

## 【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28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】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【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28年 3月11日から平成28年 9月 9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－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						

(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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 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)\*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・インデックス(配当込み、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、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・インデックス(配当込み、円ベース)」

「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。

#### 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、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。

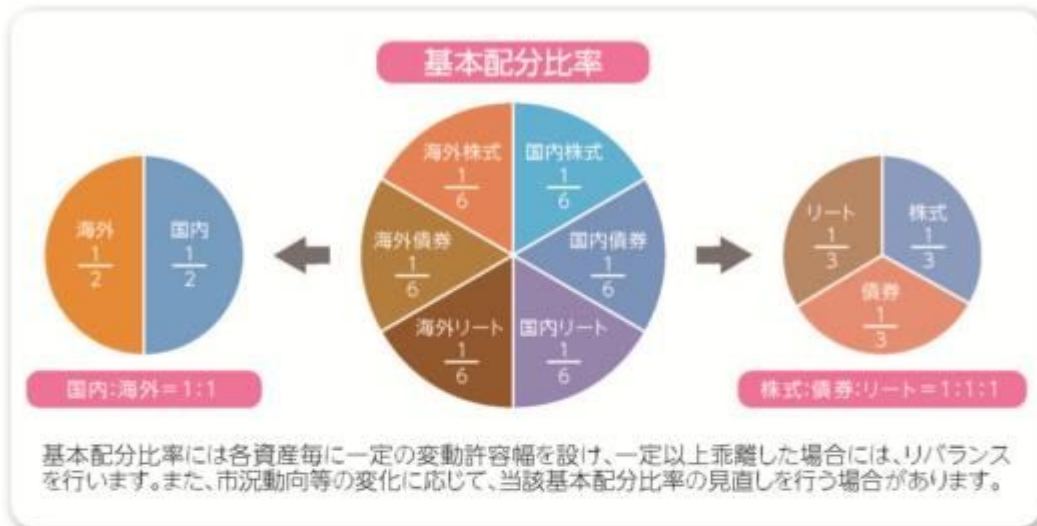
同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 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「SPDJI」)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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

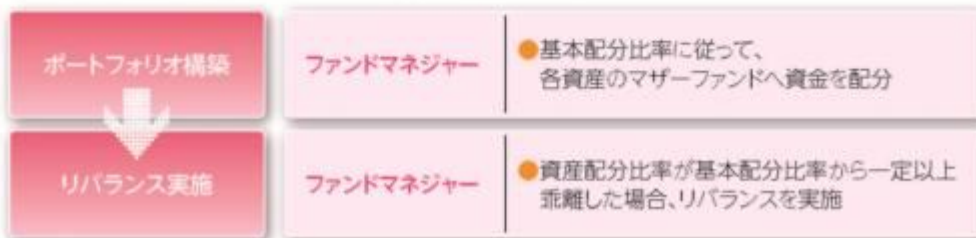
当インデックスはSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、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を負いません。

## 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、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

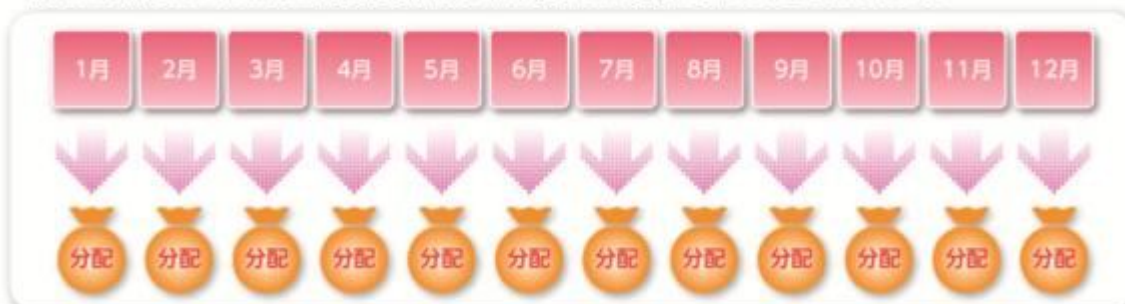
## ファンドのしくみ

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。

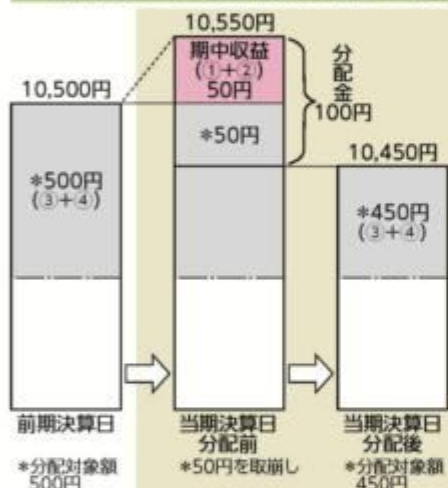
投資信託で分配金が支払われるイメージ



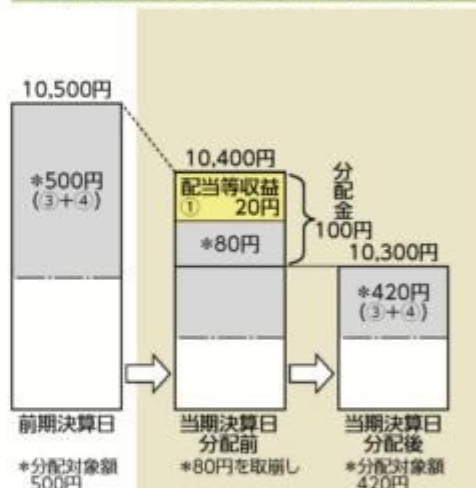
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(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)

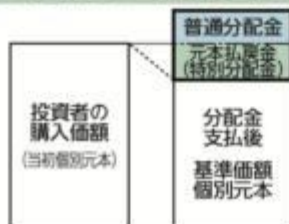


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

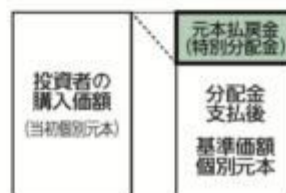
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

(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

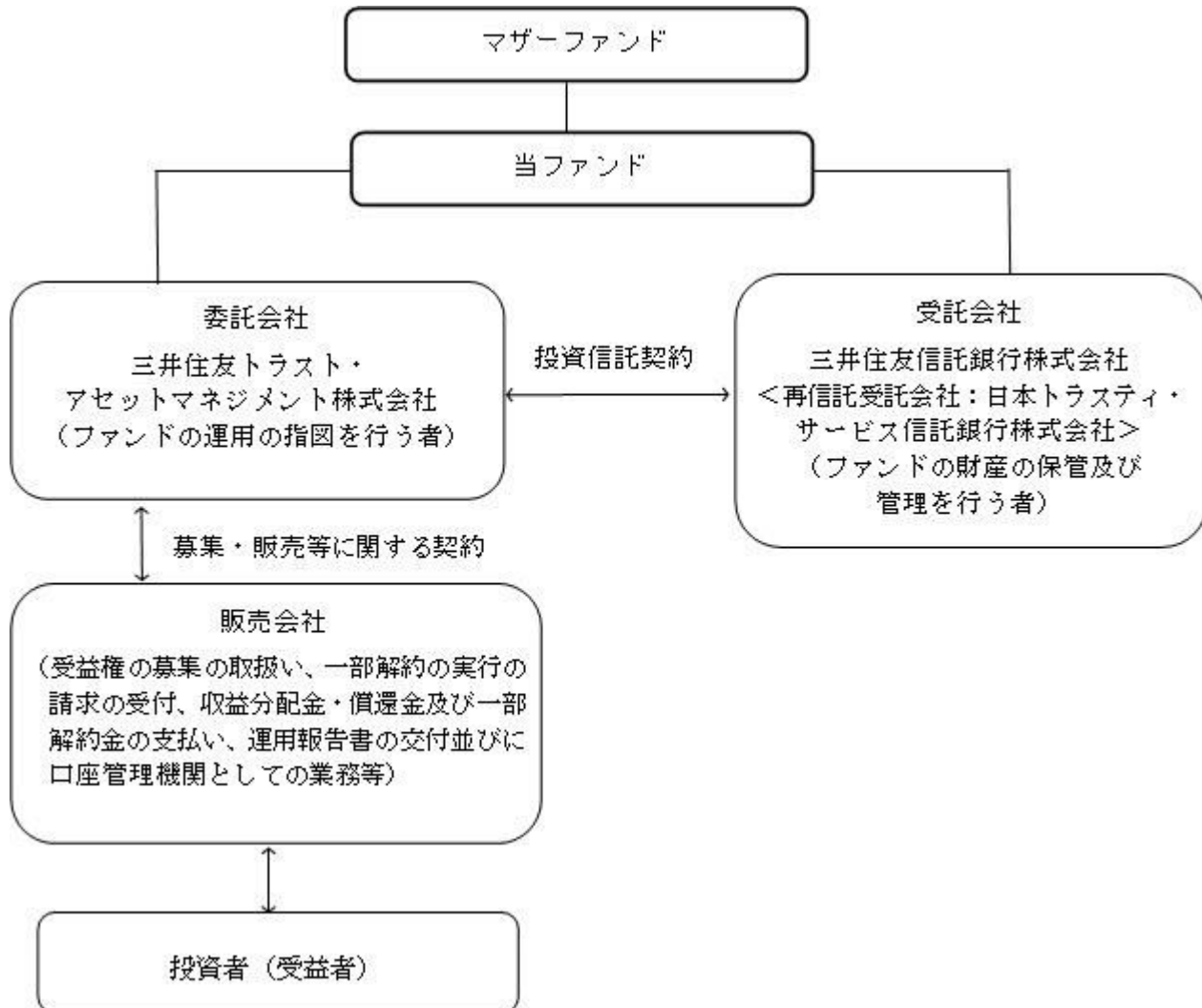
平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

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27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、T O P I X（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、）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・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（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。

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、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。

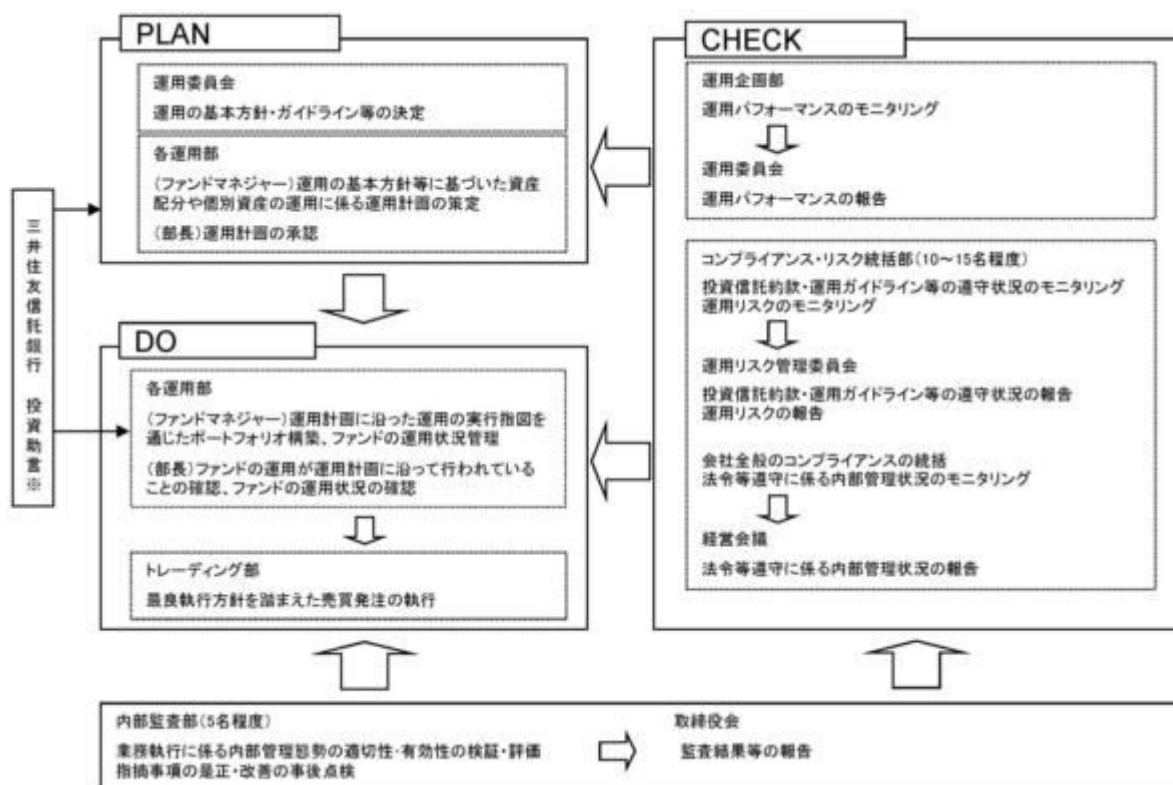
株式への直接投資は行いません。

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）【分配方針】

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

- ・ 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）で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）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、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権

証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### H．信用取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。

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。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

#### M．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 N．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### N．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### O．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### P．外国為替予約取引の指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

Q．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図

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

R．再投資の指図

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

S．資金の借入れ

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

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

ハ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

T．受託会社による資金の立替え

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

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

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

U．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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．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コンプライアンス・リスク統括部が、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

\*2011年1月～2015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… JPMオルガン・ガバナメント・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・レディバース・シフアイト(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、責任を有しません。

※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率国債の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、責任を有しません。

※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されています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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があります。）。

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ず（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益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」（\*）をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額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一定期間非課税となります。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。

\*平成28年4月1日より適用開始される、20歳未満の方を対象とした非課税制度です。

#### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じ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28年1月1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27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	579,128,144	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		40,760	0.01
合計(純資産総額)		579,087,384	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	日本株式マザーファンド	64,484,015	1.5173	97,841,596	1.5261	98,409,055	16.99
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	45,049,702	2.1562	97,136,168	2.1696	97,739,833	16.88
日本	親投資信託受益証券	海外リートマザーファンド	80,332,417	1.1789	94,703,887	1.2077	97,017,460	16.75
日本	親投資信託受益証券	Jリートマザーファンド(M)	41,676,923	2.2844	95,206,763	2.3191	96,652,952	16.69
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	72,752,461	1.3063	95,036,540	1.3119	95,443,953	16.48
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	39,133,199	2.4435	95,621,972	2.3986	93,864,891	16.21

(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	100.01
合計	100.01

(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
第16特定期間末（平成27年 6月10日）	702,772,093	703,432,466	10,642	10,652
第17特定期間末（平成27年12月10日）	580,433,326	580,999,534	10,251	10,261
平成26年12月末日	819,958,074		10,465	
平成27年 1月末日	788,760,924		10,385	
2月末日	778,796,766		10,571	
3月末日	757,221,493		10,592	
4月末日	730,810,564		10,604	
5月末日	717,372,797		10,826	
6月末日	683,588,064		10,506	
7月末日	667,355,433		10,643	
8月末日	613,541,047		10,089	
9月末日	585,317,141		9,850	
10月末日	607,702,099		10,363	
11月末日	592,074,992		10,412	
12月末日	579,087,384		10,309	

## 【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
第16特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	60
第17特定期間	平成27年 6月11日～平成27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
第16特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	3.8
第17特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	3.1

(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
第16特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	479,267	146,121,136	660,373,314
第17特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	95,536	94,260,179	566,208,671

(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	222,396,843,420	98.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,498,022,780	1.11
合計(純資産総額)		224,894,866,200	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	2,476,000,000	1.10

(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	1,209,800	7,581.76	9,172,413,248	7,488.00	9,058,982,400	4.03
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,709,100	616.01	4,748,882,691	757.10	5,836,559,610	2.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	742,700	3,371.40	2,503,938,780	4,836.00	3,591,697,200	1.60
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	769,400	4,098.77	3,153,593,638	4,606.00	3,543,856,400	1.58
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	876,100	3,652.99	3,200,384,539	3,910.00	3,425,551,000	1.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	544,400	7,036.47	3,830,654,268	6,139.00	3,342,071,600	1.49
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,532,000	196.98	2,665,533,360	243.50	3,295,042,000	1.47
日本	株式	KDDI	情報・通信業	976,100	2,744.05	2,678,467,205	3,154.00	3,078,619,400	1.37
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	644,900	3,427.65	2,210,491,485	4,471.00	2,883,347,900	1.28
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	406,000	5,574.27	2,263,153,620	6,065.00	2,462,390,000	1.09
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	401,900	4,264.52	1,713,910,588	5,550.00	2,230,545,000	0.99
日本	株式	ファナック	電気機器	99,600	20,122.89	2,004,239,844	21,080.00	2,099,568,000	0.93
日本	株式	ソニー	電気機器	686,800	2,687.74	1,845,939,832	3,002.00	2,061,773,600	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	178,000	9,182.22	1,634,435,160	11,450.00	2,038,100,000	0.91
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,141,700	1,815.74	2,073,030,358	1,731.50	1,976,853,550	0.88
日本	株式	キヤノン	電気機器	524,100	3,878.12	2,032,522,692	3,675.00	1,926,067,500	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,200	19,055.46	1,661,636,112	21,600.00	1,883,520,000	0.84
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	741,000	1,984.00	1,470,144,000	2,484.00	1,840,644,000	0.82
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	389,300	3,814.26	1,484,891,418	4,712.00	1,834,381,600	0.82
日本	株式	三菱地所	不動産業	714,000	2,375.09	1,695,814,260	2,523.50	1,801,779,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	102,100	12,982.68	1,325,531,628	17,570.00	1,793,897,000	0.80
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,366,500	1,033.34	1,412,059,110	1,279.50	1,748,436,750	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,484,000	871.04	2,163,663,360	691.50	1,717,686,000	0.76
日本	株式	花王	化学	274,200	5,114.19	1,402,310,898	6,255.00	1,715,121,000	0.76
日本	株式	三井不動産	不動産業	509,000	3,094.07	1,574,881,630	3,056.00	1,555,504,000	0.69
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	307,600	4,232.15	1,301,809,340	5,027.00	1,546,305,200	0.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	22,100	53,564.88	1,183,783,848	67,080.00	1,482,468,000	0.66
日本	株式	三菱商事	卸売業	721,000	2,111.93	1,522,701,530	2,028.00	1,462,188,000	0.65
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	344,100	4,620.12	1,589,783,292	4,174.00	1,436,273,400	0.64

日本	株式	デンソー	輸送用機器	240,700	5,353.45	1,288,575,415	5,818.00	1,400,392,600	0.62
----	----	------	-------	---------	----------	---------------	----------	---------------	------

(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	0.10
		鉱業	0.35
		建設業	2.90
		食料品	4.53
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.99
		医薬品	5.32
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.22
		非鉄金属	0.89
		金属製品	0.64
		機械	4.52
		電気機器	11.63
		輸送用機器	10.63
		精密機器	1.54
		その他製品	1.46
		電気・ガス業	2.09
		陸運業	4.39
		海運業	0.25
		空運業	0.64
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	7.38
		卸売業	3.94
		小売業	4.74
		銀行業	9.03
		証券、商品先物取引業	1.15
		保険業	2.60
その他金融業	1.32		
不動産業	2.71		
サービス業	3.49		
	小計	98.89	



合計	98.89
----	-------

(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	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	東証株価指数先物	買建	160	円	2,479,485,320	2,476,000,000	1.10

(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	256,696,571,060	80.30
	メキシコ	100,679,000	0.03
	小計	256,797,250,060	80.33
地方債証券	日本	18,687,108,431	5.85
特殊債券	日本	25,139,566,107	7.86
社債券	日本	14,173,873,180	4.43
	オーストラリア	302,762,000	0.09
	フランス	300,968,000	0.09
	オランダ	202,236,000	0.06
	スウェーデン	201,474,000	0.06
	ノルウェー	101,034,000	0.03
	アメリカ	100,152,000	0.03
	カナダ	100,108,000	0.03
	スイス	99,973,000	0.03
小計	15,582,580,180	4.87	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,477,671,534	1.09
合計(純資産総額)		319,684,176,312	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	1,937,520,000	0.61

(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)	4,130,000,000	100.54	4,152,302,000	100.43	4,147,965,500	0.200	2017/9/20	1.30
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	3,950,000,000	100.88	3,984,774,700	101.46	4,008,025,500	0.400	2025/9/20	1.25
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	3,440,000,000	102.88	3,539,072,000	103.71	3,567,727,200	0.600	2024/6/20	1.12
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	3,540,000,000	100.27	3,549,609,600	100.35	3,552,460,800	0.100	2020/9/20	1.11
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,485,000,000	99.89	3,481,494,100	101.62	3,541,457,000	0.400	2025/6/20	1.11
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,302,000,000	100.51	3,318,840,200	100.37	3,314,481,560	0.200	2017/6/20	1.04
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,240,000,000	100.14	3,244,536,000	100.37	3,252,150,000	0.100	2019/12/20	1.02
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,190,000,000	100.02	3,190,638,000	100.35	3,201,388,300	0.100	2020/3/20	1.00
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,045,000,000	101.84	3,101,212,500	102.83	3,131,203,950	0.500	2024/9/20	0.98
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,070,000,000	100.28	3,078,596,000	101.76	3,124,062,700	0.400	2025/3/20	0.98
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	3,100,000,000	100.10	3,103,147,600	100.35	3,111,036,000	0.100	2020/6/20	0.97
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,070,000,000	100.72	3,092,104,000	100.67	3,090,630,400	0.200	2019/3/20	0.97
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,920,000,000	102.94	3,005,848,000	103.77	3,030,142,400	0.600	2024/3/20	0.95
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,890,000,000	103.00	2,976,700,000	103.78	2,999,299,800	0.600	2023/12/20	0.94
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	2,960,000,000	100.66	2,979,668,400	100.63	2,978,796,000	0.200	2018/12/20	0.93
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,730,000,000	100.68	2,748,564,000	100.43	2,741,820,900	0.300	2017/3/20	0.86
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,455,000,000	104.67	2,569,648,500	105.01	2,578,069,150	0.800	2022/9/20	0.81
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	2,490,000,000	103.68	2,581,632,000	102.11	2,542,588,800	1.700	2017/3/20	0.80

日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,385,000,000	104.71	2,497,408,500	105.25	2,510,379,450	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,197,000,000	106.63	2,342,661,100	105.79	2,324,206,300	1.200	2020/12/20	0.73
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,200,000,000	106.08	2,333,760,000	105.10	2,312,222,000	1.300	2019/12/20	0.72
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	2,165,000,000	103.12	2,232,548,000	103.76	2,246,425,650	0.600	2023/3/20	0.70
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	105.41	2,266,444,000	104.10	2,238,193,000	1.500	2018/9/20	0.70
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	2,080,000,000	104.70	2,177,760,000	105.31	2,190,510,400	0.800	2023/9/20	0.69
日本	国債証券	第353回利付国債（2年）	2,180,000,000	100.20	2,184,464,800	100.23	2,185,188,400	0.100	2017/6/15	0.68
日本	国債証券	第113回利付国債（5年）	2,130,000,000	100.99	2,151,164,000	100.77	2,146,464,900	0.300	2018/6/20	0.67
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	104.39	2,140,056,500	103.00	2,111,582,000	1.500	2017/12/20	0.66
日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	2,090,000,000	99.71	2,083,939,000	101.01	2,111,171,700	0.300	2024/12/20	0.66
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	1,830,000,000	100.64	1,841,732,100	100.59	1,840,888,500	0.200	2018/9/20	0.58
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	1,670,000,000	106.13	1,772,371,000	108.70	1,815,306,700	1.400	2034/9/20	0.57

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	80.33
地方債証券	5.85
特殊債券	7.86
社債券	4.87
合計	98.91

(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	長期国債標準物先物	買建	13円		1,936,774,212	1,937,520,000	0.61

(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	127,633,335,043	56.76
	イギリス	16,948,333,272	7.54
	スイス	9,034,592,366	4.02
	ドイツ	8,227,108,213	3.66
	フランス	8,065,784,764	3.59
	カナダ	7,220,473,283	3.21
	オーストラリア	5,305,969,221	2.36
	アイルランド	3,723,183,761	1.66
	オランダ	3,669,062,321	1.63
	スペイン	2,896,436,893	1.29
	スウェーデン	2,571,918,152	1.14
	イタリア	1,936,516,776	0.86
	香港	1,904,446,463	0.85
	デンマーク	1,695,594,994	0.75
	ベルギー	1,306,506,727	0.58
	シンガポール	1,262,595,655	0.56
	ジャージー	980,146,483	0.44
	バミューダ	794,962,065	0.35
	フィンランド	784,524,062	0.35
	キュラソー	641,345,080	0.29
	イスラエル	626,191,070	0.28
	ケイマン	542,601,419	0.24
	ノルウェー	487,938,583	0.22
	ルクセンブルク	184,039,336	0.08
	パナマ	170,111,487	0.08
	オーストリア	148,891,906	0.07
	ポルトガル	141,421,880	0.06
	リベリア	135,714,632	0.06
ニュージーランド	129,607,692	0.06	
英ヴァージン諸島	53,354,833	0.02	

	パプアニューギニア	45,175,548	0.02
	マン島	19,668,220	0.01
	モーリシャス	14,130,747	0.01
	小計	209,301,682,947	93.08
投資信託受益証券	オーストラリア	156,161,209	0.07
	香港	38,361,624	0.02
	シンガポール	19,293,378	0.01
	小計	213,816,211	0.10
投資証券	アメリカ	4,056,945,790	1.80
	オーストラリア	519,448,867	0.23
	フランス	321,704,857	0.14
	イギリス	293,266,641	0.13
	香港	99,923,208	0.04
	シンガポール	69,707,528	0.03
	カナダ	32,726,029	0.01
	小計	5,393,722,920	2.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,964,051,216	4.43
合計(純資産総額)		224,873,273,294	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	6,812,511,118	3.03
	買建	カナダ	487,405,944	0.22
	買建	ドイツ	1,841,421,617	0.82
	買建	イギリス	1,017,299,319	0.45
	買建	オーストラリア	461,492,080	0.21

(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		1,663,607,280	0.74

(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	340,353	14,193.38	4,830,761,096	13,115.13	4,463,774,317	1.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	453,507	5,130.74	2,326,830,768	6,820.49	3,093,142,453	1.38
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	248,687	10,748.76	2,673,077,674	9,547.48	2,374,336,049	1.06
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	563,297	2,957.35	1,665,870,439	3,772.68	2,125,139,777	0.95
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	165,276	12,067.03	1,994,390,533	12,547.05	2,073,727,608	0.92
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	23,731	46,965.53	1,114,539,088	83,699.72	1,986,278,096	0.88
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	290,881	6,511.73	1,894,139,668	6,668.52	1,939,747,773	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	220,748	7,012.26	1,547,943,563	8,089.31	1,785,699,600	0.79
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	190,671	8,635.21	1,646,484,355	9,132.22	1,741,251,045	0.77
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	18,478	64,851.99	1,198,335,201	93,665.72	1,730,755,285	0.77
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,304	65,730.03	1,137,392,574	95,759.51	1,657,022,658	0.74
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	128,052	9,255.61	1,185,199,551	12,936.62	1,656,561,165	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	161,843	10,122.79	1,638,303,884	9,692.21	1,568,617,897	0.70
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	366,703	4,107.97	1,506,407,344	4,212.90	1,544,885,746	0.69
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	367,677	3,968.06	1,458,967,706	3,959.62	1,455,863,519	0.65

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	136,152	11,088.69	1,509,748,682	10,633.00	1,447,704,216	0.64
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	42,045	30,476.00	1,281,363,453	33,843.31	1,422,942,389	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	242,375	5,858.02	1,419,839,463	5,693.99	1,380,082,789	0.61
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	246,358	4,970.33	1,224,482,554	5,271.86	1,298,765,650	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	622,284	1,970.76	1,226,377,021	2,084.14	1,296,927,474	0.58
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	95,650	12,262.41	1,172,900,348	12,914.91	1,235,311,983	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	76,552	13,212.82	1,011,468,217	16,125.55	1,234,443,639	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	112,102	12,712.29	1,425,073,582	11,005.66	1,233,756,778	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	283,662	3,956.00	1,122,169,141	4,274.41	1,212,490,072	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	179,425	5,924.36	1,062,978,867	6,389.91	1,146,511,001	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	70,640	17,781.53	1,256,087,441	16,178.62	1,142,858,098	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,173,592	1,076.25	1,263,084,962	973.63	1,142,651,279	0.51
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	116,325	8,089.31	940,989,300	9,553.51	1,111,312,993	0.49
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	87,458	11,732.94	1,026,139,537	12,466.24	1,090,273,258	0.48
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	167,696	6,931.45	1,162,377,563	6,433.33	1,078,844,949	0.48

(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	6.31
		素材	4.03
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.72
		自動車・自動車部品	1.67
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.78
		メディア	2.83
		小売	3.87
		食品・生活必需品小売り	2.05
		食品・飲料・タバコ	6.10

	家庭用品・パーソナル用品	2.13
	ヘルスケア機器・サービス	3.52
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.93
	銀行	8.84
	各種金融	3.89
	保険	4.23
	不動産	0.66
	ソフトウェア・サービス	8.32
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.93
	電気通信サービス	3.05
	公益事業	3.05
	半導体・半導体製造装置	1.79
	小計	93.08
投資信託受益証券		0.10
投資証券		2.40
合計		95.57

(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	109	アメリカドル	54,923,015.5	6,624,264,899	56,483,800	6,812,511,118	3.03
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	36	カナダドル	5,375,466	468,633,126	5,590,800	487,405,944	0.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	45	スイスフラン	3,828,795	465,275,168	3,956,400	480,781,728	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	313	ユーロ	10,136,328.5	1,335,664,006	10,325,870	1,360,639,889	0.61
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	40	オーストラリアドル	4,859,280	427,227,898	5,249,000	461,492,080	0.21
	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	91	イギリスポンド	5,451,266.25	974,577,380	5,690,230	1,017,299,319	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	9,653,000.00	1,171,301,236	1,163,873,680	0.52
	カナダドル	買建	250,000.00	21,790,375	21,790,000	0.01
	ユーロ	買建	1,980,000.00	262,663,510	260,904,600	0.12
	イギリスポンド	買建	980,000.00	178,680,720	175,157,000	0.08
	スイスフラン	買建	200,000.00	24,314,400	24,306,000	0.01
	オーストラリアドル	買建	200,000.00	17,576,600	17,576,000	0.01

(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	78,786,068,919	42.30
	イタリア	18,034,399,831	9.68
	フランス	17,525,960,075	9.41
	イギリス	15,199,100,642	8.16
	ドイツ	13,821,068,687	7.42
	スペイン	9,849,280,414	5.29
	ベルギー	4,634,380,722	2.49
	オランダ	4,598,421,291	2.47
	カナダ	3,638,802,227	1.95
	オーストラリア	3,288,203,797	1.77
	オーストリア	2,840,068,898	1.52
	メキシコ	1,874,390,806	1.01
	アイルランド	1,460,944,226	0.78
	デンマーク	1,137,175,233	0.61
	フィンランド	1,108,140,148	0.59
	ポーランド	1,034,004,706	0.56
	スウェーデン	851,636,395	0.46
	マレーシア	831,190,881	0.45
	南アフリカ	758,612,236	0.41
	シンガポール	679,715,223	0.36
スイス	557,643,583	0.30	
ノルウェー	514,918,659	0.28	
	小計	183,024,127,599	98.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,218,489,355	1.73

合計(純資産総額)	186,242,616,954	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	226,773,188	0.12
	買建	ドイツ	311,260,505	0.17

(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		711,096,300	0.38

(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 3.625% 02/15/20	9,800,000	13,316.33	1,305,000,669	12,997.61	1,273,765,979	3.625	2020/2/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	9,900,000	11,926.36	1,180,709,665	11,723.19	1,160,596,582	2.000	2025/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	9,000,000	12,900.79	1,161,071,485	12,536.13	1,128,252,368	2.750	2024/2/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/15/18	9,000,000	12,071.37	1,086,423,522	12,026.84	1,082,415,860	1.250	2018/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	7,950,000	12,898.67	1,025,444,598	12,557.10	998,289,673	2.750	2023/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	8,250,000	12,011.67	990,962,817	11,882.91	980,340,228	1.375	2020/4/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,700,000	13,574.51	1,045,237,589	12,273.24	945,039,894	3.125	2044/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/45	8,750,000	11,022.26	964,448,338	10,772.68	942,610,136	2.500	2045/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 12/31/20	7,200,000	12,549.09	903,534,739	12,378.30	891,238,168	2.375	2020/12/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	6,500,000	14,813.82	962,898,888	13,511.85	878,270,478	3.625	2044/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875% 05/31/22	7,250,000	11,941.47	865,756,973	11,922.25	864,363,222	1.875	2022/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	7,300,000	12,908.33	942,308,265	11,709.53	854,796,053	2.875	2043/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.5% 07/31/17	7,010,000	11,955.70	838,094,696	11,965.83	838,804,769	0.500	2017/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	12,510.22	838,185,080	12,158.05	814,589,578	2.375	2024/8/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	12,200.21	793,014,284	11,966.30	777,809,652	2.000	2023/2/15	0.42
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	3,900,000	21,250.54	828,771,368	19,802.00	772,278,011	5.500	2029/4/25	0.41
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	4,550,000	17,421.31	792,669,682	16,864.25	767,323,558	4.250	2023/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	5,900,000	13,133.29	774,864,598	12,866.63	759,131,593	3.375	2019/11/15	0.41
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	4,950,000	15,521.18	768,298,821	15,165.27	750,681,238	3.500	2020/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	6,000,000	12,108.34	726,500,930	12,065.47	723,928,543	0.875	2017/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 05/15/17	6,000,000	12,090.68	725,440,884	12,048.51	722,910,896	0.875	2017/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/17	6,000,000	12,065.47	723,928,543	12,038.85	722,331,404	1.000	2017/12/15	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 5.25% 11/01/29	3,950,000	18,487.79	730,267,792	18,285.06	722,260,030	5.250	2029/11/1	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 07/31/22	6,000,000	12,128.78	727,726,969	12,000.22	720,013,434	2.000	2022/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1% 11/30/19	6,100,000	11,799.28	719,756,428	11,770.31	717,988,976	1.000	2019/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 10/15/18	6,000,000	12,006.24	720,374,584	11,913.77	714,826,261	0.875	2018/10/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	5,800,000	12,639.55	733,093,963	12,294.91	713,105,210	2.500	2024/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.625% 08/15/19	5,500,000	13,227.05	727,487,954	12,937.30	711,551,886	3.625	2019/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/20	6,000,000	11,901.07	714,064,269	11,828.02	709,681,487	1.375	2020/10/31	0.38
イギリス	国債証券	UKT 3.75% 09/07/20	3,500,000	20,271.86	709,515,247	19,926.37	697,423,015	3.750	2020/9/7	0.37

(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	98.27
合計	98.27

(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	8	アメリカ ドル	949,469,52	114,515,519	945,375.04	114,021,684	0.06
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	5	アメリカ ドル	632,207.5	76,250,546	628,281.25	75,777,001	0.04
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	2	アメリカ ドル	308,008	37,148,845	306,562.5	36,974,503	0.02
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	4	ユーロ	445,916	58,758,351	445,960	58,764,149	0.03
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	5	ユーロ	654,270	86,213,157	653,150	86,065,575	0.05

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	8	ユーロ	1,267,872	167,067,494	1,263,040	166,430,781	0.09
-----	-----------------------	-----------	----	---	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(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	2,740,000.00	333,692,544	330,334,400	0.18
	カナダドル	買建	460,000.00	41,075,976	40,084,400	0.02
	ユーロ	買建	2,070,000.00	276,007,590	272,763,900	0.15
	イギリスポンド	買建	380,000.00	70,136,144	67,913,600	0.04

(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	93,019,757,000	99.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		856,675,096	0.91
合計(純資産総額)		93,876,432,096	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	ジャパンリアルエステイト投資法人	15,557	531,914.89	8,275,000,043	587,000	9,131,959,000	9.73
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	15,628	540,335.78	8,444,367,600	577,000	9,017,356,000	9.61
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,560	147,070.44	5,229,824,846	149,400	5,312,664,000	5.66
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	22,810	246,064.19	5,612,724,352	232,200	5,296,482,000	5.64
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	18,748	232,286.85	4,354,913,880	218,500	4,096,438,000	4.36
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	13,044	274,983.03	3,586,878,686	265,700	3,465,790,800	3.69

日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,621	518,887.56	3,435,554,593	513,000	3,396,573,000	3.62
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,636	166,847.76	3,443,070,375	164,000	3,384,304,000	3.61
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,711	77,592.85	2,693,325,558	89,500	3,106,634,500	3.31
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,832	167,576.79	3,155,806,109	156,400	2,945,324,800	3.14
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	14,209	231,937.2	3,295,595,738	206,300	2,931,316,700	3.12
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,571	396,479.68	2,605,267,977	413,000	2,713,823,000	2.89
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	16,172	143,137.28	2,314,816,251	155,000	2,506,660,000	2.67
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	3,510	608,783.2	2,136,829,032	654,000	2,295,540,000	2.45
日本	投資証券	G L P投資法人	19,501	118,636.94	2,313,538,966	116,800	2,277,716,800	2.43
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	9,506	232,288.17	2,208,131,344	234,300	2,227,255,800	2.37
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,596	523,135.94	2,404,332,808	484,500	2,226,762,000	2.37
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,712	517,975.15	1,922,723,756	576,000	2,138,112,000	2.28
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,432	493,048.47	2,185,190,838	473,000	2,096,336,000	2.23
日本	投資証券	プレミアム投資法人	15,755	128,066.97	2,017,695,112	123,300	1,942,591,500	2.07
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,470	441,340.27	1,972,791,006	420,000	1,877,400,000	2.00
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	13,425	137,500.35	1,845,942,229	132,800	1,782,840,000	1.90
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	6,541	256,819.99	1,679,859,554	249,600	1,632,633,600	1.74
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,991	157,195.76	1,413,347,096	168,500	1,514,983,500	1.61
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	3,295	402,203.24	1,325,259,681	433,000	1,426,735,000	1.52
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,853	316,862.18	1,220,870,002	369,500	1,423,683,500	1.52
日本	投資証券	イオンリート投資法人	9,291	141,600	1,315,605,600	142,700	1,325,825,700	1.41
日本	投資証券	星野リゾート・リート投資法人	1,055	1,250,615.37	1,319,399,220	1,256,000	1,325,080,000	1.41
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	4,127	322,514.35	1,331,016,722	298,000	1,229,846,000	1.31
日本	投資証券	ケネディクス商業リート投資法人	4,541	259,494.47	1,178,364,388	255,200	1,158,863,200	1.23

(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	99.09
合計	99.09

(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	339,323,899	69.01
	オーストラリア	37,195,064	7.56
	イギリス	31,761,492	6.46
	フランス	21,549,684	4.38
	シンガポール	13,732,236	2.79
	香港	8,026,003	1.63
	カナダ	7,865,896	1.60
	ベルギー	2,994,472	0.61
	オランダ	2,749,185	0.56
	スペイン	2,482,889	0.50
	ニュージーランド	2,264,491	0.46
	アイルランド	1,213,846	0.25
	ドイツ	807,094	0.16
	イタリア	487,930	0.10
	マン島	334,050	0.07
	ガーンジー	326,899	0.07
イスラエル	225,314	0.05	
	小計	473,340,444	96.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,342,983	3.73
合計(純資産総額)		491,683,427	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 （％）
為替予約取引	売建		1,808,850	0.37

(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	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	1,200	21,058.50	25,270,207	23,614.23	28,337,078	5.76
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	571	24,155.26	13,792,658	30,419.04	17,369,276	3.53
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	1,418	8,363.09	11,858,873	9,886.40	14,018,918	2.85
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	381	30,353.21	11,564,576	31,308.55	11,928,558	2.43
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	514	19,433.88	9,989,019	22,377.97	11,502,281	2.34
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	1,366	7,466.96	10,199,875	8,262.99	11,287,246	2.30
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	2,036	4,402.26	8,963,012	5,254.97	10,699,135	2.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	596	13,335.84	7,948,165	15,657.59	9,331,924	1.90
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1,287	6,374.23	8,203,645	6,815.67	8,771,769	1.78
アメリカ	投資証券	HCP INC	1,797	4,345.57	7,809,005	4,656.75	8,368,184	1.70
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	681	10,377.28	7,066,930	12,239.50	8,335,101	1.70
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	20,656	340.25	7,028,213	374.53	7,736,482	1.57
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	2,266	2,942.88	6,668,575	3,309.53	7,499,414	1.53
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	254	25,044.66	6,361,346	29,463.81	7,483,810	1.52
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,114	2,231.17	6,947,877	2,148.93	6,691,785	1.36
香港	投資証券	LINK REIT	9,000	663.63	5,972,706	718.87	6,469,848	1.32
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	7,436	868.64	6,459,278	849.30	6,315,448	1.28
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	902	5,303.22	4,783,506	6,293.43	5,676,674	1.15
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	3,975	1,473.14	5,855,760	1,423.98	5,660,330	1.15
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	2,941	2,090.17	6,147,194	1,921.31	5,650,594	1.15
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	386	12,281.71	4,740,742	13,757.98	5,310,581	1.08
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	1,600	2,684.77	4,295,646	3,252.85	5,204,563	1.06
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	476	8,671.85	4,127,805	10,881.43	5,179,563	1.05
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	522	8,747.84	4,566,374	9,858.66	5,146,221	1.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	528	7,440.43	3,928,548	9,288.17	4,904,157	1.00
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	266	15,229.42	4,051,027	18,086.67	4,811,056	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	1,005	3,761.82	3,780,635	4,569.91	4,592,762	0.93
フランス	投資証券	KLEPIERRE	738	5,235.22	3,863,594	5,380.16	3,970,565	0.81
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	1,335	2,146.85	2,866,056	2,570.19	3,431,216	0.70
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	6,045	527.52	3,188,859	564.44	3,412,079	0.69

