10	739,518.30
SALESFORCE.COM INC	39,155	56.14	2,198,161.70
SERVICENOW INC	8,652	62.03	536,683.56
SYMANTEC CORP	48,197	26.01	1,253,844.95
SYNOPSYS INC	10,198	43.77	446,366.46
TERADATA CORP	9,998	43.48	434,713.04
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,898	33.49	364,974.02
TWITTER INC	22,925	37.05	849,371.25
VANTIV INC - CL A	8,790	33.81	297,189.90
VERISIGN INC	7,744	57.38	444,350.72
VISA INC-CLASS A SHARES	33,037	264.14	8,726,393.18
VMWARE INC-CLASS A	5,525	81.33	449,348.25
WESTERN UNION CO	34,669	18.34	635,829.46
WORKDAY INC-CLASS A	6,399	83.65	535,276.35
XEROX CORP	76,055	13.97	1,062,488.35
YAHOO	63,046	50.51	3,184,453.46
AMPHENOL CORPORATION	21,966	53.88	1,183,528.08
APPLE INC	399,834	114.12	45,629,056.08
ARROW ELECTRONICS INC	6,286	58.08	365,090.88
AVNET INC	8,497	44.62	379,136.14
CISCO SYSTEMS	341,192	27.42	9,355,484.64
CORNING	85,262	21.48	1,831,427.76
EMC CORP	134,643	29.88	4,023,132.84



F5 NETWORKS INC	5,029	132.21	664,884.09
FLEXTRONICS INTL LTD	38,061	11.09	422,286.79
FLIR SYSTEMS INC	8,767	32.72	286,856.24
HARRIS CORP	7,440	70.87	527,272.80
HEWLETT-PACKARD CO	125,024	38.20	4,775,916.80
JUNIPER NETWORKS INC	28,928	21.85	632,076.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,780	65.29	964,986.20
NETAPP INC	22,589	42.72	965,002.08
PALO ALTO NETWORKS INC	3,926	118.84	466,565.84
QUALCOMM	111,267	73.00	8,123,047.33
SANDISK CORP	14,808	104.78	1,551,656.28
SEAGATE TECHNOLOGY	22,700	65.76	1,492,752.00
TE CONNECTIVITY LTD	28,075	64.42	1,808,591.50
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,617	28.03	465,774.51
WESTERN DIGITAL CORP	15,515	107.80	1,672,517.00
AT&T INC	346,160	32.89	11,385,202.40
CENTURYLINK INC	39,680	39.10	1,551,488.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	67,399	6.60	444,833.40
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	17,624	47.96	845,247.04
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,899	113.11	1,006,565.89
SPRINT CORP	61,098	4.57	279,217.86
T-MOBILE US INC	18,011	25.85	465,584.35
VERIZON COMMUNICATIONS	276,855	46.92	12,990,036.60
WINDSTREAM HOLDINGS INC	47,567	9.45	449,508.15
AES CORP	48,042	13.86	665,862.12
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,163	64.63	527,574.69
AMEREN CORPORATION	15,651	43.87	686,609.37
AMERICAN ELECTRIC POWER	33,753	58.87	1,987,039.11
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,965	53.26	637,255.90
CALPINE CORP	21,631	21.90	473,718.90
CENTERPOINT ENERGY INC	26,989	23.45	632,892.05
CMS ENERGY CORP	17,557	34.01	597,113.57
CONSOLIDATED EDISON INC	20,406	64.05	1,307,004.30
DOMINION RESOURCES	38,800	72.51	2,813,388.00
DTE ENERGY COMPANY	12,526	83.31	1,043,541.06
DUKE ENERGY CORP	46,986	82.18	3,861,309.48
EDISON INTL	21,325	64.75	1,380,793.75
ENTERGY CORP	12,368	83.98	1,038,664.64
EXELON CORP	57,096	36.36	2,076,010.56
FIRSTENERGY CORP	28,642	37.82	1,083,240.44
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,588	76.03	424,855.64
MDU RESOURCES GROUP INC	12,955	23.71	307,163.05

NEXTERA ENERGY INC	29,087	104.59	3,042,209.33
NISOURCE INC	21,235	41.89	889,534.15
NORTHEAST UTILITIES	20,700	52.24	1,081,368.00
NRG ENERGY INC	22,112	27.84	615,598.08
OGE ENERGY CORP	14,225	35.82	509,539.50
PEPCO HOLDINGS INC	16,609	27.20	451,764.80
PG&E CORP	31,171	51.84	1,615,904.64
PINNACLE WEST CAPITAL	7,479	65.99	493,539.21
PPL CORPORATION	43,616	35.44	1,545,751.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	34,892	41.44	1,445,924.48
SCANA CORP	9,889	57.32	566,837.48
SEMPRA ENERGY	16,142	109.81	1,772,553.02
SOUTHERN CO	59,393	48.14	2,859,179.02
WISCONSIN ENERGY CORP	14,908	50.95	759,562.60
XCEL ENERGY INC	33,030	35.02	1,156,710.60
ALTERA CORPORATION	19,565	37.60	735,644.00
ANALOG DEVICES	20,156	56.37	1,136,193.72
APPLIED MATERIALS	83,888	24.41	2,048,125.52
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	17,293	102.64	1,774,953.52
BROADCOM CORP-CL A	36,922	42.65	1,574,723.30
CREE INC	9,546	31.78	303,371.88
INTEL CORP	330,452	36.89	12,190,374.28
KLA-TENCOR CORP	10,635	69.88	743,173.80
LAM RESEARCH CORP	10,497	82.28	863,693.16
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,912	46.31	783,194.72
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	26,984	14.75	398,014.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,317	31.04	568,559.68
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,535	45.41	660,034.35
MICRON TECHNOLOGY	71,377	35.65	2,544,946.93
NVIDIA CORP	34,799	20.73	721,383.27
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,584	69.22	801,844.48
TEXAS INSTRUMENTS	70,668	55.01	3,887,446.68
XILINX INC	17,155	47.20	809,716.00
アメリカドル 小計	20,822,286		1,256,063,748.07 (150,049,375,344)
カナダドル			
ALTAGAS INCOME LTD	8,879	39.49	350,631.71
ARC RESOURCES LTD	20,535	24.41	501,259.35
BAYTEX ENERGY CORP	10,495	16.90	177,365.50
CAMECO CORP	25,404	18.74	476,070.96
CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,183	35.97	2,596,422.51
CANADIAN OIL SANDS LTD	30,774	10.10	310,817.40
CENOVUS ENERGY INC	51,416	22.54	1,158,916.64

CRESCENT POINT ENERGY CORP	27,840	24.94	694,329.60
ENBRIDGE	57,525	56.59	3,255,339.75
ENCANA CORP	49,373	15.28	754,419.44
ENERPLUS CORP	14,416	12.24	176,451.84
HUSKY ENERGY INC	22,209	22.38	497,037.42
IMPERIAL OIL	19,688	49.11	966,877.68
INTER PIPELINE LTD	23,421	31.77	744,085.17
KEYERA CORP	6,153	74.75	459,936.75
MEG ENERGY CORP	9,886	16.15	159,658.90
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	23,201	7.18	166,583.18
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	2,200	29.89	65,758.00
PEMBINA PIPELINE CORP	21,608	39.68	857,405.44
PENN WEST PETROLEUM LTD	34,568	3.06	105,778.08
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	10,529	33.40	351,668.60
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,500	32.00	208,000.00
SUNCOR ENERGY	96,026	34.02	3,266,804.52
TALISMAN ENERGY INC	74,581	4.81	358,734.61
TOURMALINE OIL CORP	11,836	38.00	449,768.00
TRANSCANADA CORP	47,008	53.55	2,517,278.40
VERMILION ENERGY INC	7,014	45.98	322,503.72
AGNICO EAGLE MINES	13,647	29.34	400,402.98
AGRIUM INC	9,712	109.90	1,067,348.80
BARRICK GOLD CORP	82,069	13.79	1,131,731.51
ELDORADO GOLD CORP	58,874	8.25	485,710.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	38,903	17.60	684,692.80
FRANCO-NEVADA CORP	11,354	60.64	688,506.56
GOLDCORP INC	50,950	23.23	1,183,568.50
KINROSS GOLD CORP	95,851	3.70	354,648.70
METHANEX CORP	6,091	55.54	338,294.14
NEW GOLD INC	38,800	5.19	201,372.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	55,115	39.70	2,188,065.50
SILVER WHEATON CORP	27,103	24.98	677,032.94
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,598	15.85	564,228.30
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	3.52	170,871.36
YAMANA GOLD INC	62,705	4.91	307,881.55
BOMBARDIER B	104,404	4.04	421,792.16
CAE INC	14,339	14.74	211,356.86
FINNING INTERNATIONAL INC	10,642	24.06	256,046.52
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,026	41.10	453,168.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,314	76.79	4,170,772.06
CP RAILWAY LIMITED	11,563	211.14	2,441,411.82
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,061	123.94	1,742,720.34

GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,121	61.67	500,822.07
TIM HORTONS INC	9,003	94.94	854,744.82
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,492	30.72	813,834.24
THOMSON REUTERS CORP	24,104	44.81	1,080,100.24
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,855	126.48	614,060.40
DOLLARAMA INC	8,732	54.00	471,528.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	28,395	39.53	1,122,454.35
EMPIRE CO LTD 'A'	4,016	84.68	340,074.88
LOBLAW COMPANIES LTD	14,932	61.08	912,046.56
METRO INC	5,357	89.10	477,308.70
WESTON (GEORGE) LTD	3,406	100.24	341,417.44
SAPUTO INC	16,590	33.66	558,419.40
CATAMARAN CORPORATION	14,776	58.70	867,351.20
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	21,224	161.34	3,424,280.16
BANK MONTREAL	42,944	79.29	3,405,029.76
BANK NOVA SCOTIA	81,072	65.38	5,300,487.36
CANADIAN IMPERIAL BANK	26,264	101.70	2,671,048.80
NATIONAL BANK OF CANADA	21,964	47.93	1,052,734.52
ROYAL BANK OF CANADA	96,290	79.91	7,694,533.90
TORONTO-DOMINION BANK	122,848	52.75	6,480,232.00
CI FINANCIAL CORP	14,619	32.26	471,608.94
IGM FINANCIAL INC	6,544	44.69	292,451.36
ONEX CORP	6,244	63.72	397,867.68
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,405	598.00	840,190.00
GREAT-WEST LIFECO INC	20,342	32.84	668,031.28
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,595	45.37	299,215.15
INTACT FINANCIAL CORP	8,648	79.98	691,667.04
MANULIFE FINANCIAL CORP	122,753	22.45	2,755,804.85
POWER CORP OF CANADA	23,730	31.25	741,562.50
POWER FINANCIAL CORP	18,553	35.08	650,839.24
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,666	42.32	1,720,985.12
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	36,510	56.15	2,050,036.50
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	17.78	124,460.00
CGI GROUP INC - CL A	14,985	41.01	614,534.85
CONSTELLATION SOFTWARE INC	980	337.22	330,475.60
OPEN TEXT CORP	7,676	67.58	518,744.08
BLACKBERRY LIMITED	35,879	11.98	429,830.42
BCE INC	18,138	52.18	946,440.84
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	24,157	44.73	1,080,542.61
TELUS CORP	18,262	41.05	749,655.10
ATCO LTD -CLASS I	4,372	46.60	203,735.20
CANADIAN UTILITIES LTD A	8,412	39.60	333,115.20

	FORTIS INC	15,900	39.08	621,372.00
	TRANSALTA CORP	15,728	10.39	163,413.92
	カナダドル 小計	2,700,415		98,770,615.95 (10,302,762,949)
ユーロ	ENI	167,111	14.66	2,449,847.26
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	26,226	9.01	236,453.61
	NESTE OIL OYJ	8,021	19.21	154,083.41
	OMV AG	11,309	21.58	244,104.76
	REPSOL SA	65,798	17.61	1,158,702.78
	SAIPEM	19,487	9.13	177,916.31
	TECHNIP S.A.	7,699	48.60	374,171.40
	TENARIS SA	32,853	12.47	409,676.91
	TOTAL SA	142,475	43.23	6,159,194.25
	VOPAK	3,661	44.18	161,742.98
	AIR LIQUIDE	22,866	99.80	2,282,026.80
	AKZO NOBEL	16,375	55.64	911,105.00
	ARCELORMITTAL	63,982	9.50	608,020.94
	ARKEMA	4,246	55.24	234,549.04
	BASF SE	60,853	72.42	4,406,974.26
	CRH	51,499	19.12	984,660.88
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,446	34.36	152,786.79
	HEIDELBERGCEMENT AG	9,051	58.24	527,130.24
	IMERYS SA	2,111	58.74	124,000.14
	K+S AG	11,391	23.54	268,201.09
	KONINKLIJKE DSM NV	11,951	52.62	628,861.62
	LAFARGE (FRANCE)	13,182	57.40	756,646.80
	LANXESS	6,450	38.34	247,325.25
	LINDE AG	12,240	151.60	1,855,584.00
	SOLVAY SA	3,895	111.60	434,682.00
	STORA ENSO OYJ R	38,359	7.10	272,540.69
	SYMRISE AG	7,200	50.03	360,216.00
	THYSSEN KRUPP	31,852	21.12	672,714.24
	UMICORE	7,723	32.36	249,954.89
	UPM KYMMENE CORP	33,402	13.28	443,578.56
	VOESTALPINE AG	7,378	34.04	251,184.01
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,699	27.13	290,263.87
	AIRBUS GROUP NV	39,772	48.19	1,916,811.54
	ALSTOM RGPT	14,099	27.70	390,542.30
	ANDRITZ AG	3,976	44.90	178,522.40
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,895	43.33	255,459.82
	BOUYGUES ORD	10,612	29.97	318,041.64
	BRENTAG AG	9,493	43.98	417,502.14

CNH INDUSTRIAL NV	59,096	6.38	377,327.96
FERROVIAL SA	30,350	16.02	486,358.75
FINMECCANICA SPA	22,011	7.77	171,135.52
GEA GROUP AG	11,829	37.53	443,942.37
KONE OYJ-B	20,372	37.30	759,875.60
KONINKLIJKE PHILIPS	63,638	23.65	1,505,038.70
LEGRAND SA	17,223	42.95	739,813.96
MAN SE	2,691	91.63	246,576.33
METSO OYJ	8,009	25.09	200,945.81
OCI NV	6,651	29.52	196,370.77
OSRAM LICHT AG	7,339	32.85	241,086.15
PRYSMIAN SPA	11,275	14.71	165,855.25
REXEL SA	17,749	14.61	259,401.63
SAFRAN SA	18,605	52.09	969,134.45
SAINT-GOBAIN	31,778	33.66	1,069,647.48
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,648	61.95	2,146,443.60
SIEMENS	52,556	92.64	4,868,787.84
THALES SA	5,995	43.51	260,872.42
VALLOUREC	6,620	23.54	155,834.80
VINCI S.A.	33,234	43.26	1,437,702.84
WARTSILA OYJ	11,075	35.27	390,615.25
ZARDOYA OTIS SA	16,507	8.47	139,814.29
ZODIAC AEROSPACE	11,896	26.91	320,180.84
BUREAU VERITAS SA	16,689	17.87	298,232.43
EDENRED	13,096	23.95	313,649.20
RANDSTAD HOLDING NV	9,459	39.11	369,941.49
SOCIETE BIC SA	2,119	109.95	232,984.05
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	24,969	16.20	404,622.64
ADP	2,332	100.15	233,549.80
ATLANTIA SPA	29,160	19.33	563,662.80
BOLLORE	27,000	3.91	105,705.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,741	14.09	278,249.39
DEUTSCHE POST AG-REG	66,816	26.30	1,757,260.80
FRAPORT AG	2,688	49.11	132,021.12
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	35,363	10.56	373,610.09
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	68,252	5.78	394,701.31
TNT EXPRESS	30,460	5.54	168,870.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,721	88.90	2,019,896.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,141	66.87	210,038.67
CONTINENTAL AG	7,204	171.65	1,236,566.60
DAIMLER AG	63,782	67.97	4,335,262.54
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	58,121	10.50	610,270.50

