

【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9月9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 9月10日から平成29年 3月10日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】**< 振替受益権について >**

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での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の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】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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 | | エマージ ング | | | | |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉と

する旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定され

る旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

1. 国内外の株式・債券・不動産投資信託証券へ分散投資します。

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

Jリートマザーファンド(M)[※]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。

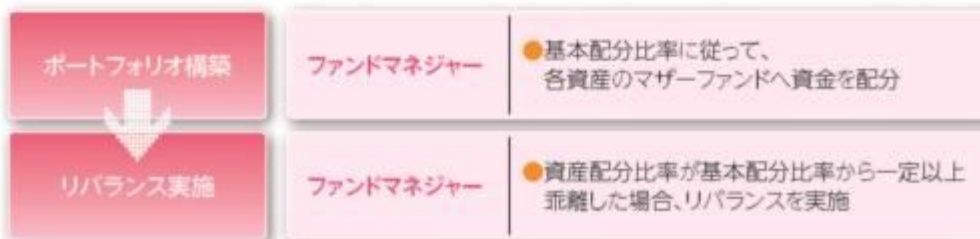
当インデックスはSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、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

2. 6つの資産への均等配分を基本配分比率とします。



ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、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。

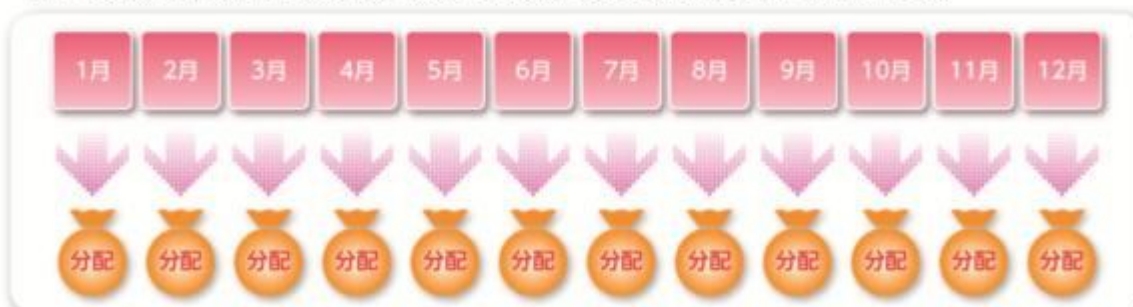
ファンドのしくみ

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。

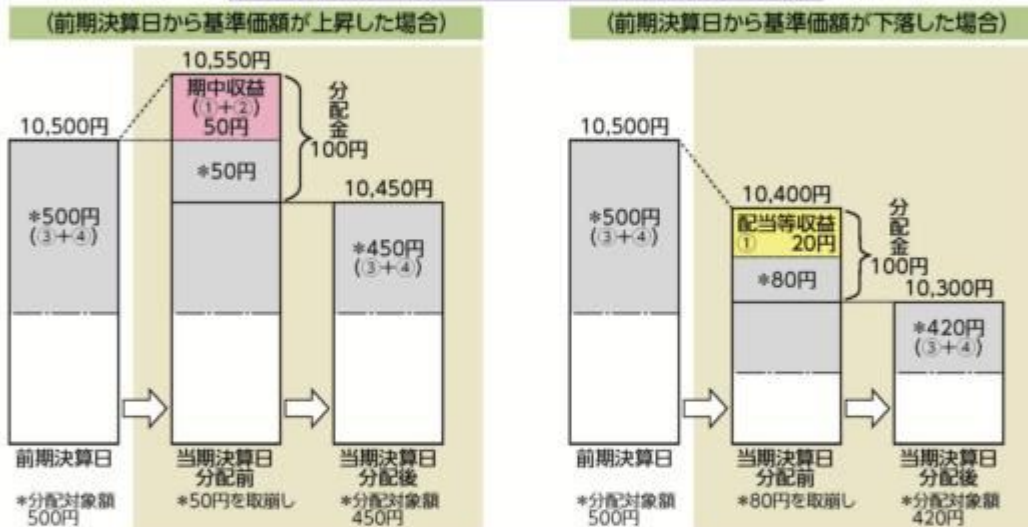
【収益分配金に関する留意事項】

- 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。



- 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）



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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



（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

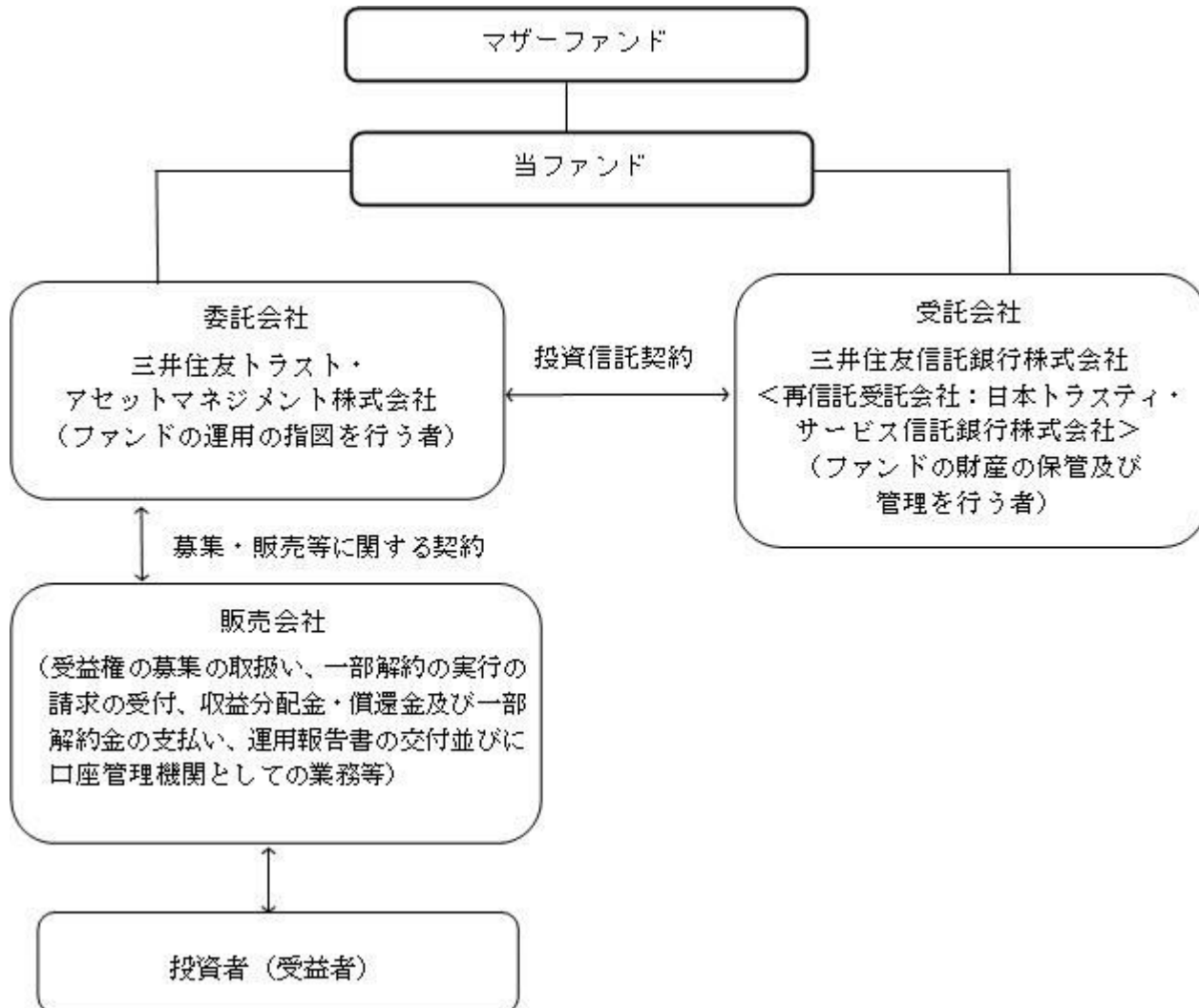
平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

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28年 6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。

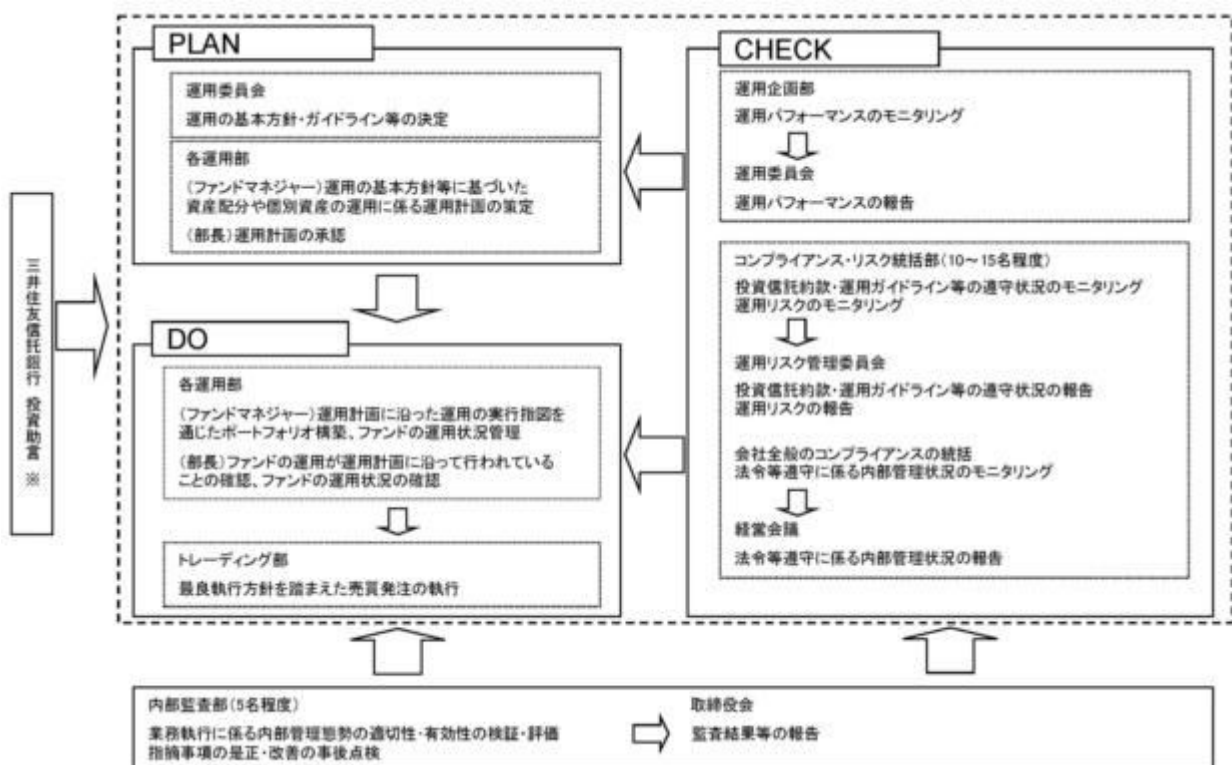
株式への直接投資は行いません。

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）で金融商品取引所が有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。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。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではあ

りません。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．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7月～2016年6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)^{*1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}

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)^{*3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}

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)^{*5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)^{*6}

(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認定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の重入り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認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、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ます。）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。

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 6月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成28年 6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 | 504,772,393 | 98.88 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 5,716,707 | 1.12 |
| 合計(純資産総額) | | 510,489,100 | 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 | Jリートマザーファンド(M) | 35,319,801 | 2.5460 | 89,924,214 | 2.5139 | 88,790,447 | 17.39 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 日本債券マザーファンド | 61,614,674 | 1.3835 | 85,243,902 | 1.3952 | 85,964,793 | 16.84 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 海外リートマザーファンド | 75,975,359 | 1.1401 | 86,619,507 | 1.1132 | 84,575,769 | 16.57 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式マザーファンド | 45,230,142 | 1.9604 | 88,669,171 | 1.8264 | 82,608,331 | 16.18 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 日本株式マザーファンド | 66,317,090 | 1.3260 | 87,936,462 | 1.2433 | 82,452,037 | 16.15 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券マザーファンド | 37,050,480 | 2.2580 | 83,659,984 | 2.1695 | 80,381,016 | 15.75 |

(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 | 98.88 |
| 合計 | 98.88 |

(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 |
| 第18特定期間末（平成28年6月10日） | 533,798,664 | 534,339,635 | 9,867 | 9,877 |
| 平成27年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 | |
| 平成28年1月末日 | 559,098,791 | | 9,992 | |
| 2月末日 | 542,971,015 | | 9,724 | |
| 3月末日 | 560,226,680 | | 10,059 | |
| 4月末日 | 542,541,990 | | 9,982 | |
| 5月末日 | 545,334,680 | | 10,057 | |
| 6月末日 | 510,489,100 | | 9,539 | |

【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 |
| 第18特定期間 | 平成27年12月11日～平成28年 6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 |
| 第18特定期間 | 平成27年12月11日～平成28年 6月10日 | 3.2 |

(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 |
| 第18特定期間 | 平成27年12月11日～平成28年 6月10日 | 107,758 | 25,344,751 | 540,971,678 |

(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 | 193,493,559,910 | 98.55 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 2,852,794,564 | 1.45 |
| 合計（純資産総額） | | 196,346,354,474 | 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 | 2,864,650,000 | 1.46 |

(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 | 1,304,500 | 6,745.75 | 8,799,843,390 | 5,052.00 | 6,590,334,000 | 3.36 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 800,200 | 4,629.51 | 3,704,540,280 | 4,800.00 | 3,840,960,000 | 1.96 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 8,305,800 | 615.05 | 5,108,506,949 | 455.90 | 3,786,614,220 | 1.93 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 586,500 | 4,945.41 | 2,900,487,070 | 5,789.00 | 3,395,248,500 | 1.73 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,024,300 | 2,786.83 | 2,854,549,969 | 3,113.00 | 3,188,645,900 | 1.62 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 694,800 | 4,082.07 | 2,836,226,760 | 4,103.00 | 2,850,764,400 | 1.45 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 943,900 | 3,316.35 | 3,130,309,294 | 2,572.50 | 2,428,182,750 | 1.24 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 828,900 | 3,904.52 | 3,236,461,930 | 2,926.00 | 2,425,361,400 | 1.24 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 740,100 | 2,539.44 | 1,879,441,020 | 2,988.00 | 2,211,418,800 | 1.13 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 14,681,100 | 204.67 | 3,004,911,392 | 148.30 | 2,177,207,130 | 1.11 |
| 日本 | 株式 | NTTドコモ | 情報・通信業 | 773,500 | 2,351.73 | 1,819,069,314 | 2,766.50 | 2,139,887,750 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 1,230,100 | 1,592.36 | 1,958,769,126 | 1,600.00 | 1,968,160,000 | 1.00 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 437,600 | 5,524.36 | 2,417,462,556 | 4,424.00 | 1,935,942,400 | 0.99 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 433,000 | 4,969.40 | 2,151,751,800 | 4,281.00 | 1,853,673,000 | 0.94 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 191,700 | 10,082.52 | 1,932,819,668 | 9,433.00 | 1,808,306,100 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 107,300 | 18,612.86 | 1,997,160,308 | 16,535.00 | 1,774,205,500 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 295,500 | 5,798.83 | 1,713,556,502 | 5,929.00 | 1,752,019,500 | 0.89 |
| 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道 | 陸運業 | 93,900 | 20,418.28 | 1,917,276,648 | 18,125.00 | 1,701,937,500 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 23,800 | 57,400.10 | 1,366,122,526 | 69,140.00 | 1,645,532,000 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 564,700 | 3,300.73 | 1,863,925,525 | 2,912.50 | 1,644,688,750 | 0.84 |
| 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 770,000 | 2,154.36 | 1,658,860,000 | 1,873.00 | 1,442,210,000 | 0.73 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 419,400 | 4,030.84 | 1,690,535,684 | 3,367.00 | 1,412,119,800 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 776,800 | 1,828.49 | 1,420,376,548 | 1,788.00 | 1,388,918,400 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 1,119,000 | 1,122.80 | 1,256,414,980 | 1,208.00 | 1,351,752,000 | 0.69 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 1,463,800 | 1,094.17 | 1,601,653,158 | 917.90 | 1,343,622,020 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 152,700 | 7,730.96 | 1,180,518,298 | 8,514.00 | 1,300,087,800 | 0.66 |
| 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 549,000 | 2,606.41 | 1,430,922,400 | 2,331.50 | 1,279,993,500 | 0.65 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 110,600 | 14,784.90 | 1,635,210,100 | 11,380.00 | 1,258,628,000 | 0.64 |
| 日本 | 株式 | ブリヂストン | ゴム製品 | 370,700 | 4,072.99 | 1,509,860,384 | 3,269.00 | 1,211,818,300 | 0.62 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 197,000 | 5,920.26 | 1,166,291,950 | 5,962.00 | 1,174,514,000 | 0.60 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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 | 0.11 |
| | | 鉱業 | 0.29 |
| | | 建設業 | 3.29 |
| | | 食料品 | 5.31 |
| | | 繊維製品 | 0.72 |
| | | パルプ・紙 | 0.26 |
| | | 化学 | 6.15 |
| | | 医薬品 | 5.94 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.50 |
| | | ゴム製品 | 0.83 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.87 |
| | | 鉄鋼 | 1.15 |
| | | 非鉄金属 | 0.81 |
| | | 金属製品 | 0.61 |
| | | 機械 | 4.62 |
| | | 電気機器 | 11.63 |
| | | 輸送用機器 | 8.85 |
| | | 精密機器 | 1.56 |
| | | その他製品 | 1.61 |
| | | 電気・ガス業 | 1.96 |
| | | 陸運業 | 4.69 |
| | | 海運業 | 0.22 |
| | | 空運業 | 0.63 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.21 |
| | | 情報・通信業 | 8.69 |
| | | 卸売業 | 4.15 |
| | | 小売業 | 5.05 |
| | | 銀行業 | 7.01 |
| | | 証券、商品先物取引業 | 0.89 |
| | | 保険業 | 2.11 |
| その他金融業 | 1.19 | | |
| 不動産業 | 2.70 | | |
| サービス業 | 3.91 | | |
| | | 小計 | 98.55 |
| 合計 | | | 98.55 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|-------|---------|---------|-----|----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物 | 買建 | 230 | 円 | 3,042,885,860 | 2,864,650,000 | 1.46 |

(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 | 265,581,953,960 | 81.74 |
| | メキシコ | 100,911,000 | 0.03 |
| | 小計 | 265,682,864,960 | 81.77 |
| 地方債証券 | 日本 | 18,342,939,237 | 5.65 |
| 特殊債券 | 日本 | 24,463,639,341 | 7.53 |
| 社債券 | 日本 | 12,819,004,000 | 3.95 |
| | フランス | 403,166,000 | 0.12 |
| | オーストラリア | 303,133,000 | 0.09 |
| | オランダ | 202,236,000 | 0.06 |
| | スウェーデン | 201,975,000 | 0.06 |
| | ノルウェー | 101,216,000 | 0.03 |
| | カナダ | 100,872,000 | 0.03 |
| | スイス | 99,823,000 | 0.03 |
| | 小計 | 14,231,425,000 | 4.38 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2,186,719,039 | 0.67 |
| 合計(純資産総額) | | 324,907,587,577 | 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 | 1,070,440,000 | 0.33 |

(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342回利付国債(10年) | 3,830,000,000 | 102.01 | 3,907,007,700 | 103.43 | 3,961,407,300 | 0.100 | 2026/3/20 | 1.22 |
| 日本 | 国債証券 | 第106回利付国債(5年) | 3,920,000,000 | 100.36 | 3,934,112,000 | 100.62 | 3,944,343,200 | 0.200 | 2017/9/20 | 1.21 |
| 日本 | 国債証券 | 第116回利付国債(5年) | 3,550,000,000 | 100.76 | 3,577,317,500 | 101.25 | 3,594,481,500 | 0.200 | 2018/12/20 | 1.11 |
| 日本 | 国債証券 | 第339回利付国債(10年) | 3,325,000,000 | 101.93 | 3,389,172,500 | 106.20 | 3,531,183,250 | 0.400 | 2025/6/20 | 1.09 |
| 日本 | 国債証券 | 第338回利付国債(10年) | 3,070,000,000 | 102.07 | 3,133,579,700 | 106.11 | 3,257,791,900 | 0.400 | 2025/3/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第341回利付国債(10年) | 2,980,000,000 | 102.33 | 3,049,652,800 | 105.38 | 3,140,353,800 | 0.300 | 2025/12/20 | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 第125回利付国債(5年) | 3,040,000,000 | 100.41 | 3,052,686,400 | 101.77 | 3,093,868,800 | 0.100 | 2020/9/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第340回利付国債(10年) | 2,910,000,000 | 101.79 | 2,962,089,000 | 106.28 | 3,092,748,000 | 0.400 | 2025/9/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第126回利付国債(5年) | 3,020,000,000 | 101.28 | 3,058,900,400 | 101.87 | 3,076,715,600 | 0.100 | 2020/12/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第117回利付国債(5年) | 2,830,000,000 | 100.64 | 2,848,225,200 | 101.37 | 2,869,025,700 | 0.200 | 2019/3/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第122回利付国債(5年) | 2,800,000,000 | 100.37 | 2,810,360,000 | 101.41 | 2,839,676,000 | 0.100 | 2019/12/20 | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第333回利付国債(10年) | 2,620,000,000 | 103.99 | 2,724,538,000 | 107.14 | 2,807,199,000 | 0.600 | 2024/3/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第127回利付国債(5年) | 2,740,000,000 | 101.57 | 2,783,096,000 | 101.98 | 2,794,334,200 | 0.100 | 2021/3/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第334回利付国債(10年) | 2,590,000,000 | 103.99 | 2,693,341,000 | 107.34 | 2,780,106,000 | 0.600 | 2024/6/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第332回利付国債(10年) | 2,530,000,000 | 103.99 | 2,630,947,000 | 106.99 | 2,706,922,900 | 0.600 | 2023/12/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第123回利付国債(5年) | 2,620,000,000 | 100.39 | 2,630,218,000 | 101.51 | 2,659,797,800 | 0.100 | 2020/3/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第124回利付国債(5年) | 2,600,000,000 | 100.41 | 2,610,660,000 | 101.64 | 2,642,744,000 | 0.100 | 2020/6/20 | 0.81 |
| 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債(10年) | 2,385,000,000 | 105.48 | 2,515,888,800 | 107.97 | 2,575,179,900 | 0.800 | 2023/6/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第362回利付国債(2年) | 2,470,000,000 | 100.64 | 2,485,975,300 | 100.69 | 2,487,043,000 | 0.100 | 2018/3/15 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第335回利付国債(10年) | 2,325,000,000 | 103.12 | 2,397,540,000 | 106.69 | 2,480,589,000 | 0.500 | 2024/9/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年) | 2,285,000,000 | 105.14 | 2,402,449,000 | 107.10 | 2,447,235,000 | 0.800 | 2022/9/20 | 0.75 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債（10年） | 2,200,000,000 | 105.02 | 2,310,594,000 | 105.61 | 2,323,574,000 | 1.300 | 2019/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債（10年） | 2,150,000,000 | 103.98 | 2,235,720,500 | 103.97 | 2,235,484,000 | 1.500 | 2018/9/20 | 0.69 |
| 日本 | 国債証券 | 第364回利付国債（2年） | 2,190,000,000 | 100.67 | 2,204,694,900 | 100.75 | 2,206,600,200 | 0.100 | 2018/5/15 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債（10年） | 2,037,000,000 | 105.80 | 2,155,146,000 | 106.83 | 2,176,188,210 | 1.200 | 2020/12/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付国債（10年） | 2,050,000,000 | 102.87 | 2,108,978,500 | 102.65 | 2,104,366,000 | 1.500 | 2017/12/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債（10年） | 1,880,000,000 | 105.51 | 1,983,588,000 | 108.27 | 2,035,476,000 | 0.800 | 2023/9/20 | 0.63 |
| 日本 | 国債証券 | 第337回利付国債（10年） | 1,920,000,000 | 101.31 | 1,945,152,000 | 105.11 | 2,018,265,600 | 0.300 | 2024/12/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債（5年） | 1,930,000,000 | 100.74 | 1,944,282,000 | 101.17 | 1,952,638,900 | 0.300 | 2018/6/20 | 0.60 |
| 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債（20年） | 1,520,000,000 | 109.82 | 1,669,264,000 | 125.27 | 1,904,119,200 | 1.400 | 2034/9/20 | 0.59 |