(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	96.27
合計	96.27

(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

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	売建	15,000.00	1,808,925	1,808,850	0.37

(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。

#### 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：2015年12月30日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	10,309円
純資産総額	5.79億円

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※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:1,510円 直近1年間分配金合計額:120円

決算期	2015年8月	2015年9月	2015年10月	2015年11月	2015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	上位購入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期間	売却比率
日本株式マザーファンド	17.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
外国株式マザーファンド	16.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	0.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
海外リートマザーファンド	16.8%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
リートマザーファンド(MI)	16.7%	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.6%
		日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.6%
日本債券マザーファンド	16.5%	第106回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.200%	2017/09/20	0.2%
		第340回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.400%	2025/09/20	0.2%
外国債券マザーファンド	16.2%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.1%
		T 2% 08/15/25	アメリカ	国債	-	2.000%	2025/08/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2007年は当初設定日から年末までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 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10億口を下回るようになった場合
- ・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っ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17特定期間(平成27年6月11日から平成27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16特定期間 （平成27年 6月10日現在）	第17特定期間 （平成27年12月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,508,501	2,226,166
親投資信託受益証券	699,324,632	578,068,489
未収入金	1,200,000	1,200,000
未収利息	5	3
流動資産合計	704,033,138	581,494,658
資産合計	704,033,138	581,494,658
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	660,373	566,208
未払受託者報酬	25,425	20,957
未払委託者報酬	572,077	471,556
その他未払費用	3,170	2,611
流動負債合計	1,261,045	1,061,332
負債合計	1,261,045	1,061,332
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	660,373,314	566,208,671
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	42,398,779	14,224,655
（分配準備積立金）	47,400,624	42,519,887
元本等合計	702,772,093	580,433,326
純資産合計	702,772,093	580,433,326
負債純資産合計	704,033,138	581,494,658

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	928	719
有価証券売買等損益	32,472,063	17,711,412
営業収益合計	32,472,991	17,710,693
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	164,949	135,875
委託者報酬	3,711,205	3,057,129
その他費用	20,557	16,923
営業費用合計	3,896,711	3,209,927
営業利益又は営業損失 ( )	28,576,280	20,920,620
経常利益又は経常損失 ( )	28,576,280	20,920,620
当期純利益又は当期純損失 ( )	28,576,280	20,920,620
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 ( )	864,797	374,721
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	25,363,281	42,398,779
剰余金増加額又は欠損金減少額	19,949	2,350
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	19,949	2,350
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,389,572	4,029,310
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,389,572	4,029,310
分配金	4,306,362	3,601,265
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	42,398,779	14,224,655

## (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16特定期間 (平成27年 6月10日現在)	第17特定期間 (平成27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	660,373,314口	566,208,671口
2. 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 (1万口当たり純資産額) 1.0642円 (10,642円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0251円 (10,251円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日																																																												
分配金の計算過程 第88期 自 平成26年12月11日 至 平成27年 1月13日	分配金の計算過程 第94期 自 平成27年 6月11日 至 平成27年 7月10日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,741,690円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>2,706,596円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>12,749,539円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>27,631,751円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>44,829,576円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>781,334,601口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>573円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>781,334円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,741,690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	2,706,596円	収益調整金額	C	12,749,539円	分配準備積立金額	D	27,631,751円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,829,576円	当ファンドの期末残存口数	F	781,334,601口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	573円	1万口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	781,334円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>895,898円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>10,482,312円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>46,070,845円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>57,449,055円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>641,942,774口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>894円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>641,942円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	895,898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	10,482,312円	分配準備積立金額	D	46,070,845円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,449,055円	当ファンドの期末残存口数	F	641,942,774口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	894円	1万口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	641,942円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,741,690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	2,706,596円																																																											
収益調整金額	C	12,749,539円																																																											
分配準備積立金額	D	27,631,751円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,829,576円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	781,334,601口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	573円																																																											
1万口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	781,334円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	895,898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	10,482,312円																																																											
分配準備積立金額	D	46,070,845円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,449,055円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	641,942,774口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	894円																																																											
1万口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	641,942円																																																											
第89期 自 平成27年 1月14日 至 平成27年 2月10日	第95期 自 平成27年 7月11日 至 平成27年 8月10日																																																												

第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日			第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	418,598円	費用控除後の配当等収益額	A	923,603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	12,211,196円	収益調整金額	C	10,219,534円
分配準備積立金額	D	29,977,131円	分配準備積立金額	D	45,163,505円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	42,606,925円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	56,306,642円
当ファンドの期末残存口数	F	748,342,951口	当ファンドの期末残存口数	F	625,849,909口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	569円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	899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 × H/10,000	748,342円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	625,849円
第90期 自 平成27年 2月11日 至 平成27年 3月10日			第96期 自 平成27年 8月11日 至 平成27年 9月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,465,424円	費用控除後の配当等収益額	A	737,682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	6,011,762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	11,900,837円	収益調整金額	C	9,750,608円
分配準備積立金額	D	28,893,874円	分配準備積立金額	D	43,375,268円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	48,271,897円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,863,558円
当ファンドの期末残存口数	F	729,323,348口	当ファンドの期末残存口数	F	597,133,005口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	661円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	902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 × H/10,000	729,323円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	597,133円
第91期 自 平成27年 3月11日 至 平成27年 4月10日			第97期 自 平成27年 9月11日 至 平成27年10月13日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,346,649円	費用控除後の配当等収益額	A	1,839,500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	14,069,293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	11,458,103円	収益調整金額	C	9,655,089円
分配準備積立金額	D	34,313,986円	分配準備積立金額	D	43,089,530円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,188,031円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	54,584,119円
当ファンドの期末残存口数	F	702,162,794口	当ファンドの期末残存口数	F	591,283,368口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	885円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	923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 × H/10,000	702,162円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	591,283円
第92期 自 平成27年 4月11日			第98期 自 平成27年10月14日		

第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日			第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日		
至 平成27年 5月11日			至 平成27年11月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	627,783円	費用控除後の配当等収益額	A	776,754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	11,175,244円	収益調整金額	C	9,452,068円
分配準備積立金額	D	48,792,756円	分配準備積立金額	D	43,405,442円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,595,783円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,634,264円
当ファンドの期末残存口数	F	684,828,866口	当ファンドの期末残存口数	F	578,850,144口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	884円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	926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 × H/10,000	684,828円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	578,850円
第93期 自 平成27年 5月12日 至 平成27年 6月10日			第99期 自 平成27年11月11日 至 平成27年12月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,065,653円	費用控除後の配当等収益額	A	434,993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	10,776,171円	収益調整金額	C	9,245,647円
分配準備積立金額	D	46,995,344円	分配準備積立金額	D	42,651,102円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	58,837,168円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,331,742円
当ファンドの期末残存口数	F	660,373,314口	当ファンドの期末残存口数	F	566,208,671口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	890円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	924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 × H/10,000	660,373円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	566,208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17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27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。

	第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
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コンプライアンス・リスク統括部が、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

	第17特定期間 (平成27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16特定期間	第17特定期間
	自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日	自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	806,015,183円	660,373,314円
期中追加設定元本額	479,267円	95,536円
期中一部解約元本額	146,121,136円	94,260,179円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16特定期間 （平成27年 6月10日現在）	第17特定期間 （平成27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	4,124,176	3,164,176
合計	4,124,176	3,164,176

（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	64,761,596	98,262,769	
	日本債券マザーファンド	73,071,828	95,453,728	
	外国株式マザーファンド	45,248,005	97,563,748	



外国債券マザーファンド	39,306,028	96,044,279	
Jリートマザーファンド（M）	41,858,297	95,621,093	
海外リートマザーファンド	80,687,821	95,122,872	
合計	344,933,575	578,068,489	

(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27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

項目	平成27年12月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,831,216,218
株式	220,676,187,310
未収配当金	50,565,440
未収利息	4,365
前払金	36,493,000
差入委託証拠金	58,434,000
流動資産合計	223,652,900,333
資産合計	223,652,900,333
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,493,000
未払金	21,027,927
未払解約金	508,098,998
流動負債合計	565,619,925
負債合計	565,619,925
純資産の部	
元本等	
元本	147,024,582,880
剰余金	

	平成27年12月10日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	76,062,697,528
元本等合計	223,087,280,408
純資産合計	223,087,280,408
負債純資産合計	223,652,900,333

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成27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	147,024,582,880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 1.5173円 (1万口当たり純資産額) (15,173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27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コンプライアンス・リスク統括部が、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27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)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。

	平成27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>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27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27年 6月11日
期首元本額	154,128,092,512円
期中追加設定元本額	9,355,632,930円
期中一部解約元本額	16,459,142,562円
期末元本額	147,024,582,880円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	1,104,526,386円
D C 日本株式インデックスファンド	331,979,627円
D C 日本株式インデックスファンド L	49,589,624,801円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,310,185,964円
D C バランスファンド 3 0	1,644,954,336円
D C バランスファンド 5 0	2,544,927,275円
D C バランスファンド 7 0	1,276,136,611円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	64,761,596円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	37,714,781円
新生・4分散ファンド	83,483,788円

区分	平成27年12月10日現在
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	671,286,191円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	26,753,670円
日本株式インデックスe	2,021,216,504円
インデックスコレクション(国内株式)	7,086,515,814円
インデックスコレクション(バランス株式30)	1,253,262,657円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,186,798,380円
インデックスコレクション(バランス株式70)	1,005,413,418円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,568,450,462円
日本株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	599,094,631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)	5,054,311,204円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	721,932,664円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	6,747,348,081円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	627,887,451円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,160,957,420円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	244,503,206円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,455,830,527円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,690,280,553円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,068,682,830円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	17,904,347,573円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	1,486,634,488円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	4,644,256,469円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,586,228,960円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	78,064,429円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	893,800,007円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	169,525,555円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	4,250,333,685円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	129,398,642円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	115,623,349円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	66,276,106円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,625,314,912円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	1,562,387,793円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	44,445,058円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	698,774,347円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	10,971,945,463円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	224,544,816円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	89,259,133円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	23,883,855円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	274,689,560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)	5,416,592円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	611,260円

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成27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	21,013,187,264	
合計	21,013,187,264	

(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27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	2,391,928,000	-	2,355,435,000	36,493,000
	合計	2,391,928,000	-	2,355,435,000	36,493,000

(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	46,000	263.00	12,098,000	
日本水産	125,700	458.00	57,570,600	
マルハニチロ	22,300	1,935.00	43,150,500	
サカタのタネ	17,600	2,700.00	47,520,000	
ホクト	11,100	2,265.00	25,141,500	
住石ホールディングス	30,600	115.00	3,519,000	
日鉄鉱業	30,000	553.00	16,590,000	
三井松島産業	71,000	132.00	9,372,000	
国際石油開発帝石	574,600	1,177.50	676,591,500	
日本海洋掘削	3,300	2,815.00	9,289,500	
石油資源開発	17,300	3,275.00	56,657,500	
K&Oエナジーグループ	7,300	1,651.00	12,052,300	

ショーボンドホールディングス	10,600	4,660.00	49,396,000
ミライト・ホールディングス	33,600	974.00	32,726,400
タマホーム	8,200	446.00	3,657,200
サンヨーホームズ	1,500	501.00	751,500
ダイセキ環境ソリューション	2,500	1,218.00	3,045,000
安藤・間	72,800	671.00	48,848,800
東急建設	35,500	891.00	31,630,500
コムシスホールディングス	48,500	1,683.00	81,625,500
ミサワホーム	13,600	896.00	12,185,600
高松コンストラクショングループ	8,200	2,604.00	21,352,800
東建コーポレーション	4,100	9,020.00	36,982,000
ヤマウラ	5,200	454.00	2,360,800
大成建設	566,000	790.00	447,140,000
大林組	327,000	1,111.00	363,297,000
清水建設	334,000	1,015.00	339,010,000
飛鳥建設	75,600	200.00	15,120,000
長谷工コーポレーション	127,300	1,318.00	167,781,400
松井建設	12,100	749.00	9,062,900
銭高組	16,000	542.00	8,672,000
鹿島建設	511,000	710.00	362,810,000
不動テトラ	77,200	148.00	11,425,600
大末建設	4,200	972.00	4,082,400
鉄建建設	66,000	301.00	19,866,000
西松建設	126,000	465.00	58,590,000
三井住友建設	418,000	116.00	48,488,000
大豊建設	42,000	605.00	25,410,000
前田建設工業	67,000	752.00	50,384,000
佐田建設	7,600	512.00	3,891,200
ナカノフドー建設	8,400	740.00	6,216,000
奥村組	104,000	655.00	68,120,000
東鉄工業	13,100	2,804.00	36,732,400
イチケン	12,000	425.00	5,100,000
浅沼組	35,000	286.00	10,010,000
戸田建設	127,000	668.00	84,836,000
熊谷組	160,000	337.00	53,920,000
青木あすなろ建設	7,200	802.00	5,774,400
北野建設	23,000	324.00	7,452,000
植木組	15,000	273.00	4,095,000
三井ホーム	14,000	578.00	8,092,000
矢作建設工業	13,600	809.00	11,002,400
ピーエス三菱	12,100	398.00	4,815,800
日本ハウスホールディングス	22,200	466.00	10,345,200

大東建託	40,800	13,560.00	553,248,000	
新日本建設	13,000	695.00	9,035,000	
N I P P O	25,000	2,016.00	50,400,000	
東亜道路工業	21,000	451.00	9,471,000	
前田道路	34,000	2,049.00	69,666,000	
日本道路	32,000	604.00	19,328,000	
東亜建設工業	95,000	323.00	30,685,000	
若築建設	63,000	145.00	9,135,000	
東洋建設	33,000	520.00	17,160,000	
五洋建設	121,000	474.00	57,354,000	
大林道路	13,000	833.00	10,829,000	
世紀東急工業	16,100	632.00	10,175,200	
福田組	18,000	1,254.00	22,572,000	
住友林業	75,100	1,615.00	121,286,500	
日本基礎技術	12,100	496.00	6,001,600	
日成ビルド工業	31,000	371.00	11,501,000	
巴コーポレーション	14,800	379.00	5,609,200	
パナホーム	41,000	886.00	36,326,000	
大和ハウス工業	322,200	3,312.00	1,067,126,400	
ライト工業	21,000	1,113.00	23,373,000	
積水ハウス	364,700	2,079.50	758,393,650	
日特建設	11,900	500.00	5,950,000	
北陸電気工事	4,000	966.00	3,864,000	
ユアテック	17,000	1,180.00	20,060,000	
西部電気工業	9,000	431.00	3,879,000	
四電工	8,000	447.00	3,576,000	
中電工	15,800	2,546.00	40,226,800	
関電工	43,000	800.00	34,400,000	
きんでん	65,900	1,591.00	104,846,900	
東京エネシス	12,000	1,037.00	12,444,000	
トーエネック	15,000	849.00	12,735,000	
住友電設	8,600	1,636.00	14,069,600	
日本電設工業	17,800	2,440.00	43,432,000	
協和エクシオ	42,700	1,234.00	52,691,800	
新日本空調	9,200	1,057.00	9,724,400	
N D S	18,000	336.00	6,048,000	
九電工	20,000	2,186.00	43,720,000	
三機工業	22,400	1,054.00	23,609,600	
日揮	110,000	1,888.00	207,680,000	
中外炉工業	33,000	242.00	7,986,000	
ヤマト	9,800	484.00	4,743,200	
太平電業	15,000	1,211.00	18,165,000	



高砂熱学工業	32,500	1,644.00	53,430,000
三晃金属工業	11,000	260.00	2,860,000
朝日工業社	12,000	500.00	6,000,000
明星工業	18,200	502.00	9,136,400
大気社	13,400	2,884.00	38,645,600
ダイダン	15,000	828.00	12,420,000
日比谷総合設備	13,100	1,577.00	20,658,700
東芝プラントシステム	17,700	1,250.00	22,125,000
O S J Bホールディングス	15,000	256.00	3,840,000
東洋エンジニアリング	54,000	322.00	17,388,000
千代田化工建設	79,000	949.00	74,971,000
新興プランテック	22,400	987.00	22,108,800
日本製粉	72,000	840.00	60,480,000
日清製粉グループ本社	119,600	1,898.00	227,000,800
日東富士製粉	9,000	385.00	3,465,000
昭和産業	45,000	470.00	21,150,000
鳥越製粉	8,700	798.00	6,942,600
中部飼料	10,200	991.00	10,108,200
フィード・ワン	66,100	133.00	8,791,300
東洋精糖	17,000	114.00	1,938,000
日本甜菜製糖	56,000	199.00	11,144,000
三井製糖	43,000	532.00	22,876,000
塩水港精糖	11,900	262.00	3,117,800
森永製菓	98,000	624.00	61,152,000
中村屋	25,000	468.00	11,700,000
江崎グリコ	25,200	6,290.00	158,508,000
名糖産業	4,900	1,340.00	6,566,000
不二家	63,000	202.00	12,726,000
山崎製パン	80,000	2,396.00	191,680,000
第一屋製パン	17,000	120.00	2,040,000
モロゾフ	17,000	432.00	7,344,000
亀田製菓	6,100	4,505.00	27,480,500
寿スピリッツ	2,600	4,715.00	12,259,000
カルビー	40,400	5,030.00	203,212,000
森永乳業	98,000	571.00	55,958,000
六甲バター	4,900	1,786.00	8,751,400
ヤクルト本社	58,500	6,120.00	358,020,000
明治ホールディングス	64,600	9,630.00	622,098,000
雪印メグミルク	25,700	3,115.00	80,055,500
プリマハム	66,000	328.00	21,648,000
日本ハム	80,000	2,317.00	185,360,000
伊藤ハム	52,000	627.00	32,604,000

丸大食品	56,000	456.00	25,536,000
米久	3,500	2,295.00	8,032,500
S Foods	6,900	2,053.00	14,165,700
サッポロホールディングス	167,000	544.00	90,848,000
アサヒグループホールディングス	204,700	3,909.00	800,172,300
麒麟ホールディングス	442,100	1,731.50	765,496,150
宝ホールディングス	79,000	923.00	72,917,000
オエノンホールディングス	30,000	236.00	7,080,000
養命酒製造	3,400	1,978.00	6,725,200
コカ・コーラウエスト	37,000	2,507.00	92,759,000
コカ・コーライーストジャパン	38,600	1,883.00	72,683,800
サントリー食品インターナショナル	74,700	5,100.00	380,970,000
ダイドードリンコ	5,500	5,470.00	30,085,000
伊藤園	32,400	2,874.00	93,117,600
キーコーヒー	9,600	1,900.00	18,240,000
ユニカフェ	3,000	943.00	2,829,000
ジャパンフーズ	1,400	1,154.00	1,615,600
日清オイリオグループ	58,000	478.00	27,724,000
不二製油グループ本社	29,100	1,774.00	51,623,400
かどや製油	1,100	2,740.00	3,014,000
J - オイルミルズ	46,000	336.00	15,456,000
キッコーマン	83,000	3,945.00	327,435,000
味の素	234,000	2,715.00	635,310,000
キューピー	55,500	2,950.00	163,725,000
ハウス食品グループ本社	37,300	2,370.00	88,401,000
カゴメ	39,200	2,124.00	83,260,800
焼津水産化学工業	5,200	1,000.00	5,200,000
アリアケジャパン	8,900	6,520.00	58,028,000
エバラ食品工業	1,900	2,013.00	3,824,700
ニチレイ	116,000	778.00	90,248,000
東洋水産	53,600	4,265.00	228,604,000
イトアンド	1,200	2,266.00	2,719,200
日清食品ホールディングス	46,200	6,320.00	291,984,000
永谷園ホールディングス	10,000	1,069.00	10,690,000
一正蒲鉾	3,800	1,036.00	3,936,800
フジッコ	10,600	2,108.00	22,344,800
ロック・フィールド	5,700	3,030.00	17,271,000
日本たばこ産業	644,900	4,345.00	2,802,090,500
ケンコーマヨネーズ	3,600	1,698.00	6,112,800
わらべや日洋	5,900	2,241.00	13,221,900
なとり	5,100	1,694.00	8,639,400
ユーグレナ	36,700	1,806.00	66,280,200

ミヨシ油脂	38,000	141.00	5,358,000
理研ビタミン	3,200	3,845.00	12,304,000
片倉工業	13,000	1,317.00	17,121,000
ゲンゼ	83,000	361.00	29,963,000
東洋紡	405,000	171.00	69,255,000
ユニチカ	297,000	57.00	16,929,000
富士紡ホールディングス	50,000	223.00	11,150,000
倉敷紡績	105,000	217.00	22,785,000
シキボウ	59,000	124.00	7,316,000
日本毛織	32,000	889.00	28,448,000
トーア紡コーポレーション	4,300	675.00	2,902,500
ダイドーリミテッド	11,400	499.00	5,688,600
帝国繊維	10,700	1,670.00	17,869,000
帝人	417,000	413.00	172,221,000
東レ	740,000	1,080.00	799,200,000
サカイオーベックス	27,000	233.00	6,291,000
住江織物	28,000	351.00	9,828,000
日本フェルト	5,400	504.00	2,721,600
イチカワ	7,000	334.00	2,338,000
芦森工業	27,000	204.00	5,508,000
アツギ	86,000	120.00	10,320,000
ダイニック	19,000	177.00	3,363,000
セーレン	25,400	1,391.00	35,331,400
東海染工	14,000	135.00	1,890,000
小松精練	16,800	688.00	11,558,400
ワコールホールディングス	61,000	1,456.00	88,816,000
ホギメディカル	6,400	6,190.00	39,616,000
レナウン	24,800	128.00	3,174,400
クラウドディア	3,700	573.00	2,120,100
T S Iホールディングス	45,600	844.00	38,486,400
三陽商会	59,000	285.00	16,815,000
オンワードホールディングス	68,000	755.00	51,340,000
ルック	21,000	170.00	3,570,000
ゴールドウイン	4,600	5,260.00	24,196,000
デサント	23,300	1,408.00	32,806,400
キング	5,100	421.00	2,147,100
ヤマトインターナショナル	6,700	415.00	2,780,500
特種東海製紙	59,000	369.00	21,771,000
王子ホールディングス	418,000	498.00	208,164,000
日本製紙	52,700	1,903.00	100,288,100
三菱製紙	155,000	86.00	13,330,000
北越紀州製紙	63,300	735.00	46,525,500

中越パルプ工業	39,000	202.00	7,878,000	
巴川製紙所	16,000	231.00	3,696,000	
大王製紙	45,100	1,055.00	47,580,500	
レンゴー	90,000	510.00	45,900,000	
トーモク	32,000	283.00	9,056,000	
ザ・パック	7,200	3,135.00	22,572,000	
クラレ	160,900	1,520.00	244,568,000	
旭化成	636,000	797.60	507,273,600	
共和レザー	6,700	927.00	6,210,900	
昭和電工	679,000	151.00	102,529,000	
住友化学	751,000	682.00	512,182,000	
日本化成	19,000	135.00	2,565,000	
住友精化	21,000	737.00	15,477,000	
日産化学工業	61,300	2,843.00	174,275,900	
ラサ工業	38,000	140.00	5,320,000	
クレハ	77,000	466.00	35,882,000	
多木化学	7,000	746.00	5,222,000	
テイカ	17,000	600.00	10,200,000	
石原産業	173,000	103.00	17,819,000	
片倉コープアグリ	11,000	253.00	2,783,000	
日東エフシー	6,000	887.00	5,322,000	
日本曹達	66,000	707.00	46,662,000	
東ソー	275,000	648.00	178,200,000	
トクヤマ	169,000	265.00	44,785,000	
セントラル硝子	110,000	561.00	61,710,000	
東亜合成	63,800	1,017.00	64,884,600	
大阪ソーダ	41,000	435.00	17,835,000	
関東電化工業	24,000	814.00	19,536,000	
デンカ	211,000	533.00	112,463,000	
信越化学工業	182,900	6,741.00	1,232,928,900	
日本カーバイド工業	35,000	179.00	6,265,000	
堺化学工業	41,000	423.00	17,343,000	
エア・ウォーター	84,000	1,890.00	158,760,000	
大陽日酸	78,500	1,076.00	84,466,000	
日本化学工業	38,000	278.00	10,564,000	
日本パーカライズニング	52,100	1,223.00	63,718,300	
高压ガス工業	15,000	676.00	10,140,000	
チタン工業	12,000	212.00	2,544,000	
四国化成工業	15,000	1,120.00	16,800,000	
戸田工業	20,000	325.00	6,500,000	
ステラ ケミファ	5,200	1,459.00	7,586,800	
保土谷化学工業	31,000	225.00	6,975,000	

日本触媒	14,800	9,130.00	135,124,000	
大日精化工業	39,000	559.00	21,801,000	
カネカ	138,000	1,174.00	162,012,000	
三菱瓦斯化学	175,000	614.00	107,450,000	
三井化学	432,000	520.00	224,640,000	
J S R	100,700	1,829.00	184,180,300	
東京応化工業	20,400	3,700.00	75,480,000	
大阪有機化学工業	7,400	591.00	4,373,400	
三菱ケミカルホールディングス	683,000	765.10	522,563,300	
日本合成化学工業	24,000	863.00	20,712,000	
ダイセル	143,400	1,772.00	254,104,800	
住友ベークライト	95,000	500.00	47,500,000	
積水化学工業	236,000	1,551.00	366,036,000	
日本ゼオン	88,000	959.00	84,392,000	
アイカ工業	30,700	2,396.00	73,557,200	
宇部興産	546,000	248.00	135,408,000	
積水樹脂	15,700	1,594.00	25,025,800	
タキロン	22,000	567.00	12,474,000	
旭有機材工業	33,000	231.00	7,623,000	
日立化成	50,400	1,935.00	97,524,000	
ニチバン	10,000	613.00	6,130,000	
リケンテクノス	16,500	412.00	6,798,000	
大倉工業	24,000	360.00	8,640,000	
積水化成品工業	26,000	382.00	9,932,000	
群栄化学工業	27,000	315.00	8,505,000	
タイガースポリマー	5,100	724.00	3,692,400	
ミライアル	3,700	1,120.00	4,144,000	
ダイキアクシス	1,900	977.00	1,856,300	
ダイキョーニシカワ	3,300	8,320.00	27,456,000	
日本化薬	66,000	1,345.00	88,770,000	
カーリットホールディングス	9,500	525.00	4,987,500	
日本精化	8,400	965.00	8,106,000	
A D E K A	50,100	1,716.00	85,971,600	
日油	78,000	931.00	72,618,000	
ハリマ化成グループ	8,800	588.00	5,174,400	
花王	274,200	6,054.00	1,660,006,800	
第一工業製薬	22,000	355.00	7,810,000	
ニイタカ	1,500	1,467.00	2,200,500	
三洋化成工業	32,000	979.00	31,328,000	
大日本塗料	58,000	225.00	13,050,000	
日本ペイントホールディングス	78,700	2,840.00	223,508,000	
関西ペイント	115,400	1,818.00	209,797,200	

神東塗料	8,000	208.00	1,664,000	
中国塗料	29,000	822.00	23,838,000	
日本特殊塗料	7,100	1,102.00	7,824,200	
藤倉化成	13,800	570.00	7,866,000	
太陽ホールディングス	7,500	4,600.00	34,500,000	
D I C	409,000	348.00	142,332,000	
サカティンクス	20,800	1,205.00	25,064,000	
東洋インキS Cホールディングス	101,000	488.00	49,288,000	
T & K T O K A	3,500	2,290.00	8,015,000	
富士フィルムホールディングス	233,300	4,854.00	1,132,438,200	
資生堂	193,500	2,710.00	524,385,000	
ライオン	118,000	1,170.00	138,060,000	
高砂香料工業	6,700	2,931.00	19,637,700	
マンダム	9,500	4,575.00	43,462,500	
ミルボン	6,000	4,625.00	27,750,000	
ファンケル	23,700	1,719.00	40,740,300	
コーセー	16,500	11,690.00	192,885,000	
コタ	3,200	1,358.00	4,345,600	
シーズ・ホールディングス	13,900	2,363.00	32,845,700	
シーボン	1,200	2,552.00	3,062,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	10,400	8,200.00	85,280,000	
ノエビアホールディングス	6,400	3,270.00	20,928,000	
アジュバンコスメジャパン	2,000	1,000.00	2,000,000	
エステー	7,000	1,117.00	7,819,000	
アグロ カネショウ	4,000	980.00	3,920,000	
コニシ	8,000	2,460.00	19,680,000	
長谷川香料	12,900	1,524.00	19,659,600	
星光P M C	5,600	1,144.00	6,406,400	
小林製薬	15,400	9,910.00	152,614,000	
荒川化学工業	8,700	1,156.00	10,057,200	
メック	8,000	857.00	6,856,000	
日本高純度化学	2,900	2,350.00	6,815,000	
J C U	2,800	4,485.00	12,558,000	
新田ゼラチン	6,300	718.00	4,523,400	
デクセリアルズ	22,900	1,338.00	30,640,200	
アース製薬	7,300	5,040.00	36,792,000	
イハラケミカル工業	15,700	1,535.00	24,099,500	
北興化学工業	11,000	470.00	5,170,000	
大成ラミック	2,900	3,095.00	8,975,500	
クミアイ化学工業	21,000	1,031.00	21,651,000	
日本農薬	23,300	758.00	17,661,400	
アキレス	87,000	154.00	13,398,000	

有沢製作所	15,100	802.00	12,110,200
日東電工	78,800	8,580.00	676,104,000
レック	3,200	1,312.00	4,198,400
きもと	16,800	273.00	4,586,400
藤森工業	8,800	3,160.00	27,808,000
前澤化成工業	7,100	1,120.00	7,952,000
JSP	6,700	2,408.00	16,133,600
エフピコ	9,000	4,470.00	40,230,000
天馬	7,900	2,217.00	17,514,300
信越ポリマー	20,000	676.00	13,520,000
東リ	26,000	336.00	8,736,000
ニフコ	19,500	5,330.00	103,935,000
日本バルカー工業	40,000	302.00	12,080,000
ユニ・チャーム	206,400	2,438.50	503,306,400
協和発酵キリン	122,000	2,082.00	254,004,000
武田薬品工業	406,000	5,749.00	2,334,094,000
アステラス製薬	1,141,700	1,660.00	1,895,222,000
大日本住友製薬	72,200	1,410.00	101,802,000
塩野義製薬	148,600	5,247.00	779,704,200
田辺三菱製薬	118,800	2,021.00	240,094,800
わかもと製薬	12,000	281.00	3,372,000
あすか製薬	12,100	1,535.00	18,573,500
日本新薬	23,000	4,835.00	111,205,000
バイオフェルミン製薬	1,700	3,755.00	6,383,500
中外製薬	101,500	4,140.00	420,210,000
科研製薬	17,600	7,520.00	132,352,000
エーザイ	125,500	7,639.00	958,694,500
ロート製薬	49,900	2,322.00	115,867,800
小野薬品工業	46,300	19,495.00	902,618,500
久光製薬	31,600	5,040.00	159,264,000
有機合成薬品工業	7,000	297.00	2,079,000
持田製薬	7,000	7,580.00	53,060,000
参天製薬	187,600	1,919.00	360,004,400
扶桑薬品工業	34,000	279.00	9,486,000
日本ケミファ	13,000	630.00	8,190,000
ツムラ	32,100	3,535.00	113,473,500
日医工	23,800	2,922.00	69,543,600
キッセイ薬品工業	18,100	2,966.00	53,684,600
生化学工業	19,500	1,625.00	31,687,500
栄研化学	8,600	2,067.00	17,776,200
日水製薬	4,100	1,365.00	5,596,500
鳥居薬品	7,000	2,660.00	18,620,000

JCRファーマ	7,800	2,713.00	21,161,400
東和薬品	4,700	7,420.00	34,874,000
富士製薬工業	2,800	2,118.00	5,930,400
沢井製薬	17,300	7,880.00	136,324,000
ゼリア新薬工業	20,900	1,580.00	33,022,000
第一三共	342,900	2,473.00	847,991,700
キョーリン製薬ホールディングス	27,200	2,463.00	66,993,600
大幸薬品	4,600	1,723.00	7,925,800
ダイト	4,500	3,075.00	13,837,500
大塚ホールディングス	219,200	4,186.00	917,571,200
大正製薬ホールディングス	24,500	8,150.00	199,675,000
日本コークス工業	82,300	102.00	8,394,600
昭和シェル石油	102,500	1,077.00	110,392,500
ニチレキ	12,000	963.00	11,556,000
東燃ゼネラル石油	154,000	1,155.00	177,870,000
ユシロ化学工業	5,500	1,416.00	7,788,000
ピーピー・カストロール	4,200	1,321.00	5,548,200
富士石油	23,600	361.00	8,519,600
MORESCO	2,700	1,690.00	4,563,000
出光興産	53,200	2,013.00	107,091,600
JXホールディングス	1,206,900	509.10	614,432,790
コスモエネルギーホールディングス	30,700	1,670.00	51,269,000
横浜ゴム	61,500	1,983.00	121,954,500
東洋ゴム工業	46,100	2,514.00	115,895,400
ブリヂストン	344,100	4,257.00	1,464,833,700
住友ゴム工業	95,400	1,640.00	156,456,000
藤倉ゴム工業	8,500	585.00	4,972,500
オカモト	32,000	1,051.00	33,632,000
フコク	3,700	1,066.00	3,944,200
ニッタ	11,000	3,260.00	35,860,000
住友理工	22,000	1,044.00	22,968,000
三ツ星ベルト	25,000	955.00	23,875,000
バンドー化学	37,000	523.00	19,351,000
日東紡績	69,000	331.00	22,839,000
旭硝子	538,000	696.00	374,448,000
日本板硝子	492,000	102.00	50,184,000
石塚硝子	13,000	228.00	2,964,000
日本山村硝子	42,000	182.00	7,644,000
日本電気硝子	211,000	649.00	136,939,000
オハラ	3,900	626.00	2,441,400
住友大阪セメント	202,000	434.00	87,668,000
太平洋セメント	636,000	359.00	228,324,000



デイ・シイ	11,200	339.00	3,796,800
日本ヒューム	9,800	730.00	7,154,000
日本コンクリート工業	18,700	344.00	6,432,800
三谷セキサン	5,100	1,600.00	8,160,000
アジアパイルホールディングス	12,700	540.00	6,858,000
東海カーボン	89,000	346.00	30,794,000
日本カーボン	51,000	324.00	16,524,000
東洋炭素	5,700	1,807.00	10,299,900
ノリタケカンパニーリミテド	58,000	277.00	16,066,000
TOTO	74,900	4,005.00	299,974,500
日本碍子	129,000	2,721.00	351,009,000
日本特殊陶業	87,800	3,320.00	291,496,000
MARUWA	3,000	2,842.00	8,526,000
品川リフラクトリーズ	26,000	251.00	6,526,000
黒崎播磨	24,000	276.00	6,624,000
ヨータイ	6,000	340.00	2,040,000
イソライト工業	7,700	246.00	1,894,200
東京窯業	13,000	181.00	2,353,000
ニッカトー	3,600	416.00	1,497,600
フジインコーポレーテッド	9,000	1,579.00	14,211,000
ニチアス	52,000	812.00	42,224,000
ニチハ	13,600	1,856.00	25,241,600
新日鐵住金	459,600	2,374.50	1,091,320,200
神戸製鋼所	1,874,000	138.00	258,612,000
合同製鐵	53,000	234.00	12,402,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	278,700	1,848.00	515,037,600
日新製鋼	46,800	1,329.00	62,197,200
東京製鐵	56,300	749.00	42,168,700
共英製鋼	11,000	2,100.00	23,100,000
大和工業	22,700	3,055.00	69,348,500
東京鐵鋼	20,000	569.00	11,380,000
大阪製鐵	6,400	2,212.00	14,156,800
淀川製鋼所	15,200	2,415.00	36,708,000
東洋鋼鈹	24,800	423.00	10,490,400
丸一鋼管	34,200	3,405.00	116,451,000
モリ工業	17,000	364.00	6,188,000
大同特殊鋼	172,000	485.00	83,420,000
日本高周波鋼業	44,000	100.00	4,400,000
日本冶金工業	78,600	153.00	12,025,800
山陽特殊製鋼	61,000	542.00	33,062,000
愛知製鋼	61,000	539.00	32,879,000
日立金属	116,900	1,545.00	180,610,500

日本金属	26,000	136.00	3,536,000	
大平洋金属	72,000	310.00	22,320,000	
新日本電工	59,100	221.00	13,061,100	
栗本鐵工所	50,000	226.00	11,300,000	
虹技	14,000	184.00	2,576,000	
日本鑄鉄管	12,000	193.00	2,316,000	
三菱製鋼	68,000	239.00	16,252,000	
日亜鋼業	15,500	277.00	4,293,500	
日本精線	8,000	592.00	4,736,000	
シンニッタン	9,400	605.00	5,687,000	
新家工業	23,000	139.00	3,197,000	
大紀アルミニウム工業所	16,000	321.00	5,136,000	
日本軽金属ホールディングス	230,800	206.00	47,544,800	
三井金属鉱業	260,000	227.00	59,020,000	
東邦亜鉛	54,000	283.00	15,282,000	
三菱マテリアル	636,000	416.00	264,576,000	
住友金属鉱山	281,000	1,385.00	389,185,000	
D O W Aホールディングス	131,000	890.00	116,590,000	
古河機械金属	159,000	232.00	36,888,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,000	2,683.00	26,830,000	
東邦チタニウム	17,200	1,122.00	19,298,400	
U A C J	143,000	284.00	40,612,000	
古河電気工業	321,000	272.00	87,312,000	
住友電気工業	408,000	1,660.00	677,280,000	
フジクラ	142,000	688.00	97,696,000	
昭和電線ホールディングス	113,000	76.00	8,588,000	
東京特殊電線	1,700	1,130.00	1,921,000	
タツタ電線	19,400	465.00	9,021,000	
沖電線	13,000	268.00	3,484,000	
カナレ電気	1,800	2,062.00	3,711,600	
平河ヒューテック	2,600	1,802.00	4,685,200	
リョービ	62,000	512.00	31,744,000	
アーレスティ	11,800	824.00	9,723,200	
アサヒホールディングス	15,400	1,856.00	28,582,400	
稲葉製作所	5,400	1,290.00	6,966,000	
宮地エンジニアリンググループ	35,000	195.00	6,825,000	
トーカロ	6,800	2,575.00	17,510,000	
アルファC o	4,100	1,283.00	5,260,300	
S U M C O	80,600	1,146.00	92,367,600	
川田テクノロジーズ	2,200	3,925.00	8,635,000	
東洋製罐グループホールディングス	72,600	2,374.00	172,352,400	
ホッカンホールディングス	28,000	328.00	9,184,000	

コロナ	5,300	1,190.00	6,307,000	
横河ブリッジホールディングス	19,500	1,374.00	26,793,000	
駒井ハルテック	22,000	255.00	5,610,000	
高田機工	10,000	220.00	2,200,000	
三和ホールディングス	103,600	1,015.00	105,154,000	
文化シャッター	28,400	1,040.00	29,536,000	
三協立山	13,800	1,642.00	22,659,600	
アルインコ	4,400	1,130.00	4,972,000	
東洋シャッター	3,000	762.00	2,286,000	
LIXILグループ	141,900	2,719.00	385,826,100	
日本フィルコン	9,000	511.00	4,599,000	
ノーリツ	20,000	1,774.00	35,480,000	
長府製作所	10,900	2,717.00	29,615,300	
リンナイ	18,900	10,710.00	202,419,000	
ダイニチ工業	5,200	730.00	3,796,000	
日東精工	15,000	330.00	4,950,000	
三洋工業	15,000	177.00	2,655,000	
岡部	21,200	910.00	19,292,000	
ジーテクト	9,700	1,723.00	16,713,100	
東プレ	19,600	2,755.00	53,998,000	
高周波熱錬	17,800	939.00	16,714,200	
サンコール	5,400	590.00	3,186,000	
モリテック スチール	6,100	286.00	1,744,600	
パイオラックス	5,200	6,460.00	33,592,000	
日本発條	95,900	1,230.00	117,957,000	
中央発條	13,000	294.00	3,822,000	
アドバネクス	2,600	1,793.00	4,661,800	
立川ブラインド工業	4,300	845.00	3,633,500	
三益半導体工業	7,500	1,183.00	8,872,500	
日本ドライケミカル	1,300	2,203.00	2,863,900	
日本製鋼所	169,000	436.00	73,684,000	
三浦工業	45,500	1,706.00	77,623,000	
タクマ	38,000	1,028.00	39,064,000	
ツガミ	30,000	532.00	15,960,000	
オークマ	66,000	1,084.00	71,544,000	
東芝機械	56,000	409.00	22,904,000	
アマダホールディングス	151,900	1,191.00	180,912,900	
アイダエンジニアリング	26,800	1,259.00	33,741,200	
滝澤鉄工所	32,000	169.00	5,408,000	
富士機械製造	33,300	1,196.00	39,826,800	
牧野フライス製作所	51,000	960.00	48,960,000	
オーエスジー	46,400	2,309.00	107,137,600	