MICHELIN	12,768	74.17	947,002.56
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,095	23.32	188,775.40
PEUGEOT SA	31,000	10.32	319,920.00
PIRELLI & CO	13,734	11.15	153,134.10
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,677	69.34	671,003.18
RENAULT SA	12,432	62.41	775,881.12
VALEO SA	5,150	98.50	507,275.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,548	183.10	1,931,338.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,034	181.05	368,255.70
ADIDAS AG	13,409	59.13	792,874.17
CHRISTIAN DIOR	3,587	151.40	543,071.80
HUGO BOSS AG	1,897	103.85	197,003.45
KERING	5,217	160.50	837,328.50
LUXOTTICA GROUP SPA	10,750	43.26	465,045.00
LVMH	18,419	142.00	2,615,498.00
ACCOR	12,024	35.95	432,322.92
SODEXO	6,141	79.23	486,551.43
ALTICE SA	5,165	60.41	312,017.65
AXEL SPRINGER SE	3,824	47.21	180,550.16
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,417	26.83	306,318.11
JC DECAUX SA	3,750	26.99	101,212.50
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,691	111.20	188,039.20
LAGADERE S.C.A	6,893	22.14	152,611.02
NUMERICABLE-SFR	6,600	37.30	246,180.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	14,229	33.55	477,454.09
PUBLICIS GROUPE	11,980	59.19	709,096.20
REED ELSEVIER NV	47,100	19.40	913,975.50
RTL GROUP	3,000	77.89	233,670.00
SES	19,808	29.61	586,514.88
TELENET GROUP HOLDING NV	4,084	45.65	186,434.60
WOLTERS KLUWER	20,039	23.90	479,032.29
INDITEX	74,200	22.63	1,679,146.00
CARREFOUR	40,481	23.70	959,602.10
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,257	74.04	315,188.28
COLRUYT SA	5,355	37.79	202,365.45
DELHAIZE GROUP	6,375	57.56	366,945.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	48,188	5.35	257,902.17
JERONIMO MARTINS	19,371	8.06	156,265.85
KONINKLIJKE AHOLD NV	58,520	14.28	835,665.60
METRO STAMM	12,444	24.85	309,233.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV	53,208	91.12	4,848,312.96
DANONE (GROUPE)	38,271	55.85	2,137,435.35

HEINEKEN HOLDING NV	6,802	52.15	354,724.30
HEINEKEN NV	16,014	60.47	968,366.58
KERRY GROUP PLC-A	11,223	58.73	659,126.79
PERNOD-RICARD	13,888	92.66	1,286,862.08
REMY COINTREAU	1,720	57.80	99,416.00
UNILEVER NV-CVA	108,446	32.56	3,531,543.99
BEIERSDORF AG	6,440	70.15	451,766.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,478	79.79	676,459.62
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,474	88.23	1,100,581.02
LOREAL	16,583	135.90	2,253,629.70
CELESIO AG	3,460	26.09	90,271.40
ESSILOR INTERNATIONAL	14,109	89.57	1,263,743.13
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,259	59.46	907,300.14
FRESENIUS SE&CO KGAA	25,937	42.97	1,114,642.57
BAYER	55,070	114.60	6,311,022.00
GRIFOLS SA	11,270	31.17	351,342.25
MERCK KGAA	8,948	78.75	704,655.00
ORION OYJ-CLASS B	6,539	26.45	172,956.55
QIAGEN N.V.	14,857	19.05	283,025.85
SANOFI	79,271	73.97	5,863,675.87
UCB (GROUPE)	8,718	65.53	571,290.54
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	302,505	0.58	175,755.40
BANCO BILBAO VIZCAYA	390,357	8.32	3,251,283.45
BANCO DE SABADELL SA	218,428	2.23	487,968.15
BANCO POPOLARE SPA	27,800	10.72	298,016.00
BANCO POPULAR ESPANOL	115,362	4.32	499,286.73
BANCO SANTANDER SA	822,804	7.03	5,785,957.72
BANK OF IRELAND	2,061,000	0.33	692,496.00
BANKIA SA	325,444	1.29	421,124.53
BANKINTER SA	36,000	7.12	256,320.00
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,340,000	0.08	188,604.00
BNP PARIBAS	69,927	49.98	3,494,951.46
CAIXABANK	135,466	4.38	594,424.80
COMMERZBANK AG	66,514	11.81	785,862.91
CREDIT AGRICOLE SA	68,906	10.80	744,184.80
ERSTE GROUP BANK AG	20,082	21.14	424,533.48
ING GROEP NV-CVA	254,562	11.31	2,879,096.22
INTESA SANPAOLO	760,011	2.50	1,901,547.52
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	2.19	97,515.50
KBC GROEP NV	16,463	45.11	742,728.24
NATIXIS	60,710	5.58	339,065.35
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	15.50	121,923.00



SOCIETE GENERALE	47,377	37.23	1,763,845.71
UNICREDIT SPA	292,437	5.63	1,646,420.31
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,872	6.15	337,462.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	90,896	25.53	2,320,574.88
DEUTSCHE BOERSE	12,619	57.91	730,766.29
EURAZEO	2,843	56.35	160,203.05
EXOR SPA	7,647	34.99	267,568.53
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,086	71.27	362,479.22
MEDIOBANCA	39,830	7.17	285,780.25
WENDEL	2,395	90.76	217,370.20
AEGON	125,685	6.13	770,574.73
AGEAS	12,758	28.48	363,411.63
ALLIANZ SE-REG	30,234	136.05	4,113,335.70
ASSICURAZIONI GENERALI	77,041	16.95	1,305,844.95
AXA	120,020	19.08	2,289,981.60
CNP ASSURANCES	11,327	14.75	167,073.25
DELTA LLOYD NV	13,451	18.66	250,995.66
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,749	72.75	272,739.75
MAPFRE SA	76,919	2.94	226,757.21
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,344	161.75	1,834,892.00
NN GROUP NV	6,000	24.39	146,340.00
SAMPO OYJ-A SHS	30,638	39.02	1,195,494.76
SCOR SE	9,111	24.74	225,451.69
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	66,000	2.24	148,104.00
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	3,668	38.50	141,236.34
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	14,500	26.40	382,800.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	17,557	18.71	328,491.47
IMMOFINANZ AG	68,368	2.25	154,443.31
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	26,673	31.54	841,266.42
ATOS	5,308	58.47	310,358.76
CAP GEMINI SA	9,452	58.01	548,310.52
DASSAULT SYSTEMES SA	9,572	49.76	476,350.58
GEMALTO	5,169	65.12	336,605.28
SAP SE	60,948	56.08	3,417,963.84
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,983	35.56	283,875.48
ALCATEL-LUCENT	189,233	2.71	513,767.59
NOKIA CORP	248,283	6.51	1,616,322.33
BELGACOM	10,282	31.36	322,443.52
DEUTSCHE TELEKOM	216,088	13.23	2,859,924.68
ELISA A	10,777	23.60	254,337.20
ILIAD SA	1,986	192.05	381,411.30
KPN (KON.)	213,923	2.57	550,851.72

	ORANGE	123,219	13.84	1,705,967.05
	TELECOM ITALIA ORD	616,279	0.93	573,139.47
	TELECOM ITALIA RNC	475,204	0.74	351,650.96
	TELEFONICA	279,931	12.92	3,616,708.52
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,607	4.21	124,882.32
	VIVENDI	80,526	20.28	1,633,469.91
	E.ON SE	137,997	14.63	2,019,586.09
	ELECTRICITE DE FRANCE	15,750	23.71	373,432.50
	ENAGAS	15,215	25.97	395,209.62
	ENEL	452,502	3.76	1,704,122.53
	ENEL GREEN POWER SPA	142,752	1.77	253,955.80
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	166,510	3.44	572,794.40
	FORTUM OYJ	28,754	19.64	564,728.56
	GAS NATURAL SDG SA	23,754	21.70	515,461.80
	GDF SUEZ	95,709	19.61	1,876,853.49
	IBERDROLA SA	342,346	5.66	1,939,732.43
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,195	71.45	514,082.75
	RWE STAMM	33,308	28.24	940,617.92
	SNAM SPA	137,361	4.07	560,158.15
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	21,575	14.34	309,493.37
	TERNA SPA	92,159	3.82	352,600.33
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,360	14.40	422,784.00
	ASML HOLDING NV	23,774	86.50	2,056,451.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	76,896	8.39	645,849.50
	STMICROELECTRONICS	46,205	6.09	281,665.68
	ユーロ 小計	17,055,167		205,559,761.59 (30,400,233,141)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	22,875	8.55	195,695.62
	BG GROUP	226,880	8.98	2,039,197.44
	BP PLC	1,224,747	4.05	4,971,860.44
	PETROFAC LTD	16,540	7.42	122,726.80
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	263,328	20.84	5,489,072.16
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	162,367	21.54	3,498,197.01
	TULLOW OIL PLC	60,784	3.90	237,239.95
	ANGLO AMERICAN PLC	91,688	12.23	1,121,344.24
	ANTOFAGASTA PLC	31,803	7.31	232,479.93
	BHP BILLITON PLC	139,481	14.13	1,971,563.93
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,864	25.65	227,361.60
	FRESNILLO PLC	14,610	7.33	107,091.30
	GLENCORE PLC	703,993	3.11	2,196,106.16
	JOHNSON MATTHEY PLC	13,961	33.20	463,505.20
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,875	43.35	254,681.25

REXAM PLC	55,867	4.46	249,502.02
RIO TINTO PLC REG	84,357	28.49	2,403,752.71
ASHTED GROUP PLC	29,500	10.77	317,715.00
BAE SYSTEMS PLC	220,687	4.67	1,032,153.09
BUNZL PLC	22,262	17.92	398,935.04
COBHAM PLC	73,053	3.06	223,688.28
IMI PLC	21,206	12.25	259,773.50
MEGGITT PLC	52,697	4.99	263,063.42
MELROSE INDUSTRIES PLC	75,076	2.61	196,548.96
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	124,596	8.60	1,072,148.58
SMITHS GROUP PLC	28,106	10.93	307,198.58
TRAVIS PERKINS PLC	18,014	17.83	321,189.62
WEIR GROUP PLC/THE	15,568	17.16	267,146.88
WOLSELEY LTD	17,932	35.73	640,710.36
AGGREKO PLC	18,896	14.89	281,361.44
BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	11.20	165,860.80
CAPITA GROUP PLC	45,144	10.32	465,886.08
EXPERIAN PLC	67,753	10.40	704,631.20
G4S PLC	115,465	2.79	323,071.07
INTERTEK GROUP PLC	11,859	21.76	258,051.84
EASYJET PLC	9,909	16.25	161,021.25
ROYAL MAIL PLC	48,500	3.98	193,369.50
NEW GKN	114,107	3.41	389,675.40
BURBERRY GROUP PLC	30,301	16.69	505,723.69
PERSIMMON PLC	20,660	15.55	321,263.00
CARNIVAL PLC	12,187	27.19	331,364.53
COMPASS GROUP PLC	110,804	10.80	1,196,683.20
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,398	25.14	387,105.72
MERLIN ENTERTAINME	22,600	3.75	84,908.20
TUI TRAVEL PLC	43,042	4.43	190,762.14
WHITBREAD PLC	12,284	45.19	555,113.96
WILLIAM HILL	55,124	3.47	191,445.65
ITV PLC	252,100	2.08	525,628.50
PEARSON	56,008	11.87	664,814.96
REED ELSEVIER PLC	75,536	10.80	815,788.80
SKY PLC	71,906	9.21	662,254.26
WPP PLC	86,512	13.12	1,135,037.44
DIXONS CARPHONE PLC	65,000	4.31	280,215.00
KINGFISHER PLC	160,932	3.21	516,752.65
MARKS & SPENCER GROUP PLC	111,394	4.76	531,126.59
NEXT PLC	10,022	65.30	654,436.60
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	12,900	6.74	87,010.50

MORRISON SUPERMARKETS	163,403	1.76	288,733.10
SAINSBURY (J) PLC	92,376	2.31	213,942.81
TESCO	563,529	1.74	985,612.22
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,780	31.66	784,534.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	124,126	36.08	4,478,466.08
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,138	13.29	174,604.02
DIAGEO	166,670	19.18	3,196,730.60
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	63,569	27.98	1,778,660.62
SABMILLER PLC	64,272	33.15	2,130,938.16
TATE & LYLE	29,097	5.91	172,108.75
UNILEVER PLC	85,000	26.64	2,264,400.00
RECKITT BENCKISER PLC	43,270	52.00	2,250,040.00
SMITH & NEPHEW PLC	58,200	10.72	623,904.00
ASTRAZENECA	84,293	45.61	3,845,025.19
GLAXOSMITHKLINE	322,792	14.09	4,548,139.28
SHIRE PLC	40,221	43.35	1,743,580.35
BARCLAYS	1,089,628	2.38	2,598,762.78
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,275,854	6.22	7,944,742.85
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,800,576	0.78	2,984,972.39
ROYAL BANK OF SCOTLAND	165,839	3.88	643,786.99
STANDARD CHARTERED PLC	162,965	9.44	1,538,878.49
3I GROUP PLC	64,458	4.43	286,129.06
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	69,585	4.44	309,514.08
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,952	9.32	186,052.40
ICAP PLC	40,718	4.14	168,572.52
INVESTEC PLC	35,539	5.47	194,398.33
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	15,143	21.55	326,331.65
SCHRODERS PLC	9,263	26.90	249,174.70
ADMIRAL GROUP PLC	12,465	12.59	156,934.35
AVIVA PIC	205,502	4.92	1,012,302.85
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	93,600	2.88	269,568.00
FRIENDS LIFE GROUP LTD	86,141	3.71	320,358.37
LEGAL & GENERAL GROUP	412,811	2.40	991,984.83
OLD MUTUAL PLC	335,316	1.89	635,759.13
PRUDENTIAL	171,139	14.98	2,563,662.22
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	68,001	4.42	301,176.42
STANDARD LIFE PLC	161,867	4.08	660,579.22
SAGE GROUP PLC	70,948	4.37	310,113.70
BT GROUP PLC	553,755	4.08	2,262,089.17
INMARSAT PLC	31,413	7.96	250,047.48
VODAFONE GROUP PLC	1,767,308	2.23	3,951,700.68
CENTRICA PLC	329,575	2.79	922,480.42