(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 | 81.77 |
| 地方債証券 | 5.65 |
| 特殊債券 | 7.53 |
| 社債券 | 4.38 |
| 合計 | 99.33 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額（円） | 評価金額（円） | 投資比率（%） |
|--------|-------|--------|---------|----|----|---------------|---------------|---------|
| 債券先物取引 | 大阪取引所 | 長期国債先物 | 買建 | 7円 | | 1,069,622,268 | 1,070,440,000 | 0.33 |

(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 | 116,298,128,802 | 56.46 |
| | イギリス | 14,499,429,643 | 7.04 |
| | スイス | 7,835,555,439 | 3.80 |
| | カナダ | 7,626,848,221 | 3.70 |
| | フランス | 6,798,729,778 | 3.30 |
| | ドイツ | 6,760,244,258 | 3.28 |
| | オーストラリア | 4,794,246,231 | 2.33 |
| | アイルランド | 3,310,155,471 | 1.61 |
| | オランダ | 3,256,011,870 | 1.58 |
| | スペイン | 2,283,404,700 | 1.11 |
| | スウェーデン | 2,086,873,313 | 1.01 |
| | 香港 | 1,714,957,798 | 0.83 |
| | デンマーク | 1,558,993,782 | 0.76 |
| | イタリア | 1,365,557,044 | 0.66 |
| | シンガポール | 1,349,536,118 | 0.66 |
| | ベルギー | 1,149,643,848 | 0.56 |
| | ジャージー | 1,006,980,663 | 0.49 |
| | フィンランド | 770,200,163 | 0.37 |
| | キュラソー | 721,806,806 | 0.35 |
| | バミューダ | 712,888,046 | 0.35 |
| | イスラエル | 547,228,200 | 0.27 |
| | ノルウェー | 510,136,444 | 0.25 |
| | ケイマン | 441,999,205 | 0.21 |
| | ルクセンブルク | 202,946,518 | 0.10 |
| | ニュージーランド | 150,795,135 | 0.07 |
| | オーストリア | 135,726,661 | 0.07 |
| | パナマ | 128,944,863 | 0.06 |
| | ポルトガル | 117,361,650 | 0.06 |
| | リベリア | 76,532,944 | 0.04 |
| | 英ヴァージン諸島 | 61,563,757 | 0.03 |
| | パプアニューギニア | 46,652,679 | 0.02 |
| マン島 | 22,592,679 | 0.01 | |
| モーリシャス | 12,458,742 | 0.01 | |
| | 小計 | 188,355,131,471 | 91.44 |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア | 145,304,169 | 0.07 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------------|--------|
| | 香港 | 36,984,792 | 0.02 |
| | シンガポール | 13,384,989 | 0.01 |
| | 小計 | 195,673,950 | 0.09 |
| 投資証券 | アメリカ | 4,156,225,614 | 2.02 |
| | オーストラリア | 529,657,759 | 0.26 |
| | フランス | 313,429,224 | 0.15 |
| | イギリス | 207,184,904 | 0.10 |
| | 香港 | 99,437,403 | 0.05 |
| | シンガポール | 82,736,060 | 0.04 |
| | カナダ | 56,778,545 | 0.03 |
| | 小計 | 5,445,449,509 | 2.64 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 11,993,699,704 | 5.82 |
| 合計(純資産総額) | | 205,989,954,634 | 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 | 7,688,902,126 | 3.73 |
| | 買建 | カナダ | 607,715,875 | 0.30 |
| | 買建 | ドイツ | 1,996,364,743 | 0.97 |
| | 買建 | イギリス | 1,226,080,763 | 0.60 |
| | 買建 | オーストラリア | 469,004,184 | 0.23 |

(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 | | 3,773,664,450 | 1.83 |

(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 | 362,274 | 9,744.90 | 3,530,324,433 | 9,714.70 | 3,519,384,677 | 1.71 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL | エネルギー | 271,491 | 8,271.00 | 2,245,502,971 | 9,515.05 | 2,583,252,774 | 1.25 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 489,628 | 5,183.93 | 2,538,198,931 | 5,201.07 | 2,546,590,187 | 1.24 |
| 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 | 180,474 | 10,399.56 | 1,876,851,558 | 12,280.25 | 2,216,265,893 | 1.08 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM | 小売 | 26,177 | 52,529.30 | 1,375,059,538 | 73,642.39 | 1,927,737,000 | 0.94 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO | 資本財 | 609,227 | 2,952.06 | 1,798,474,838 | 3,143.90 | 1,915,349,070 | 0.93 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | ソフトウェア・サービス | 150,104 | 10,813.86 | 1,623,203,779 | 11,748.20 | 1,763,452,653 | 0.86 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 402,594 | 3,809.41 | 1,533,647,918 | 4,377.79 | 1,762,472,551 | 0.86 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 208,792 | 7,699.86 | 1,607,671,138 | 7,853.98 | 1,639,848,714 | 0.80 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 177,148 | 8,362.51 | 1,481,402,609 | 8,635.17 | 1,529,704,530 | 0.74 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 315,779 | 4,931.20 | 1,557,171,968 | 4,833.68 | 1,526,375,489 | 0.74 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 240,250 | 5,960.40 | 1,431,987,441 | 6,298.09 | 1,513,116,603 | 0.73 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 電気通信サービス | 266,761 | 5,258.60 | 1,402,791,288 | 5,666.22 | 1,511,527,741 | 0.73 |
| 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 | 404,232 | 3,000.65 | 1,212,962,520 | 3,602.87 | 1,456,399,024 | 0.71 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | ソフトウェア・サービス | 20,357 | 70,736.95 | 1,439,992,183 | 70,401.76 | 1,433,168,630 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 19,152 | 72,810.23 | 1,394,461,650 | 71,542.00 | 1,370,172,440 | 0.67 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 123,356 | 8,610.65 | 1,062,175,437 | 10,642.95 | 1,312,872,012 | 0.64 |
| 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 | 149,186 | 7,753.11 | 1,156,655,687 | 8,379.33 | 1,250,079,098 | 0.61 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO | 食品・飲料・タバコ | 269,606 | 4,388.47 | 1,183,158,209 | 4,573.32 | 1,232,994,620 | 0.60 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 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 | 46,055 | 26,457.71 | 1,218,509,918 | 26,708.79 | 1,230,073,508 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 78,030 | 13,131.75 | 1,024,670,454 | 14,625.56 | 1,141,233,165 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 小売 | 83,105 | 12,070.36 | 1,003,107,608 | 13,107.64 | 1,089,310,979 | 0.53 |
| 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 | 180,562 | 5,098.46 | 920,588,314 | 5,871.01 | 1,060,082,301 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A | メディア | 159,014 | 6,120.05 | 973,174,856 | 6,580.06 | 1,046,322,520 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 食品・飲料・タバコ | 101,614 | 9,275.73 | 942,544,030 | 10,148.98 | 1,031,278,880 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 309,835 | 3,008.56 | 932,158,303 | 3,285.91 | 1,018,091,877 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO | メディア | 101,503 | 9,679.40 | 982,488,891 | 9,980.21 | 1,013,021,438 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・飲料・タバコ | 94,412 | 10,039.97 | 947,894,468 | 10,612.07 | 1,001,907,621 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 125,256 | 7,388.93 | 925,508,818 | 7,897.31 | 989,185,887 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 328,136 | 2,383.10 | 781,981,580 | 2,908.23 | 954,297,125 | 0.46 |

(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 | 7.16 |
| | | 素材 | 4.41 |
| | | 資本財 | 6.78 |
| | | 商業・専門サービス | 0.86 |
| | | 運輸 | 1.71 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.37 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.60 |
| | | 消費者サービス | 1.75 |
| | | メディア | 2.65 |
| | | 小売 | 3.76 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 2.09 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 6.40 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 2.27 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 3.76 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.19 |
| | | 銀行 | 7.50 |
| 各種金融 | 3.44 | | |

| | | |
|----------|--------------------|-------|
| | 保険 | 3.75 |
| | 不動産 | 0.67 |
| | ソフトウェア・サービス | 8.23 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 3.30 |
| | 電気通信サービス | 3.22 |
| | 公益事業 | 3.53 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 2.05 |
| | 小計 | 91.44 |
| 投資信託受益証券 | | 0.09 |
| 投資証券 | | 2.64 |
| 合計 | | 94.18 |

(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 EMIN | 買建 | 723 | アメリカドル | 74,331,746 | 7,649,479,981 | 74,714,820 | 7,688,902,126 | 3.73 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 | 買建 | 47 | カナダドル | 7,594,215.5 | 604,271,727 | 7,637,500 | 607,715,875 | 0.30 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | SWISS MKT IX | 買建 | 57 | スイスフラン | 4,363,329 | 458,454,978 | 4,514,400 | 474,328,008 | 0.23 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOXX | 買建 | 472 | ユーロ | 13,079,554 | 1,496,170,182 | 13,305,680 | 1,522,036,735 | 0.74 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTU | 買建 | 48 | オーストラリアドル | 6,159,386 | 472,671,282 | 6,111,600 | 469,004,184 | 0.23 |
| | 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 | 141 | イギリスポンド | 8,361,398.75 | 1,157,301,201 | 8,858,325 | 1,226,080,763 | 0.60 |

(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 | 27,239,000.00 | 2,818,299,167 | 2,802,530,250 | 1.36 |
| | ユーロ | 買建 | 4,319,000.00 | 496,597,978 | 494,050,410 | 0.24 |

| | | | | | |
|------------|----|--------------|-------------|-------------|------|
| イギリスポンド | 買建 | 1,417,000.00 | 202,010,811 | 196,076,800 | 0.10 |
| スイスフラン | 買建 | 1,070,000.00 | 111,754,010 | 112,424,900 | 0.05 |
| スウェーデンクローナ | 買建 | 1,587,000.00 | 19,104,782 | 19,297,920 | 0.01 |
| デンマーククローネ | 買建 | 1,673,000.00 | 25,476,778 | 25,730,740 | 0.01 |
| オーストラリアドル | 買建 | 1,211,000.00 | 91,675,243 | 92,920,030 | 0.05 |
| シンガポールドル | 買建 | 401,000.00 | 30,457,369 | 30,633,400 | 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 | 67,850,896,710 | 41.68 |
| | フランス | 15,711,719,761 | 9.65 |
| | イタリア | 15,252,154,096 | 9.37 |
| | イギリス | 12,414,509,847 | 7.63 |
| | ドイツ | 11,858,890,099 | 7.28 |
| | スペイン | 8,541,702,434 | 5.25 |
| | ベルギー | 4,188,853,604 | 2.57 |
| | オランダ | 3,807,308,967 | 2.34 |
| | カナダ | 3,294,985,321 | 2.02 |
| | オーストラリア | 2,993,615,881 | 1.84 |
| | オーストリア | 2,450,326,925 | 1.51 |
| | メキシコ | 1,438,368,973 | 0.88 |
| | アイルランド | 1,279,838,713 | 0.79 |
| | デンマーク | 1,092,925,738 | 0.67 |
| | フィンランド | 972,503,271 | 0.60 |
| | ポーランド | 920,483,439 | 0.57 |
| | スウェーデン | 793,758,733 | 0.49 |
| | マレーシア | 756,746,203 | 0.46 |
| | 南アフリカ | 718,775,574 | 0.44 |
| | シンガポール | 588,422,280 | 0.36 |
| スイス | 449,296,462 | 0.28 | |
| ノルウェー | 404,918,598 | 0.25 | |
| | 小計 | 157,781,001,629 | 96.92 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 5,007,740,648 | 3.08 |
| 合計(純資産総額) | | 162,788,742,277 | 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 | 953,502,966 | 0.59 |
| | 買建 | ドイツ | 1,444,109,691 | 0.89 |

(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 | | 3,208,816,800 | 1.97 |

(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 2% 08/15/25 | 11,150,000 | 10,436.72 | 1,163,694,525 | 10,741.23 | 1,197,647,284 | 2.000 | 2025/8/15 | 0.74 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.625% 02/15/20 | 9,800,000 | 11,294.37 | 1,106,848,505 | 11,315.47 | 1,108,916,753 | 3.625 | 2020/2/15 | 0.68 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 02/15/24 | 9,000,000 | 11,109.05 | 999,814,872 | 11,344.21 | 1,020,979,758 | 2.750 | 2024/2/15 | 0.63 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 11/15/18 | 9,000,000 | 10,393.91 | 935,451,900 | 10,427.47 | 938,472,872 | 1.250 | 2018/11/15 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 08/15/44 | 7,700,000 | 11,244.12 | 865,797,510 | 12,087.70 | 930,753,211 | 3.125 | 2044/8/15 | 0.57 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 11/15/23 | 7,950,000 | 11,116.89 | 883,792,992 | 11,330.95 | 900,810,828 | 2.750 | 2023/11/15 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 04/30/20 | 8,250,000 | 10,377.22 | 856,121,257 | 10,472.49 | 863,981,208 | 1.375 | 2020/4/30 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.625% 02/15/44 | 6,500,000 | 12,354.42 | 803,037,681 | 13,241.22 | 860,679,344 | 3.625 | 2044/2/15 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.625% 04/30/23 | 8,100,000 | 10,280.70 | 832,737,429 | 10,511.09 | 851,398,349 | 1.625 | 2023/4/30 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 02/15/25 | 7,550,000 | 10,497.26 | 792,543,424 | 10,748.86 | 811,539,618 | 2.000 | 2025/2/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 12/31/20 | 7,200,000 | 10,824.04 | 779,331,002 | 10,909.86 | 785,510,423 | 2.375 | 2020/12/31 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 05/31/22 | 7,250,000 | 10,523.55 | 762,957,557 | 10,688.97 | 774,950,493 | 1.875 | 2022/5/31 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/43 | 6,700,000 | 10,727.33 | 718,731,673 | 11,547.62 | 773,691,051 | 2.875 | 2043/5/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 03/15/19 | 7,250,000 | 10,336.89 | 749,425,095 | 10,369.79 | 751,809,809 | 1.000 | 2019/3/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 03/31/21 | 6,900,000 | 10,784.11 | 744,104,057 | 10,874.69 | 750,353,793 | 2.250 | 2021/3/31 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 08/15/24 | 6,700,000 | 10,794.89 | 723,258,110 | 11,063.22 | 741,236,207 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 05/15/18 | 7,000,000 | 10,313.94 | 721,976,425 | 10,362.15 | 725,350,681 | 1.000 | 2018/5/15 | 0.45 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|--------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | T 0.5% 07/31/17 | 7,010,000 | 10,258.84 | 719,144,727 | 10,287.38 | 721,145,484 | 0.500 | 2017/7/31 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 02/15/23 | 6,500,000 | 10,587.67 | 688,198,568 | 10,766.75 | 699,839,254 | 2.000 | 2023/2/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 02/15/46 | 6,300,000 | 10,036.04 | 632,270,807 | 10,692.38 | 673,620,519 | 2.500 | 2046/2/15 | 0.41 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.5% 04/25/26 | 4,350,000 | 14,659.56 | 637,690,991 | 15,167.54 | 659,788,079 | 3.500 | 2026/4/25 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.375% 11/15/19 | 5,900,000 | 11,161.91 | 658,553,050 | 11,174.57 | 659,300,154 | 3.375 | 2019/11/15 | 0.41 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.5% 04/25/20 | 4,950,000 | 13,239.44 | 655,352,350 | 13,178.35 | 652,328,679 | 3.500 | 2020/4/25 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 05/15/24 | 5,800,000 | 10,906.45 | 632,574,103 | 11,161.11 | 647,344,500 | 2.500 | 2024/5/15 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 07/31/22 | 6,000,000 | 10,590.48 | 635,429,049 | 10,761.12 | 645,667,789 | 2.000 | 2022/7/31 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.125% 12/31/22 | 5,950,000 | 10,668.47 | 634,774,005 | 10,834.69 | 644,664,317 | 2.125 | 2022/12/31 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 11/30/19 | 6,100,000 | 10,252.81 | 625,421,453 | 10,350.69 | 631,392,445 | 1.000 | 2019/11/30 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 10/31/20 | 6,000,000 | 10,355.51 | 621,331,184 | 10,462.44 | 627,746,982 | 1.375 | 2020/10/31 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 12/15/17 | 6,000,000 | 10,340.84 | 620,450,822 | 10,350.69 | 621,041,750 | 1.000 | 2017/12/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 10/15/18 | 6,000,000 | 10,293.41 | 617,604,721 | 10,338.03 | 620,281,984 | 0.875 | 2018/10/15 | 0.38 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.92 |
| 合計 | 96.92 |

(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 | 36 | アメリカドル | 4,366,605.01 | 449,367,322 | 4,395,093.84 | 452,299,107 | 0.28 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 21 | アメリカドル | 2,762,755.9 | 284,315,209 | 2,794,312.5 | 287,562,699 | 0.18 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US LONG BOND | 買建 | 12 | アメリカドル | 2,025,954.25 | 208,490,952 | 2,076,000 | 213,641,160 | 0.13 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-SCHATZ | 買建 | 20 | ユーロ | 2,238,800 | 256,096,332 | 2,241,200 | 256,370,868 | 0.16 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BOBL FU | 買建 | 24 | ユーロ | 3,191,756 | 365,104,969 | 3,205,680 | 366,697,735 | 0.23 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BUND | 買建 | 43 | ユーロ | 7,085,612 | 810,523,156 | 7,177,560 | 821,041,088 | 0.50 |

(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 | 14,380,000.00 | 1,491,126,576 | 1,478,983,000 | 0.91 |
| | カナダドル | 買建 | 1,570,000.00 | 126,968,878 | 124,846,400 | 0.08 |
| | ユーロ | 買建 | 11,600,000.00 | 1,356,168,471 | 1,326,924,000 | 0.82 |
| | イギリスポンド | 買建 | 2,010,000.00 | 298,435,894 | 278,063,400 | 0.17 |

(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 | 85,536,268,900 | 98.56 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,247,803,987 | 1.44 |
| 合計(純資産総額) | | 86,784,072,887 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|----------|------|-------------------|--------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 12,688 | 543,732.06 | 6,898,872,377 | 633,000 | 8,031,504,000 | 9.25 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 12,237 | 535,148.49 | 6,548,612,072 | 634,000 | 7,758,258,000 | 8.94 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 | 18,700 | 246,358.38 | 4,606,901,706 | 262,100 | 4,901,270,000 | 5.65 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 27,021 | 147,197.82 | 3,977,432,294 | 162,700 | 4,396,316,700 | 5.07 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 22,674 | 169,763.31 | 3,849,213,481 | 185,100 | 4,196,957,400 | 4.84 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 16,601 | 231,376.85 | 3,841,087,086 | 251,000 | 4,166,851,000 | 4.80 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 12,574 | 274,947.76 | 3,457,193,245 | 275,300 | 3,461,622,200 | 3.99 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 5,958 | 518,743.64 | 3,090,674,615 | 544,000 | 3,241,152,000 | 3.73 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 32,676 | 78,238.78 | 2,556,530,375 | 86,500 | 2,826,474,000 | 3.26 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 15,834 | 167,477.16 | 2,651,833,351 | 177,300 | 2,807,368,200 | 3.23 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 4,567 | 490,824.97 | 2,241,597,637 | 604,000 | 2,758,468,000 | 3.18 |

| | | | | | | | | |
|----|------|------------------------------|--------|--------------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 5,856 | 399,820.59 | 2,341,349,375 | 441,000 | 2,582,496,000 | 2.98 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 4,819 | 519,361.26 | 2,502,801,921 | 534,000 | 2,573,346,000 | 2.97 |
| 日本 | 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人 | 12,212 | 231,519.27 | 2,827,313,325 | 194,800 | 2,378,897,600 | 2.74 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 13,954 | 142,457.62 | 1,987,853,629 | 161,200 | 2,249,384,800 | 2.59 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 4,740 | 441,631.46 | 2,093,333,135 | 468,000 | 2,218,320,000 | 2.56 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7,875 | 232,284.11 | 1,829,237,366 | 239,700 | 1,887,637,500 | 2.18 |
| 日本 | 投資証券 | G L P 投資法人 | 13,916 | 118,636.94 | 1,650,951,657 | 129,800 | 1,806,296,800 | 2.08 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 | 12,617 | 137,096.67 | 1,729,748,685 | 140,600 | 1,773,950,200 | 2.04 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 6,189 | 256,096.75 | 1,584,982,785 | 279,100 | 1,727,349,900 | 1.99 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 11,771 | 130,981.68 | 1,541,785,422 | 138,700 | 1,632,637,700 | 1.88 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 8,496 | 160,413.83 | 1,362,875,899 | 187,800 | 1,595,548,800 | 1.84 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 2,674 | 517,975.15 | 1,385,065,551 | 573,000 | 1,532,202,000 | 1.77 |
| 日本 | 投資証券 | プレミアム投資法人 | 11,145 | 128,066.97 | 1,427,306,380 | 135,100 | 1,505,689,500 | 1.73 |
| 日本 | 投資証券 | M C U B S M i d C i t y 投資法人 | 3,832 | 322,091.95 | 1,234,256,369 | 353,500 | 1,354,612,000 | 1.56 |
| 日本 | 投資証券 | グローバル・ワン不動産投資法人 | 3,439 | 403,192.57 | 1,386,579,248 | 378,500 | 1,301,661,500 | 1.50 |
| 日本 | 投資証券 | 星野リゾート・リート投資法人 | 994 | 1,253,373.78 | 1,245,853,539 | 1,293,000 | 1,285,242,000 | 1.48 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 2,044 | 608,783.2 | 1,244,352,860 | 609,000 | 1,244,796,000 | 1.43 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス商業リート投資法人 | 4,444 | 259,914 | 1,155,057,856 | 276,700 | 1,229,654,800 | 1.42 |
| 日本 | 投資証券 | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 8,636 | 100,734.91 | 869,946,682 | 94,400 | 815,238,400 | 0.94 |