ダイジェット工業	14,000	173.00	2,422,000
旭ダイヤモンド工業	28,000	1,391.00	38,948,000
D M G 森精機	56,300	1,579.00	88,897,700
ソディック	19,400	945.00	18,333,000
ディスコ	13,000	11,890.00	154,570,000
日東工器	5,900	2,672.00	15,764,800
パンチ工業	3,600	983.00	3,538,800
豊和工業	6,000	662.00	3,972,000
O K K	42,000	151.00	6,342,000
東洋機械金属	7,000	442.00	3,094,000
津田駒工業	25,000	124.00	3,100,000
島精機製作所	14,400	1,933.00	27,835,200
日阪製作所	12,900	970.00	12,513,000
やまびこ	18,700	1,119.00	20,925,300
ペガサスミシン製造	9,000	504.00	4,536,000
ナプテスコ	54,300	2,547.00	138,302,100
三井海洋開発	11,900	1,753.00	20,860,700
レオン自動機	7,800	800.00	6,240,000
S M C	30,500	31,800.00	969,900,000
新川	8,600	561.00	4,824,600
ホソカワミクロン	17,000	640.00	10,880,000
ユニオンツール	4,400	3,460.00	15,224,000
オイレス工業	12,200	2,049.00	24,997,800
日精エー・エス・ビー機械	3,700	2,184.00	8,080,800
サトーホールディングス	13,700	2,638.00	36,140,600
日本エアーテック	3,600	694.00	2,498,400
日精樹脂工業	7,500	1,041.00	7,807,500
ワイエイシイ	4,100	902.00	3,698,200
小松製作所	499,500	1,975.50	986,762,250
住友重機械工業	297,000	526.00	156,222,000
日立建機	45,600	1,909.00	87,050,400
日工	14,000	403.00	5,642,000
巴工業	4,100	1,547.00	6,342,700
井関農機	105,000	199.00	20,895,000
T O W A	8,400	763.00	6,409,200
丸山製作所	23,000	201.00	4,623,000
北川鉄工所	47,000	269.00	12,643,000
クボタ	490,000	2,021.50	990,535,000
荏原実業	3,100	1,480.00	4,588,000
三菱化工機	34,000	284.00	9,656,000
月島機械	18,100	1,132.00	20,489,200
帝国電機製作所	6,900	850.00	5,865,000

新東工業	23,200	1,013.00	23,501,600
澁谷工業	8,500	1,786.00	15,181,000
アイチ コーポレーション	14,500	823.00	11,933,500
小森コーポレーション	24,800	1,463.00	36,282,400
鶴見製作所	7,600	1,869.00	14,204,400
住友精密工業	16,000	460.00	7,360,000
酒井重工業	20,000	232.00	4,640,000
荏原製作所	225,000	576.00	129,600,000
石井鐵工所	16,000	194.00	3,104,000
西島製作所	10,200	1,018.00	10,383,600
北越工業	10,100	840.00	8,484,000
ダイキン工業	141,800	8,650.00	1,226,570,000
オルガノ	18,000	489.00	8,802,000
トーヨーカネツ	55,000	260.00	14,300,000
栗田工業	61,300	2,610.00	159,993,000
椿本チエイン	58,000	909.00	52,722,000
大同工業	22,000	228.00	5,016,000
日本コンベヤ	32,000	182.00	5,824,000
木村化工機	9,400	447.00	4,201,800
アネスト岩田	15,400	968.00	14,907,200
ダイフク	48,100	2,002.00	96,296,200
サムコ	1,600	1,016.00	1,625,600
加藤製作所	22,000	543.00	11,946,000
油研工業	20,000	257.00	5,140,000
タダノ	47,000	1,509.00	70,923,000
フジテック	28,300	1,246.00	35,261,800
C K D	27,100	1,250.00	33,875,000
キトー	10,800	995.00	10,746,000
平和	30,200	2,252.00	68,010,400
理想科学工業	10,700	1,924.00	20,586,800
S A N K Y O	27,100	4,625.00	125,337,500
日本金銭機械	9,000	1,250.00	11,250,000
マースエンジニアリング	5,500	2,038.00	11,209,000
福島工業	5,400	2,486.00	13,424,400
オーイズミ	3,400	745.00	2,533,000
ダイコク電機	4,000	1,504.00	6,016,000
竹内製作所	14,400	2,580.00	37,152,000
アマノ	30,100	1,567.00	47,166,700
J U K I	14,400	1,142.00	16,444,800
サンデンホールディングス	59,000	390.00	23,010,000
蛇の目ミシン工業	9,400	789.00	7,416,600
マックス	15,000	1,249.00	18,735,000

グローリー	33,200	3,450.00	114,540,000
新晃工業	6,800	1,373.00	9,336,400
大和冷機工業	15,600	978.00	15,256,800
セガサミーホールディングス	104,600	1,212.00	126,775,200
日本ピストンリング	3,800	2,074.00	7,881,200
リケン	42,000	435.00	18,270,000
T P R	12,000	3,420.00	41,040,000
ホシザキ電機	21,300	8,120.00	172,956,000
大豊工業	7,800	1,398.00	10,904,400
日本精工	200,000	1,451.00	290,200,000
N T N	241,000	551.00	132,791,000
ジェイテクト	103,800	2,104.00	218,395,200
不二越	90,000	561.00	50,490,000
日本トムソン	33,000	537.00	17,721,000
T H K	64,700	2,356.00	152,433,200
ユーシン精機	3,800	2,363.00	8,979,400
前澤給装工業	3,700	1,531.00	5,664,700
イーグル工業	12,000	2,269.00	27,228,000
前澤工業	7,100	393.00	2,790,300
日本ピラー工業	9,800	1,047.00	10,260,600
キッツ	44,200	550.00	24,310,000
日立工機	26,000	898.00	23,348,000
マキタ	63,500	6,720.00	426,720,000
日立造船	76,600	663.00	50,785,800
三菱重工業	1,734,000	597.20	1,035,544,800
I H I	748,000	328.00	245,344,000
日清紡ホールディングス	54,000	1,299.00	70,146,000
イビデン	63,900	1,841.00	117,639,900
コニカミノルタ	243,200	1,242.00	302,054,400
ブラザー工業	125,900	1,465.00	184,443,500
ミネベア	157,000	1,209.00	189,813,000
日立製作所	2,484,000	711.70	1,767,862,800
東芝	2,049,000	299.30	613,265,700
三菱電機	1,038,000	1,306.50	1,356,147,000
富士電機	293,000	528.00	154,704,000
東洋電機製造	19,000	433.00	8,227,000
安川電機	120,600	1,623.00	195,733,800
シンフォニアテクノロジー	63,000	197.00	12,411,000
明電舎	89,000	470.00	41,830,000
オリジン電気	14,000	334.00	4,676,000
山洋電気	26,000	744.00	19,344,000
デンヨー	8,400	1,922.00	16,144,800

東芝テック	70,000	377.00	26,390,000
芝浦メカトロニクス	16,000	242.00	3,872,000
マブチモーター	27,900	6,570.00	183,303,000
日本電産	117,200	9,197.00	1,077,888,400
東光高岳	5,000	1,536.00	7,680,000
ダイヘン	57,000	536.00	30,552,000
田淵電機	11,100	789.00	8,757,900
ヤーマン	1,300	1,809.00	2,351,700
JVCケンウッド	71,600	315.00	22,554,000
ミマキエンジニアリング	6,000	501.00	3,006,000
第一精工	4,100	1,665.00	6,826,500
日新電機	22,800	933.00	21,272,400
大崎電気工業	18,000	687.00	12,366,000
オムロン	111,700	4,410.00	492,597,000
日東工業	15,600	2,080.00	32,448,000
I D E C	11,700	1,036.00	12,121,200
不二電機工業	900	1,504.00	1,353,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	188,000	451.00	84,788,000
サクサホールディングス	25,000	250.00	6,250,000
メルコホールディングス	5,400	2,009.00	10,848,600
テクノメディカ	2,200	2,750.00	6,050,000
日本電気	1,338,000	389.00	520,482,000
富士通	939,000	648.70	609,129,300
沖電気工業	422,000	156.00	65,832,000
岩崎通信機	43,000	79.00	3,397,000
電気興業	26,000	531.00	13,806,000
サンケン電気	50,000	486.00	24,300,000
ナカヨ	9,000	365.00	3,285,000
アイホン	5,000	2,046.00	10,230,000
ルネサスエレクトロニクス	50,500	841.00	42,470,500
セイコーエプソン	145,000	1,946.00	282,170,000
ワコム	76,800	472.00	36,249,600
アルバック	16,400	3,275.00	53,710,000
アクセル	4,600	1,372.00	6,311,200
E I Z O	9,000	2,858.00	25,722,000
ジャパンディスプレイ	181,900	367.00	66,757,300
日本信号	26,900	1,290.00	34,701,000
京三製作所	23,000	354.00	8,142,000
能美防災	11,100	1,559.00	17,304,900
ホーチキ	7,100	1,079.00	7,660,900
エレコム	7,300	1,582.00	11,548,600
日本無線	21,000	379.00	7,959,000

パナソニック	1,112,200	1,276.50	1,419,723,300
シャープ	823,000	125.00	102,875,000
アンリツ	58,400	804.00	46,953,600
富士通ゼネラル	30,000	1,613.00	48,390,000
日立国際電気	22,000	1,770.00	38,940,000
ソニー	686,800	3,005.00	2,063,834,000
T D K	58,800	8,750.00	514,500,000
帝国通信工業	23,000	205.00	4,715,000
ミツミ電機	34,800	646.00	22,480,800
タムラ製作所	38,000	377.00	14,326,000
アルプス電気	82,300	3,560.00	292,988,000
池上通信機	31,000	182.00	5,642,000
パイオニア	157,500	352.00	55,440,000
日本電波工業	8,900	807.00	7,182,300
鈴木	2,600	612.00	1,591,200
日本トリム	2,400	4,030.00	9,672,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	2,656.00	12,748,800
フォスター電機	12,200	2,678.00	32,671,600
クラリオン	51,000	420.00	21,420,000
S M K	29,000	641.00	18,589,000
ヨコオ	7,000	578.00	4,046,000
東光	20,000	389.00	7,780,000
ホシデン	29,600	675.00	19,980,000
ヒロセ電機	15,700	15,060.00	236,442,000
日本航空電子工業	28,000	2,000.00	56,000,000
T O A	10,600	1,266.00	13,419,600
日立マクセル	16,200	2,083.00	33,744,600
古野電気	11,600	889.00	10,312,400
ユニデンホールディングス	27,000	167.00	4,509,000
アルパイン	23,200	1,583.00	36,725,600
スミダコーポレーション	8,000	790.00	6,320,000
アイコム	5,400	2,538.00	13,705,200
リオン	3,700	1,755.00	6,493,500
船井電機	9,800	976.00	9,564,800
横河電機	97,400	1,440.00	140,256,000
新電元工業	34,000	468.00	15,912,000
アズビル	31,800	3,075.00	97,785,000
東亜ディーケーケー	4,200	564.00	2,368,800
日本光電工業	40,700	2,643.00	107,570,100
チノー	3,500	1,114.00	3,899,000
共和電業	11,900	441.00	5,247,900
日本電子材料	3,800	617.00	2,344,600



堀場製作所	18,000	4,420.00	79,560,000
アドバンテスト	66,400	1,077.00	71,512,800
小野測器	4,800	936.00	4,492,800
エスペック	10,100	1,504.00	15,190,400
パナソニック デバイスSUNX	8,600	682.00	5,865,200
キーエンス	22,100	64,260.00	1,420,146,000
日置電機	5,100	2,262.00	11,536,200
シスメックス	75,500	7,300.00	551,150,000
メガチップス	10,200	1,128.00	11,505,600
OBARA GROUP	6,300	4,235.00	26,680,500
澤藤電機	5,000	223.00	1,115,000
コーセル	13,500	1,152.00	15,552,000
新日本無線	7,000	578.00	4,046,000
オブテックス	7,200	2,744.00	19,756,800
千代田インテグレ	5,100	2,776.00	14,157,600
レーザーテック	10,000	1,322.00	13,220,000
スタンレー電気	69,900	2,610.00	182,439,000
岩崎電気	33,000	252.00	8,316,000
ウシオ電機	59,100	1,733.00	102,420,300
岡谷電機産業	5,400	389.00	2,100,600
ヘリオス テクノ ホールディング	8,400	449.00	3,771,600
日本セラミック	5,600	1,964.00	10,998,400
遠藤照明	4,600	1,202.00	5,529,200
日本デジタル研究所	8,200	1,630.00	13,366,000
古河電池	7,000	801.00	5,607,000
双信電機	4,900	325.00	1,592,500
山一電機	8,500	864.00	7,344,000
図研	7,100	1,208.00	8,576,800
日本電子	38,000	775.00	29,450,000
カシオ計算機	97,600	2,672.00	260,787,200
ファナック	99,600	21,130.00	2,104,548,000
日本シイエムケイ	21,200	339.00	7,186,800
エンプラス	5,000	4,740.00	23,700,000
大真空	18,000	243.00	4,374,000
ローム	48,000	6,610.00	317,280,000
浜松ホトニクス	76,000	3,175.00	241,300,000
三井ハイテック	13,000	709.00	9,217,000
新光電気工業	36,800	845.00	31,096,000
京セラ	159,800	5,606.00	895,838,800
太陽誘電	47,400	1,913.00	90,676,200
村田製作所	102,100	18,970.00	1,936,837,000
ユーシン	12,400	737.00	9,138,800

双葉電子工業	16,700	1,670.00	27,889,000
北陸電気工業	39,000	184.00	7,176,000
ニチコン	30,700	968.00	29,717,600
日本ケミコン	79,000	237.00	18,723,000
K O A	13,500	1,030.00	13,905,000
市光工業	23,000	266.00	6,118,000
小糸製作所	58,300	4,895.00	285,378,500
ミツバ	16,600	1,975.00	32,785,000
スター精密	18,500	1,581.00	29,248,500
S C R E E Nホールディングス	100,000	881.00	88,100,000
キャノン電子	9,000	2,017.00	18,153,000
キャノン	524,100	3,668.00	1,922,398,800
リコー	315,200	1,239.00	390,532,800
M U T O Hホールディングス	12,000	285.00	3,420,000
東京エレクトロン	87,300	7,798.00	680,765,400
トヨタ紡織	34,100	2,510.00	85,591,000
鬼怒川ゴム工業	22,000	688.00	15,136,000
ユニプレス	20,200	2,880.00	58,176,000
豊田自動織機	88,900	6,390.00	568,071,000
モリタホールディングス	17,100	1,293.00	22,110,300
三櫻工業	13,800	741.00	10,225,800
デンソー	240,700	5,692.00	1,370,064,400
東海理化電機製作所	28,500	2,906.00	82,821,000
三井造船	377,000	190.00	71,630,000
川崎重工業	758,000	465.00	352,470,000
名村造船所	27,400	1,075.00	29,455,000
サノヤスホールディングス	12,000	251.00	3,012,000
日本車輛製造	36,000	301.00	10,836,000
ニチユ三菱フォークリフト	11,200	504.00	5,644,800
近畿車輛	15,000	404.00	6,060,000
日産自動車	1,366,500	1,246.50	1,703,342,250
いすゞ自動車	282,100	1,337.00	377,167,700
トヨタ自動車	1,239,800	7,601.00	9,423,719,800
日野自動車	138,900	1,447.00	200,988,300
三菱自動車工業	386,500	1,075.00	415,487,500
エフテック	6,100	1,223.00	7,460,300
レシップホールディングス	3,200	838.00	2,681,600
G M B	2,200	1,032.00	2,270,400
ファルテック	2,100	1,554.00	3,263,400
武蔵精密工業	10,400	2,504.00	26,041,600
日産車体	47,500	1,356.00	64,410,000
新明和工業	42,000	1,140.00	47,880,000

極東開発工業	18,300	1,346.00	24,631,800
日信工業	21,800	1,818.00	39,632,400
トピー工業	83,000	268.00	22,244,000
ティラド	38,000	192.00	7,296,000
曙ブレーキ工業	49,300	306.00	15,085,800
タチエス	15,500	2,010.00	31,155,000
N O K	47,100	3,100.00	146,010,000
フタバ産業	31,600	537.00	16,969,200
K Y B	109,000	387.00	42,183,000
シロキ工業	22,000	368.00	8,096,000
大同メタル工業	13,600	1,089.00	14,810,400
プレス工業	49,600	534.00	26,486,400
ミクニ	10,500	429.00	4,504,500
カルソニックカンセイ	74,000	1,048.00	77,552,000
太平洋工業	21,500	1,254.00	26,961,000
ケーヒン	22,400	1,970.00	44,128,000
河西工業	12,000	1,811.00	21,732,000
アイシン精機	98,200	5,050.00	495,910,000
富士機工	11,400	490.00	5,586,000
マツダ	308,300	2,518.00	776,299,400
ダイハツ工業	116,200	1,640.00	190,568,000
今仙電機製作所	8,400	1,277.00	10,726,800
本田技研工業	876,100	3,889.00	3,407,152,900
スズキ	203,500	3,700.00	752,950,000
富士重工業	307,600	4,946.00	1,521,389,600
安永	4,900	561.00	2,748,900
ヤマハ発動機	137,500	2,856.00	392,700,000
ショーワ	25,300	1,160.00	29,348,000
T B K	12,600	477.00	6,010,200
エクセディ	13,500	2,891.00	39,028,500
豊田合成	35,400	2,820.00	99,828,000
愛三工業	17,100	1,242.00	21,238,200
盟和産業	800	1,136.00	908,800
ヨロズ	9,200	2,795.00	25,714,000
エフ・シー・シー	15,900	2,660.00	42,294,000
シマノ	39,300	18,080.00	710,544,000
テイ・エス テック	22,600	3,250.00	73,450,000
ジャムコ	4,300	4,295.00	18,468,500
テルモ	149,200	3,800.00	566,960,000
クリエートメディック	3,300	950.00	3,135,000
日機装	36,500	933.00	34,054,500
島津製作所	125,000	1,927.00	240,875,000

JMS	18,000	324.00	5,832,000
モリテックス	2,100	244.00	512,400
長野計器	6,300	759.00	4,781,700
ブイ・テクノロジー	1,900	5,020.00	9,538,000
東京計器	31,000	234.00	7,254,000
愛知時計電機	13,000	325.00	4,225,000
オーバル	9,700	272.00	2,638,400
東京精密	18,800	2,771.00	52,094,800
マニー	8,900	2,210.00	19,669,000
ニコン	181,800	1,585.00	288,153,000
トプコン	32,700	2,023.00	66,152,100
オリンパス	145,000	4,650.00	674,250,000
理研計器	7,900	1,430.00	11,297,000
タムロン	7,900	2,336.00	18,454,400
HOYA	226,500	4,850.00	1,098,525,000
ノーリツ鋼機	8,800	623.00	5,482,400
エー・アンド・デイ	8,900	430.00	3,827,000
シチズンホールディングス	119,900	871.00	104,432,900
リズム時計工業	43,000	165.00	7,095,000
大研医器	6,900	1,079.00	7,445,100
メニコン	4,900	2,867.00	14,048,300
松風	4,800	1,501.00	7,204,800
セイコーホールディングス	63,000	770.00	48,510,000
ニプロ	72,600	1,337.00	97,066,200
パラマウントベッドホールディングス	10,300	4,245.00	43,723,500
トランザクション	1,500	556.00	834,000
SHO-BI	3,200	398.00	1,273,600
ニホンフラッシュ	2,800	1,214.00	3,399,200
前田工織	10,700	1,115.00	11,930,500
永大産業	14,000	426.00	5,964,000
アートネイチャー	7,100	1,099.00	7,802,900
ダンロップスポーツ	6,100	1,210.00	7,381,000
バンダイナムコホールディングス	100,700	2,660.00	267,862,000
アイフィスジャパン	1,600	495.00	792,000
共立印刷	16,200	303.00	4,908,600
SHOEI	4,700	2,480.00	11,656,000
フランスベッドホールディングス	13,600	981.00	13,341,600
パイロットコーポレーション	17,000	5,040.00	85,680,000
萩原工業	2,000	2,093.00	4,186,000
トッパン・フォームズ	17,400	1,473.00	25,630,200
フジシールインターナショナル	11,800	3,725.00	43,955,000
タカラトミー	32,000	777.00	24,864,000

廣濟堂	9,000	388.00	3,492,000	
A s - me エステール	2,600	731.00	1,900,600	
アーク	31,100	122.00	3,794,200	
タカノ	4,300	710.00	3,053,000	
プロネクサス	9,100	1,027.00	9,345,700	
ホクシン	7,700	126.00	970,200	
ウッドワン	17,000	253.00	4,301,000	
大建工業	38,000	344.00	13,072,000	
凸版印刷	275,000	1,078.00	296,450,000	
大日本印刷	288,000	1,178.00	339,264,000	
図書印刷	16,000	532.00	8,512,000	
共同印刷	30,000	329.00	9,870,000	
日本写真印刷	16,300	2,697.00	43,961,100	
光村印刷	9,000	247.00	2,223,000	
宝印刷	5,100	1,290.00	6,579,000	
アシックス	90,700	2,674.00	242,531,800	
ツツミ	4,900	2,559.00	12,539,100	
小松ウオール工業	3,000	2,131.00	6,393,000	
ヤマハ	71,500	2,928.00	209,352,000	
河合楽器製作所	3,400	2,133.00	7,252,200	
クリナップ	9,000	721.00	6,489,000	
ピジョン	55,200	2,959.00	163,336,800	
兼松日産農林	10,000	164.00	1,640,000	
キングジム	8,100	829.00	6,714,900	
リンテック	23,100	2,582.00	59,644,200	
T A S A K I	1,800	1,655.00	2,979,000	
イトーキ	20,500	907.00	18,593,500	
任天堂	60,000	18,215.00	1,092,900,000	
三菱鉛筆	7,300	5,280.00	38,544,000	
タカラスタANDARD	40,000	918.00	36,720,000	
コクヨ	50,600	1,345.00	68,057,000	
ナカバヤシ	20,000	305.00	6,100,000	
グローブライド	4,700	1,684.00	7,914,800	
岡村製作所	34,000	1,214.00	41,276,000	
美津濃	52,000	590.00	30,680,000	
アデランス	16,900	869.00	14,686,100	
東京電力	825,800	756.00	624,304,800	
中部電力	297,900	1,680.00	500,472,000	
関西電力	397,300	1,399.00	555,822,700	
中国電力	134,600	1,564.00	210,514,400	
北陸電力	95,400	1,724.00	164,469,600	
東北電力	243,200	1,440.00	350,208,000	

四国電力	87,700	1,756.00	154,001,200	
九州電力	215,000	1,332.00	286,380,000	
北海道電力	91,100	1,142.00	104,036,200	
沖縄電力	10,300	3,030.00	31,209,000	
電源開発	83,000	4,050.00	336,150,000	
東京瓦斯	1,087,000	586.00	636,982,000	
大阪瓦斯	1,008,000	449.40	452,995,200	
東邦瓦斯	245,000	764.00	187,180,000	
北海道瓦斯	22,000	277.00	6,094,000	
広島ガス	15,600	449.00	7,004,400	
西部瓦斯	110,000	274.00	30,140,000	
静岡ガス	27,600	776.00	21,417,600	
メタウォーター	6,100	3,125.00	19,062,500	
SBSホールディングス	9,600	999.00	9,590,400	
東武鉄道	520,000	579.00	301,080,000	
相鉄ホールディングス	167,000	682.00	113,894,000	
東京急行電鉄	567,000	918.00	520,506,000	
京浜急行電鉄	267,000	973.00	259,791,000	
小田急電鉄	312,000	1,203.00	375,336,000	
京王電鉄	272,000	979.00	266,288,000	
京成電鉄	146,000	1,445.00	210,970,000	
富士急行	27,000	1,139.00	30,753,000	
新京成電鉄	12,000	441.00	5,292,000	
東日本旅客鉄道	178,000	11,345.00	2,019,410,000	
西日本旅客鉄道	93,700	7,633.00	715,212,100	
東海旅客鉄道	87,200	20,975.00	1,829,020,000	
西武ホールディングス	77,600	2,395.00	185,852,000	
鴻池運輸	13,800	1,441.00	19,885,800	
西日本鉄道	126,000	657.00	82,782,000	
ハマキョウレックス	6,900	2,313.00	15,959,700	
サカイ引越センター	1,700	6,420.00	10,914,000	
近鉄グループホールディングス	980,000	467.00	457,660,000	
阪急阪神ホールディングス	653,000	772.00	504,116,000	
南海電気鉄道	219,000	649.00	142,131,000	
京阪電気鉄道	218,000	793.00	172,874,000	
神戸電鉄	24,000	353.00	8,472,000	
名古屋鉄道	354,000	476.00	168,504,000	
山陽電気鉄道	35,000	452.00	15,820,000	
日本通運	377,000	553.00	208,481,000	
ヤマトホールディングス	179,900	2,374.50	427,172,550	
山九	128,000	596.00	76,288,000	
丸運	5,300	260.00	1,378,000	

丸全昭和運輸	33,000	426.00	14,058,000
センコー	44,000	776.00	34,144,000
トナミホールディングス	20,000	353.00	7,060,000
ニッコンホールディングス	31,800	2,273.00	72,281,400
日本石油輸送	11,000	247.00	2,717,000
福山通運	59,000	580.00	34,220,000
セイノーホールディングス	69,100	1,267.00	87,549,700
神奈川中央交通	11,000	684.00	7,524,000
日立物流	20,300	1,987.00	40,336,100
丸和運輸機関	1,800	2,570.00	4,626,000
C & F ロジホールディングス	9,300	939.00	8,732,700
日本郵船	874,000	301.00	263,074,000
商船三井	475,000	304.00	144,400,000
川崎汽船	426,000	241.00	102,666,000
N S ユナイテッド海運	48,000	230.00	11,040,000
飯野海運	51,700	502.00	25,953,400
共栄タンカー	17,000	214.00	3,638,000
乾汽船	6,600	950.00	6,270,000
日本航空	186,400	4,305.00	802,452,000
A N A ホールディングス	1,807,000	347.00	627,029,000
パスコ	9,000	372.00	3,348,000
トランコム	2,800	6,330.00	17,724,000
日新	37,000	376.00	13,912,000
三菱倉庫	69,000	1,582.00	109,158,000
三井倉庫ホールディングス	56,000	339.00	18,984,000
住友倉庫	71,000	644.00	45,724,000
澁澤倉庫	25,000	316.00	7,900,000
東陽倉庫	17,000	261.00	4,437,000
日本トランスシティ	22,000	478.00	10,516,000
ケイヒン	18,000	179.00	3,222,000
中央倉庫	5,600	982.00	5,499,200
安田倉庫	7,600	926.00	7,037,600
東洋埠頭	28,000	189.00	5,292,000
宇徳	7,900	422.00	3,333,800
上組	116,000	1,024.00	118,784,000
サンリツ	2,400	549.00	1,317,600
キムラユニティー	2,500	1,305.00	3,262,500
キューソー流通システム	2,700	2,725.00	7,357,500
郵船ロジスティクス	8,900	1,520.00	13,528,000
近鉄エクスプレス	17,400	2,200.00	38,280,000
東海運	5,200	292.00	1,518,400
エーアイティー	4,500	1,128.00	5,076,000

内外トランスライン	2,400	1,227.00	2,944,800
N E C ネットエスアイ	12,000	2,135.00	25,620,000
システナ	9,400	1,368.00	12,859,200
デジタルアーツ	4,700	1,994.00	9,371,800
新日鉄住金ソリューションズ	8,000	5,490.00	43,920,000
キューブシステム	4,200	573.00	2,406,600
コア	4,100	898.00	3,681,800
ソフトクリエイトホールディングス	3,200	971.00	3,107,200
I Tホールディングス	31,800	2,810.00	89,358,000
ネオス	2,600	533.00	1,385,800
電算システム	3,300	1,995.00	6,583,500
グリー	58,300	598.00	34,863,400
コーエーテクモホールディングス	22,800	1,822.00	41,541,600
三菱総合研究所	3,700	3,135.00	11,599,500
ボルテージ	1,700	1,301.00	2,211,700
電算	1,100	2,347.00	2,581,700
A G S	1,400	987.00	1,381,800
ファインデックス	6,300	876.00	5,518,800
ヒト・コミュニケーションズ	1,100	2,390.00	2,629,000
ブレインパッド	1,500	485.00	727,500
K L a b	14,800	989.00	14,637,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	6,400	1,090.00	6,976,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	766.00	1,608,600
ネクソン	91,700	1,974.00	181,015,800
アイスタイル	8,200	1,809.00	14,833,800
エムアップ	2,500	616.00	1,540,000
エイチーム	3,500	2,001.00	7,003,500
テクノスジャパン	1,000	2,751.00	2,751,000
e n i s h	2,700	711.00	1,919,700
コロプラ	26,400	2,562.00	67,636,800
モバイルクリエイト	5,600	434.00	2,430,400
ブロードリーフ	9,900	1,186.00	11,741,400
ハーツユナイテッドグループ	2,900	2,163.00	6,272,700
ブイキューブ	2,400	1,790.00	4,296,000
サイバーリンクス	1,100	1,511.00	1,662,100
VOYAGE GROUP	2,200	1,558.00	3,427,600
オブティム	600	4,725.00	2,835,000
ベリサーブ	1,100	1,951.00	2,146,100
ティーガイア	9,600	1,372.00	13,171,200
日本アジアグループ	8,100	650.00	5,265,000
豆蔵ホールディングス	7,500	621.00	4,657,500
テクマトリックス	4,100	1,293.00	5,301,300



ガンホー・オンライン・エンターテイメント	167,900	369.00	61,955,100
GMOペイメントゲートウェイ	8,400	5,630.00	47,292,000
ザッパラス	5,400	483.00	2,608,200
インターネットイニシアティブ	15,500	2,448.00	37,944,000
GMOクラウド	2,100	769.00	1,614,900
SRAホールディングス	5,100	2,672.00	13,627,200
朝日ネット	8,700	521.00	4,532,700
コムチュア	1,600	2,134.00	3,414,400
gumi	9,800	1,124.00	11,015,200
パイプドHD	1,200	1,560.00	1,872,000
フェイス	2,500	1,498.00	3,745,000
ハイマックス	1,300	1,210.00	1,573,000
野村総合研究所	67,300	4,580.00	308,234,000
サイバネットシステム	7,900	437.00	3,452,300
CEホールディングス	1,500	1,224.00	1,836,000
インテージホールディングス	5,000	1,710.00	8,550,000
東邦システムサイエンス	2,900	751.00	2,177,900
ソースネクスト	4,800	674.00	3,235,200
ティー・ワイ・オー	13,300	234.00	3,112,200
クレスコ	2,200	1,963.00	4,318,600
フジ・メディア・ホールディングス	100,100	1,459.00	146,045,900
オービック	33,100	6,410.00	212,171,000
ジャストシステム	17,500	970.00	16,975,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,100	1,532.00	3,217,200
ヤフー	688,600	522.00	359,449,200
トレンドマイクロ	46,700	5,260.00	245,642,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,800	911.00	1,639,800
日本オラクル	15,400	6,080.00	93,632,000
アルファシステムズ	3,200	1,877.00	6,006,400
フューチャーアーキテクト	11,600	726.00	8,421,600
CAC Holdings	7,200	986.00	7,099,200
ソフトバンク・テクノロジー	2,600	1,325.00	3,445,000
トーセ	2,600	775.00	2,015,000
オービックビジネスコンサルタント	4,900	6,720.00	32,928,000
伊藤忠テクノソリューションズ	21,800	2,477.00	53,998,600
アイティフォー	11,700	593.00	6,938,100
東計電算	1,700	2,415.00	4,105,500
エクスネット	900	1,523.00	1,370,700
大塚商会	25,800	6,100.00	157,380,000
サイボウズ	12,800	324.00	4,147,200
ソフトブレーン	14,100	182.00	2,566,200
電通国際情報サービス	5,900	2,366.00	13,959,400

E Mシステムズ	1,500	2,460.00	3,690,000
ウェザーニューズ	2,900	4,205.00	12,194,500
C I J	8,700	503.00	4,376,100
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,415.00	1,415,000
日本エンタープライズ	8,600	258.00	2,218,800
WOWOW	4,600	3,135.00	14,421,000
フュージョンパートナー	5,500	560.00	3,080,000
日本コロムビア	3,300	492.00	1,623,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,900	456.00	3,146,400
ネットワンシステムズ	39,500	757.00	29,901,500
アルゴグラフィックス	4,100	1,868.00	7,658,800
マーベラス	16,200	987.00	15,989,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,700	1,414.00	25,027,800
日本ユニシス	26,500	1,274.00	33,761,000
兼松エレクトロニクス	6,100	2,067.00	12,608,700
東京放送ホールディングス	57,600	1,916.00	110,361,600
日本テレビホールディングス	87,700	2,316.00	203,113,200
朝日放送	9,500	840.00	7,980,000
テレビ朝日ホールディングス	26,300	2,215.00	58,254,500
スカパーJ S A Tホールディングス	72,900	673.00	49,061,700
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,417.00	19,094,300
日本BS放送	1,600	1,047.00	1,675,200
コネクシオ	6,900	1,146.00	7,907,400
日本通信	45,200	309.00	13,966,800
クロップス	1,200	532.00	638,400
日本電信電話	742,700	4,584.00	3,404,536,800
K D D I	976,100	2,934.00	2,863,877,400
光通信	11,500	8,420.00	96,830,000
N T T ドコモ	741,000	2,352.50	1,743,202,500
エムティーアイ	12,300	683.00	8,400,900
G M Oインターネット	35,600	1,729.00	61,552,400
カドカワ	30,000	1,870.00	56,100,000
学研ホールディングス	32,000	282.00	9,024,000
ゼンリン	12,700	2,151.00	27,317,700
昭文社	5,300	701.00	3,715,300
インプレスホールディングス	6,900	160.00	1,104,000
アイネット	5,000	1,216.00	6,080,000
松竹	63,000	1,162.00	73,206,000
東宝	68,600	3,345.00	229,467,000
東映	36,000	1,178.00	42,408,000
A O I Pro .	4,500	1,048.00	4,716,000
エヌ・ティ・ティ・データ	59,400	6,050.00	359,370,000

ピー・シー・エー	1,200	1,508.00	1,809,600
ビジネスブレイン太田昭和	1,300	1,026.00	1,333,800
D T S	10,000	2,763.00	27,630,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,700	2,875.00	117,012,500
シーイーシー	6,300	1,150.00	7,245,000
カプコン	24,600	2,845.00	69,987,000
アイ・エス・ビー	1,200	787.00	944,400
ジャステック	6,100	1,020.00	6,222,000
S C S K	22,900	4,675.00	107,057,500
日本システムウエア	3,600	930.00	3,348,000
アイネス	13,200	1,132.00	14,942,400
T K C	8,900	3,120.00	27,768,000
富士ソフト	14,300	2,782.00	39,782,600
N S D	20,400	1,706.00	34,802,400
コナミホールディングス	43,400	2,930.00	127,162,000
福井コンピュータホールディングス	2,100	1,032.00	2,167,200
J B C Cホールディングス	8,100	765.00	6,196,500
ミロク情報サービス	6,400	874.00	5,593,600
ソフトバンクグループ	544,400	6,226.00	3,389,434,400
ハウスイ	8,000	129.00	1,032,000
高千穂交易	3,700	1,001.00	3,703,700
伊藤忠食品	2,400	4,235.00	10,164,000
エレマテック	4,500	2,898.00	13,041,000
J A L U X	2,700	2,604.00	7,030,800
あらた	4,300	2,952.00	12,693,600
トーメンデバイス	1,500	1,976.00	2,964,000
東京エレクトロン デバイス	2,600	1,600.00	4,160,000
フィールズ	6,300	2,094.00	13,192,200
双日	605,300	264.00	159,799,200
アルフレッサ ホールディングス	120,800	2,338.00	282,430,400
横浜冷凍	23,800	1,031.00	24,537,800
神栄	13,000	174.00	2,262,000
山下医科器械	800	1,773.00	1,418,400
ラサ商事	4,500	606.00	2,727,000
アルコニックス	5,500	1,601.00	8,805,500
神戸物産	6,200	4,285.00	26,567,000
あい ホールディングス	15,400	3,095.00	47,663,000
ディーブイエックス	2,600	1,101.00	2,862,600
ダイワボウホールディングス	87,000	246.00	21,402,000
マクニカ・富士エレホールディングス	17,300	1,552.00	26,849,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,700	965.00	16,115,500
八洲電機	7,500	575.00	4,312,500

U K Cホールディングス	6,200	2,800.00	17,360,000
O C H Iホールディングス	2,500	1,077.00	2,692,500
T O K A Iホールディングス	47,000	526.00	24,722,000
三洋貿易	5,300	1,409.00	7,467,700
ウイン・パートナーズ	3,200	1,790.00	5,728,000
ミタチ産業	2,300	711.00	1,635,300
シップヘルスケアホールディングス	19,500	2,808.00	54,756,000
明治電機工業	2,800	1,202.00	3,365,600
デリカフーズ	1,700	994.00	1,689,800
スターティア	1,900	631.00	1,198,900
富士興産	3,800	491.00	1,865,800
協栄産業	12,000	175.00	2,100,000
小野建	8,400	1,097.00	9,214,800
佐島電機	7,600	788.00	5,988,800
エコートレーディング	2,200	655.00	1,441,000
伯東	6,700	1,261.00	8,448,700
コンドーテック	7,100	762.00	5,410,200
中山福	5,600	850.00	4,760,000
ナガイレーベン	13,900	2,118.00	29,440,200
三菱食品	10,600	2,932.00	31,079,200
松田産業	7,000	1,433.00	10,031,000
メディバルホールディングス	96,100	2,053.00	197,293,300
アドヴァン	9,800	1,045.00	10,241,000
S P K	2,100	2,232.00	4,687,200
萩原電気	2,500	2,066.00	5,165,000
アズワン	7,500	4,600.00	34,500,000
スズデン	3,100	1,095.00	3,394,500
尾家産業	3,100	906.00	2,808,600
シモジマ	6,000	1,105.00	6,630,000
ドウシシャ	11,300	2,471.00	27,922,300
小津産業	1,900	2,090.00	3,971,000
高速	5,700	939.00	5,352,300
たけびし	3,400	1,051.00	3,573,400
黒田電気	17,900	2,265.00	40,543,500
丸文	8,500	948.00	8,058,000
ハピネット	8,700	1,222.00	10,631,400
橋本総業	1,800	1,586.00	2,854,800
エクセル	4,400	1,580.00	6,952,000
マルカキカイ	3,100	1,790.00	5,549,000
ガリバーインターナショナル	25,900	1,134.00	29,370,600
日本エム・ディ・エム	8,000	664.00	5,312,000
進和	5,700	1,717.00	9,786,900

エスケイジャパン	2,300	461.00	1,060,300	
ダイトエレクトロン	4,400	831.00	3,656,400	
シークス	6,100	3,635.00	22,173,500	
田中商事	3,000	713.00	2,139,000	
オーハシテクニカ	5,400	1,386.00	7,484,400	
白銅	2,800	1,244.00	3,483,200	
伊藤忠商事	754,000	1,453.50	1,095,939,000	
丸紅	945,600	663.00	626,932,800	
高島	18,000	239.00	4,302,000	
長瀬産業	57,800	1,514.00	87,509,200	
蝶理	6,100	1,711.00	10,437,100	
豊田通商	107,000	2,792.00	298,744,000	
三共生興	14,600	468.00	6,832,800	
兼松	204,000	196.00	39,984,000	
ツカモトコーポレーション	17,000	129.00	2,193,000	
三井物産	868,900	1,464.00	1,272,069,600	
日本紙パルプ商事	50,000	334.00	16,700,000	
日立ハイテクノロジーズ	33,300	3,350.00	111,555,000	
カメイ	12,500	1,192.00	14,900,000	
東都水産	16,000	186.00	2,976,000	
OUGホールディングス	14,000	245.00	3,430,000	
スターゼン	3,500	3,400.00	11,900,000	
山善	36,900	1,075.00	39,667,500	
椿本興業	11,000	338.00	3,718,000	
住友商事	604,800	1,277.00	772,329,600	
内田洋行	24,000	465.00	11,160,000	
三菱商事	721,000	1,994.50	1,438,034,500	
第一実業	22,000	525.00	11,550,000	
キャノンマーケティングジャパン	27,400	1,885.00	51,649,000	
西華産業	32,000	294.00	9,408,000	
佐藤商事	8,600	810.00	6,966,000	
菱洋エレクトロ	11,100	1,422.00	15,784,200	
東京産業	9,600	511.00	4,905,600	
ユアサ商事	8,500	2,958.00	25,143,000	
神鋼商事	22,000	252.00	5,544,000	
小林産業	6,500	224.00	1,456,000	
阪和興業	96,000	533.00	51,168,000	
カナデン	8,400	980.00	8,232,000	
菱電商事	15,000	816.00	12,240,000	
フルサト工業	5,300	1,791.00	9,492,300	
岩谷産業	114,000	642.00	73,188,000	
すてきナイスグループ	41,000	173.00	7,093,000	