	NATIONAL GRID PLC	248,819	9.09	2,263,008.80
	SEVERN TRENT PLC	15,696	19.40	304,502.40
	SSE PLC	64,378	16.30	1,049,361.40
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,385	8.72	387,037.20
	ARM HOLDINGS PLC	96,735	9.43	912,211.05
	イギリスポンド 小計	18,955,979		110,097,626.95 (20,609,174,788)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	24,464	17.80	435,459.20
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	674	392.00	264,208.00
	GIVAUDAN-REG	642	1,761.00	1,130,562.00
	HOLCIM LTD	15,952	70.75	1,128,604.00
	SIKA AG-BR	142	2,920.00	414,640.00
	SYNGENTA AG	6,083	309.00	1,879,647.00
	ABB LTD	145,839	20.89	3,046,576.71
	GEBERIT AG-REG	2,496	330.40	824,678.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,564	136.00	212,704.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,822	140.00	395,080.00
	SULZER AG-REG	1,409	101.30	142,731.70
	ADECCO	10,532	66.35	698,798.20
	SGS SA	348	1,998.00	695,304.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,417	130.60	446,260.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	34,349	89.05	3,058,778.45
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,923	463.10	890,541.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,638	86.95	316,324.10
	ARYZTA AG	5,627	78.65	442,563.55
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,021.00	131,709.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	71	4,825.00	342,575.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	56,655.00	396,585.00
	NESTLE SA - REGISTERED	215,245	71.65	15,422,304.25
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,617	142.10	513,975.70
	ACTELION LTD-REG	7,018	116.50	817,597.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,212	109.40	351,392.80
	NOVARTIS	153,598	91.65	14,077,256.70
	ROCHE HOLDING GENUSS	46,892	291.10	13,650,261.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	101,155	25.57	2,586,533.35
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,782	44.67	660,311.94
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	75.90	173,735.10
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,154	275.75	318,215.50
	UBS GROUP AG	254,625	17.40	4,430,475.00
	BALOISE HOLDING AG	3,051	125.10	381,680.10
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,428	228.50	554,798.00
	SWISS RE LTD	23,469	83.40	1,957,314.60

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,805	304.20	2,982,681.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,659	73.30	341,504.70	
	SWISSCOM	1,559	572.50	892,527.50	
	スイスフラン 小計	1,110,686		77,406,894.25 (9,524,918,337)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,068	101.20	1,626,081.60	
	BOLIDEN AB	20,397	122.50	2,498,632.50	
	ALFA LAVAL AB	23,908	145.00	3,466,660.00	
	ASSA ABLOY B	23,151	405.50	9,387,730.50	
	ATLAS COPCO A	44,842	215.40	9,658,966.80	
	ATLAS COPCO B	25,066	196.00	4,912,936.00	
	SANDVIK AB	69,881	77.20	5,394,813.20	
	SKANSKA B	24,171	160.00	3,867,360.00	
	SKF AB-B	25,705	158.80	4,081,954.00	
	VOLVO B	97,794	83.90	8,204,916.60	
	SECURITAS B	18,644	90.00	1,677,960.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	16,750	219.90	3,683,325.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,160	55.20	1,940,832.00	
	HENNES & MAURITZ B	62,685	315.20	19,758,312.00	
	ICA GRUPPEN AB	3,500	307.10	1,074,850.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,713	247.40	3,145,196.20	
	SCA SV CELLULOSA B	40,170	174.50	7,009,665.00	
	ELEKTA AB-B SHS	30,486	77.45	2,361,140.70	
	GETINGE AB-B SHS	12,973	170.50	2,211,896.50	
	NORDEA BANK AB	199,872	93.40	18,668,044.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	102,889	99.10	10,196,299.90	
	SVENSKA HANDELSBK A	33,902	367.80	12,469,155.60	
	SWEDBANK AB-A	62,093	196.00	12,170,228.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	133.40	1,151,375.40	
	INVESTOR AB-B SHS	29,530	278.40	8,221,152.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	17,657	259.30	4,578,460.10	
ERICSSON (LM) B	201,111	92.15	18,532,378.65		
HEXAGON AB-B SHS	18,575	231.30	4,296,397.50		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,957	609.50	3,021,291.50		
TELE2 AB-B SHS	18,919	93.95	1,777,440.05		
TELIASONERA AB	155,759	52.25	8,138,407.75		
	スウェーデンクローナ 小計	1,457,959		199,183,859.85 (3,161,047,855)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	24,906	85.65	2,133,198.90	
	STATOIL ASA	77,095	123.50	9,521,232.50	
	SUBSEA 7 SA	20,149	68.25	1,375,169.25	
	NORSK HYDRO	87,419	41.54	3,631,385.26	

	YARA INTERNATIONAL ASA	11,988	305.00	3,656,340.00	
	ORKLA	57,069	50.25	2,867,717.25	
	DNB ASA	66,750	113.40	7,569,450.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,350	119.40	1,713,390.00	
	TELENOR ASA	51,688	149.60	7,732,524.80	
	ノルウェークローネ 小計	411,414		40,200,407.96 (674,964,849)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	15,791	265.20	4,187,773.20	
	VESTAS WIND SYSEMS	16,116	229.60	3,700,233.60	
	ISS A/S	3,900	170.40	664,560.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	258	11,470.00	2,959,260.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	505	11,740.00	5,928,700.00	
	DSV A/S	10,940	184.50	2,018,430.00	
	PANDORA A/S	7,752	519.00	4,023,288.00	
	CARLSBERG AS-B	7,143	510.00	3,642,930.00	
	COLOPLAST-B	7,514	514.50	3,865,953.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	956	438.00	418,728.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	133,696	275.70	36,859,987.20	
	DANSKE BANK A/S	42,446	168.00	7,130,928.00	
	TRYG A/S	889	725.00	644,525.00	
	TDC A/S	59,213	48.01	2,842,816.13	
	デンマーククローネ 小計	307,119		78,888,112.13 (1,568,295,669)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,808	30.38	267,587.04	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	75,609	10.80	816,577.20	
	SANTOS	70,958	7.70	546,376.60	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	49,385	34.38	1,697,856.30	
	WORLEYPARSONS LTD	10,691	10.04	107,337.64	
	ALUMINA LIMITED	135,453	1.72	233,656.42	
	AMCOR	84,421	12.89	1,088,186.69	
	BHP BILLITON LTD	213,853	28.88	6,176,074.64	
	BORAL LIMITED	48,785	5.18	252,706.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	118,297	2.55	301,657.35	
	ILUKA RESOURCES LTD	28,163	5.91	166,443.33	
	INCITEC PIVOT LTD	108,462	2.98	323,216.76	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,941	12.56	376,058.96	
	NEWCREST MINING LIMITED	46,131	10.28	474,226.68	
	ORICA LTD	26,570	17.48	464,443.60	
	RIO TINTO LTD	28,637	55.50	1,589,353.50	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	6,260	21.91	137,156.60	
	ALS LTD	37,855	4.88	184,732.40	
BRAMBLES LTD	104,573	10.30	1,077,101.90		

SEEK LTD	23,092	17.09	394,642.28
ASCIANO GROUP	62,700	5.68	356,136.00
AURIZON HOLDINGS LTD	137,443	4.50	618,493.50
QANTAS AIRWAYS LIMITED	35,104	2.38	83,547.52
TOLL HOLDINGS LIMITED	35,709	5.75	205,326.75
TRANSURBAN GROUP	122,607	8.57	1,050,741.99
CROWN RESORTS LTD	22,372	13.38	299,337.36
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	38.23	114,231.24
TABCORP HOLDINGS	46,982	4.18	196,384.76
TATTS GROUP LTD	87,232	3.42	298,333.44
REA GROUP LTD	3,000	44.77	134,310.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,357	3.60	192,085.20
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD-R	2,425	0.99	2,412.87
METCASH LTD	80,938	1.80	146,093.09
WESFARMERS LTD	74,614	42.64	3,181,540.96
WOOLWORTHS LTD	83,614	30.31	2,534,340.34
COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,080	8.80	308,704.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	40,720	4.77	194,234.40
COCHLEAR LIMITED	3,095	73.77	228,318.15
HEALTHSCOPE LTD	45,805	2.63	120,467.15
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,132	55.24	504,451.68
SONIC HEALTHCARE LTD	26,678	17.45	465,531.10
CSL LIMITED	31,325	87.21	2,731,853.25
AUST AND NZ BANKING GROUP	184,005	31.88	5,866,079.40
BANK OF QUEENSLAND LTD	26,211	11.98	314,007.78
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,026	12.68	393,409.68
COMMONWEALTH BANK OF AUST	108,550	82.02	8,903,271.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	156,279	32.60	5,094,695.40
WESTPAC BANKING	207,865	33.06	6,872,016.90
ASX LTD	15,073	36.00	542,628.00
MACQUARIE GROUP LIMITED	19,782	60.66	1,199,976.12
AMP LTD	201,300	5.55	1,117,215.00
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	158,938	6.26	994,951.88
MEDIBANK PRIVATE LTD	157,000	2.22	348,540.00
QBE INSURANCE GROUP	92,967	11.16	1,037,511.72
SUNCORP GROUP LIMITED	88,499	14.02	1,240,755.98
COMPUTERSHARE LIMITED	34,261	11.42	391,260.62
TELSTRA CORP	291,278	5.64	1,642,807.92
TPG TELECOM LTD	8,100	7.12	57,672.00
AGL ENERGY LTD	45,461	13.21	600,539.81
AUSNET SERVICES	117,666	1.33	156,495.78
	4,243,125		67,416,101.93



オーストラリアドル 小計				(6,682,958,184)
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	53,297	8.32	443,431.04
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	80,261	4.31	345,924.91
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	8.10	178,200.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,967	3.03	442,280.01
	CONTACT ENERGY LTD	34,237	6.28	215,008.36
	MERIDIAN ENER-PARTLY PAID SH	35,277	1.76	62,087.52
	MIGHTY RIVER POWER	19,544	3.08	60,195.52
ニュージーランドドル 小計		390,583		1,747,127.36 (160,543,533)
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	146,000	90.50	13,213,000.00
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	14.12	1,037,820.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	103,000	17.54	1,806,620.00
	MTR CORP	110,500	31.15	3,442,075.00
	LI & FUNG	377,400	8.10	3,056,940.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,000	25.80	2,167,200.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	27.00	1,269,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	153,000	46.40	7,099,200.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	20.90	1,262,360.00
	SANDS CHINA LTD	163,000	39.85	6,495,550.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	90,000	10.86	977,400.00
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	12.98	1,817,200.00
	WYNN MACAU LTD	107,200	21.85	2,342,320.00
	WH GROUP LTD	147,000	4.32	635,040.00
	BANK EAST ASIA	80,964	30.70	2,485,594.80
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	256,000	26.35	6,745,600.00
	HANG SENG BANK	51,400	126.90	6,522,660.00
	FIRST PACIFIC CO	112,000	8.02	898,240.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	76,600	176.90	13,550,540.00
	AIA GROUP LTD	801,200	43.65	34,972,380.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS	89,000	136.00	12,104,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	151,000	21.70	3,276,700.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	69,127	51.80	3,580,778.60
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	35.55	1,102,050.00
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	27.35	1,011,950.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	375,000	9.00	3,375,000.00
	SINO LAND CO	186,600	12.40	2,313,840.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	112.80	12,182,400.00	
SWIRE PACIFIC A	41,000	103.70	4,251,700.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	23.40	1,567,800.00	
WHARF HOLDINGS	109,000	55.10	6,005,900.00	
WHEELOCK & CO LTD	63,000	37.20	2,343,600.00	

	PCCW LTD	183,000	5.16	944,280.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	44,000	56.50	2,486,000.00	
	CLP HOLDINGS	125,000	66.00	8,250,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	416,667	17.86	7,441,672.62	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	93,500	73.50	6,872,250.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,700	72.45	1,572,165.00	
	香港ドル 小計	5,390,758		192,478,826.02	(2,966,098,708)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	94,500	8.19	773,955.00	
	NOBLE GROUP LTD	292,145	1.16	338,888.20	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	4.20	260,400.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	49,400	2.89	142,766.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	108,000	3.37	363,960.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	152,000	1.19	181,640.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	114,000	2.60	296,400.00	
	SINGAPORE AIRLINES	38,600	11.20	432,320.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	414,400	1.10	455,840.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	112,250	4.15	465,837.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	43.53	348,240.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.45	221,457.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	138,000	3.22	444,360.00	
	DBS GROUP	116,000	19.86	2,303,760.00	
	OCBC BANK	194,250	10.41	2,022,142.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	87,000	24.39	2,121,930.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	56,000	7.60	425,600.00	
	CAPITALAND LTD	199,000	3.28	652,720.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	10.00	220,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	230,000	2.57	591,100.00	
KEPPEL LAND LTD	68,000	3.36	228,480.00		
UOL GROUP LIMITED	19,400	6.71	130,174.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	542,880	3.93	2,133,518.40		
STARHUB LTD	21,000	4.07	85,470.00		
	シンガポールドル 小計	3,625,545		15,640,959.20	(1,420,199,095)
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	310	1,202.00	372,620.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	26.72	761,092.48	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	256	1,933.00	494,848.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	56,922	223.80	12,739,143.60	
	BANK HAPOALIM BM	64,237	19.53	1,254,548.61	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,035	13.41	1,100,089.35	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,694	42.30	494,656.20	
	NICE SYSTEMS LTD	4,815	192.60	927,369.00	

	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,181	7.11	834,211.53	
	イスラエルシェケル 小計	365,934		18,978,578.77 (575,999,865)	
	合 計	76,836,970		238,096,572,317 (238,096,572,317)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	299,000	203,320.00	
		アメリカドル 小計	299,000	203,320.00 (24,288,607)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	58,103	463,080.91	
		LEND LEASE GROUP	36,497	569,353.20	
		SYDNEY AIRPORT	87,840	407,577.60	
		オーストラリアドル 小計	182,440	1,440,011.71 (142,748,360)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	213,000	2,155,560.00	
	香港ドル 小計	213,000	2,155,560.00 (33,217,179)		
	投資信託受益証券合計		694,440	200,254,146 (200,254,146)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,775	582,257.25	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	61,611	568,669.53	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	26,112	2,631,567.36	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,958	742,469.94	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,865	1,446,679.35	
		BOSTON PROPERTIES	10,322	1,374,477.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,153	384,929.10	
		CROWN CASTLE INTL CORP	23,105	1,824,601.85	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,579	663,537.33	
		DUKE REALTY CORP	25,178	491,474.56	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	23,371	1,688,087.33	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,300	882,704.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,213	560,708.17	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	37,204	1,020,877.76	
		HCP INC	31,518	1,419,255.54	
		HEALTH CARE REIT INC	22,253	1,681,214.15	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	48,190	1,143,548.70	
		IRON MOUNTAIN INC	12,487	464,516.40	
		KIMCO REALTY CORP	29,008	737,673.44	