(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 | 98.56 |
| 合計 | 98.56 |

(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 | 300,191,706 | 70.63 |
| | オーストラリア | 34,234,612 | 8.05 |
| | イギリス | 19,409,954 | 4.57 |
| | フランス | 17,522,351 | 4.12 |
| | シンガポール | 12,637,024 | 2.97 |
| | カナダ | 8,091,822 | 1.90 |
| | 香港 | 7,163,449 | 1.69 |
| | ベルギー | 2,793,059 | 0.66 |
| | ニュージーランド | 2,095,705 | 0.49 |
| | オランダ | 1,890,150 | 0.44 |
| | スペイン | 1,592,520 | 0.37 |
| | アイルランド | 950,377 | 0.22 |
| | ドイツ | 694,012 | 0.16 |
| | イタリア | 331,619 | 0.08 |
| | ガーンジー | 226,577 | 0.05 |
| | マン島 | 223,283 | 0.05 |
| イスラエル | 216,324 | 0.05 | |
| | 小計 | 410,264,544 | 96.53 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 14,769,331 | 3.47 |
| 合計(純資産総額) | | 425,033,875 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 投資比率(%) |
|------|------|---------------------------|-------|-----------|------------|-----------|------------|---------|
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP | 1,137 | 17,968.08 | 20,429,713 | 22,118.44 | 25,148,673 | 5.92 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 541 | 20,609.78 | 11,149,894 | 26,140.16 | 14,141,831 | 3.33 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 1,296 | 6,371.15 | 8,257,021 | 7,771.76 | 10,072,205 | 2.37 |
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 1,916 | 3,756.21 | 7,196,908 | 5,053.91 | 9,683,292 | 2.28 |
| フランス | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO SE | 359 | 26,349.73 | 9,459,556 | 26,601.39 | 9,549,901 | 2.25 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 1,338 | 7,135.77 | 9,547,672 | 6,998.90 | 9,364,540 | 2.20 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 501 | 16,581.88 | 8,307,526 | 18,333.41 | 9,185,042 | 2.16 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 1,227 | 5,438.79 | 6,673,400 | 7,414.66 | 9,097,795 | 2.14 |

| | | | | | | | | |
|---------|------|-----------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|-----------|------|
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES | 561 | 11,378.75 | 6,383,484 | 13,532.66 | 7,591,825 | 1.79 |
| オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 19,456 | 296.98 | 5,778,117 | 370.65 | 7,211,448 | 1.70 |
| アメリカ | 投資証券 | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 2,146 | 2,511.00 | 5,388,615 | 3,073.92 | 6,596,636 | 1.55 |
| アメリカ | 投資証券 | VORNADO REALTY TRUST | 646 | 8,854.37 | 5,719,927 | 10,193.23 | 6,584,830 | 1.55 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 902 | 4,524.95 | 4,081,507 | 7,045.21 | 6,354,787 | 1.50 |
| アメリカ | 投資証券 | HCP INC | 1,707 | 3,707.84 | 6,329,296 | 3,639.92 | 6,213,355 | 1.46 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 528 | 6,348.51 | 3,352,017 | 11,134.86 | 5,879,207 | 1.38 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 8,000 | 565.53 | 4,524,312 | 715.37 | 5,723,016 | 1.35 |
| オーストラリア | 投資証券 | WESTFIELD CORP | 6,936 | 758.19 | 5,258,814 | 817.28 | 5,668,661 | 1.33 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST | 242 | 21,369.26 | 5,171,361 | 23,105.35 | 5,591,495 | 1.32 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 1,520 | 2,290.77 | 3,481,980 | 3,181.97 | 4,836,605 | 1.14 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 2,761 | 1,783.43 | 4,924,051 | 1,651.70 | 4,560,359 | 1.07 |
| アメリカ | 投資証券 | MACERICH CO/THE | 492 | 7,464.06 | 3,672,318 | 8,637.23 | 4,249,520 | 1.00 |
| アメリカ | 投資証券 | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 251 | 12,994.44 | 3,261,606 | 16,875.18 | 4,235,671 | 1.00 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 446 | 7,399.23 | 3,300,057 | 9,401.85 | 4,193,229 | 0.99 |
| イギリス | 投資証券 | LAND SECURITIES GROUP PLC | 2,914 | 1,727.35 | 5,033,517 | 1,414.55 | 4,121,999 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | SL GREEN REALTY CORP | 361 | 10,479.32 | 3,783,037 | 10,601.78 | 3,827,246 | 0.90 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 965 | 3,209.76 | 3,097,421 | 3,747.98 | 3,616,803 | 0.85 |
| アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 1,255 | 1,831.79 | 2,298,907 | 2,698.30 | 3,386,367 | 0.80 |
| アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 825 | 3,010.92 | 2,484,016 | 4,070.09 | 3,357,825 | 0.79 |
| アメリカ | 投資証券 | VEREIT INC | 3,263 | 812.98 | 2,652,783 | 1,028.07 | 3,354,595 | 0.79 |
| イギリス | 投資証券 | BRITISH LAND CO PLC | 3,765 | 1,140.49 | 4,293,977 | 835.99 | 3,147,527 | 0.74 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 96.53 |
| 合計 | 96.53 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2007年8月31日
作成基準日：2016年6月30日

基準価額・純資産の推移



| | |
|-------|--------|
| 基準価額 | 9,539円 |
| 純資産総額 | 5.10億円 |

※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:1,570円 直近1年間分配金合計額:120円

| 決算期 | 2016年2月 | 2016年3月 | 2016年4月 | 2016年5月 | 2016年6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 | 売却投資比率 |
|---------------|-------|--|------|------|--------------------------|------------------|--------------------------|--------|
| リートマザーファンド(M) | 17.4% | 日本ビルファンド投資法人 ジャパニアルエステイト投資法人 | 日本 | 投資証券 | - | - | - | 1.6% |
| 日本債券マザーファンド | 16.8% | 第342回利付国債(10年) 第106回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.100% 0.200% | 2026/03/20 2017/09/20 | 0.2% |
| 海外リートマザーファンド | 16.6% | SIMON PROPERTY GROUP PUBLIC STORAGE | アメリカ | 投資証券 | - | - | - | 1.0% |
| 外国株式マザーファンド | 16.2% | APPLE INC EXXON MOBIL | アメリカ | 株式 | テクノロジー・ソフトウェア機器 エネルギー | - | - | 0.3% |
| 日本株式マザーファンド | 16.2% | トヨタ自動車 日本電信電話 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 情報・通信業 | - | - | 0.5% |
| 外国債券マザーファンド | 15.7% | T 2% 08/15/25 T 3.625% 02/15/20 | アメリカ | 国債 | - | 2.000% 3.625% | 2025/08/15 2020/02/15 | 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。また、2016年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

< 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れている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18特定期間(平成27年12月11日から平成28年6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17特定期間 （平成27年12月10日現在） | 第18特定期間 （平成28年 6月10日現在） |
|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 971,805 |
| コール・ローン | 2,226,166 | 5,937,479 |
| 親投資信託受益証券 | 578,068,489 | 527,903,994 |
| 未収入金 | 1,200,000 | 1,256,664 |
| 未収利息 | 3 | - |
| 流動資産合計 | 581,494,658 | 536,069,942 |
| 資産合計 | 581,494,658 | 536,069,942 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 566,208 | 540,971 |
| 未払解約金 | - | 1,263,373 |
| 未払受託者報酬 | 20,957 | 19,751 |
| 未払委託者報酬 | 471,556 | 444,403 |
| 未払利息 | - | 14 |
| その他未払費用 | 2,611 | 2,766 |
| 流動負債合計 | 1,061,332 | 2,271,278 |
| 負債合計 | 1,061,332 | 2,271,278 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 566,208,671 | 540,971,678 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 14,224,655 | 7,173,014 |
| （分配準備積立金） | 42,519,887 | 42,654,051 |
| 元本等合計 | 580,433,326 | 533,798,664 |
| 純資産合計 | 580,433,326 | 533,798,664 |
| 負債純資産合計 | 581,494,658 | 536,069,942 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日 | 第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 719 | 202 |
| 有価証券売買等損益 | 17,711,412 | 15,148,173 |
| 営業収益合計 | 17,710,693 | 15,147,971 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | - | 743 |
| 受託者報酬 | 135,875 | 118,977 |
| 委託者報酬 | 3,057,129 | 2,676,776 |
| その他費用 | 16,923 | 15,125 |
| 営業費用合計 | 3,209,927 | 2,811,621 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 20,920,620 | 17,959,592 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 20,920,620 | 17,959,592 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 20,920,620 | 17,959,592 |
| 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（ ） | 374,721 | 355,677 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 42,398,779 | 14,224,655 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 2,350 | 236,133 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 236,133 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 2,350 | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,029,310 | 83 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,029,310 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 83 |
| 分配金 | 3,601,265 | 3,318,450 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 14,224,655 | 7,173,014 |

(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17特定期間 (平成27年12月10日現在) | 第18特定期間 (平成28年 6月10日現在) |
|---|---|--|
| 1. 特定期間の末日における受益権の総数 | 566,208,671口 | 540,971,678口 |
| 2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 - 円 | 元本の欠損 7,173,014円 |
| 3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0251円 (1万口当たり純資産額) (10,251円) | 1口当たり純資産額 0.9867円 (1万口当たり純資産額) (9,867円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日 | 第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10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 | 分配金の計算過程 第100期 自 平成27年12月11日 至 平成28年 1月12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>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> </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 | <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>900,402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>9,136,409円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>42,017,512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>52,054,323円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>559,518,923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>930円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 900,402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 | 9,136,409円 | 分配準備積立金額 | D | 42,017,512円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 52,054,323円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 559,518,923口 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 930円 | 1万口当たり分配金額 | H | 10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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 900,402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 | 9,136,409円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 42,017,512円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 52,054,323円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 559,518,923口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 930円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1万口当たり分配金額 | H | 10円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日 | | | 第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日 | | |
|---|-------------------------|--------------|---|-------------------------|--------------|
| 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 641,942円 | 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 559,518円 |
| 第95期 自 平成27年 7月11日 至 平成27年 8月10日 | | | 第101期 自 平成28年 1月13日 至 平成28年 2月10日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 923,603円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 340,795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 | 10,219,534円 | 収益調整金額 | C | 9,137,668円 |
| 分配準備積立金額 | D | 45,163,505円 | 分配準備積立金額 | D | 42,322,335円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 56,306,642円 | 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 51,800,798円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 625,849,909口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 559,140,383口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 899円 | 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 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 | $I=F \times H / 10,000$ | 625,849円 | 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 559,140円 |
| 第96期 自 平成27年 8月11日 至 平成27年 9月10日 | | | 第102期 自 平成28年 2月11日 至 平成28年 3月10日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 737,682円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 1,351,697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 | 9,750,608円 | 収益調整金額 | C | 9,126,071円 |
| 分配準備積立金額 | D | 43,375,268円 | 分配準備積立金額 | D | 42,046,339円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 53,863,558円 | 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 52,524,107円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 597,133,005口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 558,384,681口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 902円 | 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 940円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 10円 | 1万口当たり分配金額 | H | 10円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 597,133円 | 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 558,384円 |
| 第97期 自 平成27年 9月11日 至 平成27年10月13日 | | | 第103期 自 平成28年 3月11日 至 平成28年 4月11日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 1,839,500円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 1,488,237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 | 9,655,089円 | 収益調整金額 | C | 9,102,060円 |
| 分配準備積立金額 | D | 43,089,530円 | 分配準備積立金額 | D | 42,726,942円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 54,584,119円 | 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 53,317,239円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 591,283,368口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 556,915,533口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 923円 | 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 957円 |

| 第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日 | | | 第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日 | | |
|---|-------------------------|--------------|---|-------------------------|--------------|
| 1万口当たり分配金額 | H | 10円 | 1万口当たり分配金額 | H | 10円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 591,283円 | 収益分配金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 556,915円 |
| 第98期 自 平成27年10月14日 至 平成27年11月10日 | | | 第104期 自 平成28年 4月12日 至 平成28年 5月10日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 776,754円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 775,065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 | 9,452,068円 | 収益調整金額 | C | 8,883,173円 |
| 分配準備積立金額 | D | 43,405,442円 | 分配準備積立金額 | D | 42,608,368円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 53,634,264円 | 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 52,266,606円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 578,850,144口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 543,522,495口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 926円 | 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 961円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 10円 | 1万口当たり分配金額 | H | 10円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 578,850円 | 収益分配金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 543,522円 |
| 第99期 自 平成27年11月11日 至 平成27年12月10日 | | | 第105期 自 平成28年 5月11日 至 平成28年 6月10日 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 434,993円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 556,159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 | 9,245,647円 | 収益調整金額 | C | 8,841,485円 |
| 分配準備積立金額 | D | 42,651,102円 | 分配準備積立金額 | D | 42,638,863円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 52,331,742円 | 当ファンドの分配対象収益額 | $E=A+B+C+D$ | 52,036,507円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 566,208,671口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 540,971,678口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 924円 | 1万口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 961円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 10円 | 1万口当たり分配金額 | H | 10円 |
| 収益分配金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 566,208円 | 収益分配金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 540,971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18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日 |
|------------------|---|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立したコンプライアンス・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18特定期間 (平成28年 6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17特定期間 | 第18特定期間 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日 | 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 660,373,314円 | 566,208,671円 |
| 期中追加設定元本額 | 95,536円 | 107,758円 |
| 期中一部解約元本額 | 94,260,179円 | 25,344,751円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第17特定期間 （平成27年12月10日現在） | 第18特定期間 （平成28年 6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 | 3,164,176 | 3,630,740 |
| 合計 | 3,164,176 | 3,630,740 |

（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 | 67,097,056 | 88,970,696 | |
| | 日本債券マザーファンド | 62,301,413 | 86,194,004 | |
| | 外国株式マザーファンド | 45,754,208 | 89,696,549 | |
| | 外国債券マザーファンド | 37,411,173 | 84,474,428 | |
| | Jリートマザーファンド(M) | 35,719,542 | 90,941,953 | |
| | 海外リートマザーファンド | 76,858,490 | 87,626,364 | |
| 合計 | | 325,141,882 | 527,903,994 | |

(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)

当ファンドは親投資信託受益証券を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の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

| | 平成28年 6月10日現在 |
|----------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 342,683,078 |
| コール・ローン | 2,093,704,845 |
| 株式 | 204,411,513,610 |
| 未収配当金 | 1,486,200,503 |
| 前払金 | 35,901,000 |
| 差入委託証拠金 | 143,187,000 |
| 流動資産合計 | 208,513,190,036 |
| 資産合計 | 208,513,190,036 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 35,901,540 |
| 未払金 | 6,631,358 |
| 未払解約金 | 337,085,374 |
| 未払利息 | 5,255 |
| その他未払費用 | 98,931 |
| 流動負債合計 | 379,722,458 |
| 負債合計 | 379,722,458 |
| 純資産の部 | |

| | 平成28年 6月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 元本等 | |
| 元本 | 156,957,655,657 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 51,175,811,921 |
| 元本等合計 | 208,133,467,578 |
| 純資産合計 | 208,133,467,578 |
| 負債純資産合計 | 208,513,190,036 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成28年 6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28年 6月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 156,957,655,657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 1.3260円 (1万口当たり純資産額) (13,260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28年 6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28年 6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28年 6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28年 6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12月11日 |
| 期首元本額 | 147,024,582,880円 |
| 期中追加設定元本額 | 19,066,035,057円 |
| 期中一部解約元本額 | 9,132,962,280円 |
| 期末元本額 | 156,957,655,657円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 日本株式インデックスファンド | 987,582,812円 |
| D C 日本株式インデックスファンド | 343,087,122円 |
| D C 日本株式インデックスファンド L | 51,820,944,842円 |
| D C 日本株式インデックスファンド A | 1,363,078,854円 |
| D C バランスファンド 3 0 | 1,945,961,462円 |
| D C バランスファンド 5 0 | 2,908,253,002円 |
| D C バランスファンド 7 0 | 1,390,602,521円 |
| ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型） | 67,097,056円 |
| ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型） | 38,104,395円 |
| 新生・4分散ファンド | 87,877,896円 |

| 区分 | 平成28年 6月10日現在 |
|---------------------------------|-----------------|
| グローバル・インデックス・バランス・ファンド | 706,179,179円 |
| 日本株式インデックスe | 2,082,010,211円 |
| インデックスコレクション（国内株式） | 10,034,686,086円 |
| インデックスコレクション（バランス株式30） | 3,923,400,231円 |
| インデックスコレクション（バランス株式50） | 1,289,423,327円 |
| インデックスコレクション（バランス株式70） | 1,066,103,355円 |
| 私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 7,601,182,536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） | 2,350,159,011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） | 4,327,166,377円 |
| バランスVA30（適格機関投資家専用） | 627,468,305円 |
| バランスVA50（適格機関投資家専用） | 5,658,908,649円 |
| VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用） | 327,151,997円 |
| VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用） | 1,169,591,264円 |
| VAバランス株式30（適格機関投資家専用） | 160,676,519円 |
| VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用） | 1,542,344,593円 |
| バランスVA25（適格機関投資家専用） | 2,559,262,406円 |
| バランスVA37.5（適格機関投資家専用） | 1,097,439,526円 |
| バランスVA50L（適格機関投資家専用） | 18,064,714,495円 |
| バランスVA75（適格機関投資家専用） | 1,468,081,765円 |
| VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用） | 4,912,136,316円 |
| VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用） | 2,751,090,021円 |
| VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用） | 85,724,052円 |
| バランスVA40（適格機関投資家専用） | 904,597,712円 |
| VAバランス株式40（適格機関投資家専用） | 168,093,447円 |
| バランスファンドVA（適格機関投資家専用） | 4,329,391,319円 |
| VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用） | 136,534,861円 |
| VAバランス50-50（適格機関投資家専用） | 128,591,936円 |
| バランスVA20（適格機関投資家専用） | 65,714,444円 |
| VAファンド25（適格機関投資家専用） | 1,776,778,434円 |
| バランスファンドVA2（適格機関投資家専用） | 1,641,445,427円 |
| バランスVA20L（適格機関投資家専用） | 47,014,368円 |
| バランスVA25L（適格機関投資家専用） | 737,444,863円 |
| バランスファンドVA3（適格機関投資家専用） | 11,599,162,505円 |
| 世界バランスVA25（適格機関投資家専用） | 238,431,349円 |
| 国内バランスVA30（適格機関投資家専用） | 98,047,914円 |
| 国内バランスVA25（適格機関投資家専用） | 17,952,327円 |
| VAバランス20-80（適格機関投資家専用） | 305,468,103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） | 4,816,758円 |
| 世界バランスVA20（適格機関投資家専用） | 679,707円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年 6月10日現在 | |
|----|--------------------|--|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | |
| 株式 | 6,058,206,617 | |
| 合計 | 6,058,206,617 | |

(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28年 6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 | 3,706,151,540 | - | 3,670,250,000 | 35,901,540 |
| 合計 | | 3,706,151,540 | - | 3,670,250,000 | 35,901,540 |

(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 | 49,000 | 268.00 | 13,132,000 | |
| 日本水産 | 133,900 | 638.00 | 85,428,200 | |
| マルハニチロ | 23,700 | 2,894.00 | 68,587,800 | |
| サカタのタネ | 17,100 | 2,475.00 | 42,322,500 | |
| ホクト | 11,800 | 2,027.00 | 23,918,600 | |
| ホクリヨウ | 1,200 | 1,001.00 | 1,201,200 | |
| 住石ホールディングス | 34,100 | 89.00 | 3,034,900 | |
| 日鉄鉱業 | 32,000 | 363.00 | 11,616,000 | |
| 三井松島産業 | 76,000 | 102.00 | 7,752,000 | |
| 国際石油開発帝石 | 612,200 | 884.00 | 541,184,800 | |
| 日本海洋掘削 | 3,500 | 2,447.00 | 8,564,500 | |
| 石油資源開発 | 18,400 | 2,347.00 | 43,184,800 | |
| K&Oエナジーグループ | 7,800 | 1,341.00 | 10,459,800 | |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|--|
| ショーボンドホールディングス | 12,200 | 4,835.00 | 58,987,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 35,700 | 1,060.00 | 37,842,000 | |
| タマホーム | 8,700 | 427.00 | 3,714,900 | |
| サンヨーホームズ | 2,400 | 467.00 | 1,120,800 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 2,700 | 1,131.00 | 3,053,700 | |
| 安藤・間 | 77,600 | 582.00 | 45,163,200 | |
| 東急建設 | 37,900 | 961.00 | 36,421,900 | |
| コムシスホールディングス | 49,900 | 1,806.00 | 90,119,400 | |
| ミサワホーム | 14,500 | 765.00 | 11,092,500 | |
| ピーアールホールディングス | 4,600 | 417.00 | 1,918,200 | |
| 高松コンストラクショングループ | 8,800 | 2,495.00 | 21,956,000 | |
| 東建コーポレーション | 4,800 | 8,240.00 | 39,552,000 | |
| ソネック | 1,300 | 583.00 | 757,900 | |
| ヤマウラ | 5,500 | 533.00 | 2,931,500 | |
| 大成建設 | 604,000 | 824.00 | 497,696,000 | |
| 大林組 | 348,500 | 1,086.00 | 378,471,000 | |
| 清水建設 | 356,000 | 969.00 | 344,964,000 | |
| 飛鳥建設 | 93,300 | 183.00 | 17,073,900 | |
| 長谷工コーポレーション | 135,600 | 1,167.00 | 158,245,200 | |
| 松井建設 | 12,900 | 1,055.00 | 13,609,500 | |
| 銭高組 | 17,000 | 392.00 | 6,664,000 | |
| 鹿島建設 | 545,000 | 710.00 | 386,950,000 | |
| 不動テトラ | 82,400 | 147.00 | 12,112,800 | |
| 大末建設 | 4,400 | 1,055.00 | 4,642,000 | |
| 鉄建建設 | 72,000 | 305.00 | 21,960,000 | |
| 西松建設 | 134,000 | 451.00 | 60,434,000 | |
| 三井住友建設 | 445,300 | 92.00 | 40,967,600 | |
| 大豊建設 | 46,000 | 502.00 | 23,092,000 | |
| 前田建設工業 | 72,000 | 763.00 | 54,936,000 | |
| 佐田建設 | 8,900 | 389.00 | 3,462,100 | |
| ナカノフドー建設 | 9,600 | 475.00 | 4,560,000 | |
| 奥村組 | 110,000 | 556.00 | 61,160,000 | |
| 東鉄工業 | 13,900 | 2,800.00 | 38,920,000 | |
| イチケン | 14,000 | 298.00 | 4,172,000 | |
| 浅沼組 | 37,000 | 227.00 | 8,399,000 | |
| 戸田建設 | 135,000 | 447.00 | 60,345,000 | |
| 熊谷組 | 171,000 | 294.00 | 50,274,000 | |
| 青木あすなろ建設 | 7,700 | 705.00 | 5,428,500 | |
| 北野建設 | 24,000 | 259.00 | 6,216,000 | |
| 植木組 | 16,000 | 210.00 | 3,360,000 | |
| 三井ホーム | 15,000 | 480.00 | 7,200,000 | |
| 矢作建設工業 | 15,800 | 865.00 | 13,667,000 | |