昭光通商	34,000	85.00	2,890,000	
ニチモウ	15,000	200.00	3,000,000	
極東貿易	13,000	264.00	3,432,000	
イワキ	15,000	218.00	3,270,000	
三愛石油	25,000	966.00	24,150,000	
稲畑産業	23,100	1,207.00	27,881,700	
G S Iクレオス	26,000	123.00	3,198,000	
明和産業	7,700	425.00	3,272,500	
ワキタ	20,500	1,016.00	20,828,000	
東邦ホールディングス	30,800	2,849.00	87,749,200	
サンゲツ	35,100	2,279.00	79,992,900	
ミツウロコグループホールディングス	15,500	620.00	9,610,000	
シナネンホールディングス	21,000	473.00	9,933,000	
伊藤忠エネクス	24,800	989.00	24,527,200	
サンリオ	29,600	2,905.00	85,988,000	
サンワテクノス	6,100	983.00	5,996,300	
リョーサン	15,200	3,130.00	47,576,000	
新光商事	11,300	1,268.00	14,328,400	
トーホー	4,300	2,438.00	10,483,400	
三信電気	13,300	1,264.00	16,811,200	
東陽テクニカ	14,100	1,034.00	14,579,400	
モスフードサービス	12,600	3,175.00	40,005,000	
加賀電子	8,700	1,723.00	14,990,100	
ソーダニッカ	9,900	500.00	4,950,000	
立花エレテック	7,100	1,381.00	9,805,100	
フォーバル	3,800	654.00	2,485,200	
P A L T A C	15,400	2,280.00	35,112,000	
三谷産業	10,300	388.00	3,996,400	
ヤマタネ	45,000	195.00	8,775,000	
丸紅建材リース	8,000	218.00	1,744,000	
日鉄住金物産	63,000	407.00	25,641,000	
トラスコ中山	11,000	4,385.00	48,235,000	
オートバックスセブン	36,800	2,151.00	79,156,800	
加藤産業	15,000	2,703.00	40,545,000	
イノテック	8,900	596.00	5,304,400	
イエローハット	9,100	2,515.00	22,886,500	
J Kホールディングス	9,700	473.00	4,588,100	
日伝	4,000	2,992.00	11,968,000	
北沢産業	8,000	200.00	1,600,000	
杉本商事	5,200	1,441.00	7,493,200	
因幡電機産業	13,500	3,800.00	51,300,000	
バイテックホールディングス	3,000	1,210.00	3,630,000	

ミスミグループ本社	107,800	1,725.00	185,955,000
アルテック	8,200	191.00	1,566,200
タキヒヨー	16,000	480.00	7,680,000
蔵王産業	1,300	1,401.00	1,821,300
スズケン	43,700	4,490.00	196,213,000
ジェコス	6,600	1,041.00	6,870,600
ルネサスイーストン	4,800	469.00	2,251,200
ローソン	36,400	9,500.00	345,800,000
サンエー	6,500	5,190.00	33,735,000
ダイユーエイト	2,800	853.00	2,388,400
カワチ薬品	7,500	2,431.00	18,232,500
エービーシー・マート	12,200	6,640.00	81,008,000
ハードオフコーポレーション	4,600	1,481.00	6,812,600
アスクル	10,000	4,675.00	46,750,000
ゲオホールディングス	18,200	1,986.00	36,145,200
アダストリア	8,900	6,570.00	58,473,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	12,000	110.00	1,320,000
くらコーポレーション	5,600	3,960.00	22,176,000
キャンドウ	5,100	1,542.00	7,864,200
パル	5,600	2,959.00	16,570,400
エディオン	40,800	948.00	38,678,400
サーラコーポレーション	8,200	627.00	5,141,400
ワッツ	3,800	906.00	3,442,800
ハローズ	2,900	4,550.00	13,195,000
あみやき亭	1,700	4,670.00	7,939,000
ひらまつ	13,300	745.00	9,908,500
ゲンキー	1,900	4,080.00	7,752,000
サッポロドラッグストアー	1,000	2,710.00	2,710,000
大黒天物産	2,300	4,525.00	10,407,500
ハニーズ	8,400	1,005.00	8,442,000
ファーマライズホールディングス	2,800	582.00	1,629,600
アルペン	8,600	2,067.00	17,776,200
クオール	9,800	1,663.00	16,297,400
ジェイアイエヌ	6,500	4,395.00	28,567,500
ビックカメラ	49,700	1,087.00	54,023,900
DCMホールディングス	47,400	789.00	37,398,600
Monotaro	33,800	3,355.00	113,399,000
東京一番フーズ	1,600	623.00	996,800
ダイヤモンドダイニング	1,600	1,250.00	2,000,000
きちり	2,600	717.00	1,864,200
アーランドサービス	1,500	5,200.00	7,800,000
J.フロント リテイリング	121,600	1,852.00	225,203,200

ドトール・日レスホールディングス	16,800	1,886.00	31,684,800
マツモトキヨシホールディングス	19,800	6,160.00	121,968,000
ブロンコピリー	3,800	2,375.00	9,025,000
スタートトゥデイ	29,900	4,055.00	121,244,500
トレジャー・ファクトリー	2,400	1,103.00	2,647,200
物語コーポレーション	2,700	5,120.00	13,824,000
ココカラファイン	10,000	5,270.00	52,700,000
三越伊勢丹ホールディングス	191,000	1,691.00	322,981,000
ウエルシアホールディングス	8,300	6,380.00	52,954,000
クリエイトSDホールディングス	4,700	7,870.00	36,989,000
丸善CHIホールディングス	11,200	351.00	3,931,200
ミサワ	1,100	673.00	740,300
エー・ピーカンパニー	1,400	1,540.00	2,156,000
チムニー	2,300	3,180.00	7,314,000
ネクステージ	1,600	866.00	1,385,600
ジョイフル本田	14,000	2,361.00	33,054,000
キリン堂ホールディングス	3,200	1,335.00	4,272,000
ホットランド	2,600	1,529.00	3,975,400
すかいらーく	29,500	1,653.00	48,763,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,900	1,012.00	32,282,800
ブックオフコーポレーション	5,700	898.00	5,118,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	2,000	883.00	1,766,000
あさひ	6,400	1,355.00	8,672,000
日本調剤	2,500	4,700.00	11,750,000
コスモス薬品	4,800	17,370.00	83,376,000
トーエル	5,100	620.00	3,162,000
一六堂	2,400	397.00	952,800
セブン&アイ・ホールディングス	401,900	5,376.00	2,160,614,400
薬王堂	1,300	2,881.00	3,745,300
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,600	3,235.00	27,821,000
ツルハホールディングス	20,600	10,720.00	220,832,000
サンマルクホールディングス	7,600	3,465.00	26,334,000
フェリシモ	2,500	1,078.00	2,695,000
トリドール	10,500	2,089.00	21,934,500
クスリのアオキ	7,600	5,980.00	45,448,000
メディカルシステムネットワーク	10,100	650.00	6,565,000
総合メディカル	4,600	4,395.00	20,217,000
はるやま商事	4,200	754.00	3,166,800
カップ・クリエイト	13,400	1,213.00	16,254,200
ライトオン	7,200	1,388.00	9,993,600
良品計画	11,000	25,260.00	277,860,000



三城ホールディングス	11,900	464.00	5,521,600
アルビス	2,200	2,206.00	4,853,200
コナカ	11,300	636.00	7,186,800
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,445.00	1,589,500
G - 7ホールディングス	2,100	1,634.00	3,431,400
イオン北海道	6,900	546.00	3,767,400
コジマ	14,400	283.00	4,075,200
ヒマラヤ	3,100	1,093.00	3,388,300
コーナン商事	13,900	1,725.00	23,977,500
エコス	3,500	1,603.00	5,610,500
マルシェ	2,400	866.00	2,078,400
ドンキホーテホールディングス	62,100	4,600.00	285,660,000
西松屋チェーン	18,900	1,102.00	20,827,800
ゼンショーホールディングス	49,400	1,465.00	72,371,000
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,568.00	9,564,800
ハークスレイ	2,700	1,536.00	4,147,200
サイゼリヤ	15,800	2,890.00	45,662,000
V Tホールディングス	30,200	702.00	21,200,400
魚力	2,700	1,519.00	4,101,300
ポブラ	2,400	524.00	1,257,600
ユナイテッドアローズ	13,700	5,120.00	70,144,000
ハイデイ日高	7,300	3,500.00	25,550,000
京都きもの友禅	5,700	975.00	5,557,500
コロワイド	32,100	1,797.00	57,683,700
壱番屋	4,300	5,770.00	24,811,000
トップカルチャー	4,200	506.00	2,125,200
P L A N T	2,400	1,335.00	3,204,000
スギホールディングス	17,200	6,510.00	111,972,000
スクロール	12,600	427.00	5,380,200
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,691.00	19,644,300
ファミリーマート	29,500	5,600.00	165,200,000
木曽路	11,800	2,112.00	24,921,600
サトレストランシステムズ	10,800	896.00	9,676,800
千趣会	19,000	801.00	15,219,000
タカキュー	6,800	199.00	1,353,200
ケーヨー	16,400	500.00	8,200,000
上新電機	21,000	1,072.00	22,512,000
日本瓦斯	11,000	2,623.00	28,853,000
ベスト電器	30,900	131.00	4,047,900
ロイヤルホールディングス	16,000	2,305.00	36,880,000
東天紅	7,000	161.00	1,127,000
いなげや	10,700	1,369.00	14,648,300

島忠	24,900	2,746.00	68,375,400
チヨダ	11,300	3,935.00	44,465,500
ライフコーポレーション	6,200	2,973.00	18,432,600
リンガーハット	8,700	2,632.00	22,898,400
MrMax	9,100	374.00	3,403,400
テンアライド	8,100	399.00	3,231,900
AOKIホールディングス	21,900	1,531.00	33,528,900
オークワ	15,000	1,128.00	16,920,000
コメリ	14,800	2,553.00	37,784,400
青山商事	18,400	4,755.00	87,492,000
しまむら	11,200	14,010.00	156,912,000
はせがわ	3,700	475.00	1,757,500
高島屋	140,000	1,047.00	146,580,000
松屋	19,700	1,355.00	26,693,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,300	2,430.00	119,799,000
近鉄百貨店	38,000	321.00	12,198,000
ニッセンホールディングス	14,100	185.00	2,608,500
パルコ	9,300	1,098.00	10,211,400
丸井グループ	118,100	1,874.00	221,319,400
アクシアル リテイリング	7,400	4,180.00	30,932,000
イオン	395,500	1,829.00	723,369,500
ユニグループ・ホールディングス	92,900	747.00	69,396,300
イズミ	19,100	4,625.00	88,337,500
東武ストア	12,000	308.00	3,696,000
平和堂	19,500	2,735.00	53,332,500
フジ	10,900	2,475.00	26,977,500
ヤオコー	10,900	5,050.00	55,045,000
ゼビオホールディングス	13,000	2,363.00	30,719,000
ケーズホールディングス	20,300	4,410.00	89,523,000
Olympicグループ	6,100	629.00	3,836,900
日産東京販売ホールディングス	16,600	305.00	5,063,000
アインホールディングス	11,600	5,240.00	60,784,000
元気寿司	2,700	2,228.00	6,015,600
ヤマダ電機	292,300	543.00	158,718,900
アークランドサカモト	8,100	2,584.00	20,930,400
ニトリホールディングス	41,500	10,160.00	421,640,000
グルメ杵屋	7,000	1,050.00	7,350,000
愛眼	7,600	248.00	1,884,800
ケーユーホールディングス	5,000	796.00	3,980,000
吉野家ホールディングス	35,400	1,548.00	54,799,200
松屋フーズ	4,600	2,852.00	13,119,200
サガミチェーン	12,000	1,270.00	15,240,000

関西スーパーマーケット	7,400	831.00	6,149,400
王将フードサービス	7,000	4,155.00	29,085,000
プレナス	10,700	2,024.00	21,656,800
ミニストップ	7,200	2,223.00	16,005,600
アークス	18,000	2,544.00	45,792,000
パローホールディングス	20,700	2,792.00	57,794,400
藤久	800	1,750.00	1,400,000
ベルク	4,700	4,265.00	20,045,500
大庄	4,600	1,506.00	6,927,600
ファーストリテイリング	19,200	45,440.00	872,448,000
サンドラッグ	20,300	7,610.00	154,483,000
サクスパー ホールディングス	9,000	1,830.00	16,470,000
ヤマザワ	2,000	1,666.00	3,332,000
やまや	1,700	2,180.00	3,706,000
ベルーナ	24,000	691.00	16,584,000
島根銀行	2,000	1,438.00	2,876,000
じもとホールディングス	68,900	200.00	13,780,000
足利ホールディングス	70,500	462.00	32,571,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,300	3,720.00	49,476,000
九州フィナンシャルグループ	147,100	845.00	124,299,500
新生銀行	831,000	219.00	181,989,000
あおぞら銀行	608,000	428.00	260,224,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,709,100	779.50	6,009,243,450
りそなホールディングス	1,124,000	595.40	669,229,600
三井住友トラスト・ホールディングス	2,004,000	459.40	920,637,600
三井住友フィナンシャルグループ	769,400	4,673.00	3,595,406,200
第四銀行	122,000	516.00	62,952,000
北越銀行	104,000	250.00	26,000,000
西日本シティ銀行	313,000	314.00	98,282,000
千葉銀行	371,000	826.00	306,446,000
横浜銀行	644,000	708.60	456,338,400
常陽銀行	347,000	552.00	191,544,000
群馬銀行	214,000	701.00	150,014,000
武蔵野銀行	15,300	4,430.00	67,779,000
千葉興業銀行	24,100	708.00	17,062,800
筑波銀行	39,900	396.00	15,800,400
七十七銀行	151,000	622.00	93,922,000
青森銀行	70,000	381.00	26,670,000
秋田銀行	64,000	410.00	26,240,000
山形銀行	54,000	456.00	24,624,000
岩手銀行	6,700	4,910.00	32,897,000
東邦銀行	86,000	426.00	36,636,000

東北銀行	49,000	158.00	7,742,000	
みちのく銀行	48,000	199.00	9,552,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	416,000	573.00	238,368,000	
静岡銀行	281,000	1,161.00	326,241,000	
十六銀行	120,000	470.00	56,400,000	
スルガ銀行	101,400	2,408.00	244,171,200	
八十二銀行	174,000	726.00	126,324,000	
山梨中央銀行	59,000	612.00	36,108,000	
大垣共立銀行	128,000	484.00	61,952,000	
福井銀行	82,000	243.00	19,926,000	
北國銀行	107,000	394.00	42,158,000	
清水銀行	3,300	2,927.00	9,659,100	
富山銀行	1,800	4,555.00	8,199,000	
滋賀銀行	90,000	597.00	53,730,000	
南都銀行	93,000	388.00	36,084,000	
百五銀行	86,000	579.00	49,794,000	
京都銀行	183,000	1,084.00	198,372,000	
紀陽銀行	37,700	1,729.00	65,183,300	
三重銀行	43,000	260.00	11,180,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	654,000	246.00	160,884,000	
広島銀行	283,000	672.00	190,176,000	
山陰合同銀行	58,200	974.00	56,686,800	
中国銀行	68,100	1,642.00	111,820,200	
鳥取銀行	31,000	220.00	6,820,000	
伊予銀行	102,800	1,169.00	120,173,200	
百十四銀行	105,000	441.00	46,305,000	
四国銀行	74,000	275.00	20,350,000	
阿波銀行	79,000	679.00	53,641,000	
大分銀行	55,000	478.00	26,290,000	
宮崎銀行	64,000	400.00	25,600,000	
佐賀銀行	58,000	266.00	15,428,000	
十八銀行	59,000	360.00	21,240,000	
沖縄銀行	7,600	4,625.00	35,150,000	
琉球銀行	19,800	1,674.00	33,145,200	
セブン銀行	360,000	525.00	189,000,000	
みずほフィナンシャルグループ	13,532,000	242.80	3,285,569,600	
高知銀行	37,000	141.00	5,217,000	
山口フィナンシャルグループ	90,000	1,387.00	124,830,000	
長野銀行	31,000	205.00	6,355,000	
名古屋銀行	81,000	430.00	34,830,000	
北洋銀行	144,700	438.00	63,378,600	
愛知銀行	3,200	6,530.00	20,896,000	

第三銀行	54,000	177.00	9,558,000
中京銀行	39,000	226.00	8,814,000
東日本銀行	42,000	385.00	16,170,000
大光銀行	34,000	241.00	8,194,000
愛媛銀行	57,000	253.00	14,421,000
トマト銀行	37,000	171.00	6,327,000
みなと銀行	87,000	198.00	17,226,000
京葉銀行	79,000	565.00	44,635,000
関西アーバン銀行	13,400	1,305.00	17,487,000
栃木銀行	49,000	701.00	34,349,000
北日本銀行	3,000	3,275.00	9,825,000
東和銀行	135,000	108.00	14,580,000
福島銀行	118,000	95.00	11,210,000
大東銀行	58,000	210.00	12,180,000
トモニホールディングス	73,700	449.00	33,091,300
フィデアホールディングス	58,800	268.00	15,758,400
池田泉州ホールディングス	101,900	488.00	49,727,200
F P G	29,700	824.00	24,472,800
S B Iホールディングス	115,900	1,359.00	157,508,100
ジャフコ	16,200	4,855.00	78,651,000
大和証券グループ本社	899,000	764.00	686,836,000
野村ホールディングス	1,849,100	713.70	1,319,702,670
岡三証券グループ	82,000	712.00	58,384,000
丸三証券	28,500	1,212.00	34,542,000
東洋証券	37,000	385.00	14,245,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	110,300	709.00	78,202,700
光世証券	23,000	175.00	4,025,000
水戸証券	29,800	408.00	12,158,400
いちよし証券	20,400	1,116.00	22,766,400
松井証券	48,900	1,115.00	54,523,500
だいこう証券ビジネス	4,900	1,080.00	5,292,000
マネックスグループ	113,100	317.00	35,852,700
カブドットコム証券	85,300	381.00	32,499,300
極東証券	12,900	1,589.00	20,498,100
岩井コスモホールディングス	9,100	1,368.00	12,448,800
藍澤證券	13,500	719.00	9,706,500
マネースクウェアHD	3,300	1,450.00	4,785,000
マネーパートナーズグループ	9,000	386.00	3,474,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	213,400	3,827.00	816,681,800
アニコムホールディングス	6,500	2,830.00	18,395,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	287,100	3,453.00	991,356,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	92,000	2,172.00	199,824,000

第一生命保険	615,600	2,042.00	1,257,055,200
東京海上ホールディングス	389,300	4,609.00	1,794,283,700
T & Dホールディングス	350,200	1,660.00	581,332,000
全国保証	25,000	3,925.00	98,125,000
クレディセゾン	72,900	2,317.00	168,909,300
アクリーティブ	6,600	510.00	3,366,000
芙蓉総合リース	11,000	5,710.00	62,810,000
興銀リース	18,000	2,532.00	45,576,000
東京センチュリーリース	22,600	4,080.00	92,208,000
日本証券金融	42,300	638.00	26,987,400
アイフル	160,800	401.00	64,480,800
ポケットカード	7,300	556.00	4,058,800
リコーリース	7,600	3,630.00	27,588,000
イオンフィナンシャルサービス	63,000	2,701.00	170,163,000
アコム	193,000	595.00	114,835,000
ジャックス	53,000	444.00	23,532,000
オリエントコーポレーション	415,400	250.00	103,850,000
日立キャピタル	22,600	3,335.00	75,371,000
アプラスフィナンシャル	46,100	113.00	5,209,300
オリックス	680,400	1,738.00	1,182,535,200
三菱UFJリース	243,700	628.00	153,043,600
日本取引所グループ	282,100	1,850.00	521,885,000
イー・ギャランティ	2,800	2,601.00	7,282,800
アサックス	1,700	1,621.00	2,755,700
NECキャピタルソリューション	3,900	1,675.00	6,532,500
日本駐車場開発	105,300	139.00	14,636,700
ヒューリック	200,300	1,073.00	214,921,900
三栄建築設計	3,900	1,349.00	5,261,100
野村不動産ホールディングス	63,700	2,369.00	150,905,300
三重交通グループホールディングス	17,200	461.00	7,929,200
サムティ	5,100	1,231.00	6,278,100
ディア・ライフ	5,000	395.00	1,975,000
エー・ディー・ワークス	66,800	51.00	3,406,800
日本商業開発	3,200	1,762.00	5,638,400
プレサンスコーポレーション	3,300	4,115.00	13,579,500
ユニゾホールディングス	6,000	4,760.00	28,560,000
日本管理センター	6,300	1,443.00	9,090,900
サンセイランディック	2,300	793.00	1,823,900
エストラスト	1,400	515.00	721,000
フージャースホールディングス	13,500	534.00	7,209,000
オープンハウス	13,900	2,394.00	33,276,600
東急不動産ホールディングス	232,500	781.00	181,582,500

飯田グループホールディングス	89,000	2,266.00	201,674,000
パーク24	48,400	2,552.00	123,516,800
パラカ	3,400	1,560.00	5,304,000
三井不動産	509,000	3,067.00	1,561,103,000
三菱地所	714,000	2,516.50	1,796,781,000
平和不動産	18,200	1,371.00	24,952,200
東京建物	105,000	1,405.00	147,525,000
ダイビル	24,800	975.00	24,180,000
京阪神ビルディング	16,000	690.00	11,040,000
住友不動産	230,000	3,647.00	838,810,000
大京	179,000	197.00	35,263,000
テーオーシー	37,300	998.00	37,225,400
東京楽天地	16,000	510.00	8,160,000
レオパレス21	113,300	683.00	77,383,900
スターツコーポレーション	11,000	2,190.00	24,090,000
フジ住宅	12,300	733.00	9,015,900
空港施設	11,700	578.00	6,762,600
明和地所	5,400	536.00	2,894,400
住友不動産販売	6,900	2,894.00	19,968,600
ゴールドクレスト	7,600	2,397.00	18,217,200
日本エスリード	3,800	1,144.00	4,347,200
日神不動産	12,900	424.00	5,469,600
タカラレーベン	42,700	707.00	30,188,900
サンヨーハウジング名古屋	5,500	1,153.00	6,341,500
イオンモール	62,000	2,199.00	136,338,000
ファースト住建	3,600	1,262.00	4,543,200
トーセイ	14,700	756.00	11,113,200
穴吹興産	9,000	250.00	2,250,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	59,700	1,160.00	69,252,000
サンフロンティア不動産	10,500	902.00	9,471,000
エフ・ジェー・ネクスト	7,500	502.00	3,765,000
ランドビジネス	6,500	350.00	2,275,000
グランディハウス	8,500	400.00	3,400,000
日本空港ビルデング	30,700	5,700.00	174,990,000
日本工営	34,000	440.00	14,960,000
ネクスト	28,900	1,309.00	37,830,100
ジェイエイシーリクルートメント	4,700	855.00	4,018,500
日本M&Aセンター	15,700	5,290.00	83,053,000
ノバレーゼ	2,600	952.00	2,475,200
アコーディア・ゴルフ	28,200	1,127.00	31,781,400
タケエイ	9,200	1,031.00	9,485,200
トラスト・テック	1,800	2,377.00	4,278,600

パソナグループ	8,000	919.00	7,352,000
C D S	2,300	988.00	2,272,400
リンクアンドモチベーション	20,600	126.00	2,595,600
G C A サヴィアン	9,100	1,244.00	11,320,400
エス・エム・エス	12,700	2,371.00	30,111,700
テンプホールディングス	71,200	1,863.00	132,645,600
リニカル	2,900	3,210.00	9,309,000
クックパッド	22,600	2,635.00	59,551,000
エスクリ	4,400	1,032.00	4,540,800
アイ・ケイ・ケイ	5,400	589.00	3,180,600
学情	3,800	1,082.00	4,111,600
スタジオアリス	4,700	2,179.00	10,241,300
シミックホールディングス	4,600	1,532.00	7,047,200
N J S	2,100	1,494.00	3,137,400
総合警備保障	33,900	5,680.00	192,552,000
カカクコム	73,700	2,337.00	172,236,900
アイロムグループ	2,600	1,154.00	3,000,400
ルネサンス	5,600	1,277.00	7,151,200
ディップ	11,500	2,605.00	29,957,500
オプトホールディング	6,400	636.00	4,070,400
ツクイ	12,200	1,286.00	15,689,200
総合臨床ホールディングス	5,200	567.00	2,948,400
キャリアデザインセンター	3,100	1,284.00	3,980,400
エムスリー	88,000	2,640.00	232,320,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,400	810.00	5,994,000
アウトソーシング	4,700	3,110.00	14,617,000
ウェルネット	3,500	2,690.00	9,415,000
ディー・エヌ・エー	45,600	1,956.00	89,193,600
博報堂D Yホールディングス	140,900	1,333.00	187,819,700
ぐるなび	11,800	2,596.00	30,632,800
エスアールジータカミヤ	8,700	498.00	4,332,600
一休	7,000	2,478.00	17,346,000
ファンコミュニケーションズ	23,500	808.00	18,988,000
ジェイコムホールディングス	2,500	1,403.00	3,507,500
W D Bホールディングス	3,600	1,175.00	4,230,000
ティア	4,300	741.00	3,186,300
バリューコマース	9,400	502.00	4,718,800
インフォマート	14,700	1,180.00	17,346,000
J Pホールディングス	26,300	347.00	9,126,100
E P Sホールディングス	9,300	1,465.00	13,624,500
レッグス	1,500	792.00	1,188,000
プレステージ・インターナショナル	7,900	1,100.00	8,690,000



アミューズ	2,800	5,600.00	15,680,000
ドリームインキュベータ	3,600	2,366.00	8,517,600
クイック	4,700	979.00	4,601,300
T A C	8,000	230.00	1,840,000
ケネディクス	138,100	465.00	64,216,500
電通	113,300	6,560.00	743,248,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,000	721.00	3,605,000
ぴあ	3,000	2,335.00	7,005,000
イオンファンタジー	3,400	1,995.00	6,783,000
シーティーエス	2,300	784.00	1,803,200
ネクシィーズ	4,100	847.00	3,472,700
みらかホールディングス	25,900	5,250.00	135,975,000
アルプス技研	3,700	2,568.00	9,501,600
ダイオーズ	1,800	1,201.00	2,161,800
日本空調サービス	5,000	1,202.00	6,010,000
オリエンタルランド	109,900	7,069.00	776,883,100
ダスキン	28,800	2,274.00	65,491,200
明光ネットワークジャパン	11,800	1,419.00	16,744,200
ファルコホールディングス	4,400	1,473.00	6,481,200
ラウンドワン	29,300	538.00	15,763,400
リゾートトラスト	42,600	3,110.00	132,486,000
ビー・エム・エル	6,000	3,610.00	21,660,000
ワタベウェディング	3,700	473.00	1,750,100
りらいあコミュニケーションズ	16,800	1,133.00	19,034,400
早稲田アカデミー	1,300	835.00	1,085,500
ユー・エス・エス	123,100	1,889.00	232,535,900
東京個別指導学院	4,900	634.00	3,106,600
サイバーエージェント	24,800	5,200.00	128,960,000
楽天	475,500	1,476.50	702,075,750
テー・オー・ダブリュー	6,100	721.00	4,398,100
セントラルスポーツ	3,500	2,300.00	8,050,000
フルキャストホールディングス	9,900	737.00	7,296,300
リゾートソリューション	13,000	335.00	4,355,000
テクノプロ・ホールディングス	14,400	3,390.00	48,816,000
リブセンス	6,800	425.00	2,890,000
ジャパンマテリアル	4,200	2,472.00	10,382,400
ベクトル	2,300	1,931.00	4,441,300
ウチヤマホールディングス	6,100	489.00	2,982,900
サクセスホールディングス	1,500	1,427.00	2,140,500
キャリアリンク	1,500	1,536.00	2,304,000
I B J	2,000	1,696.00	3,392,000
アサンテ	3,400	1,505.00	5,117,000

N・フィールド	3,600	1,403.00	5,050,800
M&Aキャピタルパートナーズ	800	1,828.00	1,462,400
E R Iホールディングス	2,600	851.00	2,212,600
アビスト	1,100	2,243.00	2,467,300
ウィルグループ	2,400	935.00	2,244,000
日本ビューホテル	1,300	1,948.00	2,532,400
リクルートホールディングス	205,100	3,630.00	744,513,000
リロ・ホールディング	3,800	12,600.00	47,880,000
東祥	3,000	3,155.00	9,465,000
エイチ・アイ・エス	16,600	3,820.00	63,412,000
ラックランド	1,400	2,193.00	3,070,200
共立メンテナンス	7,600	9,350.00	71,060,000
イチネンホールディングス	11,400	1,096.00	12,494,400
建設技術研究所	6,000	1,262.00	7,572,000
スペース	5,500	1,394.00	7,667,000
燦ホールディングス	2,000	1,598.00	3,196,000
スバル興業	7,000	446.00	3,122,000
東京テアトル	39,000	136.00	5,304,000
よみうりランド	22,000	409.00	8,998,000
東京都競馬	70,000	277.00	19,390,000
カナモト	14,500	2,722.00	39,469,000
東京ドーム	83,000	561.00	46,563,000
西尾レントオール	8,400	3,025.00	25,410,000
トランス・コスモス	11,800	2,910.00	34,338,000
乃村工藝社	21,800	1,798.00	39,196,400
藤田観光	38,000	558.00	21,204,000
KNT-CTホールディングス	49,000	234.00	11,466,000
日本管財	8,700	1,890.00	16,443,000
トーカイ	4,500	3,775.00	16,987,500
白洋舎	12,000	274.00	3,288,000
セコム	105,800	8,189.00	866,396,200
セントラル警備保障	4,500	1,721.00	7,744,500
丹青社	17,800	915.00	16,287,000
メイテック	12,700	4,170.00	52,959,000
アサツー ディ・ケイ	17,800	3,180.00	56,604,000
応用地質	10,700	1,381.00	14,776,700
船井総研ホールディングス	11,800	2,045.00	24,131,000
進学会	4,400	634.00	2,789,600
オオバ	5,800	478.00	2,772,400
ベネッセホールディングス	34,100	3,295.00	112,359,500
イオンディライト	9,800	3,715.00	36,407,000
ナック	6,200	952.00	5,902,400

ニチイ学館	18,400	805.00	14,812,000	
ダイセキ	19,100	2,016.00	38,505,600	
ステップ	3,400	1,118.00	3,801,200	
合 計	159,296,600		220,676,187,310	

## (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27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	2,048,145,913
国債証券	255,771,222,370
地方債証券	18,662,927,765
特殊債証券	25,332,571,004
社債証券	15,777,299,000
未収入金	414,816
未収利息	1,089,524,896
前払金	100,000
前払費用	21,956,789
流動資産合計	318,704,162,553
資産合計	318,704,162,553
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,916
未払金	100,600,000
未払解約金	336,878,239
流動負債合計	437,581,155
負債合計	437,581,155
純資産の部	
元本等	
元本	243,643,993,202
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	74,622,588,196
元本等合計	318,266,581,398
純資産合計	318,266,581,398

	平成27年12月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	318,704,162,553

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27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27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	243,643,993,202口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 105,833,000円</p>
3. 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 1.3063円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,063円)</p>

(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27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コンプライアンス・リスク統括部が、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27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)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。

平成27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>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27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27年 6月11日
期首元本額	254,586,079,485円
期中追加設定元本額	12,406,884,229円
期中一部解約元本額	23,348,970,512円
期末元本額	243,643,993,202円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	2,037,201,899円
D C 日本債券インデックスファンド	2,759,406,601円
D C 日本債券インデックスファンド L	31,029,345,229円
D C バランスファンド 3 0	5,699,028,939円
D C バランスファンド 5 0	3,877,152,333円
D C バランスファンド 7 0	925,265,343円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	73,071,828円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	41,625,815円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	334,026,328円
新生・4分散ファンド	98,553,944円

区分	平成27年12月10日現在
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	127,633,686円
日本債券インデックスe	2,023,080,581円
インデックスコレクション（国内債券）	6,931,376,662円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,335,119,544円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,811,041,896円
インデックスコレクション（バランス株式70）	719,557,134円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	42,775,326,429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）	5,152,844,779円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,956,505,408円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	7,667,966,342円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	878,364,964円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	531,627,670円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,632,604,649円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	8,443,638,283円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,859,520,428円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	20,809,372,302円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	211,276,907円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	13,997,392,511円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	4,675,323,741円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	376,298,480円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	1,552,636,582円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	201,625,725円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	5,094,905,968円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	623,835,985円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	1,254,004,158円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	306,793,793円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,917,679,476円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	6,063,391,959円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	363,013,918円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,691,513,088円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	44,539,013,100円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	904,858,478円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	251,147,310円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	84,330,871円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	993,234,330円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	6,013,640円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	5,444,166円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

平成27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)
国債証券	20,203,830
地方債証券	138,016,822
特殊債券	168,128,576
社債券	103,782,560
合計	430,131,788

(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27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	1,338,852,916	-	1,338,750,000	102,916
	合計	1,338,852,916	-	1,338,750,000	102,916

(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349回利付国債(2年)	840,000,000	841,377,600	
	第350回利付国債(2年)	620,000,000	621,078,800	
	第353回利付国債(2年)	2,180,000,000	2,184,578,000	
	第355回利付国債(2年)	1,270,000,000	1,272,959,100	
	第356回利付国債(2年)	1,660,000,000	1,664,067,000	
	第358回利付国債(2年)	1,330,000,000	1,333,577,700	
	第103回利付国債(5年)	2,730,000,000	2,741,711,700	
	第104回利付国債(5年)	200,000,000	200,606,000	
	第105回利付国債(5年)	3,302,000,000	3,313,986,260	



第106回利付国債（5年）	4,230,000,000	4,247,935,200	
第107回利付国債（5年）	1,710,000,000	1,717,934,400	
第108回利付国債（5年）	880,000,000	882,305,600	
第109回利付国債（5年）	880,000,000	882,490,400	
第110回利付国債（5年）	370,000,000	372,719,500	
第111回利付国債（5年）	1,230,000,000	1,241,832,600	
第112回利付国債（5年）	660,000,000	666,969,600	
第113回利付国債（5年）	2,130,000,000	2,147,146,500	
第114回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,008,720,000	
第115回利付国債（5年）	2,100,000,000	2,112,495,000	
第116回利付国債（5年）	2,960,000,000	2,979,180,800	
第117回利付国債（5年）	3,070,000,000	3,090,538,300	
第118回利付国債（5年）	1,720,000,000	1,732,091,600	
第119回利付国債（5年）	1,220,000,000	1,224,282,200	
第120回利付国債（5年）	1,340,000,000	1,349,835,600	
第121回利付国債（5年）	1,450,000,000	1,455,176,500	
第122回利付国債（5年）	3,240,000,000	3,251,048,400	
第123回利付国債（5年）	3,190,000,000	3,200,846,000	
第124回利付国債（5年）	3,100,000,000	3,110,478,000	
第125回利付国債（5年）	3,930,000,000	3,943,086,900	
第1回利付国債（40年）	230,000,000	289,811,500	
第2回利付国債（40年）	500,000,000	604,495,000	
第3回利付国債（40年）	460,000,000	556,158,400	
第4回利付国債（40年）	545,000,000	659,608,050	
第5回利付国債（40年）	630,000,000	727,032,600	
第6回利付国債（40年）	670,000,000	753,877,300	
第7回利付国債（40年）	570,000,000	608,058,900	
第8回利付国債（40年）	720,000,000	702,201,600	
第285回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,544,580,800	
第286回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,439,046,000	
第287回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,327,938,900	
第288回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,133,836,000	
第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	2,113,283,500	
第290回利付国債（10年）	900,000,000	928,926,000	
第291回利付国債（10年）	820,000,000	844,501,600	
第292回利付国債（10年）	550,000,000	571,417,000	
第293回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,150,369,000	
第294回利付国債（10年）	900,000,000	938,952,000	
第295回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,131,681,600	
第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	2,240,149,500	
第297回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,199,105,000	
第298回利付国債（10年）	1,360,000,000	1,413,964,800	

第299回利付国債(10年)	1,140,000,000	1,188,735,000	
第300回利付国債(10年)	550,000,000	577,104,000	
第301回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,789,624,000	
第302回利付国債(10年)	870,000,000	912,812,700	
第303回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,725,837,600	
第304回利付国債(10年)	740,000,000	775,941,800	
第305回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,313,476,000	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,450,213,500	
第307回利付国債(10年)	970,000,000	1,022,661,300	
第308回利付国債(10年)	970,000,000	1,025,542,200	
第309回利付国債(10年)	1,040,000,000	1,090,169,600	
第310回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,464,638,000	
第311回利付国債(10年)	670,000,000	694,555,500	
第312回利付国債(10年)	2,197,000,000	2,325,151,010	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,535,284,800	
第314回利付国債(10年)	620,000,000	654,515,400	
第315回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,201,800,200	
第316回利付国債(10年)	570,000,000	603,077,100	
第317回利付国債(10年)	940,000,000	996,757,200	
第318回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,339,380,100	
第319回利付国債(10年)	740,000,000	786,368,400	
第320回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,426,491,000	
第321回利付国債(10年)	1,420,000,000	1,503,283,000	
第322回利付国債(10年)	680,000,000	715,638,800	
第323回利付国債(10年)	690,000,000	727,377,300	
第324回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,257,216,000	
第325回利付国債(10年)	2,455,000,000	2,575,687,800	
第326回利付国債(10年)	560,000,000	584,018,400	
第327回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,553,807,600	
第328回利付国債(10年)	2,165,000,000	2,242,225,550	
第329回利付国債(10年)	2,385,000,000	2,505,776,400	
第330回利付国債(10年)	2,080,000,000	2,186,308,800	
第331回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,160,028,800	
第332回利付国債(10年)	2,990,000,000	3,095,337,700	
第333回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,187,892,400	
第334回利付国債(10年)	3,440,000,000	3,558,164,000	
第335回利付国債(10年)	3,045,000,000	3,121,003,200	
第336回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,362,917,500	
第337回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,103,835,800	
第338回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,114,484,300	
第339回利付国債(10年)	3,485,000,000	3,530,270,150	
第340回利付国債(10年)	3,950,000,000	3,995,030,000	

第1回利付国債(30年)	50,000,000	64,729,000
第2回利付国債(30年)	100,000,000	124,345,000
第3回利付国債(30年)	140,000,000	172,407,200
第4回利付国債(30年)	190,000,000	250,581,500
第5回利付国債(30年)	180,000,000	219,587,400
第6回利付国債(30年)	270,000,000	337,491,900
第7回利付国債(30年)	390,000,000	481,946,400
第8回利付国債(30年)	270,000,000	312,373,800
第9回利付国債(30年)	180,000,000	196,615,800
第10回利付国債(30年)	170,000,000	177,063,500
第11回利付国債(30年)	280,000,000	318,222,800
第12回利付国債(30年)	370,000,000	444,133,200
第13回利付国債(30年)	350,000,000	413,854,000
第14回利付国債(30年)	350,000,000	436,796,500
第15回利付国債(30年)	500,000,000	631,975,000
第16回利付国債(30年)	250,000,000	315,995,000
第17回利付国債(30年)	420,000,000	523,567,800
第18回利付国債(30年)	540,000,000	663,022,800
第19回利付国債(30年)	300,000,000	367,884,000
第20回利付国債(30年)	290,000,000	365,716,100
第21回利付国債(30年)	360,000,000	440,622,000
第22回利付国債(30年)	410,000,000	516,665,600
第23回利付国債(30年)	370,000,000	466,063,100
第24回利付国債(30年)	310,000,000	390,296,200
第25回利付国債(30年)	355,000,000	433,639,600
第26回利付国債(30年)	700,000,000	868,028,000
第27回利付国債(30年)	550,000,000	693,137,500
第28回利付国債(30年)	690,000,000	871,318,200
第29回利付国債(30年)	470,000,000	584,971,400
第30回利付国債(30年)	890,000,000	1,090,855,200
第31回利付国債(30年)	810,000,000	976,949,100
第32回利付国債(30年)	960,000,000	1,178,361,600
第33回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,315,150,500
第34回利付国債(30年)	910,000,000	1,099,198,100
第35回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,338,968,000
第36回利付国債(30年)	1,085,000,000	1,263,374,000
第37回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,448,638,200
第38回利付国債(30年)	885,000,000	987,987,450
第39回利付国債(30年)	540,000,000	614,374,200
第40回利付国債(30年)	720,000,000	801,619,200
第41回利付国債(30年)	685,000,000	746,636,300
第42回利付国債(30年)	820,000,000	892,397,800
第43回利付国債(30年)	755,000,000	821,236,150

第44回利付国債（30年）	760,000,000	826,241,600	
第45回利付国債（30年）	720,000,000	747,187,200	
第46回利付国債（30年）	910,000,000	942,578,000	
第47回利付国債（30年）	960,000,000	1,017,091,200	
第48回利付国債（30年）	1,450,000,000	1,463,833,000	
第34回利付国債（20年）	70,000,000	73,122,000	
第35回利付国債（20年）	270,000,000	281,358,900	
第37回利付国債（20年）	410,000,000	432,648,400	
第39回利付国債（20年）	640,000,000	677,958,400	
第40回利付国債（20年）	450,000,000	478,836,000	
第41回利付国債（20年）	520,000,000	545,537,200	
第42回利付国債（20年）	380,000,000	412,303,800	
第43回利付国債（20年）	340,000,000	377,070,200	
第44回利付国債（20年）	370,000,000	409,083,100	
第45回利付国債（20年）	270,000,000	297,305,100	
第46回利付国債（20年）	290,000,000	318,408,400	
第47回利付国債（20年）	470,000,000	518,452,300	
第48回利付国債（20年）	230,000,000	258,469,400	
第49回利付国債（20年）	280,000,000	310,405,200	
第50回利付国債（20年）	590,000,000	647,861,300	
第51回利付国債（20年）	240,000,000	265,898,400	
第52回利付国債（20年）	430,000,000	480,714,200	
第53回利付国債（20年）	350,000,000	393,036,000	
第54回利付国債（20年）	280,000,000	316,108,800	
第55回利付国債（20年）	490,000,000	549,339,000	
第56回利付国債（20年）	410,000,000	461,619,000	
第57回利付国債（20年）	360,000,000	402,854,400	
第58回利付国債（20年）	250,000,000	280,812,500	
第59回利付国債（20年）	440,000,000	489,733,200	
第60回利付国債（20年）	570,000,000	622,497,000	
第61回利付国債（20年）	390,000,000	415,307,100	
第62回利付国債（20年）	250,000,000	262,757,500	
第63回利付国債（20年）	570,000,000	641,797,200	
第64回利付国債（20年）	410,000,000	465,801,000	
第65回利付国債（20年）	370,000,000	421,289,400	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	373,127,700	
第67回利付国債（20年）	310,000,000	353,989,000	
第68回利付国債（20年）	230,000,000	268,262,800	
第69回利付国債（20年）	530,000,000	613,851,300	
第70回利付国債（20年）	490,000,000	581,228,200	
第71回利付国債（20年）	400,000,000	467,760,000	
第72回利付国債（20年）	710,000,000	826,582,000	