	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,090	362,533.70	
	MACERICH CO/THE	9,794	796,056.32	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,719	446,553.54	
	PROLOGIS INC	34,217	1,469,620.15	
	PUBLIC STORAGE	10,081	1,874,158.71	
	RAYONIER INC	10,390	282,919.70	
	REALTY INCOME CORP	14,646	667,125.30	
	REGENCY CENTERS CORP	6,134	387,178.08	
	SIMON PROPERTY GROUP	20,575	3,749,382.25	
	SL GREEN REALTY CORP	6,783	829,425.24	
	UDR INC	15,851	492,966.10	
	VENTAS INC	19,109	1,383,109.42	
	VORNADO REALTY TRUST	11,079	1,265,664.96	
	アメリカドル 小計	652,670	34,315,942.75 (4,099,382,520)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	12,000	254,040.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,532	194,702.20	
	カナダドル 小計	19,532	448,742.20 (46,808,298)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	CORIO NV	4,870	193,533.80	
	FONCIERE DES REGIONS	1,902	143,981.40	
	GECINA SA	2,157	229,828.35	
	ICADE	2,664	175,690.80	
	KLEPIERRE	8,081	284,208.77	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,677	1,367,449.60	
	ユーロ 小計	1,631,935	2,394,692.72 (354,151,106)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	70,070	530,780.25	
	HAMMERSON PLC	50,271	304,642.26	
	INTU PROPERTIES PLC	53,831	181,841.11	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	53,551	616,372.01	
	SEGRO PLC	45,745	173,831.00	
	イギリスポンド 小計	273,468	1,807,466.63 (338,339,678)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	63,152	440,169.44	
	FEDERATION CENTRES	94,986	263,111.22	
	GOODMAN GROUP	112,498	634,488.72	
	GPT GROUP	106,799	444,283.84	
	MIRVAC GROUP	229,116	412,408.80	
	NOVION PROPERTY GROUP	126,417	269,268.21	
	SCENTRE GROUP	368,785	1,264,932.55	

	STOCKLAND	158,209	653,403.17	
	WESTFIELD CORP	128,674	1,114,316.84	
	オーストラリアドル 小計	1,388,636	5,496,382.79	(544,856,425)
香港ドル	LINK REIT	158,000	7,678,800.00	
	香港ドル 小計	158,000	7,678,800.00	(118,330,308)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,000	318,780.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000	185,350.00	
	CAPITAMALL TRUST	144,600	287,031.00	
	SUNTEC REIT	113,000	219,785.00	
	シンガポールドル 小計	505,600	1,010,946.00	(91,793,896)
	投資証券合計	4,629,841	5,593,662,231	(5,593,662,231)
	合計		5,793,916,377	(5,793,916,377)

(注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。

(注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。

(注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。

(注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	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	株式 599銘柄	97.3%			61.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 32銘柄			2.7%	1.7%
カナダドル	株式 93銘柄	99.5%			4.2%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	98.8%			12.5%
	投資証券 7銘柄			1.2%	0.1%
イギリスポンド	株式 104銘柄	98.4%			8.5%
	投資証券 5銘柄			1.6%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.9%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.3%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	90.7%			2.7%
	投資信託受 益証券 3銘柄		1.9%		0.1%
	投資証券 9銘柄			7.4%	0.2%

ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	38銘柄	95.1%			1.2%
	投資信託受益証券	1銘柄		1.1%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式	24銘柄	93.9%			0.6%
	投資証券	4銘柄			6.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	216,449,552
コール・ローン	6,291,997,262
国債証券	265,379,453,522
派生商品評価勘定	15,216,773
未収入金	99,320,612
未収利息	2,386,601,354
前払費用	36,820,178
差入委託証拠金	158,534,107
流動資産合計	274,584,393,360
資産合計	274,584,393,360
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,322,482
前受金	2,229,232
未払金	9,905,500
未払解約金	1,777,104,480
流動負債合計	1,792,561,694
負債合計	1,792,561,694
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	109,005,662,924
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	163,786,168,742
元本等合計	272,791,831,666

	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	272,791,831,666
負債純資産合計	274,584,393,360

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年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発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)先物取引 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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</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)派生商品取引等損益 約定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 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26年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		109,005,662,924口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5025円 (25,025円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成26年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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。	

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。	



3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>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>
----------------------------	---

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	136,121,081,679円
期中追加設定元本額	5,943,273,989円
期中一部解約元本額	33,058,692,744円
期末元本額	109,005,662,924円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	3,263,250,752円
DC外国債券インデックスファンド	1,839,257,407円
DC外国債券インデックスファンドL	9,838,671,991円
物価連動債組入世界債券ファンド	45,469,178円
DCバランスファンド30	378,196,466円
DCバランスファンド50	403,926,130円
DCバランスファンド70	80,105,161円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	54,513,933円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	28,639,657円
新生・4分散ファンド	56,229,140円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	380,334,744円

4資産インデックスバランスオープン（分配型）	11,661,686円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	42,077,334円
外国債券インデックスe	1,561,779,829円
インデックスコレクション（外国債券）	1,587,650,506円
インデックスコレクション（バランス株式30）	253,234,565円
インデックスコレクション（バランス株式50）	189,767,104円
インデックスコレクション（バランス株式70）	60,071,242円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	2,783,886,701円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,995,210,901円
外国債券インデックスファンドF（一般投資家私募）	190,058,774円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,819,293,708円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,965,878,382円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	7,261,808,515円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	14,786,149,063円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,641,695,507円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	90,018,855円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	3,406,427,968円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	4,928,466,479円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,314,991,594円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	13,594,007,206円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	579,334,657円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	16,400,814,646円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,866,342,917円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	235,502,972円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	1,181,383,140円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	677,805,014円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	200,497,339円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	85,204,105円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	247,407,092円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,483,875,712円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	24,863,861円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	479,499,404円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	163,383,892円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	2,490,354,834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）	35,840,819円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	822,042円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26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	11,892,881,603
合計	11,892,881,603

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(平成26年12月10日現在)

区分	種類	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	2,412,879,519	-	2,415,108,751	2,229,232
	合計	2,412,879,519	-	2,415,108,751	2,229,232

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(平成26年12月10日現在)

区分	種類	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	3,181,699,834	-	3,191,362,400	9,662,566
	アメリカドル	1,351,678,107	-	1,358,032,800	6,354,693
	カナダドル	117,272,643	-	117,836,400	563,757
	ユーロ	1,460,513,964	-	1,460,955,600	441,636
	イギリスポンド	252,235,120	-	254,537,600	2,302,480

	売建	119,641,023	-	119,638,530	2,493
	イギリスポンド	119,641,023	-	119,638,530	2,493
	合計	3,301,340,857	-	3,311,000,930	9,665,059

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/16	5,000,000.00	4,993,847.65	
		T 0.25% 05/15/16	5,000,000.00	4,991,406.25	
		T 0.25% 12/15/15	1,650,000.00	1,650,000.00	
		T 0.375% 01/31/16	4,000,000.00	4,003,906.24	
		T 0.375% 02/15/16	12,500,000.00	12,511,474.62	
		T 0.375% 03/15/16	15,000,000.00	15,010,839.90	
		T 0.5% 06/15/16	1,050,000.00	1,051,538.08	
		T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,932,506.62	
		T 0.625% 02/15/17	5,000,000.00	4,988,769.55	
		T 0.625% 04/30/18	9,000,000.00	8,826,328.17	
		T 0.625% 05/31/17	3,000,000.00	2,983,535.16	
		T 0.625% 07/15/16	7,000,000.00	7,019,550.79	
		T 0.625% 08/15/16	9,050,000.00	9,070,327.11	
		T 0.625% 08/31/17	2,500,000.00	2,477,001.95	
		T 0.625% 09/30/17	3,250,000.00	3,216,230.48	
		T 0.625% 10/15/16	9,000,000.00	9,009,316.44	
		T 0.625% 11/15/16	8,500,000.00	8,503,320.35	
T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,935,449.20			

T 0.625% 12/15/16	9,000,000.00	8,995,429.71	
T 0.75% 02/28/18	4,500,000.00	4,441,025.38	
T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,928,808.60	
T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,986,328.12	
T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,587,375.00	
T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,948,046.90	
T 0.875% 01/31/17	2,000,000.00	2,006,914.06	
T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,984,179.68	
T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,016,875.00	
T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,009,960.95	
T 0.875% 04/30/17	3,350,000.00	3,355,757.81	
T 0.875% 05/15/17	6,000,000.00	6,005,859.36	
T 0.875% 06/15/17	4,550,000.00	4,550,355.49	
T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	3,997,343.76	
T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,846,582.05	
T 0.875% 09/15/16	5,000,000.00	5,029,882.80	
T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,009,687.50	
T 0.875% 12/31/16	5,000,000.00	5,020,605.45	
T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,942,734.38	
T 1.125% 05/31/19	4,800,000.00	4,719,093.74	
T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,070,406.27	
T 1.25% 01/31/19	4,800,000.00	4,761,187.48	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,978,281.26	
T 1.375% 02/28/19	5,500,000.00	5,478,408.21	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,905,273.45	
T 1.375% 06/30/18	3,500,000.00	3,512,167.96	
T 1.375% 07/31/18	6,000,000.00	6,015,937.50	
T 1.375% 09/30/18	8,520,000.00	8,527,987.50	
T 1.375% 11/30/15	4,550,000.00	4,600,832.05	
T 1.375% 11/30/18	3,000,000.00	2,998,886.73	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,692,628.89	
T 1.5% 01/31/19	8,550,000.00	8,565,196.25	
T 1.5% 02/28/19	6,100,000.00	6,109,173.85	
T 1.5% 05/31/19	1,350,000.00	1,348,259.76	
T 1.5% 06/30/16	7,450,000.00	7,574,409.18	
T 1.5% 07/31/16	8,500,000.00	8,644,101.60	
T 1.5% 08/31/18	6,500,000.00	6,541,259.79	
T 1.5% 12/31/18	2,500,000.00	2,507,519.52	
T 1.625% 03/31/19	4,400,000.00	4,424,578.13	
T 1.625% 04/30/19	7,000,000.00	7,034,042.96	
T 1.625% 06/30/19	4,000,000.00	4,014,687.52	
T 1.625% 08/15/22	5,700,000.00	5,534,009.78	

T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,871,562.52
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,515,636.73
T 1.75% 05/15/23	7,950,000.00	7,724,853.53
T 1.75% 05/31/16	4,600,000.00	4,692,359.39
T 1.75% 10/31/18	1,800,000.00	1,825,628.90
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,234,937.50
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,048,867.18
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,239,068.36
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,017,332.01
T 1% 03/31/17	5,000,000.00	5,023,632.80
T 1% 05/31/18	1,000,000.00	991,640.63
T 1% 06/30/19	1,200,000.00	1,171,312.50
T 1% 08/31/16	4,850,000.00	4,890,637.71
T 1% 08/31/19	2,800,000.00	2,725,953.13
T 1% 09/15/17	7,000,000.00	7,006,835.92
T 1% 09/30/16	3,000,000.00	3,024,375.00
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,862,109.40
T 1% 10/31/16	6,200,000.00	6,248,437.50
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,920,097.64
T 2.125% 01/31/21	5,000,000.00	5,071,093.75
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,034,980.48
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,932,058.60
T 2.125% 08/31/20	6,000,000.00	6,108,632.82
T 2.125% 12/31/15	6,000,000.00	6,117,421.86
T 2.25% 03/31/16	9,150,000.00	9,379,107.39
T 2.25% 03/31/21	3,000,000.00	3,061,933.59
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,795,101.58
T 2.25% 07/31/18	4,500,000.00	4,652,226.58
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,585,781.25
T 2.25% 11/15/24	3,000,000.00	3,007,734.39
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,069,140.62
T 2.375% 03/31/16	7,900,000.00	8,109,998.03
T 2.375% 05/31/18	3,800,000.00	3,946,953.14
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,595,654.30
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,075,585.94
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,793,302.72
T 2.375% 12/31/20	7,200,000.00	7,414,031.23
T 2.5% 05/15/24	5,800,000.00	5,952,136.72
T 2.5% 06/30/17	3,200,000.00	3,330,750.01
T 2.5% 08/15/23	7,000,000.00	7,210,546.91
T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,499,378.91
T 2.625% 02/29/16	12,850,000.00	13,211,657.21
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,260,968.75

T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,768,679.69
T 2.625% 08/15/20	5,000,000.00	5,225,292.95
T 2.625% 11/15/20	13,000,000.00	13,577,636.67
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,105,468.76
T 2.75% 02/15/24	9,000,000.00	9,439,277.31
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	304,647.26
T 2.75% 05/31/17	4,900,000.00	5,130,740.21
T 2.75% 08/15/42	3,150,000.00	3,077,402.35
T 2.75% 11/15/23	7,950,000.00	8,345,481.41
T 2.75% 11/15/42	2,900,000.00	2,830,501.96
T 2.75% 11/30/16	3,000,000.00	3,124,746.09
T 2.75% 12/31/17	5,300,000.00	5,563,654.27
T 2.875% 03/31/18	4,800,000.00	5,064,750.00
T 2.875% 05/15/43	7,300,000.00	7,294,724.58
T 2% 01/31/16	3,000,000.00	3,057,832.02
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	6,008,906.28
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,461,279.30
T 2% 02/28/21	1,550,000.00	1,560,232.41
T 2% 04/30/16	6,090,000.00	6,227,738.68
T 2% 05/31/21	3,000,000.00	3,013,359.39
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,051,953.12
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,211,566.42
T 2% 11/15/21	4,300,000.00	4,311,085.95
T 2% 11/30/20	6,000,000.00	6,051,679.68
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,205,703.12
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	4,001,058.60
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,727,765.63
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,169,787.09
T 3.125% 05/15/19	3,620,000.00	3,869,582.02
T 3.125% 05/15/21	4,190,000.00	4,497,703.12
T 3.125% 08/15/44	7,700,000.00	8,078,082.01
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,466,691.40
T 3.125% 11/15/41	3,200,000.00	3,376,812.51
T 3.25% 03/31/17	5,000,000.00	5,283,593.75
T 3.25% 05/31/16	3,250,000.00	3,386,157.22
T 3.25% 06/30/16	2,500,000.00	2,609,667.97
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,721,938.27
T 3.25% 12/31/16	2,800,000.00	2,947,000.00
T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,648,740.24
T 3.375% 11/15/19	5,900,000.00	6,395,392.55
T 3.5% 02/15/18	3,650,000.00	3,919,543.95
T 3.5% 02/15/39	1,600,000.00	1,801,781.24