| | | | |
|---------------|---------|-----------|---------------|
| ピーエス三菱 | 13,900 | 388.00 | 5,393,200 |
| 日本ハウスホールディングス | 23,700 | 336.00 | 7,963,200 |
| 大東建託 | 42,800 | 16,070.00 | 687,796,000 |
| 新日本建設 | 14,000 | 659.00 | 9,226,000 |
| N I P P O | 27,000 | 1,907.00 | 51,489,000 |
| 東亜道路工業 | 22,000 | 285.00 | 6,270,000 |
| 前田道路 | 36,000 | 1,859.00 | 66,924,000 |
| 日本道路 | 35,000 | 438.00 | 15,330,000 |
| 東亜建設工業 | 101,000 | 168.00 | 16,968,000 |
| 若築建設 | 67,000 | 150.00 | 10,050,000 |
| 東洋建設 | 36,500 | 472.00 | 17,228,000 |
| 五洋建設 | 128,900 | 550.00 | 70,895,000 |
| 大林道路 | 13,600 | 719.00 | 9,778,400 |
| 世紀東急工業 | 18,200 | 505.00 | 9,191,000 |
| 福田組 | 19,000 | 1,137.00 | 21,603,000 |
| 住友林業 | 80,000 | 1,556.00 | 124,480,000 |
| 日本基礎技術 | 12,900 | 366.00 | 4,721,400 |
| 日成ビルド工業 | 32,000 | 559.00 | 17,888,000 |
| 巴コーポレーション | 14,600 | 351.00 | 5,124,600 |
| パナホーム | 43,000 | 844.00 | 36,292,000 |
| 大和ハウス工業 | 343,300 | 3,179.00 | 1,091,350,700 |
| ライト工業 | 22,300 | 1,085.00 | 24,195,500 |
| 積水ハウス | 388,500 | 1,925.00 | 747,862,500 |
| 日特建設 | 12,700 | 418.00 | 5,308,600 |
| 北陸電気工事 | 5,600 | 804.00 | 4,502,400 |
| ユアテック | 18,000 | 793.00 | 14,274,000 |
| 西部電気工業 | 10,000 | 415.00 | 4,150,000 |
| 四電工 | 9,000 | 414.00 | 3,726,000 |
| 中電工 | 16,800 | 2,022.00 | 33,969,600 |
| 関電工 | 46,000 | 804.00 | 36,984,000 |
| きんでん | 70,200 | 1,207.00 | 84,731,400 |
| 東京エネシス | 13,000 | 1,056.00 | 13,728,000 |
| トーエネック | 16,000 | 571.00 | 9,136,000 |
| 住友電設 | 9,200 | 1,263.00 | 11,619,600 |
| 日本電設工業 | 18,900 | 1,878.00 | 35,494,200 |
| 協和エクシオ | 45,500 | 1,338.00 | 60,879,000 |
| 新日本空調 | 9,800 | 1,051.00 | 10,299,800 |
| N D S | 18,000 | 274.00 | 4,932,000 |
| 九電工 | 21,300 | 3,255.00 | 69,331,500 |
| 三機工業 | 25,800 | 894.00 | 23,065,200 |
| 日揮 | 117,000 | 1,584.00 | 185,328,000 |
| 中外炉工業 | 35,000 | 219.00 | 7,665,000 |

| | | | | |
|--------------|---------|-----------|-------------|--|
| ヤマト | 10,500 | 526.00 | 5,523,000 | |
| 太平電業 | 17,000 | 1,101.00 | 18,717,000 | |
| 高砂熱学工業 | 34,700 | 1,361.00 | 47,226,700 | |
| 三晃金属工業 | 13,000 | 315.00 | 4,095,000 | |
| 朝日工業社 | 13,000 | 500.00 | 6,500,000 | |
| 明星工業 | 21,000 | 462.00 | 9,702,000 | |
| 大気社 | 14,200 | 2,508.00 | 35,613,600 | |
| ダイダン | 16,000 | 798.00 | 12,768,000 | |
| 日比谷総合設備 | 14,000 | 1,595.00 | 22,330,000 | |
| 東芝プラントシステム | 18,900 | 1,613.00 | 30,485,700 | |
| OSJBホールディングス | 23,700 | 205.00 | 4,858,500 | |
| 東洋エンジニアリング | 62,000 | 356.00 | 22,072,000 | |
| 千代田化工建設 | 84,000 | 716.00 | 60,144,000 | |
| 新興プランテック | 23,900 | 833.00 | 19,908,700 | |
| 日本製粉 | 76,000 | 816.00 | 62,016,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 127,400 | 1,757.00 | 223,841,800 | |
| 日東富士製粉 | 9,000 | 347.00 | 3,123,000 | |
| 昭和産業 | 48,000 | 478.00 | 22,944,000 | |
| 鳥越製粉 | 9,300 | 655.00 | 6,091,500 | |
| 中部飼料 | 10,800 | 758.00 | 8,186,400 | |
| フィード・ワン | 70,300 | 121.00 | 8,506,300 | |
| 東洋精糖 | 18,000 | 110.00 | 1,980,000 | |
| 日本甜菜製糖 | 59,000 | 187.00 | 11,033,000 | |
| 三井製糖 | 46,000 | 515.00 | 23,690,000 | |
| 塩水港精糖 | 12,600 | 237.00 | 2,986,200 | |
| 日新製糖 | 5,000 | 1,434.00 | 7,170,000 | |
| 森永製菓 | 105,000 | 659.00 | 69,195,000 | |
| 中村屋 | 27,000 | 469.00 | 12,663,000 | |
| 江崎グリコ | 26,800 | 6,200.00 | 166,160,000 | |
| 名糖産業 | 5,200 | 1,304.00 | 6,780,800 | |
| 不二家 | 67,000 | 199.00 | 13,333,000 | |
| 山崎製パン | 85,000 | 2,780.00 | 236,300,000 | |
| 第一屋製パン | 18,000 | 117.00 | 2,106,000 | |
| モロゾフ | 18,000 | 429.00 | 7,722,000 | |
| 亀田製菓 | 6,500 | 5,460.00 | 35,490,000 | |
| 寿スピリッツ | 8,300 | 3,190.00 | 26,477,000 | |
| カルビー | 43,100 | 4,165.00 | 179,511,500 | |
| 森永乳業 | 104,000 | 706.00 | 73,424,000 | |
| 六甲バター | 5,200 | 2,465.00 | 12,818,000 | |
| ヤクルト本社 | 62,300 | 5,580.00 | 347,634,000 | |
| 明治ホールディングス | 68,800 | 10,570.00 | 727,216,000 | |
| 雪印メグミルク | 27,400 | 3,735.00 | 102,339,000 | |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| プリマハム | 73,000 | 332.00 | 24,236,000 |
| 日本ハム | 85,000 | 2,452.00 | 208,420,000 |
| 丸大食品 | 60,000 | 496.00 | 29,760,000 |
| S Foods | 7,300 | 2,969.00 | 21,673,700 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 69,500 | 1,081.00 | 75,129,500 |
| サッポロホールディングス | 178,000 | 577.00 | 102,706,000 |
| アサヒグループホールディングス | 218,000 | 3,583.00 | 781,094,000 |
| キリンホールディングス | 471,000 | 1,842.50 | 867,817,500 |
| 宝ホールディングス | 84,200 | 971.00 | 81,758,200 |
| オエノンホールディングス | 32,000 | 206.00 | 6,592,000 |
| 養命酒製造 | 3,600 | 1,802.00 | 6,487,200 |
| コカ・コーラウエスト | 39,400 | 3,015.00 | 118,791,000 |
| コカ・コーライーストジャパン | 41,100 | 2,052.00 | 84,337,200 |
| サントリー食品インターナショナル | 79,600 | 5,120.00 | 407,552,000 |
| ダイドードリンコ | 5,900 | 5,690.00 | 33,571,000 |
| 伊藤園 | 34,500 | 3,930.00 | 135,585,000 |
| キーコーヒー | 10,300 | 1,887.00 | 19,436,100 |
| ユニカフェ | 3,200 | 888.00 | 2,841,600 |
| ジャパンフーズ | 1,500 | 1,201.00 | 1,801,500 |
| 日清オイリオグループ | 62,000 | 492.00 | 30,504,000 |
| 不二製油グループ本社 | 31,000 | 1,946.00 | 60,326,000 |
| かどや製油 | 1,200 | 2,798.00 | 3,357,600 |
| J - オイルミルズ | 49,000 | 355.00 | 17,395,000 |
| キッコーマン | 88,000 | 3,895.00 | 342,760,000 |
| 味の素 | 244,400 | 2,494.00 | 609,533,600 |
| キューピー | 59,100 | 3,120.00 | 184,392,000 |
| ハウス食品グループ本社 | 39,700 | 2,331.00 | 92,540,700 |
| カゴメ | 41,700 | 2,843.00 | 118,553,100 |
| 焼津水産化学工業 | 5,500 | 990.00 | 5,445,000 |
| アリアケジャパン | 9,500 | 6,530.00 | 62,035,000 |
| ピエトロ | 1,100 | 1,815.00 | 1,996,500 |
| エバラ食品工業 | 2,800 | 1,914.00 | 5,359,200 |
| ニチレイ | 124,000 | 926.00 | 114,824,000 |
| 東洋水産 | 57,100 | 4,320.00 | 246,672,000 |
| イトアンド | 1,300 | 2,090.00 | 2,717,000 |
| 日清食品ホールディングス | 49,200 | 5,630.00 | 276,996,000 |
| 永谷園ホールディングス | 11,000 | 1,238.00 | 13,618,000 |
| 一正蒲鉾 | 4,100 | 1,093.00 | 4,481,300 |
| フジッコ | 11,300 | 2,943.00 | 33,255,900 |
| ロック・フィールド | 12,100 | 1,667.00 | 20,170,700 |
| 日本たばこ産業 | 687,000 | 4,427.00 | 3,041,349,000 |
| ケンコーマヨネーズ | 3,800 | 2,860.00 | 10,868,000 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| わらべや日洋 | 6,300 | 2,019.00 | 12,719,700 |
| なとり | 5,800 | 1,601.00 | 9,285,800 |
| 北の達人コーポレーション | 2,200 | 493.00 | 1,084,600 |
| ユーグレナ | 39,100 | 1,638.00 | 64,045,800 |
| ミヨシ油脂 | 40,000 | 127.00 | 5,080,000 |
| 理研ビタミン | 3,400 | 4,535.00 | 15,419,000 |
| 片倉工業 | 13,800 | 1,229.00 | 16,960,200 |
| グンゼ | 88,000 | 309.00 | 27,192,000 |
| 東洋紡 | 431,000 | 207.00 | 89,217,000 |
| ユニチカ | 316,000 | 61.00 | 19,276,000 |
| 富士紡ホールディングス | 53,000 | 275.00 | 14,575,000 |
| 倉敷紡績 | 111,000 | 191.00 | 21,201,000 |
| シキボウ | 66,000 | 114.00 | 7,524,000 |
| 日本毛織 | 33,400 | 722.00 | 24,114,800 |
| トーア紡コーポレーション | 4,600 | 468.00 | 2,152,800 |
| ダイドーリミテッド | 12,300 | 458.00 | 5,633,400 |
| 帝国繊維 | 11,400 | 1,365.00 | 15,561,000 |
| 帝人 | 444,000 | 380.00 | 168,720,000 |
| 東レ | 788,000 | 925.30 | 729,136,400 |
| サカイオーベックス | 29,000 | 161.00 | 4,669,000 |
| 住江織物 | 31,000 | 244.00 | 7,564,000 |
| 日本フェルト | 5,900 | 493.00 | 2,908,700 |
| イチカワ | 8,000 | 268.00 | 2,144,000 |
| 芦森工業 | 32,000 | 189.00 | 6,048,000 |
| アツギ | 84,000 | 111.00 | 9,324,000 |
| ダイニック | 21,000 | 161.00 | 3,381,000 |
| セーレン | 27,100 | 1,097.00 | 29,728,700 |
| 東海染工 | 15,000 | 126.00 | 1,890,000 |
| 小松精練 | 17,500 | 603.00 | 10,552,500 |
| ワコールホールディングス | 65,000 | 1,153.00 | 74,945,000 |
| ホギメディカル | 6,800 | 6,900.00 | 46,920,000 |
| レナウン | 29,400 | 111.00 | 3,263,400 |
| クラウディア | 4,900 | 498.00 | 2,440,200 |
| T S Iホールディングス | 48,500 | 605.00 | 29,342,500 |
| 三陽商会 | 64,000 | 233.00 | 14,912,000 |
| オンワードホールディングス | 70,000 | 725.00 | 50,750,000 |
| ルック | 25,000 | 142.00 | 3,550,000 |
| ゴールドウイン | 4,800 | 4,930.00 | 23,664,000 |
| デサント | 24,800 | 1,240.00 | 30,752,000 |
| キング | 5,400 | 359.00 | 1,938,600 |
| ヤマトインターナショナル | 6,700 | 377.00 | 2,525,900 |
| 特種東海製紙 | 63,000 | 366.00 | 23,058,000 |

| | | | | |
|-------------|---------|----------|---------------|--|
| 王子ホールディングス | 446,000 | 427.00 | 190,442,000 | |
| 日本製紙 | 56,200 | 1,859.00 | 104,475,800 | |
| 三菱製紙 | 165,000 | 78.00 | 12,870,000 | |
| 北越紀州製紙 | 67,400 | 710.00 | 47,854,000 | |
| 中越パルプ工業 | 43,000 | 224.00 | 9,632,000 | |
| 巴川製紙所 | 17,000 | 187.00 | 3,179,000 | |
| 大王製紙 | 48,100 | 1,165.00 | 56,036,500 | |
| レンゴー | 96,000 | 664.00 | 63,744,000 | |
| トーモク | 34,000 | 303.00 | 10,302,000 | |
| ザ・パック | 7,700 | 2,715.00 | 20,905,500 | |
| クラレ | 171,400 | 1,391.00 | 238,417,400 | |
| 旭化成 | 678,000 | 694.00 | 470,532,000 | |
| 共和レザー | 7,200 | 846.00 | 6,091,200 | |
| 昭和電工 | 723,000 | 109.00 | 78,807,000 | |
| 住友化学 | 800,000 | 473.00 | 378,400,000 | |
| 日本化成 | 20,000 | 111.00 | 2,220,000 | |
| 住友精化 | 22,000 | 660.00 | 14,520,000 | |
| 日産化学工業 | 65,300 | 3,145.00 | 205,368,500 | |
| ラサ工業 | 41,000 | 101.00 | 4,141,000 | |
| クレハ | 82,000 | 391.00 | 32,062,000 | |
| 多木化学 | 7,000 | 696.00 | 4,872,000 | |
| テイカ | 18,000 | 535.00 | 9,630,000 | |
| 石原産業 | 195,000 | 71.00 | 13,845,000 | |
| 片倉コープアグリ | 13,000 | 203.00 | 2,639,000 | |
| 日東エフシー | 6,400 | 857.00 | 5,484,800 | |
| 日本曹達 | 70,000 | 506.00 | 35,420,000 | |
| 東ソー | 293,000 | 533.00 | 156,169,000 | |
| トクヤマ | 180,000 | 272.00 | 48,960,000 | |
| セントラル硝子 | 118,000 | 520.00 | 61,360,000 | |
| 東亜合成 | 68,000 | 1,046.00 | 71,128,000 | |
| 大阪ソーダ | 47,000 | 433.00 | 20,351,000 | |
| 関東電化工業 | 26,000 | 946.00 | 24,596,000 | |
| デンカ | 225,000 | 453.00 | 101,925,000 | |
| 信越化学工業 | 194,800 | 6,262.00 | 1,219,837,600 | |
| 日本カーバイド工業 | 37,000 | 159.00 | 5,883,000 | |
| 堺化学工業 | 44,000 | 298.00 | 13,112,000 | |
| エア・ウォーター | 90,000 | 1,656.00 | 149,040,000 | |
| 大陽日酸 | 83,700 | 949.00 | 79,431,300 | |
| 日本化学工業 | 40,000 | 219.00 | 8,760,000 | |
| 日本パーカライズニング | 55,500 | 1,132.00 | 62,826,000 | |
| 高圧ガス工業 | 16,000 | 662.00 | 10,592,000 | |
| チタン工業 | 13,000 | 185.00 | 2,405,000 | |

| | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|
| 四国化成工業 | 16,000 | 859.00 | 13,744,000 |
| 戸田工業 | 22,000 | 309.00 | 6,798,000 |
| ステラ ケミファ | 5,500 | 3,070.00 | 16,885,000 |
| 保土谷化学工業 | 33,000 | 274.00 | 9,042,000 |
| 日本触媒 | 15,800 | 6,560.00 | 103,648,000 |
| 大日精化工業 | 42,000 | 448.00 | 18,816,000 |
| カネカ | 147,000 | 802.00 | 117,894,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 187,000 | 589.00 | 110,143,000 |
| 三井化学 | 461,000 | 415.00 | 191,315,000 |
| J S R | 101,900 | 1,545.00 | 157,435,500 |
| 東京応化工業 | 21,800 | 2,675.00 | 58,315,000 |
| 大阪有機化学工業 | 7,800 | 595.00 | 4,641,000 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 727,700 | 531.50 | 386,772,550 |
| 日本合成化学工業 | 25,000 | 611.00 | 15,275,000 |
| ダイセル | 152,800 | 1,223.00 | 186,874,400 |
| 住友ベークライト | 102,000 | 522.00 | 53,244,000 |
| 積水化学工業 | 246,600 | 1,430.00 | 352,638,000 |
| 日本ゼオン | 93,000 | 753.00 | 70,029,000 |
| アイカ工業 | 32,700 | 2,442.00 | 79,853,400 |
| 宇部興産 | 581,000 | 190.00 | 110,390,000 |
| 積水樹脂 | 16,800 | 1,462.00 | 24,561,600 |
| タキロン | 25,000 | 500.00 | 12,500,000 |
| 旭有機材 | 35,000 | 198.00 | 6,930,000 |
| 日立化成 | 53,700 | 2,061.00 | 110,675,700 |
| ニチバン | 11,000 | 837.00 | 9,207,000 |
| リケンテクノス | 23,400 | 442.00 | 10,342,800 |
| 大倉工業 | 26,000 | 304.00 | 7,904,000 |
| 積水化成品工業 | 28,000 | 351.00 | 9,828,000 |
| 群栄化学工業 | 29,000 | 281.00 | 8,149,000 |
| タイガースポリマー | 5,400 | 557.00 | 3,007,800 |
| ミライアル | 4,000 | 777.00 | 3,108,000 |
| ダイキアクシス | 2,100 | 896.00 | 1,881,600 |
| ダイキョーニシカワ | 14,000 | 1,623.00 | 22,722,000 |
| 日本化薬 | 71,000 | 1,090.00 | 77,390,000 |
| カーリットホールディングス | 10,200 | 480.00 | 4,896,000 |
| 日本精化 | 9,000 | 743.00 | 6,687,000 |
| 扶桑化学工業 | 6,900 | 1,528.00 | 10,543,200 |
| A D E K A | 53,400 | 1,393.00 | 74,386,200 |
| 日油 | 82,000 | 912.00 | 74,784,000 |
| ハリマ化成グループ | 9,300 | 535.00 | 4,975,500 |
| 花王 | 292,100 | 6,024.00 | 1,759,610,400 |
| 第一工業製薬 | 24,000 | 347.00 | 8,328,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| ニイタカ | 1,600 | 1,325.00 | 2,120,000 |
| 三洋化成工業 | 34,000 | 894.00 | 30,396,000 |
| 大日本塗料 | 62,000 | 202.00 | 12,524,000 |
| 日本ペイントホールディングス | 83,800 | 3,060.00 | 256,428,000 |
| 関西ペイント | 122,900 | 2,080.00 | 255,632,000 |
| 神東塗料 | 8,000 | 171.00 | 1,368,000 |
| 中国塗料 | 31,000 | 738.00 | 22,878,000 |
| 日本特殊塗料 | 7,600 | 1,204.00 | 9,150,400 |
| 藤倉化成 | 14,700 | 613.00 | 9,011,100 |
| 太陽ホールディングス | 8,000 | 3,620.00 | 28,960,000 |
| D I C | 429,000 | 248.00 | 106,392,000 |
| サカタインクス | 22,200 | 1,371.00 | 30,436,200 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 107,000 | 451.00 | 48,257,000 |
| T & K T O K A | 7,900 | 809.00 | 6,391,100 |
| 富士フィルムホールディングス | 248,600 | 4,338.00 | 1,078,426,800 |
| 資生堂 | 206,100 | 2,819.50 | 581,098,950 |
| ライオン | 125,000 | 1,651.00 | 206,375,000 |
| 高砂香料工業 | 7,200 | 2,790.00 | 20,088,000 |
| マンダム | 10,100 | 5,110.00 | 51,611,000 |
| ミルボン | 6,400 | 4,860.00 | 31,104,000 |
| ファンケル | 25,200 | 1,503.00 | 37,875,600 |
| コーセー | 17,600 | 9,440.00 | 166,144,000 |
| コタ | 3,800 | 1,146.00 | 4,354,800 |
| シーズ・ホールディングス | 13,700 | 2,389.00 | 32,729,300 |
| シーボン | 1,300 | 2,263.00 | 2,941,900 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 11,100 | 9,520.00 | 105,672,000 |
| ノエビアホールディングス | 6,900 | 3,125.00 | 21,562,500 |
| アジュバンコスメジャパン | 2,100 | 900.00 | 1,890,000 |
| エステー | 7,500 | 1,136.00 | 8,520,000 |
| アグロ カネショウ | 4,300 | 1,048.00 | 4,506,400 |
| コニシ | 17,000 | 1,411.00 | 23,987,000 |
| 長谷川香料 | 13,800 | 1,924.00 | 26,551,200 |
| 星光P M C | 6,000 | 1,157.00 | 6,942,000 |
| 小林製薬 | 16,400 | 9,090.00 | 149,076,000 |
| 荒川化学工業 | 9,300 | 961.00 | 8,937,300 |
| メック | 8,500 | 956.00 | 8,126,000 |
| 日本高純度化学 | 3,100 | 2,087.00 | 6,469,700 |
| タカラバイオ | 23,300 | 1,556.00 | 36,254,800 |
| J C U | 3,200 | 3,300.00 | 10,560,000 |
| 新田ゼラチン | 7,200 | 740.00 | 5,328,000 |
| O A T アグリオ | 1,300 | 1,485.00 | 1,930,500 |
| デクセリアルズ | 32,500 | 864.00 | 28,080,000 |