第73回利付国債(20年)	540,000,000	625,806,000	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	362,005,600	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	421,246,800	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	391,673,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	336,707,400	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	23,077,600	
第79回利付国債(20年)	570,000,000	663,012,600	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	293,120,000	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	209,732,400	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	569,729,500	
第83回利付国債(20年)	270,000,000	317,876,400	
第84回利付国債(20年)	590,000,000	688,535,900	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	424,515,600	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	287,788,800	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	202,158,900	
第88回利付国債(20年)	530,000,000	637,075,900	
第89回利付国債(20年)	320,000,000	381,392,000	
第90回利付国債(20年)	620,000,000	740,546,600	
第91回利付国債(20年)	510,000,000	614,463,300	
第92回利付国債(20年)	790,000,000	937,137,500	
第93回利付国債(20年)	500,000,000	588,755,000	
第94回利付国債(20年)	645,000,000	766,472,850	
第95回利付国債(20年)	510,000,000	618,706,500	
第96回利付国債(20年)	200,000,000	238,082,000	
第97回利付国債(20年)	510,000,000	613,851,300	
第98回利付国債(20年)	450,000,000	536,571,000	
第99回利付国債(20年)	810,000,000	966,767,400	
第100回利付国債(20年)	730,000,000	881,022,400	
第101回利付国債(20年)	360,000,000	443,127,600	
第102回利付国債(20年)	500,000,000	616,610,000	
第103回利付国債(20年)	300,000,000	366,189,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	430,628,400	
第105回利付国債(20年)	580,000,000	694,700,800	
第106回利付国債(20年)	310,000,000	375,270,500	
第107回利付国債(20年)	430,000,000	515,969,900	
第108回利付国債(20年)	690,000,000	810,529,200	
第109回利付国債(20年)	370,000,000	434,698,200	
第110回利付国債(20年)	565,000,000	678,282,500	
第111回利付国債(20年)	320,000,000	388,620,800	
第112回利付国債(20年)	970,000,000	1,165,736,300	
第113回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,418,607,800	
第114回利付国債(20年)	700,000,000	842,289,000	
第115回利付国債(20年)	350,000,000	425,705,000	

第116回利付国債（20年）	450,000,000	547,834,500	
第117回利付国債（20年）	770,000,000	927,226,300	
第118回利付国債（20年）	500,000,000	595,050,000	
第119回利付国債（20年）	390,000,000	453,394,500	
第120回利付国債（20年）	500,000,000	567,515,000	
第121回利付国債（20年）	770,000,000	906,397,800	
第122回利付国債（20年）	540,000,000	627,901,200	
第123回利付国債（20年）	710,000,000	855,521,600	
第124回利付国債（20年）	400,000,000	476,484,000	
第125回利付国債（20年）	300,000,000	365,835,000	
第126回利付国債（20年）	520,000,000	619,195,200	
第127回利付国債（20年）	550,000,000	646,805,500	
第128回利付国債（20年）	640,000,000	752,748,800	
第129回利付国債（20年）	250,000,000	290,312,500	
第130回利付国債（20年）	840,000,000	974,660,400	
第131回利付国債（20年）	360,000,000	412,581,600	
第132回利付国債（20年）	200,000,000	228,802,000	
第133回利付国債（20年）	890,000,000	1,031,732,500	
第134回利付国債（20年）	350,000,000	405,618,500	
第135回利付国債（20年）	640,000,000	731,840,000	
第136回利付国債（20年）	290,000,000	327,389,700	
第137回利付国債（20年）	370,000,000	422,895,200	
第138回利付国債（20年）	540,000,000	600,393,600	
第139回利付国債（20年）	350,000,000	394,586,500	
第140回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,369,788,000	
第141回利付国債（20年）	800,000,000	911,928,000	
第142回利付国債（20年）	480,000,000	554,798,400	
第143回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,200,743,300	
第144回利付国債（20年）	440,000,000	486,714,800	
第145回利付国債（20年）	1,300,000,000	1,477,463,000	
第146回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,384,334,000	
第147回利付国債（20年）	1,460,000,000	1,629,798,000	
第148回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,481,692,500	
第149回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,477,372,500	
第150回利付国債（20年）	1,670,000,000	1,795,400,300	
第151回利付国債（20年）	1,530,000,000	1,587,757,500	
第152回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,407,341,600	
第153回利付国債（20年）	1,560,000,000	1,636,408,800	
第154回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,862,055,600	
第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,706,000	
国債証券合計	237,959,000,000	255,771,222,370	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,053,000

第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	243,810,000	
第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	237,342,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,072,000	
第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	239,674,000	
第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,284,000	
第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,757,000	
第645回東京都公募公債	100,000,000	102,151,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	102,928,000	
第647回東京都公募公債	100,000,000	102,898,000	
第657回東京都公募公債	100,000,000	103,968,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	105,926,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	105,206,000	
第714回東京都公募公債	200,000,000	207,850,000	
第722回東京都公募公債	200,000,000	208,664,000	
平成19年度第14回北海道公募公債(10年)	100,000,000	103,464,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,202,000	
平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	105,483,000	
平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,821,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	103,875,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,692,000	
第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,547,000	
第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,615,000	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	105,432,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	105,138,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	105,427,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	104,841,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	104,481,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	104,878,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	104,717,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	103,427,000	
第298回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,009,000	
第305回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,074,000	
第324回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,962,000	
第331回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,947,000	
第334回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,466,000	
第335回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,609,000	
第339回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,514,000	
第356回大阪府公募公債(10年)	130,000,000	136,637,800	
第363回大阪府公募公債(10年)	114,000,000	118,151,880	
第371回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,334,000	
第376回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,961,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	104,609,000	

平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	105,112,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	108,153,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,042,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	105,469,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	105,524,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	103,179,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,396,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	105,695,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	106,712,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,662,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,429,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	102,687,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,837,000	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,617,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,182,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,774,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,272,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	118,318,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,794,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,393,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,256,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,241,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	104,591,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	120,799,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	287,555,680	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	104,455,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	103,401,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	103,485,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	104,892,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	105,149,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,955,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,135,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,844,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,255,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	123,660,000	



平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	104,592,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	234,864,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	105,012,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	113,177,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	120,454,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	119,731,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,071,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	105,525,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	104,943,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,334,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,507,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,581,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	141,593,894	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	145,681,564	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,074,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,874,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,180,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,052,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,150,000	
第72回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,509,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,117,000	
第76回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,761,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,375,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,952,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,845,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,442,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,619,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,464,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,830,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,353,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,895,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,604,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,925,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,066,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,630,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,662,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,962,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,122,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,080,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	186,179,526	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,505,000	

第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,989,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,444,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,263,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,765,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,144,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,446,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,934,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	104,212,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	105,348,000	
平成21年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	209,848,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	105,528,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	113,603,000	
第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	104,250,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,184,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	116,069,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	103,365,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	105,638,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,399,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	104,550,000	
平成22年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,611,000	
平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	104,113,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,733,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	112,491,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	112,921,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,849,000	
平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,851,000	
第79回川崎市公募公債	100,000,000	103,153,000	
平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	103,325,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,237,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	104,264,000	
平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	159,888,421	
平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	106,604,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	104,212,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	104,216,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,368,000	
地方債証券合計	17,518,830,000	18,662,927,765	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	210,216,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	233,505,300
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,083,000

第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	200,990,000	
第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,858,000	
第41回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,079,000	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,325,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	178,488,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,248,000	
第21回道路債券	100,000,000	126,565,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	245,610,000	
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	127,425,000	
第27回道路債券	100,000,000	116,645,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,197,000	
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	197,022,120	
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,915,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,408,000	
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	102,205,000	
第33回道路債券	100,000,000	129,349,000	
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	102,339,000	
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,499,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,528,000	
第38回道路債券	100,000,000	115,921,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,010,000	
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	206,196,000	
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	120,595,000	
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	206,296,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,459,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,985,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,756,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,679,000	
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	103,089,000	

第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,145,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,959,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,850,000	
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	103,933,000	
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	104,465,000	
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	103,875,000	
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	103,945,000	
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	208,838,000	
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	104,888,000	
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	117,841,000	
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	104,608,000	
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	238,240,000	
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	104,303,000	
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	105,161,000	
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	104,433,000	
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	209,900,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,162,000	
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,439,000	
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	120,423,000	
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	105,081,000	
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	105,631,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,101,000	
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	105,288,000	
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	118,364,000	
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	105,391,000	
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	117,973,000	
	170,000,000	176,590,900	

第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	116,298,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,316,000	
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	105,456,000	
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	105,050,000	
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	131,406,250	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,685,000	
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	105,293,000	
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	104,846,000	
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	104,525,000	
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	208,674,000	
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	112,395,000	
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	209,374,000	
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	113,023,000	
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	216,315,000	
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	205,108,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,981,000	
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	105,309,000	
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	104,496,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	110,523,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,415,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	119,669,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,178,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,766,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,823,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,264,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,671,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	238,406,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,142,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	118,951,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	116,635,000	

第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,061,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,608,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,203,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,466,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,333,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,531,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,989,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	349,467,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,215,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	237,324,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	114,240,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,511,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,160,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	332,649,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	119,176,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,419,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,900,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,428,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	227,507,140	
第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,865,000	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,330,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,500,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,924,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,172,000	
第877回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,764,000	
第879回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,656,000	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,924,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	205,640,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	107,273,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	106,428,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	102,912,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	104,717,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,352,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	103,812,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	103,543,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,188,000	21,177,212	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,230,000	156,061,253	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,252,000	52,017,586	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,753,000	26,920,125	

第 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,143,000	
第 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	62,172,000	66,048,424	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	21,229,000	22,512,080	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	22,203,000	24,036,967	
第 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,571,000	
第 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,565,000	15,080,746	
第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	89,256,000	96,574,099	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	23,225,000	25,086,948	
第 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,580,000	67,031,941	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	22,909,000	24,767,607	
第 1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,690,000	34,826,026	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	23,719,000	25,632,886	
第 1 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,703,000	19,093,518	
第 1 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,128,000	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,753,000	19,577,381	
第 1 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	31,345,000	33,722,831	
第 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,975,000	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	112,071,000	117,834,811	
第 1 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,304,000	
第 1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,348,000	21,461,442	
第 1 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	37,407,000	39,134,081	
第 2 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,132,000	45,951,107	
第 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,862,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,050,000	44,808,127	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,634,000	24,910,708	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,842,000	45,549,201	
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,610,000	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,466,000	85,967,113	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,341,000	27,894,592	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,050,000	83,835,687	
第 2 9 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,887,000	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,174,000	30,894,974	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	93,378,000	98,839,679	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,540,000	34,654,449	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,270,000	57,997,263	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,251,000	62,249,931	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,584,000	30,495,126	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,067,000	64,014,002	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,147,000	32,186,746	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	85,449,000	91,017,711	

第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,086,000	137,872,322
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,154,000	66,653,949
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,857,000	33,263,228
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,425,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,704,000	31,270,711
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,589,000	77,254,468
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,215,000	78,639,698
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,713,000
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	223,839,000	239,503,253
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,416,000	300,980,040
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,486,000	29,823,959
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,505,000	73,087,984
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,431,000	72,663,457
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	85,389,000	92,741,846
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,028,000	77,488,550
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,351,000	31,708,178
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,483,000	80,493,768
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,004,000	82,078,148
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,230,000	84,146,026
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,561,000	83,583,604
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,536,000	87,922,454
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,494,000	90,004,791
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,666,000	87,951,887
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,029,000	86,296,102
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,884,000	87,202,182
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,231,000	90,916,509
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,318,000
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,596,000
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,118,000
い第740号商工債	200,000,000	200,620,000
い第741号商工債	200,000,000	200,668,000
い第758号商工債	100,000,000	100,534,000
い第773号商工債	100,000,000	100,076,000
い第786号商工債	100,000,000	100,069,000
い第745号農林債	120,000,000	120,268,800
い第749号農林債	100,000,000	100,168,000
い第751号農林債	100,000,000	100,197,000
い第765号農林債	100,000,000	100,281,000
い第766号農林債	300,000,000	300,834,000
い第769号農林債	100,000,000	100,317,000
第266回信金中金債（5年）	100,000,000	100,310,000
第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,334,000
第275回信金中金債（5年）	100,000,000	100,224,000



	第278回信金中金債（5年）	100,000,000	100,266,000	
	第280回信金中金債（5年）	100,000,000	100,073,000	
	第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,349,000	
	第295回信金中金債（5年）	100,000,000	100,229,000	
	第299回信金中金債（5年）	200,000,000	200,152,000	
	第168号商工債（3年）	100,000,000	100,028,000	
	第182号商工債（3年）	100,000,000	99,936,000	
	第183号商工債（3年）	200,000,000	199,890,000	
	第21回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,075,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,697,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,728,000	
	第20回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,974,000	
	第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,777,000	
	第21回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,129,000	
	特殊債券合計	23,663,141,000	25,332,571,004	
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	101,070,000	
	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	101,305,000	
	第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,642,000	
	第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,022,000	
	第4回スウェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,236,000	
	第13回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	100,165,000	
	第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,359,000	
	第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	202,476,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	201,602,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,260,000	
	第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債	100,000,000	100,114,000	
	第21回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,322,000	
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	103,273,000	
	第20回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,139,000	
	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	100,453,000	
	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	103,542,000	
	第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	102,049,000	
	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	101,159,000	
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	102,483,000		

第29回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,421,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,375,000	
第9回宇部興産株式会社無担保社債	100,000,000	100,847,000	
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	102,167,000	
第1回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,433,000	
第2回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,261,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,247,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	104,658,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,952,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,636,000	
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,961,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,609,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,667,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,391,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,726,000	
第1回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	100,461,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	101,268,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,006,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,249,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	101,455,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,295,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,042,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	200,000,000	202,766,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,474,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,400,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	105,650,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,760,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,760,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,760,000	
第92回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,641,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	115,504,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,716,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,622,000	
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	114,144,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,744,000	
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	106,181,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,848,000	
	100,000,000	106,763,000	

第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）			
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,286,000	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,317,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,037,000	
第140回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,159,000	
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	99,904,000	
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	108,151,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,164,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,257,000	
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	213,348,000	
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	115,134,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,540,000	
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	102,360,000	
第6回興銀リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,503,000	
第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,115,000	
第63回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	101,059,000	
第9回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	101,336,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,665,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,792,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,449,000	
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	100,381,000	
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	103,932,000	
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	106,528,000	
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	101,425,000	
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	101,411,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,251,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	110,875,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	102,180,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	118,725,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,140,000	

第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,719,000	
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	104,578,000	
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	100,841,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,495,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,404,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,871,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,248,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,081,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,498,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,294,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,093,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,906,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,910,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,308,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,929,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,840,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	119,113,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	119,040,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	110,846,000	
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	102,874,000	
第19回株式会社商船三井無担保社債	100,000,000	98,826,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,728,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,099,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,885,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,544,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	104,631,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,027,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,047,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,794,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,117,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,122,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,206,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,294,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	107,743,000	

第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,681,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,224,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,171,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,591,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,138,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,379,000	
第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,627,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,260,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,704,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,428,000	
第459回東北電力株式会社社債	173,000,000	174,384,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,442,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,962,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,842,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,746,000	
第396回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,905,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,238,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,194,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,475,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	101,659,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,217,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,689,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,915,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,185,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,338,000	
社債券合計	15,173,000,000	15,777,299,000	
合計		315,544,020,139	

(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27年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,378,498,186
コール・ローン	1,203,491,397
株式	208,437,246,959
投資信託受益証券	210,309,606
投資証券	5,268,359,926
派生商品評価勘定	295,369,258
未収入金	2,929,547
未収配当金	403,070,517
未収利息	1,855
差入委託証拠金	2,959,625,423
流動資産合計	225,158,902,674
資産合計	225,158,902,674
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	146,505,814
前受金	155,048,367
未払解約金	425,003,479
流動負債合計	726,557,660
負債合計	726,557,660
純資産の部	
元本等	
元本	104,088,914,553
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	120,343,430,461
元本等合計	224,432,345,014
純資産合計	224,432,345,014
負債純資産合計	225,158,902,674

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27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27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 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27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	104,088,914,553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) 2.1562円 (21,562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27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コンプライアンス・リスク統括部が、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27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27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27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27年 6月11日
期首元本額	96,857,370,344円
期中追加設定元本額	19,787,540,182円
期中一部解約元本額	12,555,995,973円
期末元本額	104,088,914,553円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,332,751,154円
D C 外国株式インデックスファンド	4,549,720,513円
D C 外国株式インデックスファンド L	17,179,591,725円
D C バランスファンド 3 0	565,160,923円
D C バランスファンド 5 0	1,197,012,862円

区分	平成27年12月10日現在
DCバランスファンド70	671,900,498円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	45,248,005円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	25,693,558円
新生・4分散ファンド	58,424,323円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	470,891,404円
外国株式インデックスe	6,802,040,011円
インデックスコレクション（外国株式）	3,393,519,367円
インデックスコレクション（バランス株式30）	430,790,010円
インデックスコレクション（バランス株式50）	550,711,164円
インデックスコレクション（バランス株式70）	530,286,578円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,946,878,120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）	1,239,373,560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）	2,349,343,771円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	497,451,867円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	4,679,629,169円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	447,474,977円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	826,034,830円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	81,914,152円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	5,179,708,848円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,215,315,725円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	644,799,177円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,379,496,263円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,179,548,033円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	9,914,623,300円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,840,120,659円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	55,541,430円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	620,809,744円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	117,476,440円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	276,230,520円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	740,380,622円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	44,582,513円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,156,429,657円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	31,235,469円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	216,971,529円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	586,325,172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）	17,476,911円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27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	2,947,352,086
投資信託受益証券	15,111,204
投資証券	241,473,319
合計	3,203,936,609

(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27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	10,240,066,416	-	10,395,114,783	155,048,367
合計		10,240,066,416	-	10,395,114,783	155,048,367

(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27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	997,816,374	-	989,758,960	8,057,414
	アメリカドル	738,229,194	-	729,122,960	9,106,234
	ユーロ	147,915,600	-	149,912,000	1,996,400
	イギリスポンド	111,671,580	-	110,724,000	947,580
	売建	299,136,371	-	297,263,880	1,872,491
	アメリカドル	219,474,763	-	217,583,590	1,891,173
	ユーロ	59,551,686	-	59,563,250	11,564
	イギリスポンド	20,109,922	-	20,117,040	7,118
合計		1,296,952,745	-	1,287,022,840	6,184,923

(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	30,038	50.83	1,526,831.54	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,927	19.48	57,017.96	
	APACHE CORP	22,160	44.95	996,092.00	
	BAKER HUGHES	26,747	53.03	1,418,393.41	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,017	17.37	399,805.29	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	11,835	64.72	765,961.20	
	CHENIERE ENERGY INC	12,675	42.42	537,673.50	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	31,007	4.47	138,601.29	
	CHEVRON CORP	112,102	87.60	9,820,135.20	
	CIMAREX ENERGY CO	5,950	104.18	619,871.00	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	19,032	19.39	369,030.48	
	CONCHO RESOURCES INC	7,354	99.36	730,693.44	
	CONOCOPHILLIPS	73,492	48.47	3,562,157.24	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,454	29.20	130,056.80	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,361	114.00	269,154.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,367	35.32	860,642.44	
	ENERGEN CORP	4,573	51.05	233,451.65	
	ENSCO PLC-CL A	14,447	14.86	214,682.42	
	EOG RESOURCES INC	32,551	78.38	2,551,347.38	
	EQT CORPORATION	9,555	51.75	494,471.25	
	EXXON MOBIL	248,687	75.63	18,808,197.81	
	FMC TECHNOLOGIES INC	13,591	31.43	427,165.13	
	HALLIBURTON CO	50,305	38.30	1,926,681.50	
	HELMERICH & PAYNE	5,887	51.73	304,534.51	
	HESS CORP	15,325	51.97	796,440.25	
	HOLLYFRONTIER CORP	10,931	45.49	497,251.19	
	KINDER MORGAN INC	112,896	16.81	1,897,781.76	
	MARATHON OIL CORP	41,827	14.50	606,491.50	
	MARATHON PETROLEUM CORP	31,603	51.98	1,642,723.94	
	MURPHY OIL CORP	9,351	22.85	213,670.35	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	23,957	33.85	810,944.45		
NOBLE ENERGY INC	26,454	33.06	874,569.24		

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	45,364	67.95	3,082,483.80
OCEANEERING INTL INC	5,399	39.98	215,852.02
ONEOK INC	12,311	22.20	273,304.20
PHILLIPS 66	31,865	86.09	2,743,257.85
PIONEER NATURAL RESOURCES	9,258	143.10	1,324,819.80
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	10,057	10.18	102,380.26
RANGE RESOURCES CORP	8,808	26.14	230,241.12
SCHLUMBERGER	75,415	72.12	5,438,929.80
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,593	6.95	143,121.35
SPECTRA ENERGY CORP	41,393	23.94	990,948.42
TESORO CORP	7,780	107.77	838,450.60
VALERO ENERGY CORP	29,445	69.88	2,057,616.60
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	45,274	9.40	425,575.60
WHITING PETROLEUM CORP	11,963	12.65	151,331.95
WILLIAMS COS	42,024	28.94	1,216,174.56
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,024	133.85	1,609,412.40
AIRGAS INC	3,841	137.40	527,753.40
ALBEMARLE CORP	7,122	50.02	356,242.44
ALCOA	80,917	8.74	707,214.58
ASHLAND INC	3,372	107.79	363,467.88
AVERY DENNISON CORP	5,057	63.62	321,726.34
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,941	27.42	190,322.22
BALL CORP	7,616	68.84	524,285.44
CELANESE CORP-SERIES A	9,613	67.04	644,455.52
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,310	43.12	573,927.20
CROWN HOLDINGS INC	9,048	49.69	449,595.12
DOW CHEMICAL CO	66,770	56.97	3,803,886.90
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	53,581	74.49	3,991,248.69
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,372	70.89	664,381.08
ECOLAB INC	15,657	116.95	1,831,086.15
FMC CORP	7,713	40.49	312,299.37
FREEMPORT-MCMORAN INC	57,316	6.99	400,638.84
INT'L PAPER CO	24,778	39.40	976,253.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,157	120.72	622,553.04
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,415	88.83	2,079,954.45
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,619	144.46	522,800.74
MONSANTO CO	27,674	96.61	2,673,585.14
MOSAIC CO/THE	18,201	30.84	561,318.84
NEWMONT MINING CORP	33,828	19.60	663,028.80
NUCOR CORP	19,724	40.00	788,960.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,215	65.79	408,884.85
PPG INDUSTRIES INC	15,942	101.55	1,618,910.10

PRAXAIR INC	16,894	107.06	1,808,671.64
SEALED AIR CORP	13,014	44.03	573,006.42
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,667	267.71	1,249,402.57
VULCAN MATERIALS CO	8,251	94.72	781,534.72
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,689	56.20	151,121.80
WESTROCK CO	16,359	48.05	786,049.95
3 M COMPANY	37,233	156.05	5,810,209.65
ACUITY BRANDS INC	2,799	230.08	643,993.92
AERCAP HOLDINGS NV	4,783	41.31	197,585.73
AGCO CORP	3,843	50.26	193,149.18
AMETEK INC	13,550	54.00	731,700.00
B/E AEROSPACE INC	5,411	42.61	230,562.71
BOEING CO	38,471	144.24	5,549,057.04
CATERPILLAR	33,840	65.91	2,230,394.40
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,184	38.84	240,186.56
CUMMINS INC	10,611	89.92	954,141.12
DANAHER CORP	36,648	94.47	3,462,136.56
DEERE&CO	18,473	79.24	1,463,800.52
DOVER CORP	9,943	63.40	630,386.20
EATON CORP	27,508	52.67	1,448,846.36
EMERSON ELECTRIC CO	38,825	47.14	1,830,210.50
FASTENAL CO	17,346	40.22	697,656.12
FLOWSERVE CORP	7,966	42.10	335,368.60
FLUOR CORP	9,602	45.32	435,162.64
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	9,904	54.20	536,796.80
GENERAL DYNAMICS CORP	16,211	140.17	2,272,295.87
GENERAL ELECTRIC CO	563,297	30.47	17,163,659.59
GRAINGER (WW) INC	3,721	193.12	718,599.52
HONEYWELL INTL INC	44,256	101.89	4,509,243.84
ILLINOIS TOOL WORKS	19,419	92.39	1,794,121.41
INGERSOLL-RAND PLC	16,344	54.95	898,102.80
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,216	42.77	265,858.32
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,512	120.61	544,192.32
LOCKHEED MARTIN CORP	16,469	217.54	3,582,666.26
MASCO CORP	19,054	29.30	558,282.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,502	186.55	1,959,148.10
PACCAR INC	22,055	48.84	1,077,166.20
PARKER HANNIFIN CORP	7,833	97.68	765,127.44
PENTAIR PLC	11,156	52.50	585,690.00
PRECISION CASTPARTS CORP	8,076	232.10	1,874,439.60
QUANTA SERVICES INC	10,395	20.33	211,330.35
RAYTHEON COMPANY	17,932	126.15	2,262,121.80

ROCKWELL AUTOMATION INC	8,345	103.81	866,294.45
ROCKWELL COLLIN	8,295	90.13	747,628.35
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,221	185.45	1,153,684.45
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,829	44.34	480,157.86
SNAP-ON INC	3,400	169.43	576,062.00
STANLEY BLACK&DECKER	9,486	108.09	1,025,341.74
TEXTRON	17,560	41.47	728,213.20
TRANSDIGM GROUP INC	3,294	230.24	758,410.56
UNITED RENTALS INC	5,009	71.07	355,989.63
UNITED TECHNOLOGIES CORP	50,419	94.16	4,747,453.04
WABCO HOLDINGS INC	3,642	101.69	370,354.98
WABTEC CORP	6,188	72.89	451,043.32
XYLEM INC	9,576	36.26	347,225.76
ADT CORPORATION	9,976	33.75	336,690.00
CINTAS CORP	5,410	91.23	493,554.30
DUN & BRADSTREET CORP	2,153	104.39	224,751.67
EQUIFAX INC	7,486	109.91	822,786.26
IHS INC-CLASS A	3,877	115.84	449,111.68
MANPOWER GROUP	4,737	83.93	397,576.41
NIELSEN HOLDINGS PLC	21,530	45.09	970,787.70
REPUBLIC SERVICES INC	13,687	43.96	601,680.52
ROBERT HALF INTL INC	7,911	47.76	377,829.36
STERICYCLE INC	5,353	116.55	623,892.15
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,877	126.46	490,285.42
TYCO INTERNATIONAL PLC	26,388	33.25	877,401.00
VERISK ANALYTICS INC	9,877	76.47	755,294.19
WASTE MANAGEMENT INC	26,526	51.89	1,376,434.14
AMERCO	376	393.12	147,813.12
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,742	43.65	425,238.30
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,220	60.55	558,271.00
CSX CORP	57,918	25.01	1,448,529.18
DELTA AIR LINES INC	11,444	49.51	566,592.44
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,441	46.29	483,313.89
FEDEX CORP	15,849	147.05	2,330,595.45
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	21,373	14.25	304,565.25
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,521	74.21	409,713.41
KANSAS CITY SOUTHERN	7,039	76.11	535,738.29
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,747	87.55	1,553,749.85
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,790	44.50	391,155.00
UNION PACIFIC CORP	51,704	77.54	4,009,128.16
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,600	57.86	324,016.00
UNITED PARCEL SERVICE B	41,618	100.46	4,180,944.28

AUTOLIV INC	5,464	127.96	699,173.44
BORGWARNER INC	14,286	41.27	589,583.22
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,711	84.40	1,410,408.40
FORD MOTOR COMPANY	220,534	13.89	3,063,217.26
GENERAL MOTORS CO	84,917	35.45	3,010,307.65
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,142	33.49	574,085.58
HARLEY-DAVIDSON	12,832	46.14	592,068.48
JOHNSON CONTROLS INC	38,532	40.71	1,568,637.72
LEAR CORP	4,994	122.91	613,812.54
TESLA MOTORS INC	5,831	224.52	1,309,176.12
COACH INC	16,231	30.51	495,207.81
DR HORTON INC	18,907	31.84	601,998.88
GARMIN LTD	6,761	37.37	252,658.57
HANESBRANDS INC	25,195	30.62	771,470.90
HARMAN INTL INDS INC	4,546	95.48	434,052.08
HASBRO INC	6,950	68.41	475,449.50
JARDEN CORP	12,560	53.14	667,438.40
LEGGETT & PLATT INC	8,617	43.97	378,889.49
LENNAR CORP-CL A	11,135	49.28	548,732.80
LULULEMON ATHLETICA INC	6,418	45.31	290,831.67
MATTEL INC	17,948	25.31	454,263.88
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	10,787	41.94	452,406.78
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,834	190.23	729,341.82
NEWELL RUBBERMAID	16,632	46.52	773,720.64
NIKE B	40,401	128.84	5,205,264.84
POLARIS INDUSTRIES INC	3,977	94.92	377,496.84
PULTE GROUP INC	17,706	18.02	319,062.12
PVH CORP	4,835	78.57	379,885.95
RALPH LAUREN CORPORATION	3,612	118.19	426,902.28
TOLL BROTHERS INC	10,429	33.84	352,917.36
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,148	86.31	962,183.88
VF CORP	21,070	62.75	1,322,142.50
WHIRLPOOL CORP	4,901	148.25	726,573.25
ARAMARK	11,993	33.52	402,005.36
BLOCK H & R INC	13,183	32.66	430,556.78
CARNIVAL CORPORATION	25,579	50.31	1,286,879.49
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,910	548.01	1,046,699.10
DARDEN RESTAURANTS INC	6,050	58.09	351,444.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	30,531	21.74	663,743.94
LAS VEGAS SANDS CORP	24,885	43.70	1,087,474.50
MARRIOTT INTL A	12,374	68.02	841,679.48
MCDONALD'S CORP	56,133	116.58	6,543,985.14



MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	5,200	16.05	83,460.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,831	22.06	636,011.86
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,214	57.03	582,504.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,964	92.85	1,018,007.40
STARBUCKS CORP	88,452	61.18	5,411,493.36
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,756	68.59	737,754.04
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,682	75.20	577,686.40
WYNN RESORTS LTD	4,212	69.91	294,460.92
YUM BRANDS INC	25,419	73.80	1,875,922.20
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	11,519	29.99	345,454.81
CBS CORP-CL B	26,080	48.36	1,261,228.80
CHARTER COMMUNICATION-A	5,182	185.31	960,276.42
COMCAST CORP-CL A	126,056	58.59	7,385,621.04
COMCAST CORP-SPECIAL A	21,607	58.61	1,266,386.27
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,429	28.45	211,355.05
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	14,891	27.29	406,375.39
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,850	59.85	828,922.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,934	23.15	530,922.10
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,326	41.29	591,520.54
LIBERTY GLOBAL PLC-C	35,946	39.73	1,428,134.58
LIBERTY MEDIA CORP	4,837	38.83	187,820.71
LIBERTY MEDIA CORP-C	13,035	37.58	489,855.30
NEWS CORP-CLASS A	22,501	13.50	303,763.50
OMNICOM GROUP	15,064	75.01	1,129,950.64
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,333	56.29	243,904.57
SIRIUS XM HOLDINGS INC	154,898	4.01	621,140.98
TEGNA INC	12,439	26.54	330,131.06
THE WALT DISNEY CO	95,650	111.47	10,662,105.50
TIME WARNER CABLE-A	16,856	183.92	3,100,155.52
TIME WARNER INC	48,587	68.30	3,318,492.10
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	72,325	28.14	2,035,225.50
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	27,151	28.97	786,564.47
VIACOM INC-CLASS B	19,713	43.97	866,780.61
ADVANCE AUTO PARTS	4,524	153.21	693,122.04
AMAZON.COM	23,731	664.79	15,776,131.49
AUTONATION INC	3,589	63.02	226,178.78
AUTOZONE INC	1,814	783.81	1,421,831.34
BED BATH & BEYOND INC	9,604	53.42	513,045.68
BEST BUY COMPANY INC	19,607	30.52	598,405.64
CARMAX INC	13,083	58.86	770,065.38
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,631	37.61	211,781.91
DOLLAR GENERAL CORP	17,242	71.00	1,224,182.00

DOLLAR TREE INC	13,759	78.45	1,079,393.55
EXPEDIA INC	6,382	125.02	797,877.64
FOOT LOCKER INC	8,666	66.44	575,769.04
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,469	32.44	177,414.36
GAP	14,100	26.51	373,791.00
GENUINE PARTS CO	9,408	87.27	821,036.16
HOME DEPOT	76,552	131.90	10,097,208.80
KOHL'S CORP	11,099	47.13	523,095.87
L BRANDS INC	14,578	97.64	1,423,395.92
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	27,359	27.12	741,976.08
LKQ CORP	17,698	28.67	507,401.66
LOWES COMPANIES	55,131	76.12	4,196,571.72
MACY'S INC	20,817	38.15	794,168.55
NETFLIX INC	24,033	124.20	2,984,898.60
NORDSTROM INC	9,072	56.67	514,110.24
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,847	257.72	1,506,888.84
PRICELINE GROUP INC/THE	3,014	1,294.99	3,903,099.86
ROSS STORES INC	25,696	54.04	1,388,611.84
SIGNET JEWELERS LTD	4,782	121.03	578,765.46
STAPLES INC	41,105	9.86	405,295.30
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,404	72.01	2,549,442.04
TIFFANY & CO	7,196	76.45	550,134.20
TJX COMPANIES INC	39,915	70.81	2,826,381.15
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,448	88.90	751,027.20
TRIPADVISOR INC	7,575	82.41	624,255.75
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,778	184.06	695,378.68
COSTCO WHOLESALE CORP	26,187	159.72	4,182,587.64
CVS HEALTH CORP	66,425	94.98	6,309,046.50
KROGER CO	55,115	41.25	2,273,493.75
RITE AID CORP	62,097	7.95	493,671.15
SYSCO CORP	36,802	41.13	1,513,666.26
WAL-MART STORES	95,909	59.13	5,671,099.17
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,903	83.34	4,325,596.02
WHOLE FOODS MKT INC	20,226	30.69	620,735.94
ALTRIA GROUP INC	116,864	57.33	6,699,813.12
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	35,724	35.41	1,264,986.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,704	102.64	688,098.56
BUNGE LIMITED	8,891	63.45	564,133.95
CAMPBELL SOUP CO (US)	11,600	53.53	620,948.00
COCA-COLA CO	246,358	42.66	10,509,632.28
COCA-COLA ENTERPRISES	12,434	49.64	617,223.76
CONAGRA	26,631	40.40	1,075,892.40

CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,631	140.18	1,490,253.58
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	11,892	90.94	1,081,458.48
GENERAL MILLS INC	36,640	58.58	2,146,371.20
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,296	86.61	805,126.56
HORMEL FOODS CORP	8,991	77.01	692,396.91
JM SMUCKER CO	7,112	122.59	871,860.08
KELLOGG CO	16,322	70.60	1,152,333.20
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	7,201	89.50	644,489.50
KRAFT HEINZ CO/THE	36,487	70.90	2,586,928.30
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,303	86.17	629,299.51
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	12,720	79.05	1,005,516.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,589	93.72	898,681.08
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	96,010	43.65	4,190,836.50
MONSTER BEVERAGE CORP	8,882	152.00	1,350,064.00
PEPSICO INC	87,567	99.13	8,680,516.71
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	92,294	88.02	8,123,717.88
REYNOLDS AMERICAN INC	51,028	45.42	2,317,691.76
TYSON FOODS INC	18,965	53.01	1,005,334.65
WHITEWAVE FOODS CO	11,185	38.12	426,372.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,101	85.95	696,280.95
CLOROX COMPANY	7,499	127.73	957,847.27
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,942	66.08	3,366,247.36
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	3,372	77.33	260,756.76
ESTEE LAUDER CO-CL A	13,217	86.24	1,139,834.08
KIMBERLY-CLARK CORP	21,560	120.28	2,593,236.80
PROCTER & GAMBLE CO	161,843	77.70	12,575,201.10
ABBOTT LABORATORIES	88,803	44.96	3,992,582.88
AETNA INC	20,587	103.87	2,138,371.69
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,031	100.67	1,211,160.77
ANTHEM INC	15,435	132.46	2,044,520.10
BARD C R INC	4,582	185.51	850,006.82
BAXTER INTERNATIONAL	33,465	36.77	1,230,508.05
BECTON DICKINSON & CO	12,870	152.87	1,967,436.90
BOSTON SCIENTIFIC CORP	79,258	18.48	1,464,687.84
CARDINAL HEALTH	19,275	87.51	1,686,755.25
CENTENE CORP	7,024	57.52	404,020.48
CERNER CORP	19,065	60.00	1,143,900.00
CIGNA CORP	15,195	137.12	2,083,538.40
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,780	70.86	763,870.80
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	8,960	60.89	545,574.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,633	162.01	1,074,612.33
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	11,897	25.86	307,656.42

EXPRESS SCRIPTS HOLDING	40,127	85.31	3,423,234.37
HCA HOLDINGS INC	20,519	67.38	1,382,570.22
HENRY SCHEIN INC	5,299	155.15	822,139.85
HOLOGIC INC	13,090	37.49	490,744.10
HUMANA INC	8,711	170.73	1,487,229.03
IMS HEALTH HOLDINGS INC	8,429	26.20	220,839.80
INTUITIVE SURGICAL INC	2,294	513.65	1,178,313.10
LABORATORY CRP OF AMER	6,240	122.88	766,771.20
MCKESSON CORP	13,746	187.06	2,571,326.76
MEDNAX INC	5,062	71.01	359,452.62
MEDTRONIC PLC	84,334	77.56	6,540,945.04
PATTERSON COMPANIES INC	5,902	44.06	260,042.12
QUEST DIAGNOSTICS	8,931	68.04	607,665.24
RESMED INC	8,274	55.06	455,566.44
ST JUDE MEDICAL INC	17,250	60.56	1,044,660.00
STRYKER CORP	19,989	92.32	1,845,384.48
THE COOPER COS INC	2,821	131.60	371,243.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	56,769	115.05	6,531,273.45
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,799	118.75	688,631.25
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,433	78.81	506,984.73
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,779	100.00	1,077,900.00
ABBVIE INC	98,653	56.03	5,527,527.59
AGILENT TECHNOLOGIES	21,016	40.98	861,235.68
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,763	183.16	2,520,831.08
ALKERMES PLC	9,466	73.33	694,141.78
ALLERGAN PLC	23,463	306.41	7,189,297.83
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,880	100.58	490,830.40
AMGEN	45,197	157.89	7,136,154.33
BAXALTA INC	33,377	37.21	1,241,958.17
BIOGEN INC	14,013	284.61	3,988,239.93
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,979	94.15	939,522.85
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	99,388	68.56	6,814,041.28
CELGENE CORP	47,112	110.94	5,226,605.28
ENDO INTERNATIONAL PLC	12,669	58.49	741,009.81
GILEAD SCIENCES INC	87,458	101.95	8,916,343.10
ILLUMINA INC	8,510	178.85	1,522,013.50
INCYTE CORP	10,078	108.21	1,090,540.38
ISIS PHARMACEUTICALS INC	6,863	57.20	392,563.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,889	138.43	538,354.27
JOHNSON & JOHNSON	165,276	102.15	16,882,943.40
LILLY (ELI) & CO	59,455	83.86	4,985,896.30
MALLINCKRODT PLC	6,349	70.88	450,017.12