T 3.5% 05/15/20	7,900,000.00	8,627,972.67
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	10,762,199.18
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	5,766,483.61
T 3.625% 02/15/44	6,500,000.00	7,471,953.12
T 3.625% 08/15/19	5,500,000.00	6,013,046.87
T 3.625% 08/15/43	3,200,000.00	3,678,187.48
T 3.75% 08/15/41	4,800,000.00	5,659,781.23
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,501,278.13
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,253,230.47
T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	5,876,943.92
T 3% 02/28/17	4,600,000.00	4,829,730.48
T 3% 05/15/42	6,300,000.00	6,475,834.00
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,073,875.58
T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,175,625.00
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,100,889.65
T 4.0% 08/15/18	4,000,000.00	4,393,437.52
T 4.25% 05/15/39	1,750,000.00	2,208,383.78
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,475,191.41
T 4.25% 11/15/40	3,600,000.00	4,569,960.92
T 4.375% 02/15/38	1,900,000.00	2,437,083.98
T 4.375% 05/15/40	4,750,000.00	6,132,138.66
T 4.375% 05/15/41	3,350,000.00	4,350,223.63
T 4.375% 11/15/39	3,100,000.00	3,988,949.21
T 4.5% 02/15/16	2,420,000.00	2,539,865.62
T 4.5% 02/15/36	1,400,000.00	1,831,812.50
T 4.5% 05/15/17	3,500,000.00	3,808,779.31
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,305,839.84
T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,635,766.60
T 4.625% 02/15/17	5,500,000.00	5,965,459.00
T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,999,746.09
T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,638,487.29
T 4.75% 02/15/41	2,300,000.00	3,150,281.25
T 4.75% 08/15/17	3,000,000.00	3,302,343.75
T 4.875% 08/15/16	750,000.00	805,034.18
T 5.0% 05/15/37	1,150,000.00	1,608,517.58
T 5.125% 05/15/16	2,000,000.00	2,135,429.68
T 5.25% 02/15/29	1,600,000.00	2,137,500.00
T 5.25% 11/15/28	1,350,000.00	1,799,375.97
T 5.375% 02/15/31	1,900,000.00	2,625,748.05
T 5.5% 08/15/28	1,250,000.00	1,697,167.97
T 6.0% 02/15/26	1,350,000.00	1,843,831.05
T 6.125% 11/15/27	1,300,000.00	1,841,353.51
T 6.25% 05/15/30	1,500,000.00	2,227,060.54



	T 6.25% 08/15/23	3,600,000.00	4,794,257.80
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	645,319.33
	T 7.25% 05/15/16	1,670,000.00	1,832,890.23
	T 7.5% 11/15/16	3,250,000.00	3,679,609.37
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,624,613.27
	T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,215,689.44
	T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,482,593.75
	<b>アメリカドル 小計</b>	<b>844,990,000.00</b>	<b>879,561,295.99</b> <b>(105,072,392,418)</b>
<b>カナダドル</b>	CAN 1.25% 02/01/16	2,400,000.00	2,406,984.00
	CAN 1.25% 03/01/18	1,700,000.00	1,703,680.50
	CAN 1.25% 08/01/17	400,000.00	401,732.00
	CAN 1.25% 09/01/18	1,050,000.00	1,049,711.25
	CAN 1.5% 02/01/17	1,300,000.00	1,313,227.50
	CAN 1.5% 03/01/17	600,000.00	606,528.00
	CAN 1.5% 06/01/23	2,100,000.00	2,052,256.50
	CAN 1.5% 09/01/17	1,400,000.00	1,415,246.00
	CAN 1.75% 03/01/19	1,150,000.00	1,169,285.50
	CAN 1.75% 09/01/19	700,000.00	710,251.50
	CAN 1% 05/01/16	2,700,000.00	2,700,216.00
	CAN 1% 08/01/16	1,050,000.00	1,050,105.00
	CAN 1% 11/01/16	550,000.00	550,283.25
	CAN 2.25% 06/01/25	900,000.00	921,532.50
	CAN 2.5% 06/01/24	1,950,000.00	2,053,974.00
	CAN 2.75% 06/01/22	1,950,000.00	2,093,705.25
	CAN 2.75% 09/01/16	3,150,000.00	3,244,500.00
	CAN 2.75% 12/01/48	400,000.00	430,632.00
	CAN 2.75% 12/01/64	500,000.00	551,182.50
	CAN 2% 06/01/16	1,900,000.00	1,927,873.00
	CAN 3.25% 06/01/21	1,550,000.00	1,710,587.75
	CAN 3.5% 06/01/20	2,400,000.00	2,655,336.00
	CAN 3.5% 12/01/45	2,450,000.00	3,030,086.50
	CAN 3.75% 06/01/19	3,650,000.00	4,030,530.75
	CAN 3% 12/01/15	950,000.00	968,387.25
	CAN 4.0% 06/01/41	2,250,000.00	2,944,620.00
	CAN 4.25% 06/01/18	2,000,000.00	2,206,560.00
	CAN 4% 06/01/16	2,550,000.00	2,662,008.75
	CAN 4% 06/01/17	1,750,000.00	1,877,846.25
	CAN 5.75% 06/01/29	1,800,000.00	2,595,906.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,750,000.00	2,657,637.50
	CAN 5% 06/01/37	2,100,000.00	3,052,875.00
	CAN 8.0% 06/01/27	650,000.00	1,073,234.50

カナダドル 小計		53,700,000.00	59,818,522.50 (6,239,670,081)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	10,600,000.00	14,367,558.00
	MBONO 10% 12/05/24	21,500,000.00	27,856,152.50
	MBONO 4.75% 06/14/18	25,400,000.00	25,398,603.00
	MBONO 5% 06/15/17	17,950,000.00	18,340,412.50
	MBONO 6.25% 06/16/16	26,200,000.00	27,269,091.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,850,000.00	18,564,803.25
	MBONO 6.5% 06/10/21	17,700,000.00	18,520,660.50
	MBONO 7.25% 12/15/16	18,300,000.00	19,534,152.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	15,150,000.00	16,580,387.25
	MBONO 7.75% 05/29/31	21,000,000.00	23,201,535.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,750,000.00	17,337,915.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	1,000,000.00	1,104,605.00
	MBONO 7.75% 12/14/17	23,700,000.00	25,870,446.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	11,900,000.00	14,036,704.50
	MBONO 8.5% 11/18/38	18,400,000.00	21,847,332.00
	MBONO 8.5% 12/13/18	11,450,000.00	12,956,991.75
	MBONO 8% 06/11/20	11,600,000.00	13,047,912.00
	MBONO 8% 12/07/23	12,350,000.00	14,040,406.25
MBONO 8% 12/17/15	14,150,000.00	14,835,709.00	
メキシコペソ 小計		311,950,000.00	344,711,376.50 (2,857,657,311)
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,800,000.00	1,874,781.00
	BGB 2.25% 06/22/23	2,300,000.00	2,583,406.00
	BGB 2.6% 06/22/24	1,350,000.00	1,555,652.25
	BGB 2.75% 03/28/16	690,000.00	714,591.60
	BGB 3.25% 09/28/16	2,800,000.00	2,964,206.00
	BGB 3.5% 06/28/17	1,950,000.00	2,123,130.75
	BGB 3.75% 06/22/45	850,000.00	1,183,280.75
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,994,462.50
	BGB 3% 06/22/34	850,000.00	1,028,257.75
	BGB 3% 09/28/19	1,800,000.00	2,040,255.00
	BGB 4.0% 03/28/17	1,600,000.00	1,746,944.00
	BGB 4.0% 03/28/19	1,800,000.00	2,097,720.00
	BGB 4.25% 03/28/41	2,100,000.00	3,110,121.00
	BGB 4.25% 09/28/21	2,050,000.00	2,572,647.50
	BGB 4.25% 09/28/22	2,450,000.00	3,126,065.25
	BGB 4.5% 03/28/26	1,000,000.00	1,354,515.00
	BGB 4% 03/28/18	1,300,000.00	1,469,799.50
	BGB 4% 03/28/22	2,750,000.00	3,432,701.25
	BGB 4% 03/28/32	1,200,000.00	1,633,386.00
	BGB 5.5% 03/28/28	2,700,000.00	4,074,435.00

BGB 5.5% 09/28/17	950,000.00	1,095,943.75
BGB 5% 03/28/35	2,700,000.00	4,202,739.00
BKO 0% 12/16/16	400,000.00	400,302.00
BTNS 1.75% 02/25/17	3,150,000.00	3,271,716.00
BTNS 1% 07/25/17	2,800,000.00	2,872,604.00
BTNS 2.25% 02/25/16	4,690,000.00	4,817,333.50
BTNS 2.5% 07/25/16	5,600,000.00	5,826,912.00
BTPS 1.5% 08/01/19	850,000.00	867,705.50
BTPS 1.5% 12/15/16	100,000.00	101,866.50
BTPS 2.25% 05/15/16	750,000.00	768,723.75
BTPS 2.5% 05/01/19	1,000,000.00	1,064,745.00
BTPS 3.5% 03/01/30	1,300,000.00	1,429,616.50
BTPS 3.5% 06/01/18	1,050,000.00	1,144,830.75
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	3,132,116.00
BTPS 3.5% 12/01/18	1,600,000.00	1,761,032.00
BTPS 3.75% 03/01/21	4,240,000.00	4,851,768.40
BTPS 3.75% 04/15/16	5,330,000.00	5,562,974.30
BTPS 3.75% 05/01/21	1,000,000.00	1,142,580.00
BTPS 3.75% 08/01/16	4,350,000.00	4,580,093.25
BTPS 3.75% 08/01/21	4,800,000.00	5,492,664.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,750,000.00	3,175,782.50
BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000.00	6,751,435.25
BTPS 4.25% 03/01/20	4,200,000.00	4,868,514.00
BTPS 4.25% 09/01/19	3,150,000.00	3,616,908.75
BTPS 4.5% 02/01/18	4,400,000.00	4,906,990.00
BTPS 4.5% 02/01/20	2,600,000.00	3,041,610.00
BTPS 4.5% 03/01/19	4,650,000.00	5,336,921.25
BTPS 4.5% 03/01/24	2,900,000.00	3,537,347.50
BTPS 4.5% 03/01/26	3,600,000.00	4,400,352.00
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,483,052.25
BTPS 4.5% 08/01/18	6,950,000.00	7,850,754.75
BTPS 4.75% 05/01/17	2,160,000.00	2,370,837.60
BTPS 4.75% 06/01/17	5,600,000.00	6,161,456.00
BTPS 4.75% 08/01/23	3,850,000.00	4,755,346.75
BTPS 4.75% 09/01/21	3,550,000.00	4,299,937.50
BTPS 4.75% 09/01/28	2,600,000.00	3,247,257.00
BTPS 4.75% 09/01/44	2,000,000.00	2,530,100.00
BTPS 4.75% 09/15/16	3,400,000.00	3,650,886.00
BTPS 4% 02/01/17	5,650,000.00	6,061,348.25
BTPS 4% 02/01/37	3,750,000.00	4,252,200.00
BTPS 4% 09/01/20	3,850,000.00	4,440,031.75
BTPS 5.0% 08/01/39	2,850,000.00	3,715,801.50

BTPS 5.25% 08/01/17	1,750,000.00	1,959,623.75
BTPS 5.25% 11/01/29	3,950,000.00	5,181,847.00
BTPS 5.5% 09/01/22	3,200,000.00	4,088,064.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,350,000.00	4,285,789.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,400,000.00	3,376,332.00
BTPS 5% 03/01/22	3,900,000.00	4,822,818.00
BTPS 5% 03/01/25	4,950,000.00	6,270,585.75
BTPS 5% 08/01/34	3,150,000.00	4,083,219.00
BTPS 5% 09/01/40	3,300,000.00	4,287,756.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,850,000.00	4,106,422.50
BTPS 6% 05/01/31	4,450,000.00	6,364,924.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,550,000.00	2,338,787.25
BTPS 9% 11/01/23	2,700,000.00	4,285,089.00
DBR 1.5% 02/15/23	3,400,000.00	3,684,087.00
DBR 1.5% 05/15/23	4,050,000.00	4,387,992.75
DBR 1.5% 05/15/24	1,800,000.00	1,940,859.00
DBR 1.5% 09/04/22	2,550,000.00	2,762,236.50
DBR 1.75% 02/15/24	1,800,000.00	1,983,816.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,800,000.00	3,086,594.00
DBR 1% 08/15/24	1,800,000.00	1,853,055.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,750,000.00	3,077,140.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,206,863.75
DBR 2.5% 01/04/21	2,650,000.00	3,017,303.25
DBR 2.5% 07/04/44	2,300,000.00	2,840,051.50
DBR 2.5% 08/15/46	700,000.00	867,723.50
DBR 2% 01/04/22	3,750,000.00	4,188,112.50
DBR 2% 08/15/23	1,800,000.00	2,025,684.00
DBR 3.25% 01/04/20	2,050,000.00	2,377,518.25
DBR 3.25% 07/04/21	3,100,000.00	3,705,709.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,500,000.00	3,496,725.00
DBR 3.5% 01/04/16	5,600,000.00	5,811,456.00
DBR 3.5% 07/04/19	4,810,000.00	5,568,777.50
DBR 3.75% 01/04/17	1,000,000.00	1,078,160.00
DBR 3.75% 01/04/19	5,300,000.00	6,107,932.00
DBR 3% 07/04/20	3,920,000.00	4,538,968.00
DBR 4.0% 01/04/18	2,550,000.00	2,865,218.25
DBR 4.0% 01/04/37	3,300,000.00	4,920,003.00
DBR 4.25% 07/04/17	2,750,000.00	3,052,046.25
DBR 4.25% 07/04/18	2,300,000.00	2,649,749.50
DBR 4.25% 07/04/39	2,100,000.00	3,306,156.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,100,000.00	3,099,631.50
DBR 4.75% 07/04/34	3,200,000.00	5,085,456.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,300,000.00	3,906,837.50

DBR 4% 07/04/16	3,550,000.00	3,773,579.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,250,000.00	3,673,316.25	
DBR 5.625% 01/04/28	1,800,000.00	2,832,219.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,412,656.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,149,550.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,600,000.00	2,664,040.00	
DBR 6% 06/20/16	900,000.00	982,705.50	
FRTR 0.5% 11/25/19	600,000.00	607,218.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	2,500,000.00	2,712,725.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	3,150,000.00	3,384,029.25	
FRTR 1% 05/25/18	2,400,000.00	2,476,440.00	
FRTR 1% 05/25/19	3,100,000.00	3,211,104.00	
FRTR 1% 11/25/18	2,900,000.00	2,999,484.50	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,300,000.00	4,835,586.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,800,000.00	5,395,752.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	1,850,000.00	2,098,408.75	
FRTR 2.5% 10/25/20	3,600,000.00	4,050,054.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,850,000.00	5,670,256.25	
FRTR 3.25% 04/25/16	6,600,000.00	6,894,393.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,500,000.00	1,918,695.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,550,000.00	6,589,348.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,950,000.00	6,965,694.75	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,000,000.00	3,746,790.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,400,000.00	4,790,214.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,700,000.00	6,894,805.50	
FRTR 3.75% 10/25/19	5,350,000.00	6,262,603.00	
FRTR 3% 04/25/22	4,650,000.00	5,471,701.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	4,600,000.00	5,418,938.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,550,000.00	5,103,257.25	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,000,000.00	4,640,320.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,000,000.00	6,494,975.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	5,601,582.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,200,000.00	4,853,024.00	
FRTR 4% 04/25/18	5,000,000.00	5,665,625.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,300,000.00	3,509,639.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,500,000.00	2,316,870.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,550,000.00	4,998,630.75	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,550,000.00	6,979,063.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,250,000.00	6,985,045.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,410,000.00	5,916,538.30	
FRTR 6.0% 10/25/25	3,250,000.00	4,896,823.75	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,800,000.00	2,953,161.00	

FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,892,355.75
IRISH 2.4% 05/15/30	500,000.00	529,925.00
IRISH 3.4% 03/18/24	1,100,000.00	1,297,268.50
IRISH 3.9% 03/20/23	900,000.00	1,095,583.50
IRISH 4.4% 06/18/19	850,000.00	1,001,478.50
IRISH 4.5% 04/18/20	1,600,000.00	1,932,528.00
IRISH 4.5% 10/18/18	1,650,000.00	1,913,059.50
IRISH 4.6% 04/18/16	1,050,000.00	1,114,874.25
IRISH 5.4% 03/13/25	1,750,000.00	2,395,802.50
IRISH 5.5% 10/18/17	950,000.00	1,092,063.00
IRISH 5.9% 10/18/19	1,100,000.00	1,389,921.50
IRISH 5% 10/18/20	1,250,000.00	1,569,212.50
NETHER 0.5% 04/15/17	1,850,000.00	1,871,228.75
NETHER 0% 04/15/16	1,750,000.00	1,750,148.75
NETHER 1.25% 01/15/18	1,900,000.00	1,971,392.50
NETHER 1.25% 01/15/19	1,700,000.00	1,780,265.50
NETHER 1.75% 07/15/23	2,300,000.00	2,505,413.00
NETHER 2.25% 07/15/22	1,400,000.00	1,579,396.00
NETHER 2.5% 01/15/17	2,050,000.00	2,157,348.25
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,832,061.25
NETHER 2.75% 01/15/47	500,000.00	643,410.00
NETHER 2% 07/15/24	1,600,000.00	1,774,528.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,850,000.00	3,379,800.75
NETHER 3.5% 07/15/20	2,150,000.00	2,536,645.25
NETHER 3.75% 01/15/23	2,470,000.00	3,086,018.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,350,000.00	3,515,635.25
NETHER 4.0% 07/15/18	2,950,000.00	3,367,852.75
NETHER 4.5% 07/15/17	2,200,000.00	2,455,937.00
NETHER 4% 01/15/37	2,000,000.00	2,967,090.00
NETHER 4% 07/15/16	2,650,000.00	2,818,858.00
NETHER 4% 07/15/19	2,200,000.00	2,588,223.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,900,000.00	2,917,450.00
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,084,030.50
OBL 0.25% 04/13/18	3,750,000.00	3,782,287.50
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,100,477.50
OBL 0.5% 04/07/17	3,950,000.00	3,997,874.00
OBL 0.5% 04/12/19	450,000.00	458,736.75
OBL 0.5% 10/13/17	2,800,000.00	2,841,860.00
OBL 0.75% 02/24/17	3,800,000.00	3,865,075.00
OBL 1.25% 10/14/16	2,200,000.00	2,252,118.00
OBL 1% 02/22/19	1,500,000.00	1,560,525.00
OBL 1% 10/12/18	2,750,000.00	2,854,940.00
OBL 2.75% 04/08/16	5,050,000.00	5,236,117.75

OBL 2% 02/26/16	3,150,000.00	3,227,663.25
RAGB 1.15% 10/19/18	800,000.00	833,752.00
RAGB 1.65% 10/21/24	400,000.00	431,230.00
RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	765,222.50
RAGB 1.95% 06/18/19	1,150,000.00	1,244,288.50
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	581,142.50
RAGB 3.15% 06/20/44	900,000.00	1,217,425.50
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,123,941.00
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,831,747.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,100,000.00	2,538,154.50
RAGB 3.65% 04/20/22	1,700,000.00	2,089,470.00
RAGB 3.8% 01/26/62	550,000.00	925,630.75
RAGB 3.9% 07/15/20	2,050,000.00	2,465,012.25
RAGB 4.15% 03/15/37	1,750,000.00	2,622,926.25
RAGB 4.3% 09/15/17	1,350,000.00	1,510,474.50
RAGB 4.35% 03/15/19	2,200,000.00	2,598,442.00
RAGB 4.65% 01/15/18	1,700,000.00	1,944,434.50
RAGB 4.85% 03/15/26	1,200,000.00	1,701,594.00
RAGB 4% 09/15/16	1,800,000.00	1,927,206.00
RAGB 6.25% 07/15/27	1,200,000.00	1,938,906.00
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	572,066.00
RFGB 1.5% 04/15/23	800,000.00	856,864.00
RFGB 1.625% 09/15/22	650,000.00	702,471.25
RFGB 1.75% 04/15/16	850,000.00	870,157.75
RFGB 1.875% 04/15/17	900,000.00	939,622.50
RFGB 2.625% 07/04/42	500,000.00	619,395.00
RFGB 2.75% 07/04/28	700,000.00	836,720.50
RFGB 2% 04/15/24	750,000.00	832,676.25
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,458,793.75
RFGB 3.5% 04/15/21	900,000.00	1,076,040.00
RFGB 3.875% 09/15/17	750,000.00	830,122.50
RFGB 4.375% 07/04/19	950,000.00	1,132,917.75
RFGB 4% 07/04/25	950,000.00	1,244,129.50
SPGB 1.4% 01/31/20	1,050,000.00	1,070,889.75
SPGB 2.1% 04/30/17	2,300,000.00	2,383,662.50
SPGB 2.75% 04/30/19	2,700,000.00	2,919,496.50
SPGB 2.75% 10/31/24	1,300,000.00	1,408,771.00
SPGB 3.15% 01/31/16	3,600,000.00	3,712,050.00
SPGB 3.25% 04/30/16	1,750,000.00	1,817,873.75
SPGB 3.3% 07/30/16	2,300,000.00	2,406,168.00
SPGB 3.75% 10/31/18	1,750,000.00	1,949,150.00
SPGB 3.8% 01/31/17	4,440,000.00	4,750,489.20

	SPGB 3.8% 04/30/24	3,700,000.00	4,358,526.00
	SPGB 4.1% 07/30/18	4,500,000.00	5,040,202.50
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,400,000.00	2,917,056.00
	SPGB 4.25% 10/31/16	4,050,000.00	4,336,922.25
	SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,786,376.00
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,750,000.00	3,374,181.25
	SPGB 4.5% 01/31/18	2,450,000.00	2,738,720.25
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,300,000.00	3,855,208.50
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,650,000.00	3,331,619.75
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,650,000.00	2,139,555.00
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,400,000.00	1,768,949.00
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,800,000.00	4,605,733.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,050,000.00	2,744,089.00
	SPGB 4% 04/30/20	3,850,000.00	4,444,459.25
	SPGB 5.15% 10/31/28	950,000.00	1,250,181.00
	SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,313,522.25
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,550,000.00	3,301,051.50
	SPGB 5.5% 04/30/21	2,800,000.00	3,534,734.00
	SPGB 5.5% 07/30/17	2,750,000.00	3,100,790.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,500,000.00	3,610,375.00
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,868,379.60
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,550,000.00	3,523,998.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	3,120,000.00	4,444,986.00
	<b>ユーロ 小計</b>	<b>644,540,000.00</b>	<b>770,319,098.50</b> <b>(113,922,491,477)</b>
<b>イギリスポンド</b>	UKT 1.25% 07/22/18	4,550,000.00	4,577,959.75
	UKT 1.75% 01/22/17	2,900,000.00	2,969,353.50
	UKT 1.75% 07/22/19	3,350,000.00	3,418,959.75
	UKT 1.75% 09/07/22	3,550,000.00	3,567,288.50
	UKT 1% 09/07/17	3,650,000.00	3,669,691.75
	UKT 2.25% 09/07/23	3,750,000.00	3,888,806.25
	UKT 2.75% 09/07/24	2,350,000.00	2,528,776.25
	UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,153,196.00
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,257,874.50
	UKT 3.5% 01/22/45	500,000.00	588,222.50
	UKT 3.5% 07/22/68	1,750,000.00	2,195,357.50
	UKT 3.75% 07/22/52	2,400,000.00	3,043,812.00
	UKT 3.75% 09/07/19	1,500,000.00	1,670,940.00
	UKT 3.75% 09/07/20	3,750,000.00	4,228,293.75
	UKT 3.75% 09/07/21	3,500,000.00	3,993,482.50
	UKT 4.25% 03/07/36	3,150,000.00	4,049,167.50
	UKT 4.25% 06/07/32	3,100,000.00	3,933,915.50
	UKT 4.25% 09/07/39	2,000,000.00	2,615,090.00



	UKT 4.25% 12/07/27	1,850,000.00	2,300,049.50
	UKT 4.25% 12/07/40	2,450,000.00	3,213,616.00
	UKT 4.25% 12/07/46	3,050,000.00	4,127,214.25
	UKT 4.25% 12/07/49	1,900,000.00	2,615,806.00
	UKT 4.25% 12/07/55	2,400,000.00	3,404,532.00
	UKT 4.5% 03/07/19	4,500,000.00	5,121,967.50
	UKT 4.5% 09/07/34	2,830,000.00	3,731,708.75
	UKT 4.5% 12/07/42	3,550,000.00	4,889,486.00
	UKT 4.75% 03/07/20	3,450,000.00	4,041,088.50
	UKT 4.75% 12/07/30	2,620,000.00	3,482,163.40
	UKT 4.75% 12/07/38	2,250,000.00	3,142,406.25
	UKT 4% 01/22/60	2,000,000.00	2,743,360.00
	UKT 4% 03/07/22	2,600,000.00	3,028,246.00
	UKT 4% 09/07/16	4,000,000.00	4,241,900.00
	UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,316,920.25
	UKT 5% 03/07/25	2,950,000.00	3,806,149.00
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,983,163.50
	UKT 8.75% 08/25/17	1,070,000.00	1,301,082.55
	UKT 8% 06/07/21	1,300,000.00	1,822,561.00
	UKT 8% 12/07/15	650,000.00	699,065.25
	イギリスポンド 小計	100,570,000.00	119,362,673.20 (22,343,498,796)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	750,000.00	842,955.00
	SWISS 2.5% 03/12/16	600,000.00	619,866.00
	SWISS 2% 04/28/21	500,000.00	561,190.00
	SWISS 3% 01/08/18	1,150,000.00	1,259,497.25
	SWISS 3% 05/12/19	900,000.00	1,020,105.00
	SWISS 4.25% 06/05/17	1,050,000.00	1,165,032.75
	SWISS 4% 02/11/23	550,000.00	720,082.00
	SWISS 4% 04/08/28	820,000.00	1,187,700.30
	スイスフラン 小計	6,320,000.00	7,376,428.30 (907,669,502)
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,300,000.00	9,783,507.00
	SGB 2.5% 05/12/25	6,300,000.00	7,213,909.50
	SGB 3.5% 03/30/39	6,750,000.00	9,171,731.25
	SGB 3.5% 06/01/22	10,500,000.00	12,638,272.50
	SGB 3.75% 08/12/17	9,750,000.00	10,720,320.00
	SGB 3% 07/12/16	8,000,000.00	8,381,800.00
	SGB 4.25% 03/12/19	13,600,000.00	15,939,268.00
	SGB 5% 12/01/20	8,400,000.00	10,626,084.00
	スウェーデンクローナ 小計	72,600,000.00	84,474,892.25 (1,340,616,540)

ノルウェークローネ	NGB 2% 05/24/23	7,350,000.00	7,527,576.00
	NGB 3.75% 05/25/21	9,200,000.00	10,461,504.00
	NGB 3% 03/14/24	6,000,000.00	6,621,780.00
	NGB 4.25% 05/19/17	9,450,000.00	10,151,331.75
	NGB 4.5% 05/22/19	8,750,000.00	9,959,818.75
ノルウェークローネ 小計		40,750,000.00	44,722,010.50 (750,882,556)
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,750,000.00	10,446,296.25
	DGB 1.75% 11/15/25	3,950,000.00	4,272,458.25
	DGB 2.5% 11/15/16	7,050,000.00	7,389,633.75
	DGB 3% 11/15/21	14,050,000.00	16,528,068.75
	DGB 4.5% 11/15/39	18,000,000.00	29,168,820.00
	DGB 4% 11/15/17	8,200,000.00	9,150,872.00
	DGB 4% 11/15/19	14,300,000.00	16,990,187.50
	DGB 7% 11/10/24	4,100,000.00	6,609,815.00
デンマーククローネ 小計		79,400,000.00	100,556,151.50 (1,999,056,291)
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/16	3,400,000.00	3,329,722.00
	POLGB 0% 07/25/16	1,350,000.00	1,309,304.25
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,800,000.00	3,850,749.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,550,000.00	2,663,704.50
	POLGB 3.25% 07/25/25	900,000.00	953,739.00
	POLGB 3.75% 04/25/18	2,950,000.00	3,108,783.75
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,650,000.00	2,820,116.75
	POLGB 4.75% 10/25/16	3,150,000.00	3,313,280.25
	POLGB 4% 10/25/23	4,150,000.00	4,646,879.50
	POLGB 5.25% 10/25/17	3,550,000.00	3,871,150.75
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,950,000.00	3,424,109.25
	POLGB 5.5% 10/25/19	3,050,000.00	3,507,896.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,887,466.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,250,000.00	4,008,712.50
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,850,000.00	2,242,912.25
	POLGB 5% 04/25/16	3,750,000.00	3,906,337.50
ポーランドズロチ 小計		44,700,000.00	48,844,863.75 (1,740,342,495)
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	2,600,000.00	2,558,426.00
	ACGB 2.75% 10/21/19	300,000.00	304,149.00
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,100,000.00	2,140,834.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,100,000.00	1,098,410.50
	ACGB 3.25% 10/21/18	1,400,000.00	1,447,096.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,000,000.00	1,027,895.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,750,000.00	1,945,028.75
	ACGB 4.25% 07/21/17	2,850,000.00	2,992,001.25

	ACGB 4.5% 04/15/20	2,900,000.00	3,186,665.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,200,000.00	1,377,504.00
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,950,000.00	2,271,798.75
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,750,000.00	2,849,247.50
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,100,000.00	3,460,158.00
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,550,000.00	3,890,924.25
	ACGB 5.5% 04/21/23	3,050,000.00	3,643,621.50
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,300,000.00	3,903,735.00
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,800,000.00	3,364,942.00
	ACGB 6% 02/15/17	3,100,000.00	3,342,869.50
	オーストラリアドル 小計	40,800,000.00	44,805,306.50 (4,441,550,033)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	700,000.00	689,101.00
	SIGB 1.125% 04/01/16	1,000,000.00	1,006,860.00
	SIGB 2.25% 06/01/21	820,000.00	838,245.00
	SIGB 2.375% 04/01/17	700,000.00	727,695.50
	SIGB 2.5% 06/01/19	850,000.00	891,246.25
	SIGB 2.75% 04/01/42	450,000.00	442,638.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	550,000.00	574,604.25
	SIGB 2.875% 07/01/29	300,000.00	311,649.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	362,440.75
	SIGB 3.125% 09/01/22	850,000.00	913,826.50
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	649,557.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	450,000.00	493,146.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	750,000.00	837,075.00
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,030,000.00	1,085,820.85
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	852,324.00
	SIGB 4% 09/01/18	700,000.00	772,905.00
	シンガポールドル 小計	10,900,000.00	11,449,134.10 (1,039,581,376)
マレーシアリングット	MGS 3.172% 07/15/16	950,000.00	943,967.50
	MGS 3.26% 03/01/18	1,200,000.00	1,178,796.00
	MGS 3.418% 08/15/22	1,950,000.00	1,859,617.50
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,528,336.00
	MGS 3.492% 03/31/20	3,000,000.00	2,935,065.00
	MGS 3.502% 05/31/27	1,300,000.00	1,203,650.50
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,475,100.00
	MGS 3.814% 02/15/17	1,600,000.00	1,604,624.00
	MGS 3.844% 04/15/33	850,000.00	797,703.75
	MGS 3.889% 07/31/20	1,050,000.00	1,045,406.25
	MGS 3.892% 03/15/27	640,000.00	624,809.60
	MGS 4.127% 04/15/32	850,000.00	826,161.75
	MGS 4.16% 07/15/21	2,900,000.00	2,916,457.50