| | | | |
|------------|-----------|----------|---------------|
| アース製薬 | 7,800 | 5,240.00 | 40,872,000 |
| イハラケミカル工業 | 16,700 | 1,258.00 | 21,008,600 |
| 北興化学工業 | 12,000 | 308.00 | 3,696,000 |
| 大成ラミック | 3,000 | 2,831.00 | 8,493,000 |
| クミアイ化学工業 | 22,400 | 754.00 | 16,889,600 |
| 日本農薬 | 24,800 | 483.00 | 11,978,400 |
| アキレス | 89,000 | 135.00 | 12,015,000 |
| 有沢製作所 | 16,100 | 532.00 | 8,565,200 |
| 日東電工 | 83,900 | 7,077.00 | 593,760,300 |
| レック | 3,400 | 1,473.00 | 5,008,200 |
| きもと | 17,900 | 162.00 | 2,899,800 |
| 藤森工業 | 9,300 | 2,224.00 | 20,683,200 |
| 前澤化成工業 | 7,600 | 980.00 | 7,448,000 |
| J S P | 7,100 | 2,069.00 | 14,689,900 |
| エフピコ | 9,600 | 4,910.00 | 47,136,000 |
| 天馬 | 8,400 | 1,674.00 | 14,061,600 |
| 信越ポリマー | 21,300 | 653.00 | 13,908,900 |
| 東リ | 28,000 | 305.00 | 8,540,000 |
| ニフコ | 20,800 | 5,680.00 | 118,144,000 |
| 日本バルカー工業 | 42,000 | 277.00 | 11,634,000 |
| ユニ・チャーム | 219,900 | 2,113.00 | 464,648,700 |
| 協和発酵キリン | 129,900 | 1,955.00 | 253,954,500 |
| 武田薬品工業 | 432,600 | 4,553.00 | 1,969,627,800 |
| アステラス製薬 | 1,216,300 | 1,567.50 | 1,906,550,250 |
| 大日本住友製薬 | 76,900 | 1,717.00 | 132,037,300 |
| 塩野義製薬 | 158,300 | 6,031.00 | 954,707,300 |
| 田辺三菱製薬 | 126,600 | 1,916.00 | 242,565,600 |
| わかもと製薬 | 12,000 | 247.00 | 2,964,000 |
| あすか製薬 | 13,800 | 1,868.00 | 25,778,400 |
| 日本新薬 | 24,900 | 5,910.00 | 147,159,000 |
| バイオフェルミン製薬 | 1,800 | 2,857.00 | 5,142,600 |
| 中外製薬 | 108,100 | 3,815.00 | 412,401,500 |
| 科研製薬 | 18,700 | 6,330.00 | 118,371,000 |
| エーザイ | 133,700 | 6,316.00 | 844,449,200 |
| ロート製薬 | 53,200 | 1,724.00 | 91,716,800 |
| 小野薬品工業 | 246,700 | 4,882.00 | 1,204,389,400 |
| 久光製薬 | 33,700 | 6,230.00 | 209,951,000 |
| 有機合成薬品工業 | 7,000 | 247.00 | 1,729,000 |
| 持田製薬 | 7,400 | 8,810.00 | 65,194,000 |
| 参天製薬 | 200,100 | 1,710.00 | 342,171,000 |
| 扶桑薬品工業 | 37,000 | 287.00 | 10,619,000 |
| 日本ケミファ | 15,000 | 490.00 | 7,350,000 |

| | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|
| ツムラ | 34,200 | 2,848.00 | 97,401,600 |
| 日医工 | 25,400 | 2,354.00 | 59,791,600 |
| キッセイ薬品工業 | 19,200 | 2,300.00 | 44,160,000 |
| 生化学工業 | 20,800 | 1,603.00 | 33,342,400 |
| 栄研化学 | 9,100 | 2,144.00 | 19,510,400 |
| 日水製薬 | 4,400 | 1,184.00 | 5,209,600 |
| 鳥居薬品 | 7,400 | 2,624.00 | 19,417,600 |
| JCRファーマ | 8,400 | 3,285.00 | 27,594,000 |
| 東和薬品 | 5,000 | 6,050.00 | 30,250,000 |
| 富士製薬工業 | 3,500 | 2,254.00 | 7,889,000 |
| 沢井製薬 | 18,400 | 7,850.00 | 144,440,000 |
| ゼリア新薬工業 | 22,200 | 1,510.00 | 33,522,000 |
| 第一三共 | 365,300 | 2,503.50 | 914,528,550 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 29,000 | 2,124.00 | 61,596,000 |
| 大幸薬品 | 5,300 | 1,579.00 | 8,368,700 |
| ダイト | 6,000 | 2,751.00 | 16,506,000 |
| 大塚ホールディングス | 233,500 | 4,768.00 | 1,113,328,000 |
| 大正製薬ホールディングス | 26,100 | 10,650.00 | 277,965,000 |
| ペプチドリーム | 18,100 | 7,150.00 | 129,415,000 |
| 日本コークス工業 | 87,600 | 66.00 | 5,781,600 |
| 昭和シェル石油 | 109,200 | 1,200.00 | 131,040,000 |
| ニチレキ | 13,300 | 652.00 | 8,671,600 |
| 東燃ゼネラル石油 | 164,000 | 1,056.00 | 173,184,000 |
| ユシロ化学工業 | 5,800 | 1,403.00 | 8,137,400 |
| ビーピー・カストロール | 4,400 | 1,280.00 | 5,632,000 |
| 富士石油 | 25,200 | 401.00 | 10,105,200 |
| MORESCO | 3,400 | 1,147.00 | 3,899,800 |
| 出光興産 | 56,700 | 2,436.00 | 138,121,200 |
| JXホールディングス | 1,285,700 | 432.00 | 555,422,400 |
| コスモエネルギーホールディングス | 32,800 | 1,423.00 | 46,674,400 |
| 横浜ゴム | 65,500 | 1,545.00 | 101,197,500 |
| 東洋ゴム工業 | 49,100 | 1,327.00 | 65,155,700 |
| ブリヂストン | 366,600 | 3,633.00 | 1,331,857,800 |
| 住友ゴム工業 | 101,600 | 1,565.00 | 159,004,000 |
| 藤倉ゴム工業 | 9,100 | 424.00 | 3,858,400 |
| オカモト | 34,000 | 1,095.00 | 37,230,000 |
| フコク | 4,000 | 793.00 | 3,172,000 |
| ニッタ | 11,700 | 2,614.00 | 30,583,800 |
| 住友理工 | 23,500 | 880.00 | 20,680,000 |
| 三ツ星ベルト | 26,000 | 854.00 | 22,204,000 |
| バンドー化学 | 40,000 | 522.00 | 20,880,000 |
| 日東紡績 | 72,000 | 330.00 | 23,760,000 |

| | | | |
|--------------------|-----------|----------|---------------|
| 旭硝子 | 573,000 | 608.00 | 348,384,000 |
| 日本板硝子 | 524,000 | 84.00 | 44,016,000 |
| 石塚硝子 | 15,000 | 167.00 | 2,505,000 |
| 日本山村硝子 | 45,000 | 162.00 | 7,290,000 |
| 日本電気硝子 | 224,000 | 491.00 | 109,984,000 |
| オハラ | 4,500 | 546.00 | 2,457,000 |
| 住友大阪セメント | 215,000 | 439.00 | 94,385,000 |
| 太平洋セメント | 678,000 | 266.00 | 180,348,000 |
| デイ・シイ | 11,600 | 364.00 | 4,222,400 |
| 日本ヒューム | 10,700 | 592.00 | 6,334,400 |
| 日本コンクリート工業 | 23,000 | 317.00 | 7,291,000 |
| 三谷セキサン | 5,400 | 1,972.00 | 10,648,800 |
| アジアパイルホールディングス | 13,500 | 371.00 | 5,008,500 |
| 東海カーボン | 95,000 | 285.00 | 27,075,000 |
| 日本カーボン | 53,000 | 216.00 | 11,448,000 |
| 東洋炭素 | 6,000 | 1,406.00 | 8,436,000 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 61,000 | 250.00 | 15,250,000 |
| TOTO | 79,800 | 4,175.00 | 333,165,000 |
| 日本碍子 | 137,000 | 2,342.00 | 320,854,000 |
| 日本特殊陶業 | 93,600 | 1,907.00 | 178,495,200 |
| MARUWA | 4,000 | 3,130.00 | 12,520,000 |
| 品川リフラクトリーズ | 28,000 | 198.00 | 5,544,000 |
| 黒崎播磨 | 26,000 | 257.00 | 6,682,000 |
| ヨータイ | 7,000 | 282.00 | 1,974,000 |
| イソライト工業 | 7,700 | 239.00 | 1,840,300 |
| 東京窯業 | 14,000 | 165.00 | 2,310,000 |
| ニッカトー | 4,400 | 355.00 | 1,562,000 |
| フジインコーポレーテッド | 9,600 | 1,693.00 | 16,252,800 |
| ニチアス | 56,000 | 841.00 | 47,096,000 |
| ニチハ | 14,500 | 1,569.00 | 22,750,500 |
| 新日鐵住金 | 489,700 | 2,055.50 | 1,006,578,350 |
| 神戸製鋼所 | 1,996,000 | 93.00 | 185,628,000 |
| 合同製鐵 | 63,000 | 165.00 | 10,395,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 296,900 | 1,421.00 | 421,894,900 |
| 日新製鋼 | 49,800 | 1,384.00 | 68,923,200 |
| 東京製鐵 | 60,300 | 611.00 | 36,843,300 |
| 共英製鋼 | 11,700 | 1,581.00 | 18,497,700 |
| 大和工業 | 24,000 | 2,610.00 | 62,640,000 |
| 東京鐵鋼 | 23,000 | 352.00 | 8,096,000 |
| 大阪製鐵 | 7,000 | 1,831.00 | 12,817,000 |
| 淀川製鋼所 | 16,300 | 2,612.00 | 42,575,600 |
| 東洋鋼鈹 | 26,400 | 286.00 | 7,550,400 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|
| 丸一鋼管 | 36,400 | 3,755.00 | 136,682,000 |
| モリ工業 | 18,000 | 303.00 | 5,454,000 |
| 大同特殊鋼 | 183,000 | 383.00 | 70,089,000 |
| 日本高周波鋼業 | 47,000 | 72.00 | 3,384,000 |
| 日本冶金工業 | 82,100 | 141.00 | 11,576,100 |
| 山陽特殊製鋼 | 65,000 | 493.00 | 32,045,000 |
| 愛知製鋼 | 65,000 | 480.00 | 31,200,000 |
| 日立金属 | 124,400 | 1,133.00 | 140,945,200 |
| 日本金属 | 28,000 | 99.00 | 2,772,000 |
| 大平洋金属 | 76,000 | 318.00 | 24,168,000 |
| 新日本電工 | 62,900 | 170.00 | 10,693,000 |
| 栗本鐵工所 | 53,000 | 177.00 | 9,381,000 |
| 虹技 | 19,000 | 157.00 | 2,983,000 |
| 日本鑄鉄管 | 14,000 | 143.00 | 2,002,000 |
| 三菱製鋼 | 77,000 | 172.00 | 13,244,000 |
| 日亜鋼業 | 16,700 | 226.00 | 3,774,200 |
| 日本精線 | 8,000 | 452.00 | 3,616,000 |
| シンニッタン | 10,200 | 575.00 | 5,865,000 |
| 新家工業 | 25,000 | 140.00 | 3,500,000 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 17,000 | 320.00 | 5,440,000 |
| 日本軽金属ホールディングス | 245,900 | 229.00 | 56,311,100 |
| 三井金属鉱業 | 277,000 | 190.00 | 52,630,000 |
| 東邦亜鉛 | 57,000 | 350.00 | 19,950,000 |
| 三菱マテリアル | 678,000 | 285.00 | 193,230,000 |
| 住友金属鉱山 | 300,000 | 1,121.00 | 336,300,000 |
| D O W Aホールディングス | 140,000 | 621.00 | 86,940,000 |
| 古河機械金属 | 169,000 | 164.00 | 27,716,000 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 10,800 | 1,345.00 | 14,526,000 |
| 東邦チタニウム | 18,400 | 743.00 | 13,671,200 |
| U A C J | 152,000 | 266.00 | 40,432,000 |
| 古河電気工業 | 341,000 | 262.00 | 89,342,000 |
| 住友電気工業 | 434,600 | 1,535.00 | 667,111,000 |
| フジクラ | 151,000 | 537.00 | 81,087,000 |
| 昭和電線ホールディングス | 129,000 | 57.00 | 7,353,000 |
| 東京特殊電線 | 1,600 | 800.00 | 1,280,000 |
| タツタ電線 | 23,600 | 311.00 | 7,339,600 |
| 沖電線 | 15,000 | 188.00 | 2,820,000 |
| カナレ電気 | 1,900 | 2,007.00 | 3,813,300 |
| 平河ヒューテック | 5,100 | 864.00 | 4,406,400 |
| リョービ | 66,000 | 489.00 | 32,274,000 |
| アーレスティ | 12,600 | 779.00 | 9,815,400 |
| アサヒホールディングス | 16,400 | 1,552.00 | 25,452,800 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| 稲葉製作所 | 5,800 | 1,386.00 | 8,038,800 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 40,000 | 143.00 | 5,720,000 |
| トーカロ | 7,800 | 1,809.00 | 14,110,200 |
| アルファC o | 4,300 | 965.00 | 4,149,500 |
| SUMCO | 86,200 | 759.00 | 65,425,800 |
| 川田テクノロジーズ | 2,300 | 3,930.00 | 9,039,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 77,100 | 2,171.00 | 167,384,100 |
| ホッカンホールディングス | 31,000 | 342.00 | 10,602,000 |
| コロナ | 5,700 | 1,049.00 | 5,979,300 |
| 横河ブリッジホールディングス | 20,900 | 1,036.00 | 21,652,400 |
| 駒井ハルテック | 22,000 | 206.00 | 4,532,000 |
| 高田機工 | 11,000 | 197.00 | 2,167,000 |
| 三和ホールディングス | 108,100 | 920.00 | 99,452,000 |
| 文化シャッター | 30,300 | 900.00 | 27,270,000 |
| 三協立山 | 14,800 | 1,464.00 | 21,667,200 |
| アルインコ | 8,200 | 974.00 | 7,986,800 |
| 東洋シャッター | 3,900 | 544.00 | 2,121,600 |
| LIXILグループ | 151,400 | 1,884.00 | 285,237,600 |
| 日本フィルコン | 8,900 | 429.00 | 3,818,100 |
| ノーリツ | 21,300 | 2,086.00 | 44,431,800 |
| 長府製作所 | 11,600 | 2,700.00 | 31,320,000 |
| リンナイ | 20,200 | 9,210.00 | 186,042,000 |
| ダイニチ工業 | 5,600 | 619.00 | 3,466,400 |
| 日東精工 | 17,000 | 288.00 | 4,896,000 |
| 三洋工業 | 16,000 | 173.00 | 2,768,000 |
| 岡部 | 22,900 | 802.00 | 18,365,800 |
| ジーテクト | 11,600 | 1,300.00 | 15,080,000 |
| 東プレ | 20,900 | 2,312.00 | 48,320,800 |
| 高周波熱錬 | 20,600 | 782.00 | 16,109,200 |
| 東京製綱 | 73,000 | 156.00 | 11,388,000 |
| サンコール | 6,500 | 465.00 | 3,022,500 |
| モリテック スチール | 6,800 | 255.00 | 1,734,000 |
| パイオラックス | 5,500 | 5,600.00 | 30,800,000 |
| 日本発條 | 102,200 | 896.00 | 91,571,200 |
| 中央発條 | 15,000 | 286.00 | 4,290,000 |
| アドバネクス | 2,800 | 1,274.00 | 3,567,200 |
| 立川ブラインド工業 | 4,600 | 729.00 | 3,353,400 |
| 三益半導体工業 | 8,100 | 1,016.00 | 8,229,600 |
| 日本ドライケミカル | 1,400 | 2,133.00 | 2,986,200 |
| 日本製鋼所 | 180,000 | 490.00 | 88,200,000 |
| 三浦工業 | 48,400 | 2,422.00 | 117,224,800 |
| タクマ | 40,000 | 893.00 | 35,720,000 |

| | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|
| ツガミ | 31,000 | 422.00 | 13,082,000 |
| オークマ | 71,000 | 751.00 | 53,321,000 |
| 東芝機械 | 59,000 | 343.00 | 20,237,000 |
| アマダホールディングス | 158,300 | 1,146.00 | 181,411,800 |
| アイダエンジニアリング | 28,500 | 1,010.00 | 28,785,000 |
| 滝澤鉄工所 | 34,000 | 127.00 | 4,318,000 |
| 富士機械製造 | 35,400 | 990.00 | 35,046,000 |
| 牧野フライス製作所 | 54,000 | 629.00 | 33,966,000 |
| オーエスジー | 49,500 | 1,863.00 | 92,218,500 |
| ダイジェット工業 | 17,000 | 131.00 | 2,227,000 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 29,300 | 865.00 | 25,344,500 |
| D M G 森精機 | 60,300 | 1,282.00 | 77,304,600 |
| ソディック | 27,500 | 898.00 | 24,695,000 |
| ディスコ | 13,800 | 10,640.00 | 146,832,000 |
| 日東工器 | 6,300 | 2,440.00 | 15,372,000 |
| パンチ工業 | 4,300 | 866.00 | 3,723,800 |
| 豊和工業 | 6,500 | 540.00 | 3,510,000 |
| O K K | 48,000 | 103.00 | 4,944,000 |
| 東洋機械金属 | 8,000 | 391.00 | 3,128,000 |
| 島精機製作所 | 15,300 | 2,079.00 | 31,808,700 |
| N C ホールディングス | 3,500 | 1,108.00 | 3,878,000 |
| フリー | 2,100 | 2,665.00 | 5,596,500 |
| ヤマシンフィルタ | 2,100 | 462.00 | 970,200 |
| 日阪製作所 | 13,700 | 870.00 | 11,919,000 |
| やまびこ | 19,900 | 827.00 | 16,457,300 |
| ペガサスミシン製造 | 11,200 | 498.00 | 5,577,600 |
| ナプテスコ | 56,400 | 2,698.00 | 152,167,200 |
| 三井海洋開発 | 12,700 | 1,736.00 | 22,047,200 |
| レオン自動機 | 9,100 | 618.00 | 5,623,800 |
| S M C | 32,500 | 26,885.00 | 873,762,500 |
| 新川 | 9,700 | 505.00 | 4,898,500 |
| ホソカワミクロン | 18,000 | 564.00 | 10,152,000 |
| ユニオンツール | 4,700 | 2,869.00 | 13,484,300 |
| オイレス工業 | 14,000 | 1,828.00 | 25,592,000 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 3,900 | 1,926.00 | 7,511,400 |
| サトーホールディングス | 14,600 | 2,213.00 | 32,309,800 |
| 日本エアーテック | 3,800 | 662.00 | 2,515,600 |
| 日精樹脂工業 | 8,200 | 703.00 | 5,764,600 |
| オカダアイヨン | 2,100 | 782.00 | 1,642,200 |
| ワイエイシイ | 4,400 | 1,040.00 | 4,576,000 |
| 小松製作所 | 532,100 | 1,907.50 | 1,014,980,750 |
| 住友重機械工業 | 317,000 | 509.00 | 161,353,000 |

| | | | |
|--------------|---------|----------|---------------|
| 日立建機 | 48,500 | 1,617.00 | 78,424,500 |
| 日工 | 16,000 | 305.00 | 4,880,000 |
| 巴工業 | 4,400 | 1,497.00 | 6,586,800 |
| 井関農機 | 113,000 | 268.00 | 30,284,000 |
| TOWA | 10,500 | 934.00 | 9,807,000 |
| 丸山製作所 | 24,000 | 172.00 | 4,128,000 |
| 北川鉄工所 | 51,000 | 178.00 | 9,078,000 |
| タカキタ | 3,600 | 517.00 | 1,861,200 |
| クボタ | 521,200 | 1,473.50 | 767,988,200 |
| 荏原実業 | 3,300 | 1,275.00 | 4,207,500 |
| 三菱化工機 | 38,000 | 202.00 | 7,676,000 |
| 月島機械 | 20,600 | 994.00 | 20,476,400 |
| 帝国電機製作所 | 7,900 | 829.00 | 6,549,100 |
| 新東工業 | 24,700 | 827.00 | 20,426,900 |
| 澁谷工業 | 9,100 | 1,875.00 | 17,062,500 |
| アイチ コーポレーション | 15,400 | 809.00 | 12,458,600 |
| 小森コーポレーション | 26,400 | 1,204.00 | 31,785,600 |
| 鶴見製作所 | 8,100 | 1,372.00 | 11,113,200 |
| 住友精密工業 | 17,000 | 337.00 | 5,729,000 |
| 酒井重工業 | 22,000 | 177.00 | 3,894,000 |
| 荏原製作所 | 240,000 | 551.00 | 132,240,000 |
| 石井鐵工所 | 20,000 | 156.00 | 3,120,000 |
| 西島製作所 | 11,600 | 1,100.00 | 12,760,000 |
| 北越工業 | 11,700 | 600.00 | 7,020,000 |
| ダイキン工業 | 151,000 | 8,963.00 | 1,353,413,000 |
| オルガノ | 19,000 | 412.00 | 7,828,000 |
| トーヨーカネツ | 58,000 | 190.00 | 11,020,000 |
| 栗田工業 | 65,300 | 2,477.00 | 161,748,100 |
| 椿本チエイン | 62,000 | 751.00 | 46,562,000 |
| 大同工業 | 25,000 | 204.00 | 5,100,000 |
| 木村化工機 | 10,800 | 316.00 | 3,412,800 |
| アネスト岩田 | 17,500 | 969.00 | 16,957,500 |
| ダイフク | 55,800 | 2,011.00 | 112,213,800 |
| サムコ | 2,600 | 907.00 | 2,358,200 |
| 加藤製作所 | 26,000 | 426.00 | 11,076,000 |
| 油研工業 | 23,000 | 176.00 | 4,048,000 |
| タダノ | 50,100 | 973.00 | 48,747,300 |
| フジテック | 30,200 | 988.00 | 29,837,600 |
| C K D | 28,800 | 906.00 | 26,092,800 |
| キトー | 13,100 | 853.00 | 11,174,300 |
| 平和 | 32,100 | 2,154.00 | 69,143,400 |
| 理想科学工業 | 11,400 | 1,632.00 | 18,604,800 |