MEDIVATION INC	9,040	42.02	379,860.80
MERCK & CO	167,696	52.82	8,857,702.72
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,739	331.53	576,530.67
MYLAN NV	24,638	50.70	1,249,146.60
PERRIGO CO PLC	8,990	148.16	1,331,958.40
PFIZER	367,677	32.29	11,872,290.33
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	4,830	66.69	322,112.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,514	547.39	2,470,918.46
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	377	148.27	55,897.79
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	23,735	134.39	3,189,746.65
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,948	153.68	453,048.64
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,426	120.63	1,740,208.38
WATERS CORP	5,270	128.93	679,461.10
ZOETIS INC	27,966	45.21	1,264,342.86
BANK OF AMERICA CORP	622,284	17.10	10,641,056.40
BB&T CORP	46,098	37.24	1,716,689.52
CIT GROUP INC	9,325	41.76	389,412.00
CITIGROUP	179,425	52.81	9,475,434.25
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30,646	26.10	799,860.60
COMERICA INC	10,500	42.49	446,145.00
FIFTH THIRD BANCORP	50,118	19.76	990,331.68
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,040	66.90	604,776.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	51,590	11.06	570,585.40
JPMORGAN CHASE & CO	220,748	65.46	14,450,164.08
KEY CORP	52,579	12.85	675,640.15
M & T BANK CORP	8,412	120.98	1,017,683.76
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,490	16.41	467,520.90
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,390	16.18	313,730.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,401	93.56	2,844,317.56
REGIONS FINL CORP	82,936	9.45	783,745.20
SIGNATURE BANK	2,790	153.38	427,930.20
SUNTRUST BANKS	30,158	42.27	1,274,778.66
US BANCORP	104,574	43.01	4,497,727.74
WELLS FARGO & CO	290,881	54.12	15,742,479.72
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,494	166.60	582,100.40
ALLY FINANCIAL INC	26,873	19.69	529,129.37
AMERICAN EXPRESS	53,691	69.86	3,750,853.26
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,437	108.83	1,135,858.71
BANK NEW YORK CO	65,497	42.40	2,777,072.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,640	131.71	9,303,994.40
BLACKROCK INC	7,259	344.57	2,501,233.63
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32,076	75.42	2,419,171.92

CME GROUP INC	18,977	94.05	1,784,786.85
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,581	54.08	1,383,420.48
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,489	29.62	547,644.18
EATON VANCE CORP	6,907	33.78	233,318.46
FRANKLIN RESOURCES INC	25,068	38.51	965,368.68
GOLDMAN SACHS GROUP INC	23,128	180.71	4,179,460.88
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,508	252.28	1,641,838.24
INVESCO LTD	26,852	32.37	869,199.24
LEGG MASON INC	4,994	41.61	207,800.34
LEUCADIA NATIONAL CORP	20,553	17.32	355,977.96
MCGRAW-HILL FINANCIAL	16,029	94.45	1,513,939.05
MOODY'S CORP	10,541	99.34	1,047,142.94
MORGAN STANLEY	86,765	33.37	2,895,348.05
NASDAQ INC	6,939	56.46	391,775.94
NAVIENT CORP	20,947	11.74	245,917.78
NORTHERN TRUST CORP	13,696	72.48	992,686.08
PRICE T ROWE GROUP INC	14,996	73.17	1,097,257.32
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,527	57.49	432,727.23
SCHWAB (CHARLES) CORP	69,972	32.97	2,306,976.84
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,570	51.89	392,807.30
STATE STREET CORP	23,987	68.83	1,651,025.21
SYNCHRONY FINANCIAL	49,043	30.61	1,501,206.23
TD AMERITRADE HOLDING CORP	15,844	35.31	559,451.64
VOYA FINANCIAL INC	14,298	37.88	541,608.24
ACE LTD	19,122	114.89	2,196,926.58
AFLAC	25,353	61.26	1,553,124.78
ALLEGHANY CORP	944	488.40	461,049.60
ALLSTATE CORP	23,532	62.90	1,480,162.80
AMERICAN INT'L GROUP	77,105	62.18	4,794,388.90
AON PLC	16,472	94.23	1,552,156.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,212	71.25	513,855.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,452	43.20	451,526.40
ASSURANT INC	4,255	84.09	357,802.95
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,257	56.38	352,769.66
CHUBB CORPORATION	13,371	130.83	1,749,327.93
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,273	60.22	558,420.06
EVEREST RE GROUP LTD	2,861	185.39	530,400.79
FNF GROUP	16,127	35.22	567,992.94
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,266	45.14	1,095,367.24
LINCOLN NATIONAL CORP	14,192	52.22	741,106.24
LOEWS CORP	18,501	37.20	688,237.20
MARKEL CORP	789	890.93	702,943.77

MARSH & MCLENNAN COS	31,359	55.55	1,741,992.45
METLIFE INC	56,129	48.59	2,727,308.11
PARTNERRE LTD	2,636	138.79	365,850.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,205	47.23	859,822.15
PROGRESSIVE CORP	36,164	30.66	1,108,788.24
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,589	84.08	2,235,603.12
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,888	111.40	321,723.20
TORCHMARK CORP	8,075	59.53	480,704.75
TRAVELERS COS INC/THE	18,431	111.04	2,046,578.24
UNUM GROUP	13,270	35.14	466,307.80
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,356	44.87	419,803.72
WR BERKLEY CORP	6,561	54.65	358,558.65
XL GROUP PLC	19,247	38.45	740,047.15
CBRE GROUP INC-A	18,907	35.33	667,984.31
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	32,000	7.03	224,960.00
JONES LANG LASALLE INC	2,910	161.03	468,597.30
REALOGY HOLDINGS CORP	7,960	39.62	315,375.20
WEYERHAEUSER CO	30,139	31.19	940,035.41
ACCENTURE PLC-CL A	37,187	107.29	3,989,793.23
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,375	38.59	1,210,761.25
ADOBE SYSTEMS INC	29,442	89.56	2,636,825.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,160	53.27	594,493.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,830	280.09	1,072,744.70
ALPHABET INC-CL A	17,304	762.55	13,195,165.20
ALPHABET INC-CL C	18,478	751.61	13,888,249.58
ANSYS INC	5,078	90.58	459,965.24
AUTODESK INC	13,147	63.25	831,547.75
AUTOMATIC DATA PROCESS	27,529	84.95	2,338,588.55
CA INC	18,266	27.57	503,593.62
CDK GLOBAL INC	8,454	46.15	390,152.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,775	85.29	321,969.75
CITRIX SYSTEMS INC	10,055	76.55	769,710.25
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,015	60.33	2,172,784.95
EBAY	64,458	28.34	1,826,739.72
ELECTRONIC ARTS INC	19,377	67.09	1,300,002.93
FACEBOOK INC-A	128,052	104.60	13,394,239.20
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,615	63.45	1,117,671.75
FIREEYE INC	7,037	21.76	153,125.12
FISERV INC	13,828	93.18	1,288,493.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,827	146.00	704,742.00
FORTINET INC	7,600	32.71	248,596.00
GARTNER INC	5,328	89.72	478,028.16

GLOBAL PAYMENTS INC	7,146	69.63	497,575.98
INTL BUSINESS MACHINES CORP	55,477	136.61	7,578,712.97
INTUIT INC	16,237	97.72	1,586,679.64
LINKEDIN CORP - A	6,843	231.34	1,583,059.62
MASTERCARD INC-CLASS A	59,454	97.82	5,815,790.28
MICROSOFT CORP	453,507	54.98	24,933,814.86
MOBILEYE NV	4,348	42.82	186,181.36
NETSUITE INC	2,299	81.40	187,138.60
NUANCE COMMUNICATIONS INC	13,610	20.81	283,224.10
ORACLE CORP	206,607	38.58	7,970,898.06
PAYCHEX INC	20,178	52.99	1,069,232.22
PAYPAL HOLDINGS INC	66,911	35.07	2,346,568.77
RED HAT INC	11,321	79.05	894,925.05
SABRE CORP	9,279	28.57	265,101.03
SALESFORCE.COM INC	36,872	79.71	2,939,067.12
SERVICENOW INC	9,170	86.10	789,537.00
SPLUNK INC	8,088	56.74	458,913.12
SYMANTEC CORP	42,648	20.01	853,386.48
SYNOPSYS INC	9,205	45.38	417,722.90
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,612	91.25	238,345.00
TERADATA CORP	7,871	28.15	221,568.65
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,091	55.30	502,732.30
TWITTER INC	33,022	24.31	802,764.82
VANTIV INC - CL A	8,790	51.64	453,915.60
VERISIGN INC	6,144	91.28	560,824.32
VISA INC-CLASS A SHARES	116,325	77.88	9,059,391.00
VMWARE INC-CLASS A	4,467	58.84	262,838.28
WESTERN UNION CO	32,001	18.87	603,858.87
WORKDAY INC-CLASS A	6,886	83.39	574,223.54
XEROX CORP	58,604	10.02	587,212.08
YAHOO	52,683	34.40	1,812,295.20
ZILLOW GROUP INC-C	5,200	23.57	122,564.00
AMPHENOL CORPORATION	19,068	53.89	1,027,574.52
APPLE INC	340,353	115.62	39,351,613.86
ARROW ELECTRONICS INC	5,053	55.40	279,936.20
AVNET INC	7,147	44.00	314,468.00
CDW CORP/DE	7,703	43.51	335,157.53
CISCO SYSTEMS	303,163	26.73	8,103,546.99
CORNING	71,973	17.75	1,277,520.75
EMC CORP	114,210	26.00	2,969,460.00
F5 NETWORKS INC	4,529	100.34	454,439.86
FLEXTRONICS INTL LTD	31,468	10.80	339,854.40



FLIR SYSTEMS INC	8,767	29.49	258,538.83
HARRIS CORP	7,806	83.34	650,552.04
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	111,598	14.85	1,657,230.30
HP INC	111,598	12.11	1,351,451.78
JUNIPER NETWORKS INC	19,985	29.03	580,164.55
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,281	69.31	643,266.11
NETAPP INC	16,995	30.12	511,889.40
PALO ALTO NETWORKS INC	4,439	190.08	843,765.12
QUALCOMM	93,627	48.59	4,549,335.93
SANDISK CORP	11,748	75.14	882,744.72
SEAGATE TECHNOLOGY	17,377	35.72	620,706.44
TE CONNECTIVITY LTD	23,679	64.27	1,521,849.33
TRIMBLE NAVIGATION LTD	12,982	21.72	281,969.04
WESTERN DIGITAL CORP	14,387	62.95	905,661.65
AT&T INC	366,703	33.57	12,310,219.71
CENTURYLINK INC	31,922	26.38	842,102.36
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	74,843	4.92	368,227.56
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,609	52.64	979,577.76
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,086	105.01	849,110.86
SPRINT CORP	49,920	3.74	186,700.80
T-MOBILE US INC	17,774	36.07	641,108.18
VERIZON COMMUNICATIONS	242,375	45.36	10,994,130.00
AES CORP	40,128	9.26	371,585.28
AGL RESOURCES INC	6,528	62.82	410,088.96
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,132	60.28	369,636.96
AMEREN CORPORATION	15,103	42.58	643,085.74
AMERICAN ELECTRIC POWER	28,867	56.25	1,623,768.75
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,155	57.91	645,986.05
CALPINE CORP	21,631	12.93	279,688.83
CENTERPOINT ENERGY INC	25,372	16.41	416,354.52
CMS ENERGY CORP	15,476	35.26	545,683.76
CONSOLIDATED EDISON INC	18,199	63.02	1,146,900.98
DOMINION RESOURCES	35,121	66.19	2,324,658.99
DTE ENERGY COMPANY	11,061	80.21	887,202.81
DUKE ENERGY CORP	40,731	68.61	2,794,553.91
EDISON INTL	20,074	59.40	1,192,395.60
ENERGY CORP	10,157	68.04	691,082.28
EVERSOURCE ENERGY	19,611	50.84	997,023.24
EXELON CORP	53,011	26.57	1,408,502.27
FIRSTENERGY CORP	26,040	32.05	834,582.00
NEXTERA ENERGY INC	27,206	98.76	2,686,864.56
NRG ENERGY INC	18,649	10.55	196,746.95

OGE ENERGY CORP	11,648	24.75	288,288.00	
PEPCO HOLDINGS INC	13,913	26.31	366,051.03	
PG&E CORP	29,725	52.57	1,562,643.25	
PINNACLE WEST CAPITAL	6,883	63.12	434,454.96	
PPL CORPORATION	41,391	33.43	1,383,701.13	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	31,174	38.20	1,190,846.80	
SCANA CORP	7,611	58.71	446,841.81	
SEMPRA ENERGY	14,487	93.75	1,358,156.25	
SOUTHERN CO	53,681	45.14	2,423,160.34	
WEC ENERGY GROUP INC	19,673	49.94	982,469.62	
XCEL ENERGY INC	31,264	35.28	1,102,993.92	
ALTERA CORPORATION	18,859	53.09	1,001,224.31	
ANALOG DEVICES	19,339	56.65	1,095,554.35	
APPLIED MATERIALS	70,432	19.03	1,340,320.96	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,321	145.65	2,231,503.65	
BROADCOM CORP-CL A	34,202	57.48	1,965,930.96	
INTEL CORP	283,662	34.81	9,874,274.22	
KLA-TENCOR CORP	8,895	67.58	601,124.10	
LAM RESEARCH CORP	9,865	78.32	772,626.80	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	13,921	43.74	608,904.54	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	19,484	8.27	161,132.68	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	17,776	37.11	659,667.36	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,557	45.51	525,959.07	
MICRON TECHNOLOGY	66,504	14.32	952,337.28	
NVIDIA CORP	33,258	32.71	1,087,869.18	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,440	86.24	814,105.60	
QORVO INC	8,400	56.15	471,660.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,900	84.68	1,007,692.00	
TEXAS INSTRUMENTS	60,956	56.76	3,459,862.56	
XILINX INC	16,007	47.87	766,255.09	
アメリカドル 小計	18,954,165		1,104,425,354.99 (134,187,680,631)	
カナダドル				
ALTAGAS INCOME LTD	6,443	29.74	191,614.82	
ARC RESOURCES LTD	20,535	16.15	331,640.25	
CAMECO CORP	21,278	16.12	343,001.36	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	66,249	28.94	1,917,246.06	
CANADIAN OIL SANDS LTD	30,774	8.25	253,885.50	
CENOVUS ENERGY INC	53,472	18.68	998,856.96	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	33,864	15.77	534,035.28	
ENBRIDGE	51,987	43.13	2,242,199.31	
ENCANA CORP	49,366	9.14	451,205.24	
HUSKY ENERGY INC	18,451	15.11	278,794.61	

IMPERIAL OIL	19,461	40.73	792,646.53
INTER PIPELINE LTD	18,978	20.56	390,187.68
KEYERA CORP	9,280	37.85	351,248.00
MEG ENERGY CORP	9,886	9.71	95,993.06
PEMBINA PIPELINE CORP	22,522	29.08	654,939.76
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	7,989	23.88	190,777.32
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,500	22.98	149,370.00
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	7,940	14.18	112,589.20
SUNCOR ENERGY	87,391	35.38	3,091,893.58
TOURMALINE OIL CORP	9,307	23.05	214,526.35
TRANSCANADA CORP	43,040	43.80	1,885,152.00
VERESEN INC	12,406	9.57	118,725.42
VERMILION ENERGY INC	5,208	35.74	186,133.92
AGNICO EAGLE MINES	11,371	37.87	430,619.77
AGRIUM INC	7,555	130.72	987,589.60
BARRICK GOLD CORP	67,383	10.49	706,847.67
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,570	218.87	343,625.90
ELDORADO GOLD CORP	38,874	4.12	160,160.88
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,303	4.76	144,242.28
FRANCO-NEVADA CORP	8,810	64.29	566,394.90
GOLDCORP INC	53,693	16.38	879,491.34
KINROSS GOLD CORP	58,315	2.63	153,368.45
METHANEX CORP	4,891	49.88	243,963.08
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	50,400	24.35	1,227,240.00
SILVER WHEATON CORP	28,040	17.94	503,037.60
TECK RESOURCES LTD-CL B	29,215	5.00	146,075.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	3.35	162,619.05
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,900	50.83	147,407.00
YAMANA GOLD INC	62,705	2.85	178,709.25
BOMBARDIER B	104,404	1.12	116,932.48
CAE INC	14,339	15.03	215,515.17
FINNING INTERNATIONAL INC	10,642	18.05	192,088.10
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	40.09	351,789.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,982	73.77	3,539,632.14
CP RAILWAY LIMITED	9,309	174.96	1,628,702.64
LINAMAR CORP	2,700	71.95	194,265.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	24,803	57.68	1,430,637.04
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,580	40.57	550,940.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,467	46.98	632,679.66
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,181	26.83	621,946.23
THOMSON REUTERS CORP	22,357	52.67	1,177,543.19
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,876	122.19	473,608.44

	DOLLARAMA INC	7,306	81.70	596,900.20
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	26,159	60.74	1,588,897.66
	EMPIRE CO LTD 'A'	8,376	26.03	218,027.28
	JEAN COUTU GROUP INC A	1,800	17.77	31,986.00
	LOBLAW COMPANIES LTD	13,707	65.45	897,123.15
	METRO INC	13,502	38.65	521,852.30
	WESTON (GEORGE) LTD	3,660	107.60	393,816.00
	SAPUTO INC	13,399	31.72	425,016.28
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	19,503	128.15	2,499,309.45
	BANK MONTREAL	38,920	77.43	3,013,575.60
	BANK NOVA SCOTIA	72,927	57.52	4,194,761.04
	CANADIAN IMPERIAL BANK	24,059	94.81	2,281,033.79
	NATIONAL BANK OF CANADA	21,045	42.14	886,836.30
	ROYAL BANK OF CANADA	88,869	74.55	6,625,183.95
	TORONTO-DOMINION BANK	111,142	53.78	5,977,216.76
	CI FINANCIAL CORP	16,463	30.36	499,816.68
	ELEMENT FINANCIAL CORP	21,290	16.41	349,368.90
	IGM FINANCIAL INC	6,544	35.59	232,900.96
	ONEX CORP	4,444	80.78	358,986.32
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,405	611.89	859,705.45
	GREAT-WEST LIFECO INC	17,342	34.78	603,154.76
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,595	43.96	289,916.20
	INTACT FINANCIAL CORP	8,448	89.80	758,630.40
	MANULIFE FINANCIAL CORP	119,027	20.96	2,494,805.92
	POWER CORP OF CANADA	21,838	29.79	650,554.02
	POWER FINANCIAL CORP	13,740	32.60	447,924.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	35,893	43.04	1,544,834.72
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	52,155	44.02	2,295,863.10
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	18.52	129,640.00
	CGI GROUP INC - CL A	14,411	55.89	805,430.79
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,107	573.00	634,311.00
	OPEN TEXT CORP	8,394	64.23	539,146.62
	BLACKBERRY LIMITED	24,879	9.99	248,541.21
	BCE INC	9,538	55.65	530,789.70
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,995	48.87	1,074,895.65
	TELUS CORP	11,560	39.67	458,585.20
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	33.74	147,511.28
	CANADIAN UTILITIES LTD A	8,973	29.81	267,485.13
	FORTIS INC	15,900	36.27	576,693.00
	カナダドル 小計	2,333,997		80,835,361.19 (7,242,848,362)
ユーロ	ENI	153,306	13.99	2,144,750.94

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	27,776	9.99	277,593.34
NESTE OIL OYJ	8,021	26.18	209,989.78
OMV AG	8,029	25.41	204,016.89
REPSOL SA	66,931	10.92	730,886.52
SAIPEM	14,052	7.51	105,530.52
TECHNIP S.A.	5,700	45.37	258,637.50
TENARIS SA	25,356	10.99	278,662.44
TOTAL SA	129,149	42.82	5,530,805.92
VOPAK	3,661	37.00	135,475.30
AIR LIQUIDE	20,610	104.75	2,158,897.50
AKZO NOBEL	14,462	62.80	908,213.60
ARCELORMITTAL	59,593	3.74	223,354.56
ARKEMA	3,329	64.92	216,118.68
BASF SE	54,565	70.72	3,858,836.80
CRH	44,999	26.87	1,209,348.12
EVONIK INDUSTRIES AG	9,556	30.18	288,400.08
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,446	43.22	192,156.12
HEIDELBERGCEMENT AG	8,988	72.80	654,326.40
IMERYS SA	2,111	61.56	129,953.16
K+S AG	11,391	24.03	273,782.68
KONINKLIJKE DSM NV	10,335	45.78	473,187.97
LANXESS	4,650	43.84	203,879.25
LINDE AG	10,956	133.15	1,458,791.40
OCI NV	5,100	22.62	115,362.00
SOLVAY SA	3,145	92.05	289,497.25
SOLVAY SA - RTS	3,145	5.25	16,511.25
STORA ENSO OYJ R	27,359	8.39	229,678.80
SYMRISE AG	7,200	62.00	446,400.00
THYSSEN KRUPP	20,122	17.69	356,058.79
UMICORE	4,723	37.20	175,695.60
UPM KYMMENE CORP	29,265	16.86	493,407.90
VOESTALPINE AG	5,824	27.80	161,936.32
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,854	28.49	309,284.73
AIRBUS GROUP SE	35,273	63.49	2,239,482.77
ALSTOM RGPT	11,927	28.14	335,625.78
ANDRITZ AG	3,976	46.51	184,923.76
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,606	38.73	178,413.41
BOUYGUES ORD	12,252	35.20	431,331.66
BRENTAG AG	10,244	48.52	497,090.10
CNH INDUSTRIAL NV	51,842	6.51	337,491.42
FERROVIAL SA	28,114	21.42	602,342.45
FINMECCANICA SPA	22,011	13.16	289,664.76

GEA GROUP AG	9,883	37.57	371,304.31
KONE OYJ-B	20,514	38.07	780,967.98
KONINKLIJKE PHILIPS	58,702	24.23	1,422,349.46
LEGRAND SA	15,350	53.64	823,374.00
MAN SE	1,673	92.35	154,501.55
METSO OYJ	4,962	21.15	104,946.30
OSRAM LICHT AG	5,181	37.83	196,023.13
PRYSMIAN SPA	11,275	19.94	224,823.50
REXEL SA	17,749	12.09	214,674.15
SAFRAN SA	17,871	62.67	1,119,975.57
SAINT-GOBAIN	29,052	38.83	1,128,234.42
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,042	54.80	1,865,501.60
SIEMENS	47,493	90.46	4,296,216.78
THALES SA	5,995	69.00	413,655.00
VINCI S.A.	29,121	59.41	1,730,078.61
WARTSILA OYJ	8,281	41.22	341,342.82
ZARDOYA OTIS SA	8,907	10.98	97,798.86
ZODIAC AEROSPACE	11,896	24.09	286,634.12
BUREAU VERITAS SA	16,438	18.41	302,623.58
EDENRED	9,977	17.21	171,704.17
RANDSTAD HOLDING NV	7,024	56.37	395,942.88
SOCIETE BIC SA	1,751	152.00	266,152.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	29,717	13.76	408,905.92
ADP	1,532	106.25	162,775.00
AENA SA	4,472	105.50	471,796.00
ATLANTIA SPA	23,519	23.72	557,870.68
BOLLORE	52,200	4.14	216,316.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	11,333	13.51	153,165.49
DEUTSCHE POST AG-REG	58,150	24.89	1,447,644.25
FRAPORT AG	2,688	57.70	155,097.60
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	26,998	11.71	316,146.58
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	53,552	7.93	424,720.91
TNT EXPRESS	30,460	7.73	235,516.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,927	97.14	1,935,708.78
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,141	75.51	237,176.91
CONTINENTAL AG	6,470	222.35	1,438,604.50
DAIMLER AG	57,380	77.09	4,423,424.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	55,116	12.64	696,666.24
MICHELIN	11,494	89.61	1,029,977.34
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,716	34.38	196,516.08
PEUGEOT SA	23,234	16.04	372,673.36
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,384	49.69	416,600.96

RENAULT SA	11,828	92.03	1,088,530.84
VALEO SA	4,526	138.35	626,172.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,186	131.75	1,473,755.50
VOLKSWAGEN STAMM	2,477	140.40	347,770.80
ADIDAS AG	12,252	88.41	1,083,199.32
CHRISTIAN DIOR	3,315	165.70	549,295.50
HERMES INTERNATIONAL	1,616	327.15	528,674.40
HUGO BOSS AG	4,478	77.71	347,985.38
KERING	4,341	157.75	684,792.75
LUXOTTICA GROUP SPA	10,161	60.90	618,804.90
LVMH	16,534	148.85	2,461,085.90
ACCOR	12,765	38.86	496,047.90
SODEXO	5,274	91.65	483,362.10
ALTICE NV -A	20,543	11.71	240,661.24
ALTICE NV -B	4,665	11.92	55,630.12
AXEL SPRINGER SE	3,427	51.68	177,107.36
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,009	27.76	250,089.84
JC DECAUX SA	3,750	34.83	130,612.50
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,209	105.40	127,428.60
LAGADERE S.C.A	6,893	26.83	184,939.19
NUMERICABLE-SFR	5,697	36.59	208,481.71
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	13,820	47.29	653,547.80
PUBLICIS GROUPE	11,662	58.48	681,993.76
RELX NV	60,416	15.36	927,989.76
RTL GROUP	2,176	78.94	171,773.44
SES	19,467	25.70	500,301.90
TELENET GROUP HOLDING NV	2,299	47.87	110,053.13
VIVENDI	70,924	19.26	1,365,996.24
WOLTERS KLUWER	17,383	31.00	538,959.91
INDITEX	64,765	32.54	2,107,776.92
ZALANDO SE	4,525	35.00	158,375.00
CARREFOUR	33,732	27.27	919,871.64
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	47.27	155,912.95
COLRUYT SA	5,212	46.05	240,012.60
DELHAIZE GROUP	6,627	89.04	590,068.08
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	32,188	5.59	179,930.92
JERONIMO MARTINS	18,556	12.28	227,960.46
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,737	19.41	984,805.17
METRO STAMM	9,401	28.22	265,343.22
ANHEUSER-BUSCH INBEV	48,117	116.35	5,598,412.95
DANONE (GROUPE)	35,346	62.92	2,223,970.32
HEINEKEN HOLDING NV	6,086	71.91	437,644.26

HEINEKEN NV	14,041	80.61	1,131,845.01
KERRY GROUP PLC-A	9,623	76.10	732,310.30
PERNOD-RICARD	13,004	102.50	1,332,910.00
REMY COINTREAU	1,720	66.25	113,950.00
BEIERSDORF AG	6,463	83.14	537,333.82
HENKEL AG & CO KGAA	5,713	86.83	496,059.79
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,439	102.85	1,073,651.15
LOREAL	15,084	157.45	2,374,975.80
UNILEVER NV-CVA	97,620	39.70	3,875,514.00
ESSILOR INTERNATIONAL	12,492	116.20	1,451,570.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,668	75.96	1,038,221.28
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,520	64.20	1,509,984.00
BAYER	49,229	113.60	5,592,414.40
GRIFOLS SA	8,770	42.71	374,610.55
MERCK KGAA	8,185	89.10	729,283.50
ORION OYJ-CLASS B	5,393	30.75	165,834.75
QIAGEN N.V.	11,549	23.98	277,002.76
SANOFI	70,871	77.27	5,476,202.17
UCB (GROUPE)	8,162	81.64	666,345.68
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	163,126	1.25	204,886.25
BANCO BILBAO VIZCAYA	382,647	7.16	2,742,431.04
BANCO DE SABADELL SA	325,355	1.69	552,778.14
BANCO POPOLARE SPA	20,969	12.40	260,015.60
BANCO POPULAR ESPANOL	91,462	3.23	295,879.57
BANCO SANTANDER SA	868,302	4.73	4,110,541.66
BANK OF IRELAND	1,696,027	0.33	566,473.01
BANKIA SA	269,344	1.13	305,166.75
BANKINTER SA	36,000	6.70	241,200.00
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,340,000	0.04	107,874.00
BNP PARIBAS	63,952	52.18	3,337,015.36
CAIXABANK	167,029	3.48	582,764.18
COMMERZBANK AG	60,211	9.49	571,703.44
CREDIT AGRICOLE SA	63,731	10.57	673,955.32
ERSTE GROUP BANK AG	16,259	27.50	447,203.79
ING GROEP NV-CVA	232,168	12.33	2,862,631.44
INTESA SANPAOLO	762,579	3.09	2,356,369.11
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	2.83	125,898.21
KBC GROEP NV	15,724	54.71	860,260.04
NATIXIS	50,808	5.21	264,709.68
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	13.85	108,944.10
SOCIETE GENERALE	44,231	41.80	1,848,855.80
UNICREDIT SPA	293,067	5.18	1,518,087.06



UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	46,528	5.90	274,515.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	83,023	22.33	1,853,903.59
DEUTSCHE BOERSE	12,021	77.20	928,021.20
EURAZEO	1,926	61.96	119,334.96
EXOR SPA	5,390	41.18	221,960.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,501	75.45	415,050.45
MEDIOBANCA	30,850	8.63	266,235.50
WENDEL	1,767	105.95	187,213.65
AEGON	101,474	5.38	546,336.01
AGEAS	12,106	40.98	496,103.88
ALLIANZ SE-REG	27,233	161.35	4,394,044.55
ASSICURAZIONI GENERALI	69,849	17.25	1,204,895.25
AXA	118,192	25.26	2,986,120.88
CNP ASSURANCES	11,327	12.19	138,132.76
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,639	108.15	393,557.85
MAPFRE SA	46,919	2.47	115,889.93
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,044	185.15	1,859,646.60
NN GROUP NV	13,238	32.14	425,535.51
SAMPO OYJ-A SHS	27,164	46.32	1,258,236.48
SCOR SE	9,111	36.60	333,462.60
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	59,209	2.36	140,206.91
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	21,706	24.70	536,138.20
VONOVIA SE	27,116	27.92	757,214.30
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	26,608	37.92	1,009,108.40
ATOS SE	5,386	77.69	418,438.34
CAP GEMINI SA	9,589	85.46	819,475.94
DASSAULT SYSTEMES SA	7,162	73.71	527,911.02
GEMALTO	4,337	55.89	242,394.93
SAP SE	58,879	71.71	4,222,213.09
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,509	50.40	328,053.60
ALCATEL-LUCENT	174,864	3.51	615,346.41
INGENICO GROUP	3,351	115.60	387,375.60
NOKIA OYJ	221,706	6.46	1,433,329.29
DEUTSCHE TELEKOM	193,507	16.27	3,148,358.89
ELISA A	7,731	34.05	263,240.55
ILIAD SA	1,579	213.35	336,879.65
KPN (KON.)	205,478	3.41	701,912.84
ORANGE	121,597	15.16	1,843,410.52
PROXIMUS	8,202	28.80	236,217.60
TELECOM ITALIA ORD	667,384	1.14	763,487.29
TELECOM ITALIA RNC	345,204	1.01	351,762.87
TELEFONICA	270,637	10.87	2,943,177.37

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,607	5.06	150,018.66
	E.ON SE	124,645	8.56	1,067,584.42
	ELECTRICITE DE FRANCE	12,828	12.61	161,825.22
	ENAGAS	11,715	27.44	321,518.17
	ENDESA	21,382	19.11	408,716.93
	ENEL	431,993	4.02	1,739,203.81
	ENEL GREEN POWER SPA	82,675	1.92	159,480.07
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	131,710	3.13	412,252.30
	ENGIE	89,966	15.76	1,417,864.16
	FORTUM OYJ	24,361	13.40	326,437.40
	GAS NATURAL SDG SA	19,754	19.74	389,943.96
	IBERDROLA SA	324,320	6.57	2,133,376.96
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,239	78.88	492,132.32
	RWE STAMM	26,985	11.01	297,104.85
	SNAM SPA	126,585	4.83	611,405.55
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	15,575	17.62	274,509.37
	TERNA SPA	101,213	4.69	475,093.82
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,294	21.63	547,109.22
	ASML HOLDING NV	20,948	82.40	1,726,115.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	65,796	13.50	888,574.98
	STMICROELECTRONICS	35,110	6.41	225,160.43
	ユーロ 小計	15,744,891		201,591,993.08 (26,985,104,193)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	22,875	4.03	92,254.87
	BG GROUP	206,220	9.85	2,031,679.44
	BP PLC	1,097,335	3.50	3,845,610.50
	PETROFAC LTD	14,944	7.79	116,413.76
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	235,641	15.41	3,631,227.81
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	147,389	15.51	2,286,740.33
	ANGLO AMERICAN PLC	84,985	3.19	271,697.04
	ANTOFAGASTA PLC	21,571	4.46	96,336.08
	BHP BILLITON PLC	129,822	7.49	972,886.06
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,430	29.64	220,225.20
	FRESNILLO PLC	14,610	6.62	96,791.25
	GLENCORE PLC	732,081	0.83	608,212.89
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,968	26.62	291,968.16
	MONDI PLC	22,464	13.44	301,916.16
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,505	41.42	228,017.10
	REXAM PLC	38,985	5.83	227,282.55
	RIO TINTO PLC REG	75,627	19.66	1,487,204.95
	ASHTREAD GROUP PLC	29,500	11.20	330,400.00
	BAE SYSTEMS PLC	195,012	5.02	978,960.24

BUNZL PLC	19,262	18.72	360,584.64
COBHAM PLC	68,649	2.95	202,926.44
IMI PLC	14,582	9.00	131,310.91
MEGGITT PLC	43,669	3.66	159,872.20
MELROSE INDUSTRIES PLC	52,939	2.84	150,399.69
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	112,578	5.78	651,263.73
SMITHS GROUP PLC	23,298	9.86	229,834.77
TRAVIS PERKINS PLC	15,153	20.08	304,272.24
WEIR GROUP PLC/THE	12,587	10.49	132,037.63
WOLSELEY LTD	15,512	38.49	597,056.88
AGGREKO PLC	15,294	9.55	146,134.17
BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	10.09	149,422.81
CAPITA GROUP PLC	40,800	11.78	480,624.00
EXPERIAN PLC	57,659	11.78	679,223.02
G4S PLC	93,926	2.18	204,758.68
INTERTEK GROUP PLC	9,459	27.62	261,257.58
EASYJET PLC	9,909	16.85	166,966.65
ROYAL MAIL PLC	48,948	4.59	225,062.90
NEW GKN	93,977	2.95	277,514.08
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	61,521	6.05	372,202.05
BURBERRY GROUP PLC	27,384	11.81	323,405.04
PERSIMMON PLC	18,455	19.43	358,580.65
TAYLOR WIMPAY PLC	201,733	1.95	393,984.54
CARNIVAL PLC	11,381	34.51	392,758.31
COMPASS GROUP PLC	102,140	11.34	1,158,267.60
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,698	24.89	340,943.22
MERLIN ENTERTAINME	43,424	4.30	186,940.32
TUI AG-DI	29,519	11.21	330,907.99
WHITBREAD PLC	11,113	44.79	497,751.27
WILLIAM HILL	44,681	3.69	165,275.01
ITV PLC	217,861	2.63	574,063.73
PEARSON	50,577	7.43	376,039.99
RELX PLC	63,380	11.70	741,546.00
SKY PLC	63,549	10.82	687,600.18
WPP PLC	77,394	14.96	1,157,814.24
DIXONS CARPHONE PLC	53,052	4.86	257,938.82
KINGFISHER PLC	127,494	3.34	426,722.41
MARKS & SPENCER GROUP PLC	100,935	4.82	487,011.37
NEXT PLC	8,896	77.30	687,660.80
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	12,900	6.65	85,849.50
MORRISON SUPERMARKETS	123,161	1.43	176,120.23
SAINSBURY (J) PLC	73,619	2.45	180,734.64

TESCO	498,345	1.53	762,467.85
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,207	35.14	710,073.98
BRITISH AMERICAN TOBACCO	111,844	37.38	4,180,728.72
COCA-COLA HBC AG-CDI	12,065	14.88	179,527.20
DIAGEO	151,217	18.52	2,800,538.84
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	58,626	34.82	2,041,357.32
SABMILLER PLC	58,526	40.42	2,365,913.55
TATE & LYLE	29,097	5.99	174,436.51
RECKITT BENCKISER PLC	38,507	61.67	2,374,726.69
UNILEVER PLC	77,344	28.14	2,176,460.16
SMITH & NEPHEW PLC	55,192	10.91	602,144.72
ASTRAZENECA	75,839	44.04	3,339,949.56
GLAXOSMITHKLINE	292,649	13.16	3,851,260.84
SHIRE PLC	35,356	43.84	1,550,007.04
BARCLAYS	1,023,950	2.21	2,272,657.02
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,173,592	5.11	6,004,096.67
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,418,141	0.70	2,415,600.24
ROYAL BANK OF SCOTLAND	197,999	2.90	574,791.09
STANDARD CHARTERED PLC	188,548	5.15	972,342.03
3I GROUP PLC	54,307	4.87	264,583.70
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,195	2.98	164,591.49
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,622	14.44	196,701.68
ICAP PLC	30,718	4.97	152,822.05
INVESTEC PLC	27,758	5.28	146,701.03
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	19,116	25.81	493,383.96
PROVIDENT FINANCIAL PLC	8,699	34.97	304,204.03
SCHRODERS PLC	7,525	28.29	212,882.25
ADMIRAL GROUP PLC	12,465	16.19	201,808.35
AVIVA PIC	249,007	5.01	1,247,525.07
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	85,800	4.05	347,919.00
LEGAL & GENERAL GROUP	366,171	2.63	965,226.75
OLD MUTUAL PLC	302,181	1.95	590,461.67
PRUDENTIAL	154,843	15.18	2,350,516.74
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	53,389	4.29	229,145.58
ST JAMES'S PLACE PLC	32,728	9.83	321,716.24
STANDARD LIFE PLC	108,016	3.91	422,774.62
AUTO TRADER GROUP PLC	44,189	4.17	184,444.88
SAGE GROUP PLC	59,665	6.03	360,078.27
BT GROUP PLC	505,231	4.67	2,360,439.23
INMARSAT PLC	27,245	11.17	304,326.65
VODAFONE GROUP PLC	1,594,744	2.15	3,441,457.55
CENTRICA PLC	304,710	2.06	628,007.31

	NATIONAL GRID PLC	225,541	9.13	2,060,091.49
	SEVERN TRENT PLC	13,547	21.54	291,802.38
	SSE PLC	61,176	14.42	882,157.92
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	39,385	9.44	371,991.32
	ARM HOLDINGS PLC	86,354	10.94	944,712.76
	イギリスポンド 小計	17,454,212		93,778,019.32 (17,308,609,025)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	25,316	13.39	338,981.24
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	396	404.25	160,083.00
	GIVAUDAN-REG	561	1,825.00	1,023,825.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	25,616	50.50	1,293,608.00
	SIKA AG-BR	114	3,470.00	395,580.00
	SYNGENTA AG	5,629	366.10	2,060,776.90
	ABB LTD	132,277	18.14	2,399,504.78
	GEBERIT AG-REG	2,275	337.30	767,357.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	914	165.60	151,358.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,384	164.00	390,976.00
	SULZER AG-REG	1,409	102.40	144,281.60
	ADECCO	9,518	67.90	646,272.20
	SGS SA	297	1,905.00	565,785.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,638	135.10	491,493.80
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	31,462	72.80	2,290,433.60
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,990	344.40	685,356.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	65.25	196,011.00
	DUFREY AG-REG	2,072	123.50	255,892.00
	ARYZTA AG	6,169	48.40	298,579.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,113.00	143,577.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	56	6,090.00	341,040.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	72,770.00	436,620.00
	NESTLE SA - REGISTERED	190,671	73.70	14,052,452.70
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,574	122.90	439,244.60
	ACTELION LTD-REG	6,532	134.40	877,900.80
	GALENICA AG-REG	219	1,477.00	323,463.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,018	155.40	468,997.20
	NOVARTIS	136,152	83.60	11,382,307.20
	ROCHE HOLDING GENUSS	42,045	268.50	11,289,082.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG	106,095	21.18	2,247,092.10
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,528	47.40	641,227.20
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	62.70	143,520.30
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	859	348.50	299,361.50
	UBS GROUP AG	219,155	18.78	4,115,730.90
	BALOISE HOLDING AG	2,555	126.30	322,696.50

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,853	264.40	489,933.20
	SWISS RE LTD	20,776	97.45	2,024,621.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,077	255.80	2,321,896.60
	SWISS PRIME SITE-REG	4,615	75.00	346,125.00
	SWISSCOM	1,501	488.40	733,088.40
	スイスフラン 小計	1,019,746		67,996,133.52 (8,396,162,567)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,036	126.90	1,400,468.40
	BOLIDEN AB	15,596	147.10	2,294,171.60
	ALFA LAVAL AB	17,624	153.80	2,710,571.20
	ASSA ABLOY AB-B	61,122	179.00	10,940,838.00
	ATLAS COPCO A	40,916	215.50	8,817,398.00
	ATLAS COPCO B	23,611	201.30	4,752,894.30
	SANDVIK AB	60,966	79.40	4,840,700.40
	SKANSKA B	25,444	168.70	4,292,402.80
	SKF AB-B	22,705	143.60	3,260,438.00
	VOLVO B	96,421	80.55	7,766,711.55
	SECURITAS B	18,644	126.10	2,351,008.40
	ELECTROLUX AB-SER B	14,061	201.00	2,826,261.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	53.95	1,178,321.95
	HENNES & MAURITZ B	57,093	307.00	17,527,551.00
	ICA GRUPPEN AB	3,500	310.80	1,087,800.00
	SWEDISH MATCH AB	13,067	293.00	3,828,631.00
	SCA SV CELLULOSA B	36,870	239.70	8,837,739.00
	GETINGE AB-B SHS	14,126	215.60	3,045,565.60
	NORDEA BANK AB	183,317	91.65	16,801,003.05
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	91,861	87.25	8,014,872.25
	SVENSKA HANDELSBK A	87,686	111.70	9,794,526.20
	SWEDBANK AB-A	53,027	182.40	9,672,124.80
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	148.40	1,280,840.40
	INVESTOR AB-B SHS	27,466	316.80	8,701,228.80
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,657	254.90	3,481,169.30	
ERICSSON (LM) B	179,965	78.30	14,091,259.50	
HEXAGON AB-B SHS	16,813	308.80	5,191,854.40	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,878	505.00	1,958,390.00	
TELE2 AB-B SHS	18,919	83.45	1,578,790.55	
TELIASONERA AB	163,614	40.72	6,662,362.08	
	スウェーデンクローナ 小計	1,403,477		178,987,893.53 (2,584,585,182)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	65,188	126.10	8,220,206.80
	NORSK HYDRO	71,518	30.75	2,199,178.50
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,504	401.10	4,213,154.40