	MGS 4.181% 07/15/24	900,000.00	902,650.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	3,800,000.00	3,844,156.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	5,350,000.00	5,410,428.25	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,570,770.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,600,000.00	1,628,520.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	950,000.00	973,526.75	
	MGS 4.935% 09/30/43	600,000.00	625,935.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,050,000.00	1,149,246.00	
	マレーシアリンギット 小計	38,140,000.00	38,044,927.85	(1,306,082,373)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,750,000.00	25,055,210.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	13,950,000.00	11,022,243.75	
	SAGB 6.5% 02/28/41	12,100,000.00	9,646,906.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	12,650,000.00	12,255,762.75	
	SAGB 7.25% 01/15/20	14,450,000.00	14,456,069.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,750,000.00	6,814,462.50	
	SAGB 7% 02/28/31	13,450,000.00	11,972,046.75	
	SAGB 8.25% 03/31/32	2,700,000.00	2,672,973.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	11,800,000.00	12,237,544.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	3,300,000.00	3,318,199.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	1,500,000.00	1,527,562.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	8,900,000.00	9,094,865.50	
	SAGB 8% 01/31/30	3,150,000.00	3,103,411.50	
	SAGB 8% 12/21/18	12,100,000.00	12,512,912.50	
	南アフリカランド 小計	137,550,000.00	135,690,169.75	(1,417,962,273)
	合計		265,379,453,522	(265,379,453,522)

(注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。

(注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。

(注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。

(注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 195銘柄	100.0%	39.6%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.4%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 255銘柄	100.0%	42.9%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	8.4%
スイスフラン	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%

ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	18銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券	16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	21銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

## Jリートマザーファンド(M)

### 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	305,384,136
投資証券	100,973,301,800
未収入金	1,598,639,106
未収配当金	577,234,791
未収利息	374
流動資産合計	103,454,560,207
資産合計	103,454,560,207
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	643,053,167
流動負債合計	643,053,167
負債合計	643,053,167
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	43,522,331,161
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	59,289,175,879
元本等合計	102,811,507,040
純資産合計	102,811,507,040
負債純資産合計	103,454,560,207

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として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>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,522,331,161口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	<p>1口当たり純資産額 2.3623円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (23,623円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26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そのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p>
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経営会議に報告します。</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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)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についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては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。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	54,939,603,187円
期中追加設定元本額	1,686,358,696円
期中一部解約元本額	13,103,630,722円
期末元本額	43,522,331,161円

区分	平成26年12月10日現在
期末元本額の内訳	
Jリートファンド	41,128,125,433円
3資産バランスオープン	859,102,735円
3資産バランスオープンアルファ	141,526,939円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	60,669,734円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	32,254,425円
Jリートアクティブファンド（1年決算型）	1,300,651,895円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26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		11,241,968,450
合計		11,241,968,450

(注)当計算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)」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	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	4,778	2,293,440,000	
	M I Dリート投資法人	2,201	663,601,500	
	森ヒルズリート投資法人	17,679	2,938,249,800	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	1,028	712,404,000	
	産業ファンド投資法人	1,860	2,018,100,000	
	大和ハウスリート投資法人	3,302	1,845,818,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	14,934	4,629,540,000	



ケネディクス・レジデンシャル投資法人	3,525	1,184,400,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,917	2,914,083,000	
G L P 投資法人	24,235	3,281,419,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,210	1,058,815,000	
日本プロロジスリート投資法人	17,765	4,501,651,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	20,217	3,208,437,900	
星野リゾート・リート投資法人	537	633,660,000	
イオンリート投資法人	12,310	2,013,916,000	
ヒューリックリート投資法人	9,839	1,729,696,200	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	7,121	783,310,000	
積水ハウス・リート投資法人	7,325	969,097,500	
日本ビルファンド投資法人	15,358	9,076,578,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	13,847	7,934,331,000	
日本リテールファンド投資法人	23,943	5,983,355,700	
オリックス不動産投資法人	21,789	3,756,423,600	
日本プライムリアルティ投資法人	6,962	3,018,027,000	
プレミア投資法人	2,710	1,428,170,000	
東急リアル・エステート投資法人	7,606	1,188,817,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,972	824,296,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人	2,328	1,194,264,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,514	4,984,632,000	
森トラスト総合リート投資法人	15,795	3,651,804,000	
フロンティア不動産投資法人	5,243	3,030,454,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	10,056	2,697,019,200	
福岡リート投資法人	4,850	1,067,970,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,227	1,505,452,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	8,526	1,093,885,800	
大和証券オフィス投資法人	4,600	2,760,000,000	
阪急リート投資法人	6,562	950,833,800	
トップリート投資法人	1,739	855,588,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	3,262	1,816,934,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,595	2,815,564,500	
ジャパンエクセレント投資法人	12,057	1,959,262,500	
合計	389,324	100,973,301,800	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外リートマザーファンド

### 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	17,740,371
コール・ローン	6,494,197
投資証券	652,798,096
未収入金	2,907
未収配当金	800,879
未収利息	7
流動資産合計	677,836,457
資産合計	677,836,457
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,274,480
流動負債合計	2,274,480
負債合計	2,274,480
純資産の部	
元本等	
元本	582,563,897
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,998,080
元本等合計	675,561,977
純資産合計	675,561,977
負債純資産合計	677,836,457

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</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 投資証券は、原則として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) 為替予約取引による為替差損益 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26年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			582,563,897口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		1.1596円 (11,596円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成26年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そのリスク		<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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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経営会議に報告します。</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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>
------------------	--

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</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についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては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。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

期首	平成26年 6月11日
期首元本額	749,206,399円
期中追加設定元本額	712,453円
期中一部解約元本額	167,354,955円
期末元本額	582,563,897円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	390,747,454円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	125,206,677円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	66,609,766円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26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		25,849,786
合計		25,849,786

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	369	11,863.35	
		AGREE REALTY CORP	86	2,680.62	
		ALEXANDER'S INC	20	8,199.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	394	35,534.86	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	216	8,670.24	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	582	23,518.62	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	767	12,946.96	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	5,044	46,556.12	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	210	3,660.30	
		AMREIT INC	90	2,405.70	
		APARTMENT INVEST & MGMT	812	30,490.60	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	190	1,784.10	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	151	2,654.58	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	497	5,099.22	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	349	8,006.06	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	729	118,965.51	
		AVIV REIT INC	150	5,127.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	1,079	23,684.05	
		BOSTON PROPERTIES	852	113,452.32	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	978	15,295.92	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	759	18,474.06	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	475	35,482.50	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	469	3,667.58	
		CARETRUST REIT INC	150	2,670.00	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	946	18,286.18	
		CEDAR REALTY TRUST INC	363	2,504.70	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	1,434	11,744.46	
		CHATHAM LODGING TRUST	200	5,800.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	325	11,391.25	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	694	17,794.16	
		CORESITE REALTY CORP	131	5,050.05	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	500	14,320.00	
		CORRECTIONS CORP OF AMERICA	638	23,625.14	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,143	13,167.36	
CUBESMART	895	19,287.25			
CYRUSONE INC	180	4,824.00			
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	517	17,836.50			
DDR CORPORATION	1,658	30,540.36			

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,074	16,410.72	
DIGITAL REALTY TRUST INC	753	52,160.31	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	754	21,164.78	
DUKE REALTY CORP	1,895	36,990.40	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	362	12,289.90	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	191	12,541.06	
EDUCATION REALTY TRUST INC	258	9,223.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	531	9,074.79	
EPR PROPERTIES	315	17,766.00	
EQUITY COMMONWEALTH	716	18,737.72	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	435	21,997.95	
EQUITY ONE INC	474	11,835.78	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	2,019	145,832.37	
ESSEX PROPERTY TRUST	352	72,258.56	
EXCEL TRUST INC	376	4,921.84	
EXTRA SPACE STORAGE INC	607	36,383.58	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	376	50,041.84	
FELCOR LODGING TRUST INC	662	6,984.10	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	669	13,480.35	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	310	3,844.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	540	6,615.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	499	14,835.27	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	3,478	95,436.32	
GEO GROUP INC/THE	404	16,172.12	
GETTY REALTY CORP	204	3,712.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	144	2,561.76	
GLIMCHER REALTY TRUST	827	11,354.71	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	409	9,456.08	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	660	3,808.20	
HCP INC	2,557	115,141.71	
HEALTH CARE REIT INC	1,806	136,443.30	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	530	14,278.20	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	1,328	17,157.76	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,242	9,153.54	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	502	22,253.66	
HOME PROPERTIES INC	317	20,706.44	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	832	26,024.96	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4,201	99,689.73	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	305	8,909.05	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	120	1,132.80	
INLAND REAL ESTATE CORP	533	5,836.35	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	694	5,760.20	

IRON MOUNTAIN INC	1,033	38,427.60
KILROY REALTY CORPORATION	462	32,173.68
KIMCO REALTY CORP	2,283	58,056.69
KITE REALTY GROUP TRUST	450	12,541.50
LASALLE HOTEL PROPERTIES	569	22,731.55
LEXINGTON CORP PROPERTIES	1,156	13,039.68
LIBERTY PROPERTY TRUST	823	29,570.39
LTC PROPERTIES INC	217	9,192.12
MACERICH CO/THE	782	63,560.96
MACK-CALI REALTY CORP	506	9,684.84
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	963	13,154.58
MID-AMERICA APARTMENT COMM	418	30,702.10
MONMOUTH REIT -CL A	286	3,266.12
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	695	26,500.35
NATL HEALTH INVESTORS INC	163	10,842.76
NEW YORK REIT INC	1,000	10,880.00
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	707	27,198.29
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	82	1,967.18
PARKWAY PROPERTIES INC	461	8,583.82
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	401	17,708.16
PENN REAL ESTATE INVEST TST	435	10,309.50
PHYSICIANS REALTY TRUST	290	4,544.30
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	857	16,120.17
POST PROPERTIES	302	17,733.44
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	110	959.20
PROLOGIS INC	2,786	119,658.70
PS BUSINESS PARKS INC	118	9,665.38
PUBLIC STORAGE	808	150,215.28
QTS REALTY TRUST INC	72	2,349.36
RAMCO-GERSHENSON PRYS	462	8,376.06
REALTY INCOME CORP	1,227	55,889.85
REGENCY CENTERS CORP	513	32,380.56
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	558	9,346.50
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	1,314	21,628.44
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	250	3,832.50
RLJ LODGING TRUST	734	24,633.04
ROUSE PROPERTIES INC	200	3,562.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	283	14,990.51
SABRA HEALTH CARE REIT INC	296	8,252.48
SAUL CENTERS INC	68	3,788.96
SELECT INCOME REIT	200	4,868.00
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,132	25,798.28



	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	233	3,835.18
	SIMON PROPERTY GROUP	1,737	316,533.51
	SL GREEN REALTY CORP	529	64,686.12
	SOVRAN SELF STORAGE INC	181	15,707.18
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,216	25,439.68
	STAG INDUSTRIAL INC	348	8,355.48
	STARWOOD WAYPOINT RESIDE	240	6,345.60
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	1,374	17,944.44
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	518	6,236.72
	SUN COMMUNITIES INC	253	15,169.88
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,141	18,986.24
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	533	19,763.64
	TAUBMAN CENTERS INC	352	28,064.96
	TERRENO REALTY CORP	204	4,020.84
	TRADE STREET RESIDENTIAL INC	90	693.90
	UDR INC	1,398	43,477.80
	UMH PROPERTIES INC	200	1,880.00
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	90	4,421.70
	URSTADT BIDDLE - CL A	194	4,363.06
	VENTAS INC	1,641	118,775.58
	VORNADO REALTY TRUST	971	110,927.04
	WASHINGTON PRIME GROUP	862	14,576.42
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	415	11,412.50
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	625	21,918.75
	WHITESTONE REIT	136	2,025.04
	WINTHROP REALTY TRUST	149	2,661.14
	WP CAREY INC	510	35,598.00
	アメリカドル 小計	103,915	3,869,946.27 (462,303,781)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	205	7,572.70
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	384	5,637.12
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	135	8,349.75
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	103	2,761.43
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	349	9,402.06
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	329	8,057.21
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	204	9,402.36
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	490	5,747.70
	CHOICE PROPERTIES REIT	271	2,875.31
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	369	6,715.80
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	350	4,375.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	120	1,430.40

	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	328	2,686.32
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	270	2,268.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	282	7,075.38
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	139	5,611.43
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	721	15,263.57
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	91	509.60
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	301	1,775.90
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	180	2,181.60
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	150	1,437.00
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	160	2,771.20
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	75	1,824.75
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	90	792.00
	PLAZA RETAIL REIT	400	1,600.00
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	660	2,917.20
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	283	1,109.36
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	825	21,326.25
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>8,264</b>	<b>143,476.40</b> <b>(14,966,023)</b>
<b>ユーロ</b>	AEDIFICA	47	2,550.69
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	416	4,338.88
	ALTAREA	14	1,897.00
	ANF IMMOBILIER	57	1,203.84
	AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	230	2,334.50
	BEFIMMO S.C.A.	105	6,478.50
	BENI STABILI SPA	5,310	3,095.73
	BGP HOLDINGS PLC	900,544	-
	COFINIMMO	96	9,023.04
	CORIO NV	560	22,254.40
	EUROCOMMERCIAL	238	8,332.38
	FONCIERE DES REGIONS	248	18,773.60
	GECINA SA	196	20,883.80
	GREEN REIT PLC	4,089	5,479.26
	HAMBORNER REIT AG	230	1,863.00
	HIBERNIA REIT PLC	3,100	3,410.00
	ICADE	201	13,255.95
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	584	362.37
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	800	850.40
	KLEPIERRE	553	19,449.01
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	250	2,262.50