| | | | |
|---------------|-----------|-----------|-------------|
| SANKYO | 28,900 | 4,105.00 | 118,634,500 |
| 日本金銭機械 | 9,600 | 887.00 | 8,515,200 |
| マースエンジニアリング | 5,900 | 2,115.00 | 12,478,500 |
| 福島工業 | 6,400 | 2,887.00 | 18,476,800 |
| オーイズミ | 4,300 | 444.00 | 1,909,200 |
| ダイコク電機 | 4,300 | 1,423.00 | 6,118,900 |
| 竹内製作所 | 20,500 | 1,725.00 | 35,362,500 |
| アマノ | 32,100 | 1,866.00 | 59,898,600 |
| JUKI | 15,400 | 1,081.00 | 16,647,400 |
| サンデンホールディングス | 63,000 | 338.00 | 21,294,000 |
| 蛇の目ミシン工業 | 10,100 | 632.00 | 6,383,200 |
| マックス | 16,000 | 1,249.00 | 19,984,000 |
| グローリー | 35,400 | 3,060.00 | 108,324,000 |
| 新晃工業 | 7,200 | 1,331.00 | 9,583,200 |
| 大和冷機工業 | 16,700 | 895.00 | 14,946,500 |
| セガサミーホールディングス | 111,500 | 1,340.00 | 149,410,000 |
| 日本ピストンリング | 4,300 | 1,500.00 | 6,450,000 |
| リケン | 48,000 | 354.00 | 16,992,000 |
| T P R | 12,800 | 2,600.00 | 33,280,000 |
| ツバキ・ナカシマ | 12,800 | 1,488.00 | 19,046,400 |
| ホンザキ電機 | 22,700 | 10,450.00 | 237,215,000 |
| 大豊工業 | 8,400 | 1,199.00 | 10,071,600 |
| 日本精工 | 213,000 | 871.00 | 185,523,000 |
| NTN | 257,000 | 324.00 | 83,268,000 |
| ジェイテクト | 110,500 | 1,309.00 | 144,644,500 |
| 不二越 | 96,000 | 347.00 | 33,312,000 |
| 日本トムソン | 35,500 | 411.00 | 14,590,500 |
| THK | 69,000 | 2,033.00 | 140,277,000 |
| ユーシン精機 | 4,000 | 1,839.00 | 7,356,000 |
| 前澤給装工業 | 4,200 | 1,398.00 | 5,871,600 |
| イーグル工業 | 12,800 | 1,440.00 | 18,432,000 |
| 前澤工業 | 7,600 | 266.00 | 2,021,600 |
| 日本ピラー工業 | 10,500 | 937.00 | 9,838,500 |
| キッツ | 46,200 | 543.00 | 25,086,600 |
| 日立工機 | 27,700 | 683.00 | 18,919,100 |
| マキタ | 67,600 | 6,890.00 | 465,764,000 |
| 日立造船 | 82,600 | 527.00 | 43,530,200 |
| 三菱重工業 | 1,847,000 | 423.80 | 782,758,600 |
| I H I | 799,000 | 287.00 | 229,313,000 |
| 日清紡ホールディングス | 57,600 | 1,051.00 | 60,537,600 |
| イビデン | 63,500 | 1,295.00 | 82,232,500 |
| コニカミノルタ | 259,000 | 873.00 | 226,107,000 |

| | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|
| ブラザー工業 | 134,100 | 1,206.00 | 161,724,600 |
| ミネベア | 167,000 | 813.00 | 135,771,000 |
| 日立製作所 | 2,646,000 | 485.50 | 1,284,633,000 |
| 東芝 | 2,183,000 | 292.50 | 638,527,500 |
| 三菱電機 | 1,106,000 | 1,294.00 | 1,431,164,000 |
| 富士電機 | 312,000 | 435.00 | 135,720,000 |
| 東洋電機製造 | 20,000 | 318.00 | 6,360,000 |
| 安川電機 | 128,800 | 1,379.00 | 177,615,200 |
| シンフォニアテクノロジー | 67,000 | 184.00 | 12,328,000 |
| 明電舎 | 95,000 | 389.00 | 36,955,000 |
| オリジン電気 | 15,000 | 273.00 | 4,095,000 |
| 山洋電気 | 27,000 | 536.00 | 14,472,000 |
| デンヨー | 9,600 | 1,136.00 | 10,905,600 |
| 東芝テック | 74,000 | 393.00 | 29,082,000 |
| 芝浦メカトロニクス | 17,000 | 222.00 | 3,774,000 |
| マブチモーター | 29,700 | 4,965.00 | 147,460,500 |
| 日本電産 | 124,800 | 8,148.00 | 1,016,870,400 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 1,200 | 2,313.00 | 2,775,600 |
| 東光高岳 | 5,800 | 1,762.00 | 10,219,600 |
| ダブル・スコープ | 4,100 | 6,630.00 | 27,183,000 |
| ダイヘン | 61,000 | 519.00 | 31,659,000 |
| 田淵電機 | 11,800 | 402.00 | 4,743,600 |
| ヤーマン | 1,300 | 2,084.00 | 2,709,200 |
| JVCケンウッド | 76,300 | 247.00 | 18,846,100 |
| ミマキエンジニアリング | 9,400 | 562.00 | 5,282,800 |
| 第一精工 | 4,300 | 1,070.00 | 4,601,000 |
| 日新電機 | 24,300 | 1,385.00 | 33,655,500 |
| 大崎電気工業 | 19,000 | 798.00 | 15,162,000 |
| オムロン | 117,100 | 3,475.00 | 406,922,500 |
| 日東工業 | 16,600 | 1,494.00 | 24,800,400 |
| I D E C | 13,500 | 950.00 | 12,825,000 |
| 不二電機工業 | 1,000 | 1,413.00 | 1,413,000 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 200,000 | 443.00 | 88,600,000 |
| サクサホールディングス | 26,000 | 217.00 | 5,642,000 |
| メルコホールディングス | 5,800 | 2,216.00 | 12,852,800 |
| テクノメディカ | 2,300 | 1,888.00 | 4,342,400 |
| 日本電気 | 1,426,000 | 258.00 | 367,908,000 |
| 富士通 | 1,000,000 | 427.40 | 427,400,000 |
| 沖電気工業 | 449,000 | 152.00 | 68,248,000 |
| 岩崎通信機 | 49,000 | 67.00 | 3,283,000 |
| 電気興業 | 27,000 | 497.00 | 13,419,000 |
| サンケン電気 | 57,000 | 356.00 | 20,292,000 |

| | | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| ナカヨ | 10,000 | 319.00 | 3,190,000 | |
| アイホン | 5,900 | 1,735.00 | 10,236,500 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 53,800 | 648.00 | 34,862,400 | |
| セイコーエプソン | 154,400 | 1,884.00 | 290,889,600 | |
| ワコム | 81,800 | 418.00 | 34,192,400 | |
| アルバック | 19,100 | 3,505.00 | 66,945,500 | |
| アクセル | 4,700 | 806.00 | 3,788,200 | |
| E I Z O | 10,200 | 2,944.00 | 30,028,800 | |
| ジャパンディスプレイ | 193,900 | 209.00 | 40,525,100 | |
| 日本信号 | 28,600 | 963.00 | 27,541,800 | |
| 京三製作所 | 24,000 | 349.00 | 8,376,000 | |
| 能美防災 | 11,800 | 1,387.00 | 16,366,600 | |
| ホーチキ | 7,600 | 1,298.00 | 9,864,800 | |
| エレコム | 9,000 | 2,059.00 | 18,531,000 | |
| 日本無線 | 30,000 | 285.00 | 8,550,000 | |
| パナソニック | 1,184,900 | 950.00 | 1,125,655,000 | |
| シャープ | 877,000 | 137.00 | 120,149,000 | |
| アンリツ | 62,300 | 622.00 | 38,750,600 | |
| 富士通ゼネラル | 32,000 | 2,135.00 | 68,320,000 | |
| 日立国際電気 | 23,700 | 1,587.00 | 37,611,900 | |
| ソニー | 731,800 | 3,051.00 | 2,232,721,800 | |
| T D K | 62,600 | 6,340.00 | 396,884,000 | |
| 帝国通信工業 | 25,000 | 148.00 | 3,700,000 | |
| ミツミ電機 | 39,500 | 482.00 | 19,039,000 | |
| タムラ製作所 | 40,000 | 314.00 | 12,560,000 | |
| アルプス電気 | 89,400 | 2,308.00 | 206,335,200 | |
| 池上通信機 | 33,000 | 127.00 | 4,191,000 | |
| パイオニア | 167,800 | 210.00 | 35,238,000 | |
| 日本電波工業 | 9,400 | 814.00 | 7,651,600 | |
| 鈴木 | 4,100 | 579.00 | 2,373,900 | |
| 日本トリム | 2,800 | 7,140.00 | 19,992,000 | |
| ローランド ディー . ジー . | 5,100 | 2,254.00 | 11,495,400 | |
| フォスター電機 | 13,000 | 1,898.00 | 24,674,000 | |
| クラリオン | 55,000 | 290.00 | 15,950,000 | |
| S M K | 31,000 | 399.00 | 12,369,000 | |
| ヨコオ | 7,500 | 482.00 | 3,615,000 | |
| ホシデン | 31,500 | 673.00 | 21,199,500 | |
| ヒロセ電機 | 16,800 | 13,660.00 | 229,488,000 | |
| 日本航空電子工業 | 30,000 | 1,580.00 | 47,400,000 | |
| T O A | 12,200 | 1,023.00 | 12,480,600 | |
| 日立マクセル | 17,200 | 1,562.00 | 26,866,400 | |
| 古野電気 | 12,400 | 583.00 | 7,229,200 | |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|--|
| ユニデンホールディングス | 33,000 | 124.00 | 4,092,000 | |
| アルパイン | 24,700 | 1,099.00 | 27,145,300 | |
| スミダコーポレーション | 8,600 | 768.00 | 6,604,800 | |
| アイコム | 5,700 | 2,117.00 | 12,066,900 | |
| リオン | 4,000 | 1,509.00 | 6,036,000 | |
| 本多通信工業 | 2,800 | 877.00 | 2,455,600 | |
| 船井電機 | 10,500 | 916.00 | 9,618,000 | |
| 横河電機 | 103,800 | 1,195.00 | 124,041,000 | |
| 新電元工業 | 37,000 | 390.00 | 14,430,000 | |
| アズビル | 33,900 | 2,956.00 | 100,208,400 | |
| 東亜ディーケーケー | 5,900 | 481.00 | 2,837,900 | |
| 日本光電工業 | 43,400 | 2,983.00 | 129,462,200 | |
| チノー | 3,700 | 1,003.00 | 3,711,100 | |
| 共和電業 | 12,600 | 349.00 | 4,397,400 | |
| 日本電子材料 | 4,100 | 444.00 | 1,820,400 | |
| 堀場製作所 | 19,200 | 5,110.00 | 98,112,000 | |
| アドバンテスト | 70,700 | 1,194.00 | 84,415,800 | |
| 小野測器 | 5,100 | 864.00 | 4,406,400 | |
| エスベック | 10,800 | 1,341.00 | 14,482,800 | |
| パナソニック デバイスSUNX | 9,200 | 663.00 | 6,099,600 | |
| キーエンス | 23,500 | 68,560.00 | 1,611,160,000 | |
| 日置電機 | 5,400 | 2,535.00 | 13,689,000 | |
| シスメックス | 80,500 | 7,810.00 | 628,705,000 | |
| 日本マイクロニクス | 19,400 | 1,002.00 | 19,438,800 | |
| メガチップス | 10,400 | 1,253.00 | 13,031,200 | |
| O B A R A G R O U P | 6,700 | 4,035.00 | 27,034,500 | |
| 澤藤電機 | 6,000 | 172.00 | 1,032,000 | |
| コーセル | 14,400 | 1,234.00 | 17,769,600 | |
| 新日本無線 | 7,600 | 399.00 | 3,032,400 | |
| オブテックス | 7,700 | 3,245.00 | 24,986,500 | |
| 千代田インテグレ | 5,500 | 2,006.00 | 11,033,000 | |
| アイ・オー・データ機器 | 3,300 | 629.00 | 2,075,700 | |
| レーザーテック | 12,200 | 1,405.00 | 17,141,000 | |
| スタンレー電気 | 74,200 | 2,466.00 | 182,977,200 | |
| 岩崎電気 | 36,000 | 151.00 | 5,436,000 | |
| ウシオ電機 | 63,000 | 1,295.00 | 81,585,000 | |
| 岡谷電機産業 | 5,700 | 363.00 | 2,069,100 | |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 8,900 | 363.00 | 3,230,700 | |
| 日本セラミック | 6,000 | 1,974.00 | 11,844,000 | |
| 遠藤照明 | 5,300 | 964.00 | 5,109,200 | |
| 日本デジタル研究所 | 8,700 | 1,358.00 | 11,814,600 | |
| 古河電池 | 7,000 | 643.00 | 4,501,000 | |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| 双信電機 | 5,200 | 275.00 | 1,430,000 |
| 山一電機 | 9,100 | 680.00 | 6,188,000 |
| 図研 | 7,500 | 1,035.00 | 7,762,500 |
| 日本電子 | 41,000 | 522.00 | 21,402,000 |
| カシオ計算機 | 104,000 | 1,700.00 | 176,800,000 |
| ファナック | 106,100 | 16,730.00 | 1,775,053,000 |
| 日本シイエムケイ | 22,500 | 440.00 | 9,900,000 |
| エンプラス | 5,300 | 3,000.00 | 15,900,000 |
| 大真空 | 19,000 | 283.00 | 5,377,000 |
| ローム | 51,100 | 4,650.00 | 237,615,000 |
| 浜松ホトニクス | 80,900 | 2,917.00 | 235,985,300 |
| 三井ハイテック | 15,100 | 740.00 | 11,174,000 |
| 新光電気工業 | 39,300 | 609.00 | 23,933,700 |
| 京セラ | 170,200 | 5,301.00 | 902,230,200 |
| 太陽誘電 | 50,500 | 1,123.00 | 56,711,500 |
| 村田製作所 | 109,300 | 12,595.00 | 1,376,633,500 |
| ユーシン | 13,800 | 665.00 | 9,177,000 |
| 双葉電子工業 | 17,000 | 2,013.00 | 34,221,000 |
| 北陸電気工業 | 42,000 | 124.00 | 5,208,000 |
| ニチコン | 32,700 | 718.00 | 23,478,600 |
| 日本ケミコン | 84,000 | 144.00 | 12,096,000 |
| K O A | 14,400 | 795.00 | 11,448,000 |
| 市光工業 | 25,000 | 296.00 | 7,400,000 |
| 小糸製作所 | 62,100 | 5,130.00 | 318,573,000 |
| ミツバ | 17,600 | 1,582.00 | 27,843,200 |
| スター精密 | 19,700 | 1,236.00 | 24,349,200 |
| S C R E E Nホールディングス | 106,000 | 1,114.00 | 118,084,000 |
| キャノン電子 | 9,500 | 1,563.00 | 14,848,500 |
| キャノン | 558,300 | 3,104.00 | 1,732,963,200 |
| リコー | 335,800 | 905.00 | 303,899,000 |
| M U T O Hホールディングス | 13,000 | 241.00 | 3,133,000 |
| 東京エレクトロン | 85,100 | 8,159.00 | 694,330,900 |
| トヨタ紡織 | 36,400 | 2,287.00 | 83,246,800 |
| 鬼怒川ゴム工業 | 24,000 | 774.00 | 18,576,000 |
| ユニプレス | 21,600 | 1,938.00 | 41,860,800 |
| 豊田自動織機 | 94,500 | 4,490.00 | 424,305,000 |
| モリタホールディングス | 18,200 | 1,430.00 | 26,026,000 |
| 三櫻工業 | 13,600 | 569.00 | 7,738,400 |
| デンソー | 256,300 | 3,909.00 | 1,001,876,700 |
| 東海理化電機製作所 | 30,400 | 1,752.00 | 53,260,800 |
| 三井造船 | 401,000 | 151.00 | 60,551,000 |
| 川崎重工業 | 807,000 | 319.00 | 257,433,000 |

| | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|
| 名村造船所 | 31,500 | 654.00 | 20,601,000 |
| サノヤスホールディングス | 13,900 | 176.00 | 2,446,400 |
| 日本車輛製造 | 43,000 | 279.00 | 11,997,000 |
| ニチユ三菱フォークリフト | 11,900 | 539.00 | 6,414,100 |
| 近畿車輛 | 16,000 | 290.00 | 4,640,000 |
| 日産自動車 | 1,447,400 | 1,053.00 | 1,524,112,200 |
| いすゞ自動車 | 300,500 | 1,301.50 | 391,100,750 |
| トヨタ自動車 | 1,289,900 | 5,627.00 | 7,258,267,300 |
| 日野自動車 | 148,000 | 1,073.00 | 158,804,000 |
| 三菱自動車工業 | 409,700 | 550.00 | 225,335,000 |
| エフテック | 5,700 | 1,056.00 | 6,019,200 |
| レシップホールディングス | 3,500 | 774.00 | 2,709,000 |
| G M B | 2,000 | 989.00 | 1,978,000 |
| ファルテック | 1,900 | 1,253.00 | 2,380,700 |
| 武蔵精密工業 | 11,100 | 2,302.00 | 25,552,200 |
| 日産車体 | 50,600 | 1,123.00 | 56,823,800 |
| 新明和工業 | 45,000 | 745.00 | 33,525,000 |
| 極東開発工業 | 20,600 | 1,046.00 | 21,547,600 |
| 日信工業 | 23,200 | 1,457.00 | 33,802,400 |
| トピー工業 | 87,000 | 218.00 | 18,966,000 |
| ティラド | 41,000 | 192.00 | 7,872,000 |
| 曙ブレーキ工業 | 52,600 | 235.00 | 12,361,000 |
| タチエス | 16,500 | 1,640.00 | 27,060,000 |
| N O K | 50,300 | 1,853.00 | 93,205,900 |
| フタバ産業 | 32,500 | 541.00 | 17,582,500 |
| K Y B | 117,000 | 371.00 | 43,407,000 |
| 大同メタル工業 | 14,700 | 1,014.00 | 14,905,800 |
| プレス工業 | 55,500 | 379.00 | 21,034,500 |
| ミクニ | 14,000 | 300.00 | 4,200,000 |
| カルソニックカンセイ | 79,000 | 868.00 | 68,572,000 |
| 太平洋工業 | 23,200 | 1,044.00 | 24,220,800 |
| ケーヒン | 23,900 | 1,794.00 | 42,876,600 |
| 河西工業 | 12,900 | 1,109.00 | 14,306,100 |
| アイシン精機 | 106,300 | 4,385.00 | 466,125,500 |
| 富士機工 | 12,100 | 390.00 | 4,719,000 |
| マツダ | 328,400 | 1,759.50 | 577,819,800 |
| ダイハツ工業 | 123,800 | 1,460.00 | 180,748,000 |
| 今仙電機製作所 | 9,500 | 901.00 | 8,559,500 |
| 本田技研工業 | 933,300 | 2,890.50 | 2,697,703,650 |
| スズキ | 189,700 | 2,795.50 | 530,306,350 |
| 富士重工業 | 327,700 | 3,909.00 | 1,280,979,300 |
| 安永 | 3,800 | 462.00 | 1,755,600 |

| | | | | |
|-------------------|---------|-----------|-------------|--|
| ヤマハ発動機 | 146,500 | 1,711.00 | 250,661,500 | |
| ショーワ | 27,000 | 742.00 | 20,034,000 | |
| T B K | 13,100 | 359.00 | 4,702,900 | |
| エクセディ | 14,200 | 2,458.00 | 34,903,600 | |
| 豊田合成 | 37,700 | 1,985.00 | 74,834,500 | |
| 愛三工業 | 18,400 | 826.00 | 15,198,400 | |
| 盟和産業 | 2,000 | 995.00 | 1,990,000 | |
| ヨロズ | 9,700 | 1,652.00 | 16,024,400 | |
| エフ・シー・シー | 17,000 | 1,938.00 | 32,946,000 | |
| シマノ | 41,800 | 15,650.00 | 654,170,000 | |
| テイ・エス テック | 24,100 | 2,826.00 | 68,106,600 | |
| ジャムコ | 6,100 | 2,103.00 | 12,828,300 | |
| テルモ | 159,000 | 4,685.00 | 744,915,000 | |
| クリエートメディック | 3,500 | 853.00 | 2,985,500 | |
| 日機装 | 37,400 | 749.00 | 28,012,600 | |
| 島津製作所 | 134,000 | 1,641.00 | 219,894,000 | |
| J M S | 19,000 | 281.00 | 5,339,000 | |
| 長野計器 | 6,300 | 600.00 | 3,780,000 | |
| ブイ・テクノロジー | 2,500 | 10,300.00 | 25,750,000 | |
| 東京計器 | 33,000 | 165.00 | 5,445,000 | |
| 愛知時計電機 | 14,000 | 295.00 | 4,130,000 | |
| オーバル | 10,300 | 231.00 | 2,379,300 | |
| 東京精密 | 20,000 | 2,612.00 | 52,240,000 | |
| マニー | 13,800 | 1,895.00 | 26,151,000 | |
| ニコン | 193,700 | 1,499.00 | 290,356,300 | |
| トプコン | 34,800 | 1,180.00 | 41,064,000 | |
| オリンパス | 154,500 | 4,350.00 | 672,075,000 | |
| 理研計器 | 8,400 | 1,085.00 | 9,114,000 | |
| タムロン | 8,400 | 1,619.00 | 13,599,600 | |
| H O Y A | 234,500 | 3,796.00 | 890,162,000 | |
| ノーリツ鋼機 | 9,400 | 789.00 | 7,416,600 | |
| エー・アンド・デイ | 9,500 | 410.00 | 3,895,000 | |
| シチズンホールディングス | 127,700 | 570.00 | 72,789,000 | |
| リズム時計工業 | 46,000 | 171.00 | 7,866,000 | |
| 大研医器 | 8,200 | 833.00 | 6,830,600 | |
| メニコン | 7,000 | 3,060.00 | 21,420,000 | |
| 松風 | 5,100 | 1,366.00 | 6,966,600 | |
| セイコーホールディングス | 67,000 | 363.00 | 24,321,000 | |
| ニプロ | 77,300 | 1,243.00 | 96,083,900 | |
| スノーピーク | 1,100 | 3,915.00 | 4,306,500 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 10,900 | 4,950.00 | 53,955,000 | |
| トランザクション | 2,100 | 910.00 | 1,911,000 | |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|
| SHO - B I | 3,500 | 400.00 | 1,400,000 |
| ニホンフラッシュ | 4,000 | 1,183.00 | 4,732,000 |
| 前田工織 | 11,400 | 1,027.00 | 11,707,800 |
| 永大産業 | 15,000 | 421.00 | 6,315,000 |
| アートネイチャー | 11,100 | 878.00 | 9,745,800 |
| ダンロップスポーツ | 6,500 | 1,062.00 | 6,903,000 |
| バンダイナムコホールディングス | 107,200 | 2,715.00 | 291,048,000 |
| アイフィスジャパン | 2,300 | 421.00 | 968,300 |
| 共立印刷 | 17,200 | 291.00 | 5,005,200 |
| SHOEI | 5,000 | 1,682.00 | 8,410,000 |
| フランスベッドホールディングス | 14,500 | 976.00 | 14,152,000 |
| パイロットコーポレーション | 18,100 | 5,100.00 | 92,310,000 |
| 萩原工業 | 2,900 | 2,745.00 | 7,960,500 |
| トッパン・フォームズ | 18,500 | 1,186.00 | 21,941,000 |
| フジシールインターナショナル | 12,600 | 4,115.00 | 51,849,000 |
| タカラトミー | 34,100 | 901.00 | 30,724,100 |
| 廣済堂 | 9,600 | 328.00 | 3,148,800 |
| As-me エステール | 2,800 | 619.00 | 1,733,200 |
| アーク | 43,600 | 78.00 | 3,400,800 |
| タカノ | 4,600 | 640.00 | 2,944,000 |
| プロネクサス | 9,700 | 987.00 | 9,573,900 |
| ホクシン | 8,200 | 127.00 | 1,041,400 |
| ウッドワン | 19,000 | 243.00 | 4,617,000 |
| 大建工業 | 41,000 | 303.00 | 12,423,000 |
| 凸版印刷 | 293,000 | 969.00 | 283,917,000 |
| 大日本印刷 | 307,000 | 1,101.00 | 338,007,000 |
| 図書印刷 | 19,000 | 498.00 | 9,462,000 |
| 共同印刷 | 35,000 | 331.00 | 11,585,000 |
| 日本写真印刷 | 17,400 | 2,253.00 | 39,202,200 |
| 光村印刷 | 10,000 | 200.00 | 2,000,000 |
| 宝印刷 | 5,000 | 1,379.00 | 6,895,000 |
| アシックス | 96,600 | 2,261.00 | 218,412,600 |
| ツツミ | 5,200 | 2,059.00 | 10,706,800 |
| 小松ウオール工業 | 3,500 | 1,659.00 | 5,806,500 |
| ヤマハ | 76,200 | 3,115.00 | 237,363,000 |
| 河合楽器製作所 | 3,900 | 1,912.00 | 7,456,800 |
| クリナップ | 12,200 | 771.00 | 9,406,200 |
| ピジョン | 58,800 | 3,450.00 | 202,860,000 |
| 兼松日産農林 | 11,000 | 145.00 | 1,595,000 |
| キングジム | 8,600 | 852.00 | 7,327,200 |
| リンテック | 24,700 | 2,101.00 | 51,894,700 |
| T A S A K I | 1,900 | 1,562.00 | 2,967,800 |