	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	289.00	1,360,034.00
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,934	298.00	1,172,332.00
	ORKLA	46,184	70.65	3,262,899.60
	DNB ASA	58,979	109.50	6,458,200.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,316	140.00	1,444,240.00
	TELENOR ASA	47,761	149.20	7,125,941.20
	ノルウェークローネ 小計	319,090		35,456,187.00 (496,741,179)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,551	427.80	2,374,717.80
	NOVOZYMES A/S	15,009	330.40	4,958,973.60
	VESTAS WIND SYSEMS	13,709	458.40	6,284,205.60
	ISS A/S	10,315	249.80	2,576,687.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	232	9,475.00	2,198,200.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	423	9,630.00	4,073,490.00
	DSV A/S	11,421	272.50	3,112,222.50
	PANDORA A/S	6,159	838.50	5,164,321.50
	CARLSBERG AS-B	6,285	585.50	3,679,867.50
	COLOPLAST-B	6,576	553.50	3,639,816.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	956	668.00	638,608.00
	NOVO NORDISK A/S-B	117,569	389.60	45,804,882.40
	DANSKE BANK A/S	42,310	184.10	7,789,271.00
	TRYG A/S	4,445	135.50	602,297.50
TDC A/S	43,672	33.63	1,468,689.36	
	デンマーククローネ 小計	284,632		94,366,249.76 (1,692,930,520)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,413	33.90	624,200.70
	OIL SEARCH LTD	78,089	6.35	495,865.15
	ORIGIN ENERGY LIMITED	99,230	4.82	478,288.60
	SANTOS	92,631	3.50	324,208.50
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	44,908	27.03	1,213,863.24
	ALUMINA LIMITED	135,453	1.08	146,966.50
	AMCOR	71,708	13.35	957,301.80
	BHP BILLITON LTD	193,007	17.16	3,312,000.12
	BORAL LIMITED	48,785	5.43	264,902.55
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	81,907	1.82	149,070.74
	ILUKA RESOURCES LTD	28,163	5.09	143,349.67
	INCITEC PIVOT LTD	118,256	3.84	454,103.04
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	23,392	15.80	369,593.60
	NEWCREST MINING LIMITED	46,131	12.14	560,030.34
	ORICA LTD	19,570	14.84	290,418.80
	RIO TINTO LTD	25,604	42.05	1,076,648.20
SOUTH32 LTD	307,797	1.04	321,647.86	

CIMIC GROUP LIMITED	6,260	23.80	148,988.00
BRAMBLES LTD	95,158	10.78	1,025,803.24
SEEK LTD	17,113	14.06	240,608.78
ASCIANO GROUP	41,236	8.68	357,928.48
AURIZON HOLDINGS LTD	114,077	5.21	594,341.17
QANTAS AIRWAYS LIMITED	32,962	3.86	127,233.32
TRANSURBAN GROUP	121,128	10.11	1,224,604.08
ARISTOCRAT LEISURE LTD	38,499	9.69	373,055.31
CROWN RESORTS LTD	22,372	10.98	245,644.56
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	35.00	104,580.00
TABCORP HOLDINGS	46,982	4.67	219,405.94
TATTS GROUP LTD	87,232	4.33	377,714.56
REA GROUP LTD	3,000	51.20	153,600.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	4.00	148,084.00
WESFARMERS LTD	68,157	37.99	2,589,284.43
WOOLWORTHS LTD	76,870	23.60	1,814,132.00
COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,080	8.80	308,704.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	40,720	7.89	321,280.80
COCHLEAR LIMITED	3,095	92.05	284,894.75
HEALTHSCOPE LTD	92,574	2.49	230,509.26
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,039	64.80	520,927.20
SONIC HEALTHCARE LTD	19,678	20.01	393,756.78
CSL LIMITED	27,443	99.03	2,717,680.29
AUST AND NZ BANKING GROUP	171,602	26.43	4,535,440.86
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	13.27	253,430.46
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	22,032	11.11	244,775.52
COMMONWEALTH BANK OF AUST	101,652	80.29	8,161,639.08
NATIONAL AUSTRALIA BANK	157,984	28.96	4,575,216.64
WESTPAC BANKING	197,974	32.05	6,345,066.70
ASX LTD	10,073	40.95	412,489.35
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,531	8.47	258,597.57
MACQUARIE GROUP LIMITED	18,233	80.80	1,473,226.40
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	4,900	7.68	37,632.00
AMP LTD	166,300	5.76	957,888.00
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	142,279	5.58	793,916.82
MEDIBANK PRIVATE LTD	157,000	2.22	348,540.00
QBE INSURANCE GROUP	82,294	12.24	1,007,278.56
SUNCORP GROUP LIMITED	78,058	13.31	1,038,951.98
COMPUTERSHARE LIMITED	28,680	11.47	328,959.60
TELSTRA CORP	258,660	5.31	1,373,484.60
TPG TELECOM LTD	22,697	10.14	230,147.58
AGL ENERGY LTD	44,633	16.84	751,619.72



	AUSNET SERVICES	117,666	1.48	174,734.01	
	オーストラリアドル 小計	4,303,074		59,008,255.81 (5,252,324,849)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,101	6.95	278,701.95	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,261	5.30	239,883.30	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	8.25	181,500.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	105,967	3.20	339,094.40	
	CONTACT ENERGY LTD	36,737	4.60	168,990.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	107,684	2.23	240,673.74	
	MIGHTY RIVER POWER	19,544	2.69	52,573.36	
	ニュージーランドドル 小計	377,294		1,501,416.95 (123,461,515)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	163,448	101.80	16,639,006.40	
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	11.04	811,440.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	43,000	13.28	571,040.00	
	MTR CORP	80,500	36.25	2,918,125.00	
	LI & FUNG	377,400	5.10	1,924,740.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,000	30.00	2,520,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	26.30	1,236,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	122,000	22.85	2,787,700.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	9.89	597,356.00	
	SANDS CHINA LTD	161,000	26.15	4,210,150.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	90,000	7.12	640,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	5.66	792,400.00	
	WYNN MACAU LTD	107,200	9.29	995,888.00	
	WH GROUP LTD	438,000	3.98	1,743,240.00	
	BANK EAST ASIA	67,964	27.00	1,835,028.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	237,000	23.70	5,616,900.00	
	HANG SENG BANK	45,900	143.30	6,577,470.00	
	FIRST PACIFIC CO	112,000	5.07	567,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	68,100	198.30	13,504,230.00	
	AIA GROUP LTD	722,200	48.15	34,773,930.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	168,948	51.55	8,709,269.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	117,000	18.02	2,108,340.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	62,839	47.05	2,956,574.95	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	32.55	1,009,050.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	21.65	801,050.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	7.72	2,354,600.00	
	SINO LAND CO	186,600	11.56	2,157,096.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	101,000	94.60	9,554,600.00		
SWIRE PACIFIC A	39,500	84.80	3,349,600.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	23.00	1,541,000.00		

	WHARF HOLDINGS	88,000	43.75	3,850,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	49,000	32.80	1,607,200.00	
	PCCW LTD	183,000	4.55	832,650.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	67.70	2,301,800.00	
	CLP HOLDINGS	114,000	64.30	7,330,200.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	402,933	15.02	6,052,053.66	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	87,500	69.65	6,094,375.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	62.60	732,420.00	
	香港ドル 小計	5,326,632		164,605,262.41 (2,581,010,514)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	97,600	6.42	626,592.00	
	NOBLE GROUP LTD	292,145	0.40	118,318.72	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	3.04	188,480.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	49,400	1.80	89,167.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	75,500	2.92	220,460.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	83,600	1.12	94,050.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	114,000	3.04	346,560.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,500	11.02	358,150.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	295,300	0.78	230,334.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	82,150	3.87	317,920.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,300	34.62	183,486.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.33	163,051.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	102,400	2.91	297,984.00	
	DBS GROUP	106,500	16.51	1,758,315.00	
	OCBC BANK	190,050	8.68	1,649,634.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	78,300	19.38	1,517,454.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	40,100	7.45	298,745.00	
	CAPITALAND LTD	149,000	3.22	479,780.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	7.18	157,960.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	177,000	2.02	357,540.00	
UOL GROUP LIMITED	19,400	6.11	118,534.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	484,380	3.81	1,845,487.80		
STARHUB LTD	21,000	3.57	74,970.00		
	シンガポールドル 小計	3,066,345		11,492,973.22 (996,555,707)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	310	817.40	253,394.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	17.70	504,166.80	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	51,875	256.00	13,280,000.00	
	BANK HAPOALIM BM	64,237	20.30	1,304,011.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,035	13.87	1,137,825.45	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,565	46.17	210,766.05	
	AZRIELI GROUP	3,267	148.50	485,149.50	

	NICE SYSTEMS LTD	2,614	227.90	595,730.60
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,181	8.18	958,540.58
	イスラエルシェケル 小計	354,568		18,729,584.08 (589,232,715)
	合 計	70,942,123		208,437,246,959 (208,437,246,959)

## (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	158,470.00	
		アメリカドル 小計	299,000	158,470.00 (19,254,105)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	67,084	564,176.44	
		DUET GROUP	125,970	297,289.20	
		LENDLEASE GROUP	30,349	388,770.69	
		SYDNEY AIRPORT	76,180	477,648.60	
	オーストラリアドル 小計	299,583	1,727,884.93 (153,799,037)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	790,400.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	165,000	1,585,650.00	
	香港ドル 小計	295,000	2,376,050.00 (37,256,464)		
投資信託受益証券合計			893,583	210,309,606 (210,309,606)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	22,610	394,318.40	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	25,026	2,390,984.04	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	58,573	548,829.01	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,197	1,451,852.64	
		BOSTON PROPERTIES	9,456	1,167,910.56	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,670	289,065.90	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,153	390,288.22	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,546	1,754,628.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,426	602,290.48	
		DUKE REALTY CORP	19,266	392,641.08	
		EQUINIX INC	3,600	1,073,664.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,442	1,663,255.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,035	928,937.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,857	587,096.34	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,351	627,544.73	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	32,369	855,512.67	

	HCP INC	28,457	1,023,029.15	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	47,605	755,491.35	
	IRON MOUNTAIN INC	12,938	350,231.66	
	KIMCO REALTY CORP	25,975	661,843.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,727	252,672.90	
	MACERICH CO/THE	7,483	585,469.92	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	9,319	457,656.09	
	PROLOGIS INC	32,296	1,360,630.48	
	PUBLIC STORAGE	8,708	2,113,954.08	
	REALTY INCOME CORP	13,146	652,304.52	
	REGENCY CENTERS CORP	5,012	328,686.96	
	SIMON PROPERTY GROUP	18,434	3,451,766.50	
	SL GREEN REALTY CORP	5,753	662,285.36	
	UDR INC	16,191	581,256.90	
	VENTAS INC	20,394	1,097,605.08	
	VEREIT INC	53,870	441,195.30	
	VORNADO REALTY TRUST	10,567	1,030,599.51	
	WELLTOWER INC	21,577	1,384,596.09	
	アメリカドル 小計	607,029	32,310,094.96 (3,925,676,537)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	5,050	102,969.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,532	184,383.36	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	2,942	91,172.58	
	カナダドル 小計	15,524	378,525.44 (33,915,879)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	FONCIERE DES REGIONS	1,902	155,013.00	
	GECINA SA	2,185	248,653.00	
	ICADE	1,843	116,072.14	
	KLEPIERRE	12,151	507,304.25	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,998	1,388,237.10	
	ユーロ 小計	1,629,663	2,415,279.49 (323,309,312)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	58,762	469,508.38	
	HAMMERSON PLC	43,137	257,959.26	
	INTU PROPERTIES PLC	53,831	167,037.59	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,230	529,875.40	
	SEGRO PLC	45,745	198,441.81	
	イギリスポンド 小計	245,705	1,622,822.44 (299,524,337)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	66,717	511,052.22	
	GOODMAN GROUP	95,320	586,218.00	

	GPT GROUP	106,799	496,615.35
	MIRVAC GROUP	229,116	441,048.30
	SCENTRE GROUP	322,817	1,326,777.87
	STOCKLAND	160,120	653,289.60
	VICINITY CENTERS	198,963	553,117.14
	WESTFIELD CORP	125,943	1,205,274.51
	オーストラリアドル 小計	1,305,795	5,773,392.99 (513,889,710)
香港ドル	LINK REIT	139,000	6,435,700.00
	香港ドル 小計	139,000	6,435,700.00 (100,911,776)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	93,200	221,816.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	145,750.00
	CAPITALAND MALL TRUST	144,600	277,632.00
	SUNTEC REIT	113,000	175,150.00
	シンガポールドル 小計	460,800	820,348.00 (71,132,375)
	投資証券合計	4,403,516	5,268,359,926 (5,268,359,926)
	合計		5,478,669,532 (5,478,669,532)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	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 608銘柄	97.1%			62.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 34銘柄			2.8%	1.8%
カナダドル	株式 91銘柄	99.5%			3.4%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	98.8%			12.6%
	投資証券 6銘柄			1.2%	0.2%
イギリスポンド	株式 108銘柄	98.3%			8.1%
	投資証券 5銘柄			1.7%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.9%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.2%

ノルウェークロネ	株式	9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククロネ	株式	15銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式	60銘柄	88.7%			2.5%
	投資信託受 益証券	4銘柄		2.6%		0.1%
	投資証券	8銘柄			8.7%	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	94.9%			1.2%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	23銘柄	93.3%			0.5%
	投資証券	4銘柄			6.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.3%

(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27年12月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	172,001,486
コール・ローン	3,273,892,236
国債証券	186,745,925,885
派生商品評価勘定	32,603,689
未収入金	10,545,634
未収利息	1,576,919,306
前払費用	31,893,368
差入委託証拠金	118,931,696
流動資産合計	191,962,713,300
資産合計	191,962,713,300
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,136,709
前受金	1,681,960
未払金	11,852,075
未払解約金	682,672,432

平成27年12月10日現在	
項目	金額（円）
流動負債合計	715,343,176
負債合計	715,343,176
純資産の部	
元本等	
元本	78,266,297,921
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,981,072,203
元本等合計	191,247,370,124
純資産合計	191,247,370,124
負債純資産合計	191,962,713,300

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成27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</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>(1)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、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)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>

	平成27年12月10日現在
	(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。

## (貸借対照表に関する注記)

	平成27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	78,266,297,921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 2.4435円 (1万口当たり純資産額) (24,435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27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コンプライアンス・リスク統括部が、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27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) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 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27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27年 6月11日
期首元本額	90,258,230,807円
期中追加設定元本額	3,400,849,200円
期中一部解約元本額	15,392,782,086円

区分	平成27年12月10日現在
期末元本額	78,266,297,921円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	3,053,532,095円
DC外国債券インデックスファンド	1,826,864,424円
DC外国債券インデックスファンドL	10,070,827,375円
物価連動債組入世界債券ファンド	35,163,897円
DCバランスファンド30	492,288,404円
DCバランスファンド50	491,254,380円
DCバランスファンド70	91,260,635円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	39,306,028円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	22,740,231円
新生・4分散ファンド	51,540,751円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	413,751,854円
外国債券インデックスe	1,712,586,855円
インデックスコレクション（外国債券）	1,855,454,751円
インデックスコレクション（バランス株式30）	373,725,717円
インデックスコレクション（バランス株式50）	232,359,476円
インデックスコレクション（バランス株式70）	66,924,902円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	2,621,340,058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）	3,557,225,121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）	2,243,163,571円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,043,359,926円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	4,132,903,974円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	1,951,643,042円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,201,307,612円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	38,692,773円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,354,124,192円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,860,220,945円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,075,950,924円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	11,046,633,220円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	522,519,800円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	10,514,385,269円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,508,875,902円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	201,939,755円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	833,310,614円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	210,940,081円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	167,384,379円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	74,775,745円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	160,843,052円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,204,634,013円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	19,016,066円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	419,392,948円

区分	平成27年12月10日現在
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	140,093,167円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	2,309,540,220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）	22,211,822円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	287,955円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成27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	4,239,434,745	
合計	4,239,434,745	

(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27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	1,780,131,296	-	1,781,813,256	1,681,960
	合計	1,780,131,296	-	1,781,813,256	1,681,960

## (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27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	2,541,715,660	-	2,553,492,400	11,776,740
	アメリカドル	1,170,813,799	-	1,156,489,600	14,324,199
	カナダドル	109,698,732	-	106,600,200	3,098,532
	ユーロ	1,040,652,231	-	1,070,800,000	30,147,769

	イギリスポンド	220,550,898	-	219,602,600	948,298
	売建	83,058,200	-	83,049,920	8,280
	イギリスポンド	83,058,200	-	83,049,920	8,280
	合計	2,624,773,860	-	2,636,542,320	11,785,020

## (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 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,965,639.87	
		T 0.625% 02/15/17	5,000,000.00	4,988,378.90	
		T 0.625% 04/30/18	2,850,000.00	2,819,941.42	
		T 0.625% 05/31/17	3,000,000.00	2,988,339.84	
		T 0.625% 08/31/17	2,500,000.00	2,487,060.55	
		T 0.625% 09/30/17	3,250,000.00	3,232,290.03	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,966,308.60	
		T 0.625% 12/15/16	2,000,000.00	1,997,187.50	
		T 0.75% 02/28/18	4,500,000.00	4,470,820.33	
		T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,965,625.00	
		T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,990,781.24	
		T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,594,250.00	
		T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,975,585.95	
		T 0.875% 01/31/17	2,000,000.00	2,001,289.06	
		T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,993,828.12	
		T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,002,460.96	
		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,001,269.55	
		T 0.875% 04/30/17	3,350,000.00	3,350,261.73	
		T 0.875% 05/15/17	6,000,000.00	5,999,765.64	
		T 0.875% 06/15/17	4,550,000.00	4,549,644.55	
T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	3,997,812.52			

T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,905,859.40	
T 0.875% 10/15/18	6,000,000.00	5,948,320.32	
T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,001,992.18	
T 0.875% 12/31/16	5,000,000.00	5,004,980.45	
T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,963,671.88	
T 1.125% 05/31/19	2,850,000.00	2,829,125.97	
T 1.125% 06/15/18	1,900,000.00	1,900,742.19	
T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,121,898.44	
T 1.25% 01/31/19	4,800,000.00	4,797,562.51	
T 1.25% 01/31/20	4,000,000.00	3,955,703.12	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,994,335.94	
T 1.25% 11/15/18	9,000,000.00	9,011,777.31	
T 1.375% 02/28/19	5,500,000.00	5,512,353.49	
T 1.375% 04/30/20	8,250,000.00	8,177,490.25	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,950,781.25	
T 1.375% 06/30/18	3,500,000.00	3,523,652.33	
T 1.375% 07/31/18	3,000,000.00	3,019,863.27	
T 1.375% 09/30/18	2,520,000.00	2,534,617.96	
T 1.375% 09/30/20	4,000,000.00	3,950,859.36	
T 1.375% 10/31/20	6,000,000.00	5,922,656.28	
T 1.375% 11/30/18	3,000,000.00	3,015,058.59	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,716,042.97	
T 1.5% 01/31/19	5,550,000.00	5,589,240.22	
T 1.5% 01/31/22	5,000,000.00	4,883,203.15	
T 1.5% 02/28/19	2,300,000.00	2,315,138.66	
T 1.5% 05/31/19	1,350,000.00	1,356,591.79	
T 1.5% 08/31/18	2,500,000.00	2,523,437.50	
T 1.5% 10/31/19	3,200,000.00	3,204,250.01	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,003,808.60	
T 1.5% 12/31/18	2,500,000.00	2,519,531.25	
T 1.625% 03/31/19	4,400,000.00	4,443,312.50	
T 1.625% 04/30/19	4,000,000.00	4,037,031.24	
T 1.625% 06/30/19	4,000,000.00	4,034,843.76	
T 1.625% 07/31/19	3,500,000.00	3,528,300.79	
T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,370,824.22	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,906,015.64	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,615,282.22	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,547,710.92	
T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,715,102.53	
T 1.75% 10/31/18	1,800,000.00	1,829,777.34	
T 1.875% 05/31/22	7,250,000.00	7,219,697.24	
T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,237,187.48	

T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,033,476.56
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,584,511.72
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,230,891.41
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	4,986,802.71
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,501,435.56
T 1% 03/31/17	5,000,000.00	5,010,058.60
T 1% 05/31/18	1,000,000.00	997,441.41
T 1% 06/30/19	1,200,000.00	1,184,906.25
T 1% 08/31/19	2,800,000.00	2,756,632.81
T 1% 09/15/17	4,100,000.00	4,105,285.14
T 1% 09/15/18	2,350,000.00	2,339,259.77
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,916,992.20
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,986,458.99
T 1% 12/15/17	6,000,000.00	6,002,226.54
T 2.125% 01/31/21	5,000,000.00	5,099,218.75
T 2.125% 05/15/25	5,250,000.00	5,207,958.99
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,052,675.77
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,948,767.58
T 2.125% 08/31/20	1,000,000.00	1,021,386.72
T 2.25% 03/31/21	3,000,000.00	3,075,585.93
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,816,949.20
T 2.25% 07/31/18	1,500,000.00	1,545,205.08
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,606,347.64
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,025,488.30
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,050,312.50
T 2.375% 05/31/18	1,500,000.00	1,547,636.71
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,581,982.42
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,048,945.32
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,808,351.59
T 2.375% 12/31/20	7,200,000.00	7,439,765.61
T 2.5% 02/15/45	8,750,000.00	7,914,819.31
T 2.5% 05/15/24	5,800,000.00	5,959,953.15
T 2.5% 06/30/17	3,200,000.00	3,279,875.00
T 2.5% 08/15/23	5,000,000.00	5,162,109.40
T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,448,652.33
T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,735,632.80
T 2.625% 08/15/20	5,000,000.00	5,223,339.85
T 2.625% 11/15/20	2,350,000.00	2,454,694.33
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,093,437.50
T 2.75% 02/15/24	9,000,000.00	9,434,179.71
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	300,971.28
T 2.75% 05/31/17	4,900,000.00	5,036,089.85
T 2.75% 08/15/42	3,150,000.00	3,032,797.85

T 2.75% 11/15/23	7,950,000.00	8,348,742.18
T 2.75% 11/15/42	2,900,000.00	2,785,812.50
T 2.75% 11/30/16	1,000,000.00	1,018,984.38
T 2.75% 12/31/17	5,300,000.00	5,492,435.52
T 2.875% 03/31/18	2,550,000.00	2,656,582.04
T 2.875% 05/15/43	7,300,000.00	7,173,960.97
T 2.875% 08/15/45	2,200,000.00	2,155,269.53
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,121,191.41
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,500,634.79
T 2% 02/15/25	3,500,000.00	3,438,955.06
T 2% 02/28/21	1,550,000.00	1,570,283.20
T 2% 05/31/21	3,000,000.00	3,033,691.41
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,066,093.76
T 2% 07/31/22	6,000,000.00	6,014,179.68
T 2% 08/15/25	9,900,000.00	9,706,833.97
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,238,390.64
T 2% 11/15/21	4,300,000.00	4,334,853.52
T 2% 11/30/20	2,800,000.00	2,842,328.13
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,104,375.00
T 3.125% 02/15/42	800,000.00	832,687.50
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,684,347.66
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,054,273.46
T 3.125% 05/15/19	3,620,000.00	3,837,200.00
T 3.125% 05/15/21	4,190,000.00	4,480,599.41
T 3.125% 08/15/44	7,700,000.00	7,932,203.12
T 3.125% 11/15/41	3,200,000.00	3,334,124.99
T 3.25% 03/31/17	5,000,000.00	5,159,082.05
T 3.25% 12/31/16	2,800,000.00	2,871,804.68
T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,621,962.88
T 3.375% 11/15/19	5,900,000.00	6,333,050.79
T 3.5% 02/15/18	3,650,000.00	3,845,260.72
T 3.5% 02/15/39	1,600,000.00	1,788,000.00
T 3.5% 05/15/20	4,050,000.00	4,379,220.69
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	10,634,148.46
T 3.625% 02/15/21	2,100,000.00	2,296,095.71
T 3.625% 02/15/44	6,500,000.00	7,372,041.04
T 3.625% 08/15/19	5,500,000.00	5,936,132.84
T 3.625% 08/15/43	3,200,000.00	3,633,562.49
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,274,796.87
T 3.75% 11/15/18	2,000,000.00	2,149,414.06
T 3.75% 11/15/43	1,400,000.00	1,625,914.06
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,228,725.58

T	3.875% 08/15/40	950,000.00	1,119,812.50
T	3% 02/28/17	4,600,000.00	4,719,761.73
T	3% 05/15/42	3,400,000.00	3,447,613.29
T	3% 05/15/45	1,000,000.00	1,003,828.13
T	3% 11/15/44	2,050,000.00	2,058,808.60
T	4.0% 08/15/18	300,000.00	323,455.07
T	4.25% 05/15/39	1,750,000.00	2,182,954.09
T	4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,435,746.10
T	4.25% 11/15/40	2,000,000.00	2,493,671.88
T	4.375% 02/15/38	700,000.00	892,390.62
T	4.375% 05/15/40	1,600,000.00	2,030,500.00
T	4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,718,375.97
T	4.375% 11/15/39	2,500,000.00	3,172,802.72
T	4.5% 02/15/36	600,000.00	778,160.15
T	4.5% 05/15/17	3,500,000.00	3,682,998.06
T	4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,297,324.22
T	4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,614,965.82
T	4.625% 02/15/17	5,500,000.00	5,746,103.49
T	4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,971,474.61
T	4.75% 02/15/41	2,300,000.00	3,082,853.50
T	4.75% 08/15/17	3,000,000.00	3,194,707.02
T	5.0% 05/15/37	1,150,000.00	1,594,052.73
T	5.25% 02/15/29	500,000.00	660,068.36
T	5.25% 11/15/28	1,350,000.00	1,776,541.99
T	5.375% 02/15/31	1,900,000.00	2,599,400.39
T	5.5% 08/15/28	250,000.00	334,985.35
T	6.0% 02/15/26	600,000.00	806,355.46
T	6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,464,401.36
T	6.25% 05/15/30	1,200,000.00	1,754,812.50
T	6.25% 08/15/23	2,500,000.00	3,251,367.20
T	6.5% 11/15/26	450,000.00	634,104.49
T	8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,499,031.25
T	8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,005,595.69
T	8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,376,808.59
アメリカドル 小計		638,190,000.00	657,201,763.70 (79,850,014,289)
カナダドル	CAN 0.25% 05/01/17	350,000.00	348,687.50
	CAN 1.25% 02/01/18	700,000.00	710,636.50
	CAN 1.25% 03/01/18	1,700,000.00	1,726,630.50
	CAN 1.25% 08/01/17	400,000.00	404,648.00
	CAN 1.25% 09/01/18	1,050,000.00	1,069,199.25
	CAN 1.5% 02/01/17	2,400,000.00	2,427,288.00
	CAN 1.5% 03/01/17	600,000.00	607,197.00



	CAN 1.5% 03/01/20	250,000.00	258,017.50
	CAN 1.5% 06/01/23	1,750,000.00	1,777,921.25
	CAN 1.5% 06/01/26	250,000.00	247,232.50
	CAN 1.5% 09/01/17	2,400,000.00	2,439,564.00
	CAN 1.75% 03/01/19	1,150,000.00	1,191,175.75
	CAN 1.75% 09/01/19	700,000.00	727,209.00
	CAN 2.25% 06/01/25	900,000.00	960,574.50
	CAN 2.5% 06/01/24	1,950,000.00	2,123,520.75
	CAN 2.75% 06/01/22	1,050,000.00	1,156,517.25
	CAN 2.75% 12/01/48	400,000.00	445,754.00
	CAN 2.75% 12/01/64	400,000.00	464,526.00
	CAN 3.25% 06/01/21	1,550,000.00	1,739,239.50
	CAN 3.5% 06/01/20	2,640,000.00	2,957,275.20
	CAN 3.5% 12/01/45	1,800,000.00	2,296,125.00
	CAN 3.75% 06/01/19	2,750,000.00	3,042,572.50
	CAN 4.0% 06/01/41	1,680,000.00	2,249,755.20
	CAN 4.25% 06/01/18	1,650,000.00	1,799,283.75
	CAN 4% 06/01/17	1,750,000.00	1,839,040.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,080,000.00	1,577,296.80
	CAN 5.75% 06/01/33	1,250,000.00	1,919,031.25
	CAN 5% 06/01/37	1,350,000.00	1,993,005.00
	CAN 8.0% 06/01/27	650,000.00	1,075,964.50
	カナダドル 小計	36,550,000.00	41,574,887.95 (3,725,109,960)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,614,656.00
	MBONO 10% 12/05/24	22,800,000.00	28,836,984.00
	MBONO 4.75% 06/14/18	25,400,000.00	25,540,335.00
	MBONO 5% 06/15/17	10,550,000.00	10,720,962.75
	MBONO 5% 12/11/19	8,350,000.00	8,294,890.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	9,400,000.00	9,697,792.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	17,700,000.00	18,403,132.50
	MBONO 7.25% 12/15/16	16,300,000.00	16,892,342.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,300,000.00	7,915,572.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	19,850,000.00	21,811,378.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,950,000.00	15,258,440.25
	MBONO 7.75% 11/23/34	1,900,000.00	2,087,834.00
	MBONO 7.75% 12/14/17	11,600,000.00	12,423,774.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	11,900,000.00	13,936,923.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	10,950,000.00	12,897,348.00
	MBONO 8.5% 12/13/18	16,750,000.00	18,477,595.00
	MBONO 8% 06/11/20	20,050,000.00	22,156,753.75
	MBONO 8% 12/07/23	12,350,000.00	13,842,065.25

	メキシコペソ 小計	243,500,000.00	267,808,778.50 (1,909,476,590)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,430,000.00	1,420,890.90
	BGB 1.25% 06/22/18	850,000.00	882,712.25
	BGB 1.9% 06/22/38	410,000.00	418,808.85
	BGB 2.25% 06/22/23	1,650,000.00	1,866,100.50
	BGB 2.6% 06/22/24	1,350,000.00	1,566,202.50
	BGB 3.5% 06/28/17	1,650,000.00	1,747,506.75
	BGB 3.75% 06/22/45	800,000.00	1,139,444.00
	BGB 3.75% 09/28/20	1,850,000.00	2,185,812.00
	BGB 3% 06/22/34	650,000.00	797,335.50
	BGB 3% 09/28/19	1,150,000.00	1,287,873.50
	BGB 4.0% 03/28/17	500,000.00	528,195.00
	BGB 4.0% 03/28/19	1,450,000.00	1,652,325.75
	BGB 4.25% 03/28/41	1,680,000.00	2,530,222.80
	BGB 4.25% 09/28/21	2,050,000.00	2,538,187.00
	BGB 4.25% 09/28/22	1,900,000.00	2,402,179.50
	BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,284,224.25
	BGB 4% 03/28/18	1,150,000.00	1,263,976.50
	BGB 4% 03/28/22	790,000.00	976,653.30
	BGB 4% 03/28/32	950,000.00	1,299,229.50
	BGB 5.5% 03/28/28	1,850,000.00	2,770,606.25
	BGB 5.5% 09/28/17	1,500,000.00	1,657,117.50
	BGB 5% 03/28/35	2,150,000.00	3,364,244.75
	BKO 0% 06/16/17	1,700,000.00	1,708,551.00
	BKO 0% 12/16/16	400,000.00	401,466.00
	BTNS 1.75% 02/25/17	950,000.00	973,617.00
	BTNS 1% 07/25/17	2,800,000.00	2,859,038.00
	BTPS 0.25% 05/15/18	1,200,000.00	1,203,192.00
	BTPS 0.3% 10/15/18	1,300,000.00	1,305,011.50
	BTPS 1.45% 09/15/22	1,700,000.00	1,749,385.00
	BTPS 1.5% 06/01/25	900,000.00	903,253.50
	BTPS 1.5% 08/01/19	850,000.00	885,296.25
	BTPS 1.5% 12/15/16	100,000.00	101,539.50
	BTPS 2.15% 12/15/21	700,000.00	752,608.50
	BTPS 2.5% 05/01/19	1,000,000.00	1,074,345.00
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,414,861.50	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,150,000.00	1,305,054.50	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,300,000.00	1,546,551.50	
BTPS 3.5% 06/01/18	150,000.00	162,409.50	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	3,088,340.50	
BTPS 3.5% 12/01/18	1,600,000.00	1,757,248.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	550,000.00	636,828.50	

BTPS 3.75% 05/01/21	1,350,000.00	1,566,499.50
BTPS 3.75% 08/01/21	3,700,000.00	4,305,135.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,400,000.00	2,857,320.00
BTPS 4.25% 02/01/19	4,350,000.00	4,895,859.75
BTPS 4.25% 03/01/20	3,200,000.00	3,711,232.00
BTPS 4.25% 09/01/19	3,150,000.00	3,602,198.25
BTPS 4.5% 02/01/18	4,400,000.00	4,813,402.00
BTPS 4.5% 02/01/20	2,600,000.00	3,035,084.00
BTPS 4.5% 03/01/19	4,100,000.00	4,657,969.00
BTPS 4.5% 03/01/24	2,900,000.00	3,615,357.50
BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,866,747.50
BTPS 4.5% 05/01/23	100,000.00	123,684.50
BTPS 4.5% 08/01/18	1,950,000.00	2,173,158.00
BTPS 4.75% 05/01/17	2,160,000.00	2,301,134.40
BTPS 4.75% 06/01/17	4,700,000.00	5,024,817.00
BTPS 4.75% 08/01/23	2,850,000.00	3,593,479.50
BTPS 4.75% 09/01/21	3,550,000.00	4,333,431.75
BTPS 4.75% 09/01/28	2,050,000.00	2,712,990.50
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	2,437,315.50
BTPS 4% 02/01/17	1,650,000.00	1,725,471.00
BTPS 4% 02/01/37	3,050,000.00	3,843,320.25
BTPS 4% 09/01/20	2,750,000.00	3,192,736.25
BTPS 5.0% 08/01/39	1,700,000.00	2,455,930.50
BTPS 5.25% 08/01/17	1,750,000.00	1,899,432.50
BTPS 5.25% 11/01/29	3,950,000.00	5,521,744.50
BTPS 5.5% 09/01/22	1,200,000.00	1,549,686.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,350,000.00	4,337,211.50
BTPS 5.75% 02/01/33	1,700,000.00	2,568,411.00
BTPS 5% 03/01/22	3,900,000.00	4,863,982.50
BTPS 5% 03/01/25	3,800,000.00	4,954,041.00
BTPS 5% 08/01/34	2,850,000.00	4,030,341.75
BTPS 5% 09/01/40	2,100,000.00	3,035,907.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,150,000.00	4,722,165.00
BTPS 6% 05/01/31	3,200,000.00	4,853,824.00
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	544,171.25
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,848,482.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,850,000.00	3,117,415.50
DBR 1.5% 05/15/23	3,450,000.00	3,775,507.50
DBR 1.5% 05/15/24	2,750,000.00	3,008,390.00
DBR 1.5% 09/04/22	1,600,000.00	1,748,920.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,800,000.00	2,005,839.00
DBR 1.75% 07/04/22	2,450,000.00	2,715,727.00

DBR 1% 08/15/24	1,800,000.00	1,890,090.00
DBR 1% 08/15/25	1,250,000.00	1,299,012.50
DBR 2.25% 09/04/20	1,400,000.00	1,557,598.00
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,201,238.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,650,000.00	2,995,586.50
DBR 2.5% 07/04/44	1,900,000.00	2,419,878.00
DBR 2.5% 08/15/46	750,000.00	957,600.00
DBR 2% 01/04/22	2,200,000.00	2,460,854.00
DBR 2% 08/15/23	1,800,000.00	2,039,346.00
DBR 3.25% 01/04/20	2,050,000.00	2,336,487.50
DBR 3.25% 07/04/21	1,050,000.00	1,241,058.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,800,000.00	2,572,830.00
DBR 3.5% 07/04/19	4,010,000.00	4,544,833.75
DBR 3.75% 01/04/17	1,000,000.00	1,044,055.00
DBR 3.75% 01/04/19	3,500,000.00	3,933,772.50
DBR 3% 07/04/20	3,400,000.00	3,885,945.00
DBR 4.0% 01/04/18	2,550,000.00	2,779,538.25
DBR 4.0% 01/04/37	2,300,000.00	3,462,431.50
DBR 4.25% 07/04/17	2,750,000.00	2,947,628.75
DBR 4.25% 07/04/18	1,100,000.00	1,229,514.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,450,000.00	2,318,390.50
DBR 4.75% 07/04/28	800,000.00	1,175,496.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,200,000.00	3,518,086.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,650,000.00	2,843,115.00
DBR 5.5% 01/04/31	1,530,000.00	2,490,809.40
DBR 5.625% 01/04/28	1,800,000.00	2,805,975.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,100,000.00	1,620,261.50
DBR 6.25% 01/04/30	1,000,000.00	1,707,355.00
DBR 6.5% 07/04/27	1,100,000.00	1,804,814.00
FRTR 0.25% 11/25/20	950,000.00	959,105.75
FRTR 0.5% 05/25/25	3,400,000.00	3,301,944.00
FRTR 0.5% 11/25/19	1,500,000.00	1,534,777.50
FRTR 0% 05/25/20	1,500,000.00	1,500,690.00
FRTR 1.5% 05/25/31	400,000.00	402,998.00
FRTR 1.75% 05/25/23	2,500,000.00	2,735,187.50
FRTR 1.75% 11/25/24	2,550,000.00	2,776,529.25
FRTR 1% 05/25/18	2,400,000.00	2,473,104.00
FRTR 1% 05/25/19	3,100,000.00	3,222,527.50
FRTR 1% 11/25/18	2,900,000.00	3,003,791.00
FRTR 1% 11/25/25	1,100,000.00	1,110,554.50
FRTR 2.25% 05/25/24	3,100,000.00	3,513,183.50
FRTR 2.25% 10/25/22	2,350,000.00	2,653,338.00
FRTR 2.5% 05/25/30	2,650,000.00	3,045,618.50

FRTR 2.5% 10/25/20	3,150,000.00	3,527,401.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,250,000.00	5,014,150.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,650,000.00	2,156,005.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,250,000.00	5,014,553.75	
FRTR 3.5% 04/25/20	4,950,000.00	5,717,299.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	2,050,000.00	2,571,827.50	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,400,000.00	4,645,036.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	4,350,000.00	5,202,186.75	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,250,000.00	3,736,752.50	
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,401,975.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	3,400,000.00	3,908,963.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,550,000.00	4,936,818.25	
FRTR 4.25% 10/25/18	2,800,000.00	3,160,136.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	4,550,000.00	5,863,403.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,600,000.00	4,041,778.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,450,000.00	3,737,560.75	
FRTR 4% 04/25/18	3,450,000.00	3,798,467.25	
FRTR 4% 04/25/55	1,600,000.00	2,471,488.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,150,000.00	1,803,108.00	
FRTR 4% 10/25/38	2,450,000.00	3,502,348.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,900,000.00	5,950,971.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,000,000.00	4,924,500.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,250,000.00	3,361,702.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,800,000.00	2,859,525.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,802,493.00	
IRISH 0.8% 03/15/22	300,000.00	306,918.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	750,000.00	822,900.00	
IRISH 2% 02/18/45	500,000.00	481,215.00	
IRISH 3.4% 03/18/24	850,000.00	1,016,404.50	
IRISH 3.9% 03/20/23	650,000.00	797,696.25	
IRISH 4.4% 06/18/19	750,000.00	866,115.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	1,200,000.00	1,428,534.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	970,000.00	1,097,186.40	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,200,000.00	1,648,788.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	400,000.00	441,952.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	700,000.00	857,780.00	
IRISH 5% 10/18/20	1,100,000.00	1,356,663.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	550,000.00	525,643.25	
NETHER 0.5% 04/15/17	1,850,000.00	1,870,572.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,350,000.00	1,393,281.00	
NETHER 1.25% 01/15/19	1,700,000.00	1,778,038.50	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,500,000.00	1,652,220.00	