	MERCIALYS	343	6,127.69
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	680	6,658.56
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	529	1,961.53
	UNIBAIL-RODAMCO SE	547	112,025.60
	VASTNED RETAIL	106	3,967.58
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	70	4,192.30
	WERELDHAVE NV	120	6,390.00
	ユーロ 小計	920,263	289,422.11 (42,802,635)
イギリスポンド	ASSURA GROUP LTD	5,000	2,562.50
	BIG YELLOW GROUP PLC	811	4,752.46
	BRITISH LAND CO PLC	5,685	43,063.87
	DERWENT LONDON PLC	566	16,646.06
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1,911	13,587.21
	HAMMERSON PLC	4,357	26,403.42
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	4,283	4,428.62
	INTU PROPERTIES PLC	5,246	17,720.98
	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,334	49,884.34
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	3,670	5,541.70
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	600	1,326.00
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	410	1,884.97
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	511	1,857.48
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	4,700	2,397.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,150	2,708.25
	SEGRO PLC	4,122	15,663.60
	SHAFTESBURY PLC	1,544	12,020.04
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,000	2,125.00	
WORKSPACE GROUP PLC	638	4,485.14	
	イギリスポンド 小計	51,538	229,058.64 (42,877,486)
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	1,200	1,188.00
	360 CAPITAL OFFICE FUND	500	1,030.00
	ABACUS PROPERTY GROUP	1,256	3,592.16
	ALE PROPERTY GROUP	1,182	3,794.22
	ARENA REIT	1,000	1,480.00
	ASPEN GROUP	1,618	2,103.40
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	165	780.45
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	900	2,070.00
	BWP TRUST	2,754	7,187.94
	CHARTER HALL GROUP	1,445	6,690.35
	CHARTER HALL RETAIL REIT	1,907	7,780.56
	CROMWELL PROPERTY GROUP	7,765	7,765.00
	DEXUS PROPERTY GROUP	4,980	34,710.60

	FEDERATION CENTRES	7,820	21,661.40
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	1,000	1,965.00
	GALILEO JAPAN TRUST	500	820.00
	GDI PROPERTY GROUP	2,400	2,100.00
	GOODMAN GROUP	8,507	47,979.48
	GPT GROUP	9,358	38,929.28
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	1,200	3,276.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	700	1,771.00
	INDUSTRIA REIT	1,000	1,980.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	6,200	2,697.00
	INVESTA OFFICE FUND	3,662	13,073.34
	MIRVAC GROUP	20,208	36,374.40
	NATIONAL STORAGE REIT	2,100	2,877.00
	NOVION PROPERTY GROUP	13,140	27,988.20
	SCENTRE GROUP	29,623	101,606.89
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	3,798	6,855.39
	STOCKLAND	12,755	52,678.15
	WESTFIELD CORP	10,669	92,393.54
	オーストラリアドル 小計	161,312	537,198.75 (53,252,512)
ニュージーランドドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	1,208	2,271.04
	GOODMAN PROPERTY TRUST	5,559	6,142.69
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	6,206	7,571.32
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	2,631	3,867.57
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	1,309	2,002.77
	ニュージーランドドル 小計	16,913	21,855.39 (2,008,291)
香港ドル	CHAMPION REIT	14,000	49,000.00
	FORTUNE REIT	7,000	53,550.00
	LINK REIT	13,000	631,800.00
	NEW CENTURY REIT	2,000	6,620.00
	PROSPERITY REIT	7,000	18,620.00
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	10,150.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	4,000	14,840.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,000	20,940.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	6,000	23,220.00
	香港ドル 小計	64,000	828,740.00 (12,770,883)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	3,000	4,320.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	4,000	2,760.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	11,000	25,410.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	6,000	7,590.00

	CACHE LOGISTICS TRUST	4,000	4,640.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	6,000	4,080.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	12,000	20,220.00	
	CAPITAMALL TRUST	14,000	27,790.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	3,000	4,755.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	4,000	6,960.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	4,000	3,300.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,000	5,040.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	3,000	5,685.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	3,000	4,320.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	2,000	1,770.00	
	KEPPEL REIT	9,000	10,845.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	8,000	2,720.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	8,000	11,480.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	10,000	9,600.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	7,000	10,395.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	9,000	10,485.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	2,000	1,600.00	
	OUE HOSPITALITY TRUST	4,000	3,680.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	2,000	4,800.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	3,000	2,865.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	2,000	1,580.00	
	SPH REIT	5,000	5,250.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	8,000	6,440.00	
	SUNTEC REIT	14,000	27,230.00	
	シンガポールドル 小計	174,000	237,610.00 (21,574,988)	
	イスラエルシェケル REIT 1 LTD	828	7,957.08	
	イスラエルシェケル 小計	828	7,957.08 (241,497)	
	合計	1,501,033	652,798,096 (652,798,096)	

(注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。

(注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。

(注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。

(注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 149銘柄	100.0%	70.8%
カナダドル	投資証券 28銘柄	100.0%	2.3%

ユーロ	投資証券	28銘柄	100.0%	6.6%
イギリスポンド	投資証券	19銘柄	100.0%	6.6%
オーストラリアドル	投資証券	31銘柄	100.0%	8.2%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券	9銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券	29銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

## 【純資産額計算書】

（平成26年12月30日現在）

資産総額	821,129,784円
負債総額	1,171,710円
純資産総額（ - ）	819,958,074円
発行済口数	783,535,498口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0465円
（1万口当たり純資産額）	（10,465円）

（参考）

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

資産総額	248,739,899,302円
負債総額	251,911,793円
純資産総額（ - ）	248,487,987,509円
発行済口数	182,605,820,039口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3608円
（1万口当たり純資産額）	（13,608円）

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

資産総額	365,480,935,659円
負債総額	3,727,434,109円
純資産総額（ - ）	361,753,501,550円
発行済口数	278,766,940,881口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2977円
（1万口当たり純資産額）	（12,977円）

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

資産総額	248,481,496,369円
負債総額	619,997,717円
純資産総額（ - ）	247,861,498,652円
発行済口数	113,028,034,410口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1929円
（1万口当たり純資産額）	（21,929円）

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

資産総額	267,278,843,910円
負債総額	16,857,013円
純資産総額（ - ）	267,261,986,897円
発行済口数	106,463,741,696口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5104円
（1万口当たり純資産額）	（25,104円）

## Jリートマザーファンド（M）

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

資産総額	102,547,774,178円
負債総額	287,690,413円
純資産総額（ - ）	102,260,083,765円
発行済口数	42,169,961,224口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4250円
（1万口当たり純資産額）	（24,250円）

## 海外リートマザーファンド

## 純資産額計算書



（平成26年12月30日現在）

資産総額	689,883,142円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	689,883,142円
発行済口数	576,816,855口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1960円
（1万口当たり純資産額）	（11,960円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（平成26年12月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手續を経ずに取締役会を開催することができます。

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

###### [ DO（実行） ]

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

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

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

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

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

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

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

委託会社の機構は平成27年 3月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年12月30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	396	5,990,397
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	8	52,515
単位型公社債投資信託	0	0
合計	404	6,042,912

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「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いません。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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、第29期事業年度の中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		8,192,444		10,457,599
前払費用		81,751		114,325
未収委託者報酬		2,210,605		2,735,763
未収運用受託報酬		31,051		15,268
未収入金		676		-
繰延税金資産		61,743		144,183
その他		19,263		3,448
流動資産合計		10,597,535		13,470,589
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	79,281	1	67,359
器具備品	1	103,209	1	87,378
有形固定資産合計		182,491		154,737
無形固定資産				
ソフトウェア		168,561		203,360
その他		1,770		4,686
無形固定資産合計		170,332		208,046
投資その他の資産				
投資有価証券		47,112		69,583
長期前払費用		-		34,773
長期貸付金		31,838		28,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		-		117,743
その他		633		553
貸倒引当金		31,838		28,838
投資その他の資産合計		72,746		247,653
固定資産合計		425,570		610,437
資産合計		11,023,105		14,081,027

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				

預り金	19,992	13,353
未払金	1,459,757	1,723,999
未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469
未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
固定負債		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

	前事業年度 ( 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日 )	当事業年度 ( 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	19,128,296	22,773,831
運用受託報酬	94,659	55,511
営業収益合計	19,222,955	22,829,342
営業費用		

支払手数料	9,030,246		10,451,296
広告宣伝費	73,287		76,961
公告費	2,244		-
調査費	4,132,154		5,091,105
調査費	207,030		259,236
委託調査費	3,922,394		4,830,390
図書費	2,729		1,479
営業雑経費	1,294,879		1,264,334
通信費	21,905		17,246
印刷費	330,735		327,214
協会費	21,939		22,524
諸会費	757		773
情報機器関連費	874,151		837,859
その他営業雑経費	45,391		58,716
営業費用合計	14,532,812		16,883,698
一般管理費			
給料	2,259,238		2,201,964
役員報酬	78,205		102,330
給料・手当	1,967,177		1,846,450
賞与	213,855		253,183
退職給付費用	64,787		72,029
役員退職慰労金	-		1,070
福利費	190,716		207,122
交際費	879		2,758
旅費交通費	45,160		45,973
租税公課	25,420		42,862
不動産賃借料	129,096		130,938
寄付金	-		3,385
減価償却費	129,966		119,445
諸経費	1	257,947	1
一般管理費合計	3,103,213		3,047,165
営業利益	1,586,929		2,898,479

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1
支払補償費	-	23,222
		14,648

投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112
営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-
特別損失		
統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	-	-
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
合併による増加		350,000	350,000
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	350,000	350,000
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638



当期末残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
-------	--------	-----------	-----------	-----------	-----------

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			706,344
合併による増加			2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496
当期末残高	4,998	4,998	8,546,410

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			

剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

#### 時価のあるもの

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

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度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、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
建 物	23,594	千円	35,517	千円
器具備品	235,212	"	188,630	"
計	258,807	"	224,147	"

### (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24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
	諸経費	97,199	千円	73,276
長期前払費用償却	-	"	23,222	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

## 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26年6月30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とおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30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25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
(2) 未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-

(3) 投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4) 未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（平成26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	10,457,599	10,457,599	-
(2) 未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	-
(4) 未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
(5) 未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

(\*) 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、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成26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	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	61,633	57,226	4,406
小計	61,633	57,226	4,406
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	7,950	8,138	188
小計	7,950	8,138	188
合計	69,583	65,365	4,218

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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
23,757	553	284

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
(1) 退職給付債務	268,531	313,992

(2) 退職給付引当金	268,531	313,992
-------------	---------	---------

(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。

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(1) 退職給付費用	64,787	72,029

(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。

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13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

### (税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	16,142	千円	102,368	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347	"	10,277	"
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285	"	33,736	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	"	111,906	"
減価償却超過額	1,067	"	-	"
その他	11,680	"	13,094	"
繰延税金資産 小計	171,228	"	271,384	"
評価性引当額	11,347	"	-	"
繰延税金資産 合計	159,881	"	271,384	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	"	1,503	"
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	"	7,953	"
繰延税金負債 合計	401,693	"	9,457	"
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	"	261,926	"

#### 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

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。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した法定実効税率は、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従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

### (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

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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）	2,429,898千円

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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）	3,172,592千円

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## （ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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	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	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	73,276	-	-

(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

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (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)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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25年4月1日 至 平成26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)
兄弟 会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上 の 取引 役員の 兼任	投信販売 代行手数料 等の支払	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用 の支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

(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。

(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25年3月31日）

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

当事業年度（平成26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、名古屋証券取引所に上場）

(企業結合等関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49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金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間末  
(平成26年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金	10,736,816
未収委託者報酬	3,496,458
繰延税金資産	85,943
その他流動資産	131,122
流動資産合計	14,450,340

## 固定資産

有形固定資産		
建物	1	62,410
器具備品	1	116,552
有形固定資産合計		178,963
無形固定資産		193,575
投資その他の資産		
投資有価証券		58,781
長期貸付金		27,338
会員権		25,000
その他の投資		20,550
繰延税金資産		122,025
貸倒引当金		27,338
投資その他の資産合計		226,357
固定資産合計		598,896
資産合計		15,049,237
負債の部		
流動負債		
未払金		2,137,961
未払費用		69,372
未払法人税等		681,263
賞与引当金		93,828
その他流動負債	2	185,306
流動負債合計		3,167,732
固定負債		
退職給付引当金		328,845
資産除去債務		12,599
固定負債合計		341,445
負債合計		3,509,177

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26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		65,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		8,721,600

利益剰余金合計	10,887,100
株主資本合計	11,537,100
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,959
評価・換算差額等合計	2,959
純資産合計	11,540,060
負債・純資産合計	15,049,237

## 中間損益計算書

(単位：千円)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		13,096,655
運用受託報酬		8,732
営業収益合計		13,105,387
営業費用		9,550,999
一般管理費	1	1,514,728
営業利益		2,039,658
営業外収益	2	9,123
営業外費用		24,340
経常利益		2,024,441
税引前中間純利益		2,024,441
法人税、住民税及び事業税		668,312
法人税等調整額		53,822
法人税等合計		722,134
中間純利益		1,302,307

## 中間株主資本等変動計算書

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,302,307	1,302,307	1,302,307
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,269,307	1,272,307	1,272,307
当中間期末残高	65,500	2,100,000	8,721,600	10,887,100	11,537,100

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,302,307
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	244	244	244
当中間期変動額合計	244	244	1,272,551
当中間期末残高	2,959	2,959	11,540,060

## 重要な会計方針

第29期中間会計期間 （自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）
<p>1．資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>    その他有価証券</p> <p>        時価のあるもの</p> <p>            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。</p> <p>            （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。）</p> <p>        時価のないもの</p> <p>            移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2．固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産</p> <p>    定率法によっております。</p>

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度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29期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 40,466千円
	器具備品 187,949千円
	計 228,416千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 22,111千円
	無形固定資産 36,655千円
2	営業外収益の主要項目

受取利息	3,339千円
------	---------

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

(リ-ス取引関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

平成26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、次表には含まれておりません(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	10,736,816	10,736,816	-
(2)未収委託者報酬	3,496,458	3,496,458	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,778	58,778	-
(4)未払金	(2,137,961)	(2,137,961)	-

(\*)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、並びに(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3千円）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29期中間会計期間末（平成26年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	56,226	51,514	4,711
小計	56,226	51,514	4,711
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,552	2,665	113
小計	2,552	2,665	113
合計	58,778	54,180	4,598

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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)	1,703,639千円
J-REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	1,456,865千円

(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29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,846,686円70銭
1株当たり中間純利益	434,102円38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29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益	1,302,307千円
普通株式に係る中間純利益	1,302,307千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

**（重要な後発事象）**

該当事項はありません。

**4【利害関係人との取引制限】**

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

**(1)自己又はその役員との取引**

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

**(2)運用財産相互間の取引**

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

**(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引**

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

**(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引**

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

**(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為**

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

**5【その他】****(1)定款の変更**

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

**(2)訴訟事件その他の重要事項**

平成27年 3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

**第2【その他の関係法人の概況】****1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1)受託会社**

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

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

## (2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年9月末日現在）	事業の内容
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562	
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社岩手銀行	12,089	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社四国銀行	25,000	
株式会社荘内銀行	7,000	
株式会社千葉興業銀行	57,941	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社北越銀行	24,538	
株式会社横浜銀行	215,628	
浜銀TT証券株式会社	3,307	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するた

め、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成26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 白川 芳樹 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 浩之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

平成27年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

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26年6月11日から平成26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26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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成26年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。