NETHER 2.25% 07/15/22	1,800,000.00	2,041,506.00
NETHER 2.5% 01/15/17	550,000.00	567,129.75
NETHER 2.5% 01/15/33	950,000.00	1,133,905.75
NETHER 2.75% 01/15/47	550,000.00	714,422.50
NETHER 2% 07/15/24	1,600,000.00	1,793,224.00
NETHER 3.25% 07/15/21	1,500,000.00	1,767,712.50
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,270,970.00
NETHER 3.75% 01/15/23	1,620,000.00	2,014,583.40
NETHER 3.75% 01/15/42	2,100,000.00	3,170,055.00
NETHER 4.0% 07/15/18	2,100,000.00	2,332,606.50
NETHER 4.5% 07/15/17	2,000,000.00	2,154,390.00
NETHER 4% 01/15/37	1,450,000.00	2,155,367.00
NETHER 4% 07/15/19	2,300,000.00	2,647,196.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,350,000.00	2,053,950.75
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,055,593.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,250,000.00	2,280,408.75
OBL 0.25% 10/16/20	1,800,000.00	1,828,881.00
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,105,571.00
OBL 0.5% 04/07/17	2,450,000.00	2,476,974.50
OBL 0.5% 04/12/19	850,000.00	871,441.25
OBL 0.5% 10/13/17	1,700,000.00	1,725,993.00
OBL 0.75% 02/24/17	2,450,000.00	2,482,144.00
OBL 0% 04/17/20	1,050,000.00	1,056,468.00
OBL 1% 02/22/19	1,500,000.00	1,560,682.50
OBL 1% 10/12/18	1,450,000.00	1,503,606.50
RAGB 1.15% 10/19/18	800,000.00	831,848.00
RAGB 1.2% 10/20/25	200,000.00	207,038.00
RAGB 1.65% 10/21/24	800,000.00	868,756.00
RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	769,622.00
RAGB 1.95% 06/18/19	750,000.00	806,505.00
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	578,155.00
RAGB 3.15% 06/20/44	650,000.00	870,720.50
RAGB 3.2% 02/20/17	720,000.00	750,088.80
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,819,200.00
RAGB 3.5% 09/15/21	1,850,000.00	2,213,617.50
RAGB 3.65% 04/20/22	800,000.00	974,612.00
RAGB 3.8% 01/26/62	400,000.00	656,544.00
RAGB 3.9% 07/15/20	1,150,000.00	1,360,064.75
RAGB 4.15% 03/15/37	1,200,000.00	1,771,200.00
RAGB 4.3% 09/15/17	1,050,000.00	1,134,687.75
RAGB 4.35% 03/15/19	1,800,000.00	2,068,281.00
RAGB 4.65% 01/15/18	1,100,000.00	1,213,542.00
RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,463,978.25

RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,341,100.25
RFGB 0.75% 04/15/31	420,000.00	388,901.10
RFGB 0.875% 09/15/25	250,000.00	251,010.00
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	570,674.50
RFGB 1.5% 04/15/23	400,000.00	431,656.00
RFGB 1.625% 09/15/22	150,000.00	163,656.00
RFGB 1.875% 04/15/17	550,000.00	566,373.50
RFGB 2.625% 07/04/42	380,000.00	476,803.10
RFGB 2.75% 07/04/28	600,000.00	719,784.00
RFGB 2% 04/15/24	650,000.00	725,471.50
RFGB 3.375% 04/15/20	900,000.00	1,035,018.00
RFGB 3.5% 04/15/21	1,000,000.00	1,184,000.00
RFGB 3.875% 09/15/17	700,000.00	751,698.50
RFGB 4.375% 07/04/19	300,000.00	348,679.50
RFGB 4% 07/04/25	650,000.00	845,256.75
SPGB 1.15% 07/30/20	1,200,000.00	1,229,364.00
SPGB 1.4% 01/31/20	1,050,000.00	1,089,296.25
SPGB 1.6% 04/30/25	1,050,000.00	1,054,457.25
SPGB 1.95% 07/30/30	950,000.00	929,622.50
SPGB 2.1% 04/30/17	2,300,000.00	2,365,768.50
SPGB 2.15% 10/31/25	2,350,000.00	2,462,189.00
SPGB 2.75% 04/30/19	2,100,000.00	2,272,315.50
SPGB 2.75% 10/31/24	2,700,000.00	2,973,577.50
SPGB 3.75% 10/31/18	1,750,000.00	1,929,541.25
SPGB 3.8% 01/31/17	3,400,000.00	3,547,169.00
SPGB 3.8% 04/30/24	3,800,000.00	4,501,746.00
SPGB 4.1% 07/30/18	2,600,000.00	2,867,241.00
SPGB 4.2% 01/31/37	1,650,000.00	2,090,013.75
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,760,504.00
SPGB 4.4% 10/31/23	1,550,000.00	1,910,514.50
SPGB 4.5% 01/31/18	2,450,000.00	2,678,719.75
SPGB 4.6% 07/30/19	3,300,000.00	3,806,088.00
SPGB 4.65% 07/30/25	1,850,000.00	2,352,904.00
SPGB 4.7% 07/30/41	1,500,000.00	2,048,445.00
SPGB 4.8% 01/31/24	1,400,000.00	1,769,467.00
SPGB 4.85% 10/31/20	1,850,000.00	2,222,534.50
SPGB 4.9% 07/30/40	1,400,000.00	1,958,656.00
SPGB 4% 04/30/20	2,050,000.00	2,355,234.75
SPGB 5.15% 10/31/28	1,400,000.00	1,897,182.00
SPGB 5.15% 10/31/44	1,050,000.00	1,544,355.75
SPGB 5.4% 01/31/23	1,900,000.00	2,451,988.00
SPGB 5.5% 04/30/21	1,800,000.00	2,251,944.00

	SPGB 5.5% 07/30/17	2,750,000.00	2,995,162.50
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,850,000.00	2,748,637.50
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,830,254.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	300,000.00	421,131.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,920,000.00	4,262,251.00
	ユーロ 小計	469,800,000.00	564,624,826.50 (75,580,679,275)
イギリスボ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,200,000.00	3,238,176.00
	UKT 1.5% 01/22/21	1,400,000.00	1,410,941.00
	UKT 1.75% 01/22/17	1,700,000.00	1,724,837.00
	UKT 1.75% 07/22/19	2,600,000.00	2,666,183.00
	UKT 1.75% 09/07/22	2,600,000.00	2,638,090.00
	UKT 1% 09/07/17	3,150,000.00	3,172,176.00
	UKT 2.25% 09/07/23	2,570,000.00	2,680,754.15
	UKT 2.5% 07/22/65	440,000.00	454,927.00
	UKT 2.75% 09/07/24	2,350,000.00	2,536,766.25
	UKT 2% 07/22/20	3,350,000.00	3,466,697.25
	UKT 2% 09/07/25	1,200,000.00	1,214,820.00
	UKT 3.25% 01/22/44	2,700,000.00	3,091,432.50
	UKT 3.5% 01/22/45	1,150,000.00	1,379,672.25
	UKT 3.5% 07/22/68	1,900,000.00	2,537,450.00
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,115,184.00
	UKT 3.75% 09/07/19	850,000.00	935,986.00
	UKT 3.75% 09/07/20	3,500,000.00	3,916,692.50
	UKT 3.75% 09/07/21	750,000.00	849,982.50
	UKT 4.25% 03/07/36	2,250,000.00	2,899,451.25
	UKT 4.25% 06/07/32	2,350,000.00	2,986,380.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,300,000.00	1,704,904.50
	UKT 4.25% 12/07/27	1,050,000.00	1,302,698.25
	UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	2,514,517.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,950,000.00	2,691,204.75
	UKT 4.25% 12/07/49	1,500,000.00	2,125,770.00
	UKT 4.25% 12/07/55	1,630,000.00	2,418,015.35
	UKT 4.5% 03/07/19	2,500,000.00	2,791,637.50
	UKT 4.5% 09/07/34	2,180,000.00	2,878,330.30
	UKT 4.5% 12/07/42	2,040,000.00	2,836,956.60
	UKT 4.75% 03/07/20	250,000.00	288,260.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,900,000.00	2,524,539.50
	UKT 4.75% 12/07/38	1,700,000.00	2,374,517.50
UKT 4% 01/22/60	1,300,000.00	1,877,414.50	
UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,370,825.00	
UKT 5% 03/07/18	1,520,000.00	1,669,294.40	
UKT 5% 03/07/25	2,350,000.00	3,001,678.50	



	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,966,869.00	
	UKT 8.75% 08/25/17	770,000.00	879,443.95	
	UKT 8% 06/07/21	1,300,000.00	1,761,623.50	
イギリスポンド 小計		72,150,000.00	85,895,098.75 (15,853,658,376)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	500,000.00	572,677.50	
	SWISS 2% 04/28/21	250,000.00	288,127.50	
	SWISS 3% 01/08/18	800,000.00	868,376.00	
	SWISS 3% 05/12/19	550,000.00	626,452.75	
	SWISS 4.25% 06/05/17	600,000.00	647,430.00	
	SWISS 4% 02/11/23	550,000.00	732,171.00	
	SWISS 4% 04/08/28	600,000.00	898,230.00	
スイスフラン 小計		3,850,000.00	4,633,464.75 (572,140,227)	
スウェーデン クロナ	SGB 1.5% 11/13/23	7,250,000.00	7,695,911.25	
	SGB 2.5% 05/12/25	6,300,000.00	7,202,884.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,740,000.00	6,048,074.10	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,000,000.00	10,714,005.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	7,400,000.00	7,921,552.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	9,360,000.00	10,713,268.80	
	SGB 5% 12/01/20	7,650,000.00	9,455,208.75	
スウェーデンクロナ 小計		51,700,000.00	59,750,904.40 (862,803,059)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.75% 03/13/25	2,650,000.00	2,705,491.00	
	NGB 2% 05/24/23	5,350,000.00	5,620,924.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	7,350,000.00	8,414,831.25	
	NGB 3% 03/14/24	5,200,000.00	5,838,352.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	6,620,000.00	6,966,755.60	
	NGB 4.5% 05/22/19	6,800,000.00	7,693,622.00	
ノルウェークローネ 小計		33,970,000.00	37,239,975.85 (521,732,061)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	7,050,000.00	7,591,263.75	
	DGB 1.75% 11/15/25	3,950,000.00	4,292,761.25	
	DGB 3% 11/15/21	9,800,000.00	11,407,053.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	12,700,000.00	20,641,818.00	
	DGB 4% 11/15/17	4,850,000.00	5,267,706.25	
	DGB 4% 11/15/19	10,100,000.00	11,732,968.00	
	DGB 7% 11/10/24	2,650,000.00	4,138,213.50	
デンマーククローネ 小計		51,100,000.00	65,071,783.75 (1,167,387,800)	
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	400,000.00	387,304.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	4,100,000.00	4,168,121.50	

	POLGB 2.5% 07/25/26	700,000.00	658,850.50	
	POLGB 2% 04/25/21	1,000,000.00	977,325.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	3,250,000.00	3,382,567.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,700,000.00	2,762,059.50	
	POLGB 3.75% 04/25/18	2,200,000.00	2,299,022.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	1,940,000.00	2,020,985.30	
	POLGB 4% 10/25/23	3,300,000.00	3,571,870.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	2,350,000.00	2,501,845.25	
	POLGB 5.25% 10/25/20	1,940,000.00	2,201,201.60	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,200,000.00	2,476,771.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,150,000.00	1,458,297.75	
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,800,000.00	2,139,921.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,850,000.00	2,175,905.25	
	<b>ポーランドズロチ 小計</b>	<b>30,880,000.00</b>	<b>33,182,047.65</b>	<b>(1,022,338,888)</b>
オーストラリアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	250,000.00	243,576.25	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,600,000.00	2,598,804.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	550,000.00	498,877.50	
	ACGB 2.75% 10/21/19	680,000.00	694,436.40	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,150,000.00	2,225,561.75	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,100,000.00	1,116,087.50	
	ACGB 3.25% 06/21/39	50,000.00	48,141.25	
	ACGB 3.25% 10/21/18	1,400,000.00	1,444,219.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,230,000.00	1,290,073.20	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,400,000.00	2,691,516.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,850,000.00	1,914,333.75	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,900,000.00	3,173,948.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,100,000.00	1,277,204.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,750,000.00	2,051,105.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,550,000.00	2,799,708.75	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,300,000.00	2,461,908.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,350,000.00	2,800,248.25	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,650,000.00	3,105,164.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,391,300.00	
ACGB 6% 02/15/17	2,350,000.00	2,457,289.25		
	<b>オーストラリアドル 小計</b>	<b>34,210,000.00</b>	<b>37,283,503.35</b>	<b>(3,318,604,633)</b>
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	650,000.00	639,912.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	100,000.00	99,965.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	520,000.00	525,059.60	
	SIGB 2.375% 04/01/17	400,000.00	407,380.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	150,000.00	149,093.25	
	SIGB 2.5% 06/01/19	850,000.00	876,906.75	

	SIGB 2.75% 04/01/42	480,000.00	468,480.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	400,000.00	412,046.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	204,902.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	250,000.00	254,217.50	
	SIGB 2% 07/01/20	100,000.00	100,541.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	600,000.00	634,281.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	620,000.00	657,860.30	
	SIGB 3.375% 09/01/33	300,000.00	324,360.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	550,000.00	601,496.50	
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	838,796.00	
	SIGB 4% 09/01/18	700,000.00	749,973.00	
	シンガポールドル 小計	7,670,000.00	7,945,270.40 (688,934,396)	
マレーシア リンギット	MGS 3.26% 03/01/18	1,200,000.00	1,202,268.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,950,000.00	1,867,739.25	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,528,792.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,600,000.00	1,583,544.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	950,000.00	874,394.25	
	MGS 3.58% 09/28/18	1,800,000.00	1,814,769.00	
	MGS 3.759% 03/15/19	2,300,000.00	2,324,690.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,114,531.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	830,000.00	755,789.70	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,050,000.00	1,053,150.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	640,000.00	608,579.20	
	MGS 4.127% 04/15/32	350,000.00	329,869.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,000,000.00	2,011,950.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,850,000.00	1,844,524.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	3,800,000.00	3,885,671.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,877,070.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	950,000.00	953,386.75	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,099,257.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	750,000.00	770,103.75	
	MGS 5.248% 09/15/28	950,000.00	1,026,061.75	
	マレーシアリンギット 小計	29,570,000.00	29,526,141.40 (845,333,428)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	18,700,000.00	20,898,933.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,300,000.00	7,397,511.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	9,250,000.00	6,636,782.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	6,550,000.00	6,103,159.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,700,000.00	7,445,245.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	5,750,000.00	5,484,982.50	
	SAGB 7% 02/28/31	10,240,000.00	8,357,273.60	
	SAGB 8.25% 03/31/32	4,950,000.00	4,507,494.75	

	SAGB 8.25% 09/15/17	5,300,000.00	5,359,121.50	
	SAGB 8.5% 01/31/37	6,200,000.00	5,658,120.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	3,200,000.00	2,948,240.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	9,450,000.00	8,713,561.50	
	SAGB 8.875% 02/28/35	2,800,000.00	2,663,808.00	
	SAGB 8% 01/31/30	4,900,000.00	4,427,615.50	
	SAGB 8% 12/21/18	4,700,000.00	4,709,400.00	
	南アフリカランド 小計	109,990,000.00	101,311,248.85 (827,712,903)	
	合計		186,745,925,885 (186,745,925,885)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 182銘柄	100.0%	42.8%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 258銘柄	100.0%	40.5%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.5%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%

(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27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	677,741,978
投資証券	91,094,723,800
未収入金	579,194,124
未収配当金	571,114,578
未収利息	1,045
流動資産合計	92,922,775,525
資産合計	92,922,775,525
負債の部	
流動負債	
未払金	532,726,702
未払解約金	2,369,533
流動負債合計	535,096,235
負債合計	535,096,235
純資産の部	
元本等	
元本	40,443,614,087
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	51,944,065,203
元本等合計	92,387,679,290
純資産合計	92,387,679,290
負債純資産合計	92,922,775,525

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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。
2.収益及び費用の計上基準	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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成27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		40,443,614,087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)	2.2844円 (22,844円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成27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、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。	
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コンプライアンス・リスク統括部が、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27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。	

	平成27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	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27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27年 6月11日
期首元本額	37,570,151,761円
期中追加設定元本額	5,006,584,355円
期中一部解約元本額	2,133,122,029円
期末元本額	40,443,614,087円
期末元本額の内訳	
Jリートファンド	37,821,530,209円
3 資産バランスオープン	692,426,239円
3 資産バランスオープンアルファ	118,527,159円
ベスタ・世界6 資産ファンド（毎月決算型）	41,858,297円
ベスタ・世界6 資産ファンド（1年決算型）	24,493,905円
Jリートアクティブファンド（1年決算型）	1,351,972,306円
はまぎんJリートファンド2015-09（繰上償還条件付）	392,805,972円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	平成27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)
投資証券	176,159,833
合計	176,159,833

(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	4,470	1,852,815,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,653	1,351,610,000	
	森ヒルズリート投資法人	15,652	2,419,799,200	
	産業ファンド投資法人	3,712	2,100,992,000	
	大和ハウスリート投資法人	4,032	2,003,904,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,944	3,397,800,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	4,127	1,254,608,000	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	6,621	3,317,121,000	
	G L P 投資法人	19,501	2,340,120,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3,894	917,426,400	
	日本プロロジスリート投資法人	18,318	3,984,165,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,025	1,246,400,000	
	イオンリート投資法人	9,291	1,321,180,200	
	ヒューリックリート投資法人	8,841	1,472,026,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	8,224	841,315,200	
	積水ハウス・リート投資法人	8,796	1,145,239,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,541	1,154,776,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人	35,560	5,330,444,000	
	日本ビルファンド投資法人	15,038	8,556,622,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	14,897	8,461,496,000	
日本リテールファンド投資法人	22,810	5,088,911,000		



オリックス不動産投資法人	18,832	2,920,843,200	
日本プライムリアルティ投資法人	6,571	2,730,250,500	
プレミア投資法人	16,255	1,916,464,500	
東急リアル・エステート投資法人	1,374	202,802,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,215	1,404,955,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,636	3,250,170,000	
森トラスト総合リート投資法人	14,209	2,941,263,000	
フロンティア不動産投資法人	4,596	2,245,146,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	9,506	2,195,886,000	
福岡リート投資法人	2,510	511,789,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,057	588,749,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	6,953	764,134,700	
大和証券オフィス投資法人	3,660	2,247,240,000	
阪急リート投資法人	3,234	403,926,600	
トップリート投資法人	1,523	696,011,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	6,541	1,631,979,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,711	3,155,229,900	
ジャパンエクセレント投資法人	12,875	1,729,112,500	
合計	394,205	91,094,723,800	

(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

項目	平成27年12月10日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金	14,004,167	
コール・ローン	2,131,718	
投資証券	464,546,928	
未収入金	2,353	
未収配当金	525,816	
未収利息	3	
流動資産合計	481,210,985	
資産合計	481,210,985	
負債の部		

	平成27年12月10日現在
項目	金額（円）
流動負債	
未払解約金	502,734
流動負債合計	502,734
負債合計	502,734
純資産の部	
元本等	
元本	407,762,566
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,945,685
元本等合計	480,708,251
純資産合計	480,708,251
負債純資産合計	481,210,985

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27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</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> <p>(2)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27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		407,762,566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)	1.1789円 (11,789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27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為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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27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27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)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>

## （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27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27年 6月11日
期首元本額	468,693,421円
期中追加設定元本額	373,168円
期中一部解約元本額	61,304,023円
期末元本額	407,762,566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	277,624,537円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	80,687,821円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	49,450,208円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27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		26,431,602
合計		26,431,602

(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	264	8,656.56	
		AGREE REALTY CORP	86	2,831.98	
		ALEXANDER'S INC	15	5,763.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	280	24,984.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	141	5,467.98	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	432	16,532.64	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	617	9,933.70	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	141	2,554.92	
		APARTMENT INVEST & MGMT	604	23,115.08	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	625	12,000.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	110	1,174.80	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	113	1,519.85	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	378	2,377.62	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	514	91,039.68	
		BIOMED REALTY TRUST INC	789	18,612.51	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	50	548.00	
		BOSTON PROPERTIES	596	73,611.96	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	698	9,115.88	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	639	15,828.03	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	338	25,600.12	

CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	284	1,911.32
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	321	9,967.05
CARETRUST REIT INC	187	1,982.20
CBL & ASSOCIATES PRTYS	588	7,479.36
CEDAR REALTY TRUST INC	363	2,577.30
CHAMBERS STREET PROPERTIES	924	6,662.04
CHATHAM LODGING TRUST	166	3,555.72
CHESAPEAKE LODGING TRUST	245	6,360.20
CITY OFFICE REIT INC	45	526.05
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	484	11,519.20
CORESITE REALTY CORP	106	6,066.38
CORPORATE OFFICE PPTYS	367	8,033.63
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	452	11,128.24
COUSINS PROPERTIES INC	798	7,118.16
CUBESMART	644	18,933.60
CYRUSONE INC	260	9,326.20
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	342	12,698.46
DDR CORPORATION	1,158	19,269.12
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	774	8,150.22
DIGITAL REALTY TRUST INC	528	37,741.44
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	527	15,915.40
DUKE REALTY CORP	1,335	27,207.30
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	254	8,028.94
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	30	513.00
EASTGROUP PROPERTIES, INC	126	7,035.84
EDUCATION REALTY TRUST INC	188	6,707.84
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	432	7,797.60
EPR PROPERTIES	220	12,320.00
EQUITY COMMONWEALTH	499	13,418.11
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	311	19,235.35
EQUITY ONE INC	286	7,579.00
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	1,418	109,994.26
ESSEX PROPERTY TRUST	254	58,475.88
EXTRA SPACE STORAGE INC	476	40,755.12
FEDERAL REALTY INVS TRUST	266	38,365.18
FELCOR LODGING TRUST INC	462	3,331.02
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	429	9,536.67
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	225	2,524.50
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	340	3,321.80
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	359	9,775.57
GENERAL GROWTH PROPERTIES	2,266	59,890.38
GEO GROUP INC/THE	289	8,068.88

GETTY REALTY CORP	114	1,980.18
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	89	1,267.36
GLOBAL NET LEASE INC	630	5,531.40
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	276	4,440.84
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	225	5,222.25
HCP INC	1,797	64,602.15
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	385	10,445.05
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	484	12,772.76
HERSHA HOSPITALITY TRUST	210	4,731.30
HIGHWOODS PROPERTIES INC	368	15,400.80
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	582	15,219.30
HOST HOTELS AND RESORTS INC	2,941	46,673.67
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	305	8,341.75
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	156	1,132.56
INLAND REAL ESTATE CORP	388	3,953.72
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	528	4,039.20
IRON MOUNTAIN INC	725	19,625.75
KILROY REALTY CORPORATION	363	23,173.92
KIMCO REALTY CORP	1,600	40,768.00
KITE REALTY GROUP TRUST	320	8,316.80
LASALLE HOTEL PROPERTIES	434	11,344.76
LEXINGTON CORP PROPERTIES	825	6,740.25
LIBERTY PROPERTY TRUST	578	18,900.60
LTC PROPERTIES INC	147	6,184.29
MACERICH CO/THE	522	40,841.28
MACK-CALI REALTY CORP	336	7,570.08
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	883	9,898.43
MID-AMERICA APARTMENT COMM	292	25,585.04
MONMOUTH REIT -CL A	286	2,900.04
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	650	6,272.50
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	520	19,848.40
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	90	1,499.40
NATL HEALTH INVESTORS INC	127	7,581.90
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	291	2,610.27
NEW YORK REIT INC	630	7,282.80
NEXPOINT RESIDENTIAL	100	1,270.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	216	2,276.64
NORTHSTAR REALTY FINANCE	650	10,991.50
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	623	20,826.89
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	82	1,785.14
PARKWAY PROPERTIES INC	316	5,056.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	275	8,219.75

PENN REAL ESTATE INVEST TST	265	5,549.10	
PHYSICIANS REALTY TRUST	290	4,593.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	597	11,241.51	
POST PROPERTIES	212	12,351.12	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	110	1,287.00	
PROLOGIS INC	2,036	85,776.68	
PS BUSINESS PARKS INC	78	6,722.04	
PUBLIC STORAGE	571	138,615.96	
QTS REALTY TRUST INC	132	5,530.80	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	342	5,653.26	
REALTY INCOME CORP	902	44,757.24	
REGENCY CENTERS CORP	368	24,133.44	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	398	7,104.30	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	916	13,456.04	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	250	3,972.50	
RLJ LODGING TRUST	509	11,533.94	
ROUSE PROPERTIES INC	152	2,328.64	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	198	10,240.56	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	260	5,135.00	
SAUL CENTERS INC	49	2,631.30	
SELECT INCOME REIT	247	4,833.79	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	912	12,977.76	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	164	2,546.92	
SIMON PROPERTY GROUP	1,200	224,700.00	
SL GREEN REALTY CORP	386	44,436.32	
SOVRAN SELF STORAGE INC	141	14,153.58	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1,766	17,677.66	
STAG INDUSTRIAL INC	283	5,357.19	
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	150	3,307.50	
STORE CAPITAL CORP	210	4,809.00	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	1,064	15,130.08	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	348	4,235.16	
SUN COMMUNITIES INC	208	13,965.12	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	805	10,843.35	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	374	12,132.56	
TAUBMAN CENTERS INC	238	17,428.74	
TERRENO REALTY CORP	164	3,624.40	
UDR INC	1,005	36,079.50	
UMH PROPERTIES INC	100	967.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	58	2,933.64	
URBAN EDGE PROPERTIES	358	8,341.40	



	URSTADT BIDDLE - CL A	123	2,473.53	
	VENTAS INC	1,287	69,266.34	
	VEREIT INC	3,513	28,771.47	
	VORNADO REALTY TRUST	681	66,417.93	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	265	7,353.75	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	444	15,024.96	
	WELLTOWER INC	1,366	87,656.22	
	WHITESTONE REIT	136	1,557.20	
	WINTHROP REALTY TRUST	120	1,604.40	
	WP CAREY INC	375	22,698.75	
	WP GLIMCHER INC	712	7,347.84	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	430	6,673.60	
	アメリカドル 小計	77,085	2,715,137.65 (329,889,224)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	150	4,659.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	234	2,899.26	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	105	4,736.55	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	63	1,674.54	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	229	5,844.08	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	144	5,814.72	
	CHOICE PROPERTIES REIT	151	1,731.97	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	369	5,332.05	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	110	1,377.20	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	120	1,550.40	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	178	1,422.22	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	160	1,209.60	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	222	3,858.36	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	89	3,620.52	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	511	10,419.29	
	INVEST REAL ESTATE INVESTME	241	1,238.74	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	141	930.60	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	100	1,547.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	10	105.90	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	160	2,142.40	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	75	1,242.75	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	90	744.30	

	ONEREIT	283	922.58
	PLAZA RETAIL REIT	100	455.00
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	260	1,115.40
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	575	14,076.00
	SLATE RETAIL REIT	40	557.60
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	239	7,406.61
	カナダドル 小計	5,149	88,634.64 (7,941,663)
ユーロ	AEDIFICA	47	2,754.20
	AFFINE	15	243.75
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	316	3,799.90
	ALTAREA	8	1,388.00
	ANF IMMOBILIER	57	1,242.60
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	190	2,473.80
	BEFIMMO S.C.A.	75	4,091.25
	BENI STABILI SPA	3,832	2,709.22
	BGP HOLDINGS PLC	900,544	-
	COFINIMMO	76	7,324.12
	EUROCOMMERCIAL	198	7,738.83
	FONCIERE DES MURS	25	635.00
	FONCIERE DES REGIONS	169	13,773.50
	GECINA SA	138	15,704.40
	GREEN REIT PLC	2,622	4,176.84
	HAMBORNER REIT AG	230	2,119.22
	HIBERNIA REIT PLC	2,635	3,628.39
	ICADE	134	8,439.32
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,084	959.34
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	40	914.60
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	1,200	1,302.00
	KLEPIERRE	738	30,811.50
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	250	2,385.00
	MERCIALYS	71	1,416.09
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,210	14,290.10
	NSI NV	439	1,670.39
RETAIL ESTATES	25	1,900.00	
UNIBAIL-RODAMCO SE	381	88,182.45	
VASTNED RETAIL	71	2,929.46	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	52	3,908.32	
WERELDHAVE BELGIUM	10	1,050.00	
WERELDHAVE NV	155	8,024.35	
	ユーロ 小計	917,037	241,985.94 (32,392,237)

イギリスポ ンド	ASSURA PLC	3,988	2,243.25
	BIG YELLOW GROUP PLC	631	5,003.83
	BRITISH LAND CO PLC	3,975	31,760.25
	DERWENT LONDON PLC	427	15,666.63
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	820	924.55
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1,321	11,175.66
	HAMMERSON PLC	3,040	18,179.20
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	2,883	3,329.86
	INTU PROPERTIES PLC	3,076	9,544.82
	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,114	37,305.72
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,470	3,937.18
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	390	1,033.50
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	2,044	2,135.98
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	3,700	1,914.75
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	908	3,221.58
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	2,000	1,175.00
	SEGREO PLC	2,862	12,415.35
	SHAFTESBURY PLC	1,064	9,719.64
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,380	3,001.18
	WORKSPACE GROUP PLC	488	4,687.24
イギリスポンド 小計		41,581	178,375.17 (32,922,705)
オーストラ リアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	1,200	1,218.00
	360 CAPITAL OFFICE FUND	256	529.92
	ABACUS PROPERTY GROUP	1,107	3,309.93
	ALE PROPERTY GROUP	764	2,941.40
	ARENA REIT	1,000	1,735.00
	ASPEN GROUP	520	681.20
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	165	851.40
	BWP TRUST	1,954	6,174.64
	CHARTER HALL GROUP	1,204	5,393.92
	CHARTER HALL RETAIL REIT	1,207	5,009.05
	CROMWELL PROPERTY GROUP	5,265	5,422.95
	DEXUS PROPERTY GROUP	3,690	28,265.40
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	1,000	2,200.00
	GALILEO JAPAN TRUST	500	965.00
	GDI PROPERTY GROUP	2,400	2,148.00
	GOODMAN GROUP	6,045	37,176.75
	GPT GROUP	6,790	31,573.50
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	754	2,277.08
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	700	1,806.00
	INDUSTRIA REIT	466	978.60
INGENIA COMMUNITIES GROUP	638	1,748.12	

	INVESTA OFFICE FUND	2,202	8,984.16	
	MIRVAC GROUP	14,020	26,988.50	
	NATIONAL STORAGE REIT	1,335	2,082.60	
	SCENTRE GROUP	20,656	84,896.16	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	2,498	5,245.80	
	STOCKLAND	9,103	37,140.24	
	VICINITY CENTERS	12,604	35,039.12	
	WESTFIELD CORP	7,436	71,162.52	
オーストラリアドル 小計		107,479	413,944.96	(36,845,240)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	3,500	4,042.50	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,259	5,366.34	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	4,006	5,548.31	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	3,400	4,250.00	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	2,131	3,398.94	
	STRIDE PROPERTY LTD	1,208	2,579.08	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	1,309	2,487.10	
ニュージーランドドル 小計		19,813	27,672.27	(2,275,490)
香港ドル	CHAMPION REIT	8,000	31,840.00	
	FORTUNE REIT	5,000	38,850.00	
	LINK REIT	9,000	416,700.00	
	NEW CENTURY REIT	2,000	5,800.00	
	PROSPERITY REIT	5,000	14,150.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,000	7,760.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	9,180.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,000	11,490.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	5,000	20,800.00	
香港ドル 小計		44,000	556,570.00	(8,727,017)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	2,400	3,240.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	4,000	2,620.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	7,800	18,564.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	2,800	3,276.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	2,400	2,172.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	3,800	2,204.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	7,900	10,467.50	
	CAPITALAND MALL TRUST	9,900	19,008.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	2,200	3,234.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	2,400	3,144.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	4,000	2,540.00	

	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,500	2,975.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	1,900	3,524.50	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	2,400	3,132.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	2,000	1,470.00	
	KEPPEL DC REIT	2,500	2,575.00	
	KEPPEL REIT	7,000	6,685.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	8,000	2,480.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	5,700	7,353.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	7,400	6,808.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	4,700	7,332.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	6,000	6,030.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	2,000	1,360.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	2,200	1,727.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	1,600	3,600.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	3,000	2,175.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	2,000	1,510.00	
	SPH REIT	3,300	3,118.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	6,000	4,560.00	
	SUNTEC REIT	9,500	14,725.00	
	シンガポールドル 小計	129,300	153,609.50 (13,319,479)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	700	7,434.00	
	イスラエルシェケル 小計	700	7,434.00 (233,873)	
	合計	1,342,144	464,546,928 (464,546,928)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 157銘柄	100.0%	71.0%
カナダドル	投資証券 28銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 32銘柄	100.0%	7.0%
イギリスポンド	投資証券 20銘柄	100.0%	7.1%
オーストラリアドル	投資証券 29銘柄	100.0%	7.9%

ニュージーランドドル	投資証券	7銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券	9銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	2.9%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

(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27年12月30日現在）

資産総額	581,502,075円
負債総額	2,414,691円
純資産総額（ - ）	579,087,384円
発行済口数	561,725,505口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0309円
（1万口当たり純資産額）	（10,309円）

（参考）

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年12月30日現在）

資産総額	225,958,228,711円
負債総額	1,063,362,511円
純資産総額（ - ）	224,894,866,200円
発行済口数	147,365,769,462口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5261円
（1万口当たり純資産額）	（15,261円）

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年12月30日現在）

資産総額	322,588,694,142円
負債総額	2,904,517,830円
純資産総額（ - ）	319,684,176,312円
発行済口数	243,686,091,744口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3119円
（1万口当たり純資産額）	（13,119円）

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年12月30日現在）

資産総額	225,213,431,343円
負債総額	340,158,049円
純資産総額（ - ）	224,873,273,294円
発行済口数	103,645,965,394口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1696円
（1万口当たり純資産額）	（21,696円）

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年12月30日現在）

資産総額	186,271,477,095円
負債総額	28,860,141円
純資産総額（ - ）	186,242,616,954円
発行済口数	77,646,997,484口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3986円
（1万口当たり純資産額）	（23,986円）

## Jリートマザーファンド（M）

## 純資産額計算書

（平成27年12月30日現在）

資産総額	94,613,938,827円
負債総額	737,506,731円
純資産総額（ - ）	93,876,432,096円
発行済口数	40,480,158,124口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3191円
（1万口当たり純資産額）	（23,191円）

## 海外リートマザーファンド

## 純資産額計算書



（平成27年12月30日現在）

資産総額	491,683,427円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	491,683,427円
発行済口数	407,125,881口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2077円
（1万口当たり純資産額）	（12,077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27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

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。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コンプライアンス・リスク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（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）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28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27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	425	7,942,052
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	30	114,157
単位型公社債投資信託	0	0
合計	455	8,056,209

## 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おります。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度（自平成26年4月1日 至 平成27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30期事業年度の中間会計期間（自平成27年4月1日 至 平成27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26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		10,457,599		12,314,170
前払費用		114,325		125,306
未収委託者報酬		2,735,763		4,518,944
未収運用受託報酬		15,268		-
繰延税金資産		144,183		116,728
その他		3,448		8,789
流動資産合計		13,470,589		17,083,939
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67,359	1	57,461
器具備品	1	87,378	1	116,879
有形固定資産合計		154,737		174,341
無形固定資産				
ソフトウェア		203,360		197,641
その他		4,686		7,648
無形固定資産合計		208,046		205,290
投資その他の資産				
投資有価証券		69,583		60,277
長期前払費用		34,773		5,425
長期貸付金		28,838		25,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		117,743		114,415
その他		553		463
貸倒引当金		28,838		25,838
投資その他の資産合計		247,653		205,581
固定資産合計		610,437		585,213
資産合計		14,081,027		17,669,152

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	13,353	13,868
未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	62,500	65,500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)

営業収益				
委託者報酬	22,773,831		28,159,652	
運用受託報酬	55,511		8,732	
営業収益合計	22,829,342		28,168,384	
営業費用				
支払手数料	10,451,296		12,922,655	
広告宣伝費	76,961		130,384	
公告費	-		880	
調査費	5,091,105		5,994,577	
調査費	259,236		279,702	
委託調査費	4,830,390		5,712,946	
図書費	1,479		1,928	
営業雑経費	1,264,334		1,299,065	
通信費	17,246		17,456	
印刷費	327,214		330,921	
協会費	22,524		23,182	
諸会費	773		105	
情報機器関連費	837,859		857,009	
その他営業雑経費	58,716		70,390	
営業費用合計	16,883,698		20,347,563	
一般管理費				
給料	2,201,964		2,185,555	
役員報酬	102,330		89,055	
給料・手当	1,846,450		1,839,000	
賞与	253,183		257,499	
退職給付費用	72,029		71,270	
役員退職慰労金	1,070		-	
福利費	207,122		212,286	
交際費	2,758		4,491	
旅費交通費	45,973		55,788	
租税公課	42,862		42,868	
不動産賃借料	130,938		130,938	
寄付金	3,385		-	
減価償却費	119,445		129,285	
諸経費	1	219,615	1	212,345
一般管理費合計	3,047,165		3,044,830	
営業利益	2,898,479		4,775,990	

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日	(自 平成26年4月 1日
	至 平成26年3月31日)	至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846

貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,775		1,936
営業外収益合計		16,027		18,203
営業外費用				
長期前払費用償却	1	23,222	1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		-	2	56,222
特別損失合計		-		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				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	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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
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	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	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
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

#### (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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
建 物	35,517	千円	45,415	千円
器具備品	188,630	"	218,270	"
計	224,147	"	263,685	"

### (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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	"	27,866	"

## 2. 外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

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

当事業年度(自平成26年4月1日 至平成27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

## 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27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27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27年3月31日	平成27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。

当事業年度（平成27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	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(\*) 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）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（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	-

当事業年度（平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

（有価証券関係）

## 1. その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成27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	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

（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。

## 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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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
34,635	1,846	117

（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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付費用	72,029	71,270

(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13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

## 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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	102,368	千円	64,846	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	10,277	"	8,356	"
賞与引当金損金算入限度超過額	33,736	"	31,368	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	111,906	"	110,871	"
外国税関連費用損金不算入額	-	"	18,609	"
その他	13,094	"	5,855	"
繰延税金資産 合計	271,384	"	239,908	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	1,503	"	1,546	"
投資有価証券売却益益金不算入額	7,953	"	7,217	"
繰延税金負債 合計	9,457	"	8,763	"
繰延税金資産（負債）の純額	261,926	"	231,144	"

## 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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27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等については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千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・レアルコース）	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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・レアルコース）	3,178,319千円

（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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	8,852,826	未払 手数料	1,374,578
							投資助言費用 の支払	3,428,200	その他 未払金	381,755

- (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）

当事業年度（平成27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）

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56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25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
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30期中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	14,016,702
未収委託者報酬	5,141,677
繰延税金資産	106,209
その他流動資産	141,365
流動資産合計	19,405,955
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 59,944
器具備品	1 102,740

その他有形固定資産	1	4,207
有形固定資産合計		166,892
無形固定資産		195,428
投資その他の資産		
投資有価証券		58,796
長期貸付金		24,338
会員権		25,000
その他の投資		1,137
繰延税金資産		124,183
貸倒引当金		24,338
投資その他の資産合計		209,117
固定資産合計		571,438
資産合計		19,977,393
負債の部		
流動負債		
未払金		2,781,753
未払費用		77,994
未払法人税等		1,090,560
賞与引当金		100,008
その他流動負債	2	189,082
流動負債合計		4,239,399
固定負債		
退職給付引当金		368,901
資産除去債務		12,816
その他固定負債		3,552
固定負債合計		385,270
負債合計		4,624,670

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(平成27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		68,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		12,536,088
利益剰余金合計		14,704,588
株主資本合計		15,354,588
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,864
評価・換算差額等合計		1,864

純資産合計	15,352,723
負債・純資産合計	19,977,393

## 中間損益計算書

(単位：千円)

第30期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,237,885
営業収益合計		16,237,885
営業費用		11,383,551
一般管理費	1	1,638,696
営業利益		3,215,638
営業外収益	2	12,278
営業外費用		14,137
経常利益		3,213,780
税引前中間純利益		3,213,780
法人税、住民税及び事業税		1,061,497
法人税等調整額		3,185
法人税等合計		1,064,682
中間純利益		2,149,097

## 中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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				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	利益剰余金 合計		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
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			2,149,097	2,149,097	2,149,097

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	-	2,116,097	2,119,097	2,119,097
当中間期末残高	68,500	2,100,000	12,536,088	14,704,588	15,354,588

	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	3,235	3,235	13,238,726
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			2,149,097
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	5,100	5,100	5,100
当中間期変動額合計	5,100	5,100	2,113,997
当中間期末残高	1,864	1,864	15,352,723

## 重要な会計方針

第30期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27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。 (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> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>  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。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金</p> <p>  一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金</p> <p>  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。</p>

## (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。

## 会計方針の変更

## (企業結合に関する会計基準等の適用)

第30期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。)及び「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。)等を当中間会計期間から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当中間会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項(4)及び事業分離等会計基準第57 - 4項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間末  
(平成27年9月30日)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	49,628千円
器具備品	239,367千円
その他有形固定資産	382千円
計	289,378千円

## 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30期中間会計期間  
(自 平成27年4月1日  
至 平成27年9月30日)

## 1 減価償却実施額

有形固定資産	26,652千円
--------	----------

無形固定資産	34,155千円
2 営業外収益の主要項目 受取利息	3,919千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

平成27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	14,016,702	14,016,702	-
(2)未収委託者報酬	5,141,677	5,141,677	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,793	58,793	-
(4)未払金	(2,781,753)	(2,781,753)	-
(5)未払法人税等	(1,090,560)	(1,090,560)	-

(\*)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、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30期中間会計期間末（平成27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	7,156	6,560	596
小計	7,156	6,560	596
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの その他	51,636	54,986	3,349
小計	51,636	54,986	3,349
合計	58,793	61,546	2,753

(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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,010,428千円

（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いません。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1株当たり純資産額	5,117,574円52銭
1株当たり中間純利益	716,365円75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いません。	

（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30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
中間純利益	2,149,097千円
普通株式に係る中間純利益	2,149,097千円
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)通常の実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

通常の実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

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

#### (2)訴訟事件その他の重要事項

平成28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27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27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	62,120	
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27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27年 6月 5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27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28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27年6月11日から平成27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27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27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 公認会計士 白川 芳樹  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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27年4月1日から平成28年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27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。