| | | | |
|--------------|-----------|-----------|---------------|
| イトーキ | 21,800 | 618.00 | 13,472,400 |
| 任天堂 | 63,900 | 16,065.00 | 1,026,553,500 |
| 三菱鉛筆 | 7,800 | 5,600.00 | 43,680,000 |
| タカスタンダード | 43,000 | 989.00 | 42,527,000 |
| コクヨ | 53,900 | 1,485.00 | 80,041,500 |
| ナカバヤシ | 21,000 | 276.00 | 5,796,000 |
| グロープライド | 5,000 | 1,552.00 | 7,760,000 |
| 岡村製作所 | 36,200 | 1,090.00 | 39,458,000 |
| 美津濃 | 56,000 | 507.00 | 28,392,000 |
| アデランス | 18,000 | 528.00 | 9,504,000 |
| 東京電力ホールディングス | 879,700 | 467.00 | 410,819,900 |
| 中部電力 | 317,300 | 1,568.00 | 497,526,400 |
| 関西電力 | 423,200 | 1,051.50 | 444,994,800 |
| 中国電力 | 143,400 | 1,407.00 | 201,763,800 |
| 北陸電力 | 101,600 | 1,373.00 | 139,496,800 |
| 東北電力 | 259,100 | 1,415.00 | 366,626,500 |
| 四国電力 | 93,400 | 1,242.00 | 116,002,800 |
| 九州電力 | 229,000 | 1,117.00 | 255,793,000 |
| 北海道電力 | 97,100 | 948.00 | 92,050,800 |
| 沖縄電力 | 16,500 | 2,186.00 | 36,069,000 |
| 電源開発 | 88,400 | 2,724.00 | 240,801,600 |
| ファーストエスコ | 4,200 | 698.00 | 2,931,600 |
| イーレックス | 3,100 | 2,215.00 | 6,866,500 |
| 東京瓦斯 | 1,158,000 | 445.60 | 516,004,800 |
| 大阪瓦斯 | 1,073,000 | 411.90 | 441,968,700 |
| 東邦瓦斯 | 261,000 | 826.00 | 215,586,000 |
| 北海道瓦斯 | 25,000 | 279.00 | 6,975,000 |
| 広島ガス | 18,100 | 341.00 | 6,172,100 |
| 西部瓦斯 | 117,000 | 256.00 | 29,952,000 |
| 静岡ガス | 29,400 | 758.00 | 22,285,200 |
| メタウォーター | 6,700 | 2,685.00 | 17,989,500 |
| SBSホールディングス | 10,200 | 815.00 | 8,313,000 |
| 東武鉄道 | 554,000 | 564.00 | 312,456,000 |
| 相鉄ホールディングス | 178,000 | 616.00 | 109,648,000 |
| 東京急行電鉄 | 604,000 | 947.00 | 571,988,000 |
| 京浜急行電鉄 | 284,000 | 1,043.00 | 296,212,000 |
| 小田急電鉄 | 332,000 | 1,195.00 | 396,740,000 |
| 京王電鉄 | 290,000 | 941.00 | 272,890,000 |
| 京成電鉄 | 155,000 | 1,428.00 | 221,340,000 |
| 富士急行 | 28,000 | 1,380.00 | 38,640,000 |
| 新京成電鉄 | 13,000 | 405.00 | 5,265,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 189,600 | 9,670.00 | 1,833,432,000 |

| | | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|--|
| 西日本旅客鉄道 | 99,800 | 6,937.00 | 692,312,600 | |
| 東海旅客鉄道 | 92,900 | 19,275.00 | 1,790,647,500 | |
| 西武ホールディングス | 110,200 | 1,837.00 | 202,437,400 | |
| 鴻池運輸 | 14,700 | 1,167.00 | 17,154,900 | |
| 西日本鉄道 | 134,000 | 555.00 | 74,370,000 | |
| ハマキョウレックス | 8,000 | 1,975.00 | 15,800,000 | |
| サカイ引越センター | 4,100 | 3,055.00 | 12,525,500 | |
| 近鉄グループホールディングス | 1,044,000 | 435.00 | 454,140,000 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 696,000 | 767.00 | 533,832,000 | |
| 南海電気鉄道 | 233,000 | 598.00 | 139,334,000 | |
| 京阪ホールディングス | 232,000 | 721.00 | 167,272,000 | |
| 神戸電鉄 | 25,000 | 362.00 | 9,050,000 | |
| 名古屋鉄道 | 378,000 | 559.00 | 211,302,000 | |
| 山陽電気鉄道 | 38,000 | 494.00 | 18,772,000 | |
| 日本通運 | 401,000 | 453.00 | 181,653,000 | |
| ヤマトホールディングス | 185,400 | 2,301.00 | 426,605,400 | |
| 山九 | 137,000 | 595.00 | 81,515,000 | |
| 丸運 | 5,600 | 238.00 | 1,332,800 | |
| 丸全昭和運輸 | 35,000 | 383.00 | 13,405,000 | |
| センコー | 46,600 | 632.00 | 29,451,200 | |
| トナミホールディングス | 21,000 | 275.00 | 5,775,000 | |
| ニッコンホールディングス | 33,800 | 2,143.00 | 72,433,400 | |
| 日本石油輸送 | 12,000 | 227.00 | 2,724,000 | |
| 福山通運 | 63,000 | 544.00 | 34,272,000 | |
| セイノーホールディングス | 73,600 | 970.00 | 71,392,000 | |
| 神奈川中央交通 | 12,000 | 609.00 | 7,308,000 | |
| 日立物流 | 21,600 | 1,733.00 | 37,432,800 | |
| 丸和運輸機関 | 3,100 | 3,235.00 | 10,028,500 | |
| C & F ロジホールディングス | 9,900 | 967.00 | 9,573,300 | |
| 日本郵船 | 931,000 | 198.00 | 184,338,000 | |
| 商船三井 | 505,000 | 234.00 | 118,170,000 | |
| 川崎汽船 | 454,000 | 233.00 | 105,782,000 | |
| N S ユナイテッド海運 | 52,000 | 141.00 | 7,332,000 | |
| 飯野海運 | 55,200 | 382.00 | 21,086,400 | |
| 共栄タンカー | 18,000 | 186.00 | 3,348,000 | |
| 乾汽船 | 8,600 | 872.00 | 7,499,200 | |
| 日本航空 | 198,600 | 3,564.00 | 707,810,400 | |
| A N A ホールディングス | 1,925,000 | 305.00 | 587,125,000 | |
| パスコ | 10,000 | 351.00 | 3,510,000 | |
| トランコム | 3,000 | 6,850.00 | 20,550,000 | |
| 日新 | 42,000 | 327.00 | 13,734,000 | |
| 三菱倉庫 | 74,000 | 1,441.00 | 106,634,000 | |

| | | | |
|------------------------|---------|----------|-------------|
| 三井倉庫ホールディングス | 60,000 | 286.00 | 17,160,000 |
| 住友倉庫 | 76,000 | 533.00 | 40,508,000 |
| 澁澤倉庫 | 27,000 | 276.00 | 7,452,000 |
| 東陽倉庫 | 18,000 | 227.00 | 4,086,000 |
| 日本トランスシティ | 24,000 | 337.00 | 8,088,000 |
| ケイヒン | 19,000 | 136.00 | 2,584,000 |
| 中央倉庫 | 6,000 | 880.00 | 5,280,000 |
| 安田倉庫 | 8,100 | 689.00 | 5,580,900 |
| 東洋埠頭 | 30,000 | 146.00 | 4,380,000 |
| 宇徳 | 8,400 | 314.00 | 2,637,600 |
| 上組 | 124,000 | 987.00 | 122,388,000 |
| サンリツ | 2,500 | 492.00 | 1,230,000 |
| キムラユニティー | 2,600 | 1,078.00 | 2,802,800 |
| キューソー流通システム | 2,900 | 2,566.00 | 7,441,400 |
| 郵船ロジスティクス | 9,500 | 1,160.00 | 11,020,000 |
| 近鉄エクスプレス | 18,500 | 1,431.00 | 26,473,500 |
| 東海運 | 5,600 | 260.00 | 1,456,000 |
| エーアイティー | 6,400 | 897.00 | 5,740,800 |
| 内外トランスライン | 3,400 | 989.00 | 3,362,600 |
| NEC ネットエスアイ | 12,800 | 1,944.00 | 24,883,200 |
| システナ | 10,000 | 1,567.00 | 15,670,000 |
| デジタルアーツ | 5,000 | 2,976.00 | 14,880,000 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 17,100 | 1,796.00 | 30,711,600 |
| キューブシステム | 4,500 | 706.00 | 3,177,000 |
| コア | 4,300 | 1,173.00 | 5,043,900 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 4,900 | 965.00 | 4,728,500 |
| ITホールディングス | 33,900 | 2,604.00 | 88,275,600 |
| ネオス | 3,100 | 695.00 | 2,154,500 |
| 電算システム | 3,600 | 1,511.00 | 5,439,600 |
| グリー | 62,100 | 629.00 | 39,060,900 |
| コーエーテクモホールディングス | 24,300 | 1,992.00 | 48,405,600 |
| 三菱総合研究所 | 4,000 | 3,235.00 | 12,940,000 |
| ボルテージ | 2,000 | 1,275.00 | 2,550,000 |
| 電算 | 1,100 | 1,975.00 | 2,172,500 |
| AGS | 2,300 | 1,000.00 | 2,300,000 |
| ファインデックス | 6,700 | 1,558.00 | 10,438,600 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 2,300 | 2,125.00 | 4,887,500 |
| ブレインパッド | 1,600 | 1,276.00 | 2,041,600 |
| K L a b | 15,800 | 709.00 | 11,202,200 |
| ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 6,800 | 1,070.00 | 7,276,000 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2,300 | 779.00 | 1,791,700 |
| ネクソン | 98,100 | 1,683.00 | 165,102,300 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| アイスタイル | 15,600 | 863.00 | 13,462,800 |
| エムアップ | 2,700 | 652.00 | 1,760,400 |
| エイチーム | 5,600 | 1,768.00 | 9,900,800 |
| テクノスジャパン | 3,000 | 2,622.00 | 7,866,000 |
| コロプラ | 28,500 | 2,509.00 | 71,506,500 |
| モバイルクリエイト | 6,800 | 402.00 | 2,733,600 |
| ブロードリーフ | 10,500 | 1,049.00 | 11,014,500 |
| ハーツユナイテッドグループ | 3,100 | 3,735.00 | 11,578,500 |
| メディアドゥ | 2,200 | 1,791.00 | 3,940,200 |
| ブイキューブ | 6,700 | 1,306.00 | 8,750,200 |
| サイバーリンクス | 1,600 | 1,132.00 | 1,811,200 |
| ディー・エル・イー | 2,900 | 1,036.00 | 3,004,400 |
| VOYAGE GROUP | 3,500 | 1,323.00 | 4,630,500 |
| オブティム | 900 | 5,140.00 | 4,626,000 |
| ベリサーブ | 1,200 | 4,095.00 | 4,914,000 |
| ティーガイア | 10,200 | 1,468.00 | 14,973,600 |
| 日本アジアグループ | 11,600 | 437.00 | 5,069,200 |
| 豆蔵ホールディングス | 8,100 | 971.00 | 7,865,100 |
| テクマトリックス | 4,400 | 2,352.00 | 10,348,800 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 238,600 | 304.00 | 72,534,400 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 8,900 | 6,220.00 | 55,358,000 |
| ザッパラス | 5,800 | 409.00 | 2,372,200 |
| インターネットイニシアティブ | 16,600 | 2,203.00 | 36,569,800 |
| さくらインターネット | 6,700 | 1,141.00 | 7,644,700 |
| GMOクラウド | 2,300 | 1,259.00 | 2,895,700 |
| SRAホールディングス | 5,900 | 2,173.00 | 12,820,700 |
| Minor iソリューションズ | 2,000 | 870.00 | 1,740,000 |
| 朝日ネット | 9,300 | 479.00 | 4,454,700 |
| コムチュア | 1,700 | 3,605.00 | 6,128,500 |
| サイバーコム | 1,200 | 1,002.00 | 1,202,400 |
| gumi | 10,600 | 1,054.00 | 11,172,400 |
| パイブドHD | 1,300 | 1,221.00 | 1,587,300 |
| フェイス | 2,700 | 1,200.00 | 3,240,000 |
| ハイマックス | 1,400 | 1,173.00 | 1,642,200 |
| 野村総合研究所 | 71,700 | 3,965.00 | 284,290,500 |
| サイバネットシステム | 8,400 | 850.00 | 7,140,000 |
| CEホールディングス | 1,600 | 1,026.00 | 1,641,600 |
| インテージホールディングス | 5,400 | 1,755.00 | 9,477,000 |
| 東邦システムサイエンス | 3,100 | 614.00 | 1,903,400 |
| ソースネクスト | 5,200 | 483.00 | 2,511,600 |
| ティー・ワイ・オー | 20,300 | 168.00 | 3,410,400 |
| フォーカスシステムズ | 4,000 | 446.00 | 1,784,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| クレスコ | 2,300 | 2,114.00 | 4,862,200 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 106,600 | 1,215.00 | 129,519,000 |
| オービック | 35,300 | 5,760.00 | 203,328,000 |
| ジャストシステム | 18,600 | 904.00 | 16,814,400 |
| TDCソフトウェアエンジニアリング | 4,500 | 676.00 | 3,042,000 |
| ヤフー | 733,700 | 513.00 | 376,388,100 |
| トレンドマイクロ | 49,700 | 3,670.00 | 182,399,000 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 2,000 | 1,048.00 | 2,096,000 |
| 日本オラクル | 16,400 | 5,910.00 | 96,924,000 |
| アルファシステムズ | 3,400 | 1,712.00 | 5,820,800 |
| フューチャー | 12,300 | 817.00 | 10,049,100 |
| CAC Holdings | 7,700 | 847.00 | 6,521,900 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 2,800 | 2,193.00 | 6,140,400 |
| トーセ | 2,800 | 685.00 | 1,918,000 |
| オービックビジネスコンサルタント | 5,200 | 4,965.00 | 25,818,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 23,200 | 2,391.00 | 55,471,200 |
| アイティフォー | 13,300 | 546.00 | 7,261,800 |
| 東計電算 | 1,800 | 1,836.00 | 3,304,800 |
| エクスネット | 1,000 | 1,523.00 | 1,523,000 |
| 大塚商会 | 27,500 | 4,900.00 | 134,750,000 |
| サイボウズ | 13,700 | 397.00 | 5,438,900 |
| ソフトブレーン | 15,100 | 200.00 | 3,020,000 |
| 電通国際情報サービス | 6,300 | 1,734.00 | 10,924,200 |
| EMシステムズ | 3,500 | 1,248.00 | 4,368,000 |
| ウェザーニューズ | 3,400 | 3,620.00 | 12,308,000 |
| C I J | 9,300 | 508.00 | 4,724,400 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1,000 | 1,400.00 | 1,400,000 |
| 日本エンタープライズ | 10,600 | 390.00 | 4,134,000 |
| WOWOW | 4,900 | 2,417.00 | 11,843,300 |
| フュージョンパートナー | 6,400 | 573.00 | 3,667,200 |
| 日本コロムビア | 3,500 | 473.00 | 1,655,500 |
| イマジカ・ロボットホールディングス | 8,700 | 484.00 | 4,210,800 |
| ネットワンシステムズ | 44,400 | 623.00 | 27,661,200 |
| アルゴグラフィックス | 4,700 | 1,750.00 | 8,225,000 |
| マーベラス | 17,300 | 920.00 | 15,916,000 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 18,900 | 1,291.00 | 24,399,900 |
| 日本ユニシス | 28,300 | 1,267.00 | 35,856,100 |
| 兼松エレクトロニクス | 6,500 | 1,913.00 | 12,434,500 |
| 東京放送ホールディングス | 61,300 | 1,462.00 | 89,620,600 |
| 日本テレビホールディングス | 93,500 | 1,776.00 | 166,056,000 |
| 朝日放送 | 10,100 | 633.00 | 6,393,300 |
| テレビ朝日ホールディングス | 28,000 | 1,652.00 | 46,256,000 |

| | | | |
|----------------------|-----------|----------|---------------|
| スカパーJ S A Tホールディングス | 77,700 | 518.00 | 40,248,600 |
| テレビ東京ホールディングス | 9,300 | 2,123.00 | 19,743,900 |
| 日本BS放送 | 2,300 | 1,007.00 | 2,316,100 |
| U-NEXT | 3,200 | 851.00 | 2,723,200 |
| ワイヤレスゲート | 3,000 | 2,006.00 | 6,018,000 |
| コネクシオ | 9,000 | 1,339.00 | 12,051,000 |
| 日本通信 | 72,600 | 247.00 | 17,932,200 |
| クロップス | 1,900 | 516.00 | 980,400 |
| 日本電信電話 | 791,200 | 4,719.00 | 3,733,672,800 |
| KDDI | 1,039,800 | 3,120.00 | 3,244,176,000 |
| 光通信 | 12,300 | 8,860.00 | 108,978,000 |
| NTTドコモ | 764,800 | 2,785.00 | 2,129,968,000 |
| エムティーアイ | 15,600 | 725.00 | 11,310,000 |
| GMOインターネット | 37,800 | 1,246.00 | 47,098,800 |
| カドカワ | 32,000 | 1,318.00 | 42,176,000 |
| 学研ホールディングス | 34,000 | 260.00 | 8,840,000 |
| ゼンリン | 13,500 | 2,335.00 | 31,522,500 |
| 昭文社 | 5,600 | 598.00 | 3,348,800 |
| インプレスホールディングス | 8,400 | 151.00 | 1,268,400 |
| アイネット | 5,700 | 1,104.00 | 6,292,800 |
| 松竹 | 67,000 | 1,078.00 | 72,226,000 |
| 東宝 | 73,000 | 2,874.00 | 209,802,000 |
| 東映 | 38,000 | 985.00 | 37,430,000 |
| AOI Pro. | 5,200 | 918.00 | 4,773,600 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 63,200 | 5,270.00 | 333,064,000 |
| ピー・シー・エー | 1,300 | 1,265.00 | 1,644,500 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 1,600 | 922.00 | 1,475,200 |
| DTS | 11,400 | 2,158.00 | 24,601,200 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 43,300 | 3,450.00 | 149,385,000 |
| シーイーシー | 6,700 | 1,576.00 | 10,559,200 |
| カブコン | 26,200 | 2,656.00 | 69,587,200 |
| アイ・エス・ビー | 1,700 | 940.00 | 1,598,000 |
| ジャステック | 6,500 | 964.00 | 6,266,000 |
| SCSK | 24,300 | 3,670.00 | 89,181,000 |
| 日本システムウエア | 3,900 | 1,100.00 | 4,290,000 |
| アイネス | 14,500 | 1,079.00 | 15,645,500 |
| TKC | 9,500 | 2,856.00 | 27,132,000 |
| 富士ソフト | 15,200 | 2,597.00 | 39,474,400 |
| NSD | 21,700 | 1,678.00 | 36,412,600 |
| コナミホールディングス | 46,200 | 4,085.00 | 188,727,000 |
| 福井コンピュータホールディングス | 3,000 | 1,555.00 | 4,665,000 |
| JBCCHホールディングス | 8,600 | 686.00 | 5,899,600 |

| | | | |
|---------------------|---------|----------|---------------|
| ミロク情報サービス | 7,600 | 1,522.00 | 11,567,200 |
| ソフトバンクグループ | 580,000 | 5,996.00 | 3,477,680,000 |
| ハウスイ | 8,000 | 116.00 | 928,000 |
| 高千穂交易 | 4,000 | 892.00 | 3,568,000 |
| 伊藤忠食品 | 2,500 | 4,120.00 | 10,300,000 |
| エレマテック | 4,800 | 2,131.00 | 10,228,800 |
| JALUX | 3,300 | 1,806.00 | 5,959,800 |
| あらた | 4,600 | 2,380.00 | 10,948,000 |
| 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 | 3,700 | 1,523.00 | 5,635,100 |
| フィールズ | 9,000 | 1,434.00 | 12,906,000 |
| 双日 | 644,800 | 258.00 | 166,358,400 |
| アルフレッサ ホールディングス | 128,700 | 2,370.00 | 305,019,000 |
| 横浜冷凍 | 25,400 | 1,018.00 | 25,857,200 |
| 神栄 | 14,000 | 124.00 | 1,736,000 |
| 山下医科器械 | 800 | 1,722.00 | 1,377,600 |
| ラサ商事 | 4,800 | 474.00 | 2,275,200 |
| ラクーン | 4,400 | 610.00 | 2,684,000 |
| アルコニックス | 5,800 | 1,540.00 | 8,932,000 |
| 神戸物産 | 6,600 | 2,206.00 | 14,559,600 |
| あい ホールディングス | 18,200 | 2,703.00 | 49,194,600 |
| ディーブイエックス | 3,700 | 1,082.00 | 4,003,400 |
| ダイワボウホールディングス | 93,000 | 227.00 | 21,111,000 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 18,400 | 1,174.00 | 21,601,600 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 17,800 | 1,048.00 | 18,654,400 |
| 八洲電機 | 7,900 | 524.00 | 4,139,600 |
| UKCホールディングス | 6,600 | 1,879.00 | 12,401,400 |
| OCHIホールディングス | 3,000 | 1,015.00 | 3,045,000 |
| TOKAIホールディングス | 45,000 | 682.00 | 30,690,000 |
| 三洋貿易 | 5,600 | 1,257.00 | 7,039,200 |
| ウイン・パートナーズ | 3,700 | 1,517.00 | 5,612,900 |
| ミタチ産業 | 2,600 | 593.00 | 1,541,800 |
| シップヘルスケアホールディングス | 20,800 | 3,185.00 | 66,248,000 |
| 明治電機工業 | 3,200 | 1,007.00 | 3,222,400 |
| デリカフーズ | 2,200 | 954.00 | 2,098,800 |
| スターティア | 2,000 | 600.00 | 1,200,000 |
| 富士興産 | 4,000 | 420.00 | 1,680,000 |
| 協栄産業 | 14,000 | 137.00 | 1,918,000 |
| 小野建 | 8,900 | 1,239.00 | 11,027,100 |
| 佐島電機 | 8,100 | 658.00 | 5,329,800 |
| エコトレーディング | 2,400 | 588.00 | 1,411,200 |
| 伯東 | 7,800 | 908.00 | 7,082,400 |

| | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|
| コンドーテック | 8,100 | 774.00 | 6,269,400 |
| 中山福 | 6,400 | 773.00 | 4,947,200 |
| ナガイレーベン | 14,800 | 2,463.00 | 36,452,400 |
| 三菱食品 | 11,200 | 2,799.00 | 31,348,800 |
| 松田産業 | 7,500 | 1,285.00 | 9,637,500 |
| 第一興商 | 18,100 | 4,440.00 | 80,364,000 |
| メディカルホールディングス | 102,400 | 1,837.00 | 188,108,800 |
| アドヴァン | 10,400 | 1,172.00 | 12,188,800 |
| S P K | 2,400 | 1,952.00 | 4,684,800 |
| 萩原電気 | 3,500 | 1,940.00 | 6,790,000 |
| アズワン | 8,000 | 4,120.00 | 32,960,000 |
| スズデン | 3,300 | 934.00 | 3,082,200 |
| 尾家産業 | 3,300 | 868.00 | 2,864,400 |
| シモジマ | 7,000 | 1,032.00 | 7,224,000 |
| ドウシシャ | 12,000 | 2,139.00 | 25,668,000 |
| 小津産業 | 2,300 | 1,992.00 | 4,581,600 |
| 高速 | 6,100 | 877.00 | 5,349,700 |
| たけびし | 3,600 | 1,001.00 | 3,603,600 |
| 黒田電気 | 19,100 | 1,802.00 | 34,418,200 |
| 丸文 | 9,100 | 602.00 | 5,478,200 |
| ハピネット | 9,300 | 843.00 | 7,839,900 |
| 橋本総業ホールディングス | 2,100 | 1,500.00 | 3,150,000 |
| エクセル | 5,000 | 1,389.00 | 6,945,000 |
| マルカキカイ | 3,300 | 1,162.00 | 3,834,600 |
| ガリバーインターナショナル | 27,600 | 1,039.00 | 28,676,400 |
| 日本エム・ディ・エム | 8,600 | 792.00 | 6,811,200 |
| 進和 | 6,000 | 1,418.00 | 8,508,000 |
| エスケイジャパン | 2,500 | 272.00 | 680,000 |
| ダイトエレクトロン | 4,700 | 627.00 | 2,946,900 |
| シークス | 6,500 | 3,615.00 | 23,497,500 |
| 田中商事 | 3,200 | 662.00 | 2,118,400 |
| オーハシテクニカ | 5,800 | 1,283.00 | 7,441,400 |
| 白銅 | 2,900 | 1,081.00 | 3,134,900 |
| 伊藤忠商事 | 803,200 | 1,337.00 | 1,073,878,400 |
| 丸紅 | 1,007,400 | 492.80 | 496,446,720 |
| 高島 | 19,000 | 161.00 | 3,059,000 |
| 長瀬産業 | 61,600 | 1,222.00 | 75,275,200 |
| 蝶理 | 6,500 | 1,402.00 | 9,113,000 |
| 豊田通商 | 114,000 | 2,339.00 | 266,646,000 |
| 三共生興 | 15,500 | 327.00 | 5,068,500 |
| 兼松 | 218,000 | 176.00 | 38,368,000 |
| ツカモトコーポレーション | 18,000 | 108.00 | 1,944,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|
| 三井物産 | 925,600 | 1,291.50 | 1,195,412,400 |
| 日本紙パルプ商事 | 53,000 | 341.00 | 18,073,000 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 35,500 | 3,075.00 | 109,162,500 |
| カメイ | 13,300 | 895.00 | 11,903,500 |
| 東都水産 | 17,000 | 168.00 | 2,856,000 |
| OUGホールディングス | 15,000 | 251.00 | 3,765,000 |
| スターゼン | 3,700 | 3,895.00 | 14,411,500 |
| 山善 | 39,300 | 869.00 | 34,151,700 |
| 椿本興業 | 12,000 | 283.00 | 3,396,000 |
| 住友商事 | 644,300 | 1,049.50 | 676,192,850 |
| 内田洋行 | 25,000 | 458.00 | 11,450,000 |
| 三菱商事 | 768,100 | 1,922.00 | 1,476,288,200 |
| 第一実業 | 23,000 | 505.00 | 11,615,000 |
| キャノンマーケティングジャパン | 29,200 | 2,083.00 | 60,823,600 |
| 西華産業 | 34,000 | 284.00 | 9,656,000 |
| 佐藤商事 | 9,200 | 619.00 | 5,694,800 |
| 菱洋エレクトロ | 11,800 | 1,370.00 | 16,166,000 |
| 東京産業 | 10,200 | 373.00 | 3,804,600 |
| ユアサ商事 | 9,700 | 2,312.00 | 22,426,400 |
| 神鋼商事 | 23,000 | 177.00 | 4,071,000 |
| 小林産業 | 6,900 | 230.00 | 1,587,000 |
| 阪和興業 | 102,000 | 596.00 | 60,792,000 |
| カナデン | 9,800 | 894.00 | 8,761,200 |
| 菱電商事 | 16,000 | 653.00 | 10,448,000 |
| フルサト工業 | 5,600 | 1,368.00 | 7,660,800 |
| 岩谷産業 | 121,000 | 615.00 | 74,415,000 |
| すてきナイスグループ | 44,000 | 156.00 | 6,864,000 |
| 昭光通商 | 36,000 | 74.00 | 2,664,000 |
| ニチモウ | 16,000 | 160.00 | 2,560,000 |
| 極東貿易 | 15,000 | 201.00 | 3,015,000 |
| イワキ | 15,000 | 190.00 | 2,850,000 |
| 三愛石油 | 25,200 | 731.00 | 18,421,200 |
| 稲畑産業 | 24,600 | 1,048.00 | 25,780,800 |
| G S Iクレオス | 27,000 | 105.00 | 2,835,000 |
| 明和産業 | 9,500 | 306.00 | 2,907,000 |
| ワキタ | 21,800 | 685.00 | 14,933,000 |
| 東邦ホールディングス | 32,800 | 2,698.00 | 88,494,400 |
| サンゲツ | 35,600 | 1,969.00 | 70,096,400 |
| ミツウロコグループホールディングス | 16,500 | 512.00 | 8,448,000 |
| シナネンホールディングス | 22,000 | 421.00 | 9,262,000 |
| 伊藤忠エネクス | 26,400 | 915.00 | 24,156,000 |
| サンリオ | 31,600 | 2,030.00 | 64,148,000 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| サンワテクノス | 6,500 | 754.00 | 4,901,000 |
| リョーサン | 16,200 | 2,590.00 | 41,958,000 |
| 新光商事 | 12,000 | 1,050.00 | 12,600,000 |
| トーホー | 4,600 | 2,479.00 | 11,403,400 |
| 三信電気 | 14,200 | 862.00 | 12,240,400 |
| 東陽テクニカ | 14,400 | 1,075.00 | 15,480,000 |
| モスフードサービス | 13,400 | 3,015.00 | 40,401,000 |
| 加賀電子 | 9,300 | 1,282.00 | 11,922,600 |
| ソーダニッカ | 10,600 | 478.00 | 5,066,800 |
| 立花エレテック | 7,600 | 1,099.00 | 8,352,400 |
| フォーバル | 5,400 | 738.00 | 3,985,200 |
| PALTAC | 16,400 | 2,099.00 | 34,423,600 |
| 三谷産業 | 10,900 | 329.00 | 3,586,100 |
| ヤマタネ | 47,000 | 147.00 | 6,909,000 |
| 丸紅建材リース | 9,000 | 181.00 | 1,629,000 |
| 日鉄住金物産 | 90,000 | 378.00 | 34,020,000 |
| トラスコ中山 | 11,700 | 5,380.00 | 62,946,000 |
| オートバックスセブン | 39,200 | 1,574.00 | 61,700,800 |
| 加藤産業 | 16,000 | 2,628.00 | 42,048,000 |
| イノテック | 9,400 | 484.00 | 4,549,600 |
| イエローハット | 9,700 | 2,417.00 | 23,444,900 |
| J Kホールディングス | 10,300 | 461.00 | 4,748,300 |
| 日伝 | 4,200 | 2,972.00 | 12,482,400 |
| 北沢産業 | 8,600 | 155.00 | 1,333,000 |
| 杉本商事 | 5,900 | 1,163.00 | 6,861,700 |
| 因幡電機産業 | 14,400 | 3,590.00 | 51,696,000 |
| バイテックホールディングス | 4,200 | 1,027.00 | 4,313,400 |
| ミスミグループ本社 | 115,000 | 1,769.00 | 203,435,000 |
| アルテック | 8,700 | 141.00 | 1,226,700 |
| タキヒヨー | 17,000 | 445.00 | 7,565,000 |
| 蔵王産業 | 1,700 | 1,323.00 | 2,249,100 |
| スズケン | 46,600 | 3,595.00 | 167,527,000 |
| ジェコス | 7,100 | 1,062.00 | 7,540,200 |
| ルネサスイーストン | 8,600 | 412.00 | 3,543,200 |
| ローソン | 38,800 | 8,770.00 | 340,276,000 |
| サンエー | 7,000 | 5,260.00 | 36,820,000 |
| ダイユーエイト | 3,300 | 681.00 | 2,247,300 |
| カワチ薬品 | 8,000 | 2,770.00 | 22,160,000 |
| エービーシー・マート | 13,300 | 6,790.00 | 90,307,000 |
| ハードオフコーポレーション | 5,000 | 1,294.00 | 6,470,000 |
| アスクル | 12,500 | 3,830.00 | 47,875,000 |
| ゲオホールディングス | 17,100 | 1,535.00 | 26,248,500 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| アダストリア | 18,900 | 3,930.00 | 74,277,000 |
| ジーフット | 6,200 | 779.00 | 4,829,800 |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 15,000 | 83.00 | 1,245,000 |
| くらコーポレーション | 6,000 | 5,740.00 | 34,440,000 |
| キャンドゥ | 5,400 | 1,691.00 | 9,131,400 |
| パル | 6,000 | 2,495.00 | 14,970,000 |
| エディオン | 43,700 | 829.00 | 36,227,300 |
| サーラコーポレーション | 8,800 | 540.00 | 4,752,000 |
| ワッツ | 4,400 | 1,029.00 | 4,527,600 |
| ハローズ | 3,300 | 2,231.00 | 7,362,300 |
| あみやき亭 | 2,000 | 4,575.00 | 9,150,000 |
| ひらまつ | 14,100 | 709.00 | 9,996,900 |
| ゲンキー | 2,100 | 3,670.00 | 7,707,000 |
| サッポロドラッグストア | 1,400 | 2,057.00 | 2,879,800 |
| 大黒天物産 | 2,400 | 4,810.00 | 11,544,000 |
| ハニーズ | 9,000 | 1,032.00 | 9,288,000 |
| ファーマライズホールディングス | 3,100 | 541.00 | 1,677,100 |
| アルペン | 9,200 | 1,768.00 | 16,265,600 |
| クオール | 10,400 | 1,437.00 | 14,944,800 |
| ジェイアイエヌ | 7,000 | 3,865.00 | 27,055,000 |
| ビックカメラ | 58,800 | 1,018.00 | 59,858,400 |
| D C Mホールディングス | 50,500 | 778.00 | 39,289,000 |
| Monotaro | 36,100 | 3,985.00 | 143,858,500 |
| 東京一番フーズ | 2,600 | 545.00 | 1,417,000 |
| ダイヤモンドダイニング | 2,500 | 995.00 | 2,487,500 |
| きちり | 2,800 | 640.00 | 1,792,000 |
| アークランドサービス | 3,200 | 3,370.00 | 10,784,000 |
| J.フロント リテイリング | 129,600 | 1,205.00 | 156,168,000 |
| ドトール・日レスホールディングス | 17,900 | 1,889.00 | 33,813,100 |
| マツモトキヨシホールディングス | 21,100 | 5,790.00 | 122,169,000 |
| broncoビリー | 5,300 | 3,335.00 | 17,675,500 |
| スタートトゥデイ | 31,100 | 5,420.00 | 168,562,000 |
| トレジャー・ファクトリー | 2,900 | 1,159.00 | 3,361,100 |
| 物語コーポレーション | 2,700 | 5,550.00 | 14,985,000 |
| ココカラファイン | 10,700 | 5,730.00 | 61,311,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 203,700 | 1,001.00 | 203,903,700 |
| ウエルシアホールディングス | 8,900 | 6,440.00 | 57,316,000 |
| クリエイトSDホールディングス | 15,100 | 2,929.00 | 44,227,900 |
| 丸善CHIホールディングス | 11,900 | 385.00 | 4,581,500 |
| ミサワ | 1,700 | 512.00 | 870,400 |
| エー・ピーカンパニー | 1,800 | 938.00 | 1,688,400 |
| チムニー | 2,500 | 3,055.00 | 7,637,500 |

| | | | |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|
| シュッピン | 3,900 | 1,318.00 | 5,140,200 |
| ネクステージ | 1,900 | 768.00 | 1,459,200 |
| ジョイフル本田 | 16,600 | 2,530.00 | 41,998,000 |
| 鳥貴族 | 2,500 | 2,060.00 | 5,150,000 |
| キリン堂ホールディングス | 3,300 | 1,035.00 | 3,415,500 |
| ホットランド | 3,600 | 1,013.00 | 3,646,800 |
| すかいらーく | 31,600 | 1,300.00 | 41,080,000 |
| 綿半ホールディングス | 3,900 | 1,641.00 | 6,399,900 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 34,000 | 1,100.00 | 37,400,000 |
| ブックオフコーポレーション | 6,200 | 877.00 | 5,437,400 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 2,900 | 956.00 | 2,772,400 |
| あさひ | 7,600 | 1,498.00 | 11,384,800 |
| 日本調剤 | 2,600 | 4,905.00 | 12,753,000 |
| コスモス薬品 | 5,200 | 20,270.00 | 105,404,000 |
| トーエル | 5,000 | 811.00 | 4,055,000 |
| 一六堂 | 2,500 | 328.00 | 820,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 428,200 | 4,601.00 | 1,970,148,200 |
| 薬王堂 | 1,900 | 4,465.00 | 8,483,500 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 27,500 | 1,000.00 | 27,500,000 |
| ツルハホールディングス | 23,500 | 11,680.00 | 274,480,000 |
| サンマルクホールディングス | 8,100 | 3,155.00 | 25,555,500 |
| フェリシモ | 2,900 | 1,041.00 | 3,018,900 |
| トリドール | 12,600 | 2,881.00 | 36,300,600 |
| クスリのアオキ | 9,100 | 6,880.00 | 62,608,000 |
| メディカルシステムネットワーク | 12,300 | 546.00 | 6,715,800 |
| 総合メディカル | 4,900 | 3,965.00 | 19,428,500 |
| はるやま商事 | 4,300 | 741.00 | 3,186,300 |
| カッパ・クリエイト | 14,300 | 1,277.00 | 18,261,100 |
| ライトオン | 7,700 | 1,340.00 | 10,318,000 |
| 良品計画 | 11,800 | 26,170.00 | 308,806,000 |
| 三城ホールディングス | 12,700 | 414.00 | 5,257,800 |
| アルビス | 2,700 | 2,041.00 | 5,510,700 |
| コナカ | 13,100 | 525.00 | 6,877,500 |
| ハウス オブ ローゼ | 1,300 | 1,407.00 | 1,829,100 |
| G - 7ホールディングス | 3,000 | 1,220.00 | 3,660,000 |
| イオン北海道 | 7,000 | 514.00 | 3,598,000 |
| コジマ | 15,200 | 233.00 | 3,541,600 |
| ヒマラヤ | 3,300 | 982.00 | 3,240,600 |
| コーナン商事 | 14,800 | 1,926.00 | 28,504,800 |
| エコス | 4,200 | 1,366.00 | 5,737,200 |
| マルシェ | 2,500 | 827.00 | 2,067,500 |

| | | | |
|-----------------|--------|-----------|-------------|
| ドンキホーテホールディングス | 66,200 | 3,900.00 | 258,180,000 |
| 西松屋チェーン | 20,200 | 1,223.00 | 24,704,600 |
| ゼンショーホールディングス | 52,600 | 1,519.00 | 79,899,400 |
| 幸楽苑ホールディングス | 6,700 | 1,538.00 | 10,304,600 |
| ハークスレイ | 2,900 | 986.00 | 2,859,400 |
| サイゼリヤ | 16,800 | 2,031.00 | 34,120,800 |
| V Tホールディングス | 34,700 | 490.00 | 17,003,000 |
| 魚力 | 3,200 | 1,442.00 | 4,614,400 |
| ポブラ | 2,600 | 497.00 | 1,292,200 |
| ユナイテッドアローズ | 14,600 | 3,170.00 | 46,282,000 |
| ハイデイ日高 | 9,300 | 2,544.00 | 23,659,200 |
| 京都きもの友禅 | 7,000 | 874.00 | 6,118,000 |
| コロワイド | 34,200 | 1,904.00 | 65,116,800 |
| ピーシーデポコーポレーション | 11,300 | 1,563.00 | 17,661,900 |
| 壱番屋 | 9,200 | 3,635.00 | 33,442,000 |
| トップカルチャー | 4,600 | 463.00 | 2,129,800 |
| P L A N T | 2,500 | 1,199.00 | 2,997,500 |
| スギホールディングス | 18,400 | 6,000.00 | 110,400,000 |
| スクロール | 15,500 | 465.00 | 7,207,500 |
| ヨンドシーホールディングス | 7,800 | 2,345.00 | 18,291,000 |
| ファミリーマート | 31,500 | 6,010.00 | 189,315,000 |
| 木曾路 | 12,500 | 2,245.00 | 28,062,500 |
| サトレストランシステムズ | 12,100 | 814.00 | 9,849,400 |
| 千趣会 | 20,300 | 731.00 | 14,839,300 |
| タカキュー | 8,000 | 179.00 | 1,432,000 |
| ケーヨー | 17,300 | 539.00 | 9,324,700 |
| 上新電機 | 24,000 | 906.00 | 21,744,000 |
| 日本瓦斯 | 15,600 | 2,378.00 | 37,096,800 |
| ベスト電器 | 33,000 | 111.00 | 3,663,000 |
| ロイヤルホールディングス | 17,100 | 2,012.00 | 34,405,200 |
| いなげや | 11,400 | 1,425.00 | 16,245,000 |
| 島忠 | 26,500 | 2,360.00 | 62,540,000 |
| チヨダ | 12,100 | 2,378.00 | 28,773,800 |
| ライフコーポレーション | 6,800 | 3,110.00 | 21,148,000 |
| リンガーハット | 9,300 | 2,404.00 | 22,357,200 |
| M r M a x | 10,600 | 289.00 | 3,063,400 |
| テンアライド | 9,400 | 364.00 | 3,421,600 |
| A O K Iホールディングス | 23,400 | 1,154.00 | 27,003,600 |
| オークワ | 16,000 | 1,171.00 | 18,736,000 |
| コメリ | 15,800 | 2,729.00 | 43,118,200 |
| 青山商事 | 19,600 | 3,780.00 | 74,088,000 |
| しまむら | 11,900 | 14,060.00 | 167,314,000 |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|--|
| はせがわ | 4,900 | 420.00 | 2,058,000 | |
| 高島屋 | 149,000 | 739.00 | 110,111,000 | |
| 松屋 | 21,700 | 809.00 | 17,555,300 | |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 52,400 | 1,622.00 | 84,992,800 | |
| 近鉄百貨店 | 40,000 | 338.00 | 13,520,000 | |
| パルコ | 9,900 | 908.00 | 8,989,200 | |
| 丸井グループ | 125,700 | 1,591.00 | 199,988,700 | |
| アクシアル リテイリング | 7,900 | 3,730.00 | 29,467,000 | |
| イオン | 421,200 | 1,629.50 | 686,345,400 | |
| ユニーグループ・ホールディングス | 98,800 | 822.00 | 81,213,600 | |
| イズミ | 20,400 | 4,235.00 | 86,394,000 | |
| 東武ストア | 12,000 | 294.00 | 3,528,000 | |
| 平和堂 | 20,900 | 2,345.00 | 49,010,500 | |
| フジ | 11,700 | 2,624.00 | 30,700,800 | |
| ヤオコー | 11,600 | 5,060.00 | 58,696,000 | |
| ゼビオホールディングス | 13,900 | 1,562.00 | 21,711,800 | |
| ケーズホールディングス | 43,200 | 1,753.00 | 75,729,600 | |
| Olympicグループ | 6,700 | 536.00 | 3,591,200 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 17,300 | 234.00 | 4,048,200 | |
| アインホールディングス | 12,300 | 7,410.00 | 91,143,000 | |
| 元気寿司 | 3,000 | 2,195.00 | 6,585,000 | |
| ヤマダ電機 | 311,500 | 523.00 | 162,914,500 | |
| アークランドサカモト | 17,300 | 1,199.00 | 20,742,700 | |
| ニトリホールディングス | 44,200 | 11,500.00 | 508,300,000 | |
| グルメ杵屋 | 8,000 | 977.00 | 7,816,000 | |
| 愛眼 | 8,100 | 205.00 | 1,660,500 | |
| ケーユーホールディングス | 5,400 | 711.00 | 3,839,400 | |
| 吉野家ホールディングス | 37,900 | 1,440.00 | 54,576,000 | |
| 松屋フーズ | 5,000 | 2,787.00 | 13,935,000 | |
| サガミチェーン | 13,700 | 1,231.00 | 16,864,700 | |
| 関西スーパーマーケット | 8,700 | 1,048.00 | 9,117,600 | |
| 王将フードサービス | 7,500 | 3,995.00 | 29,962,500 | |
| プレナス | 11,500 | 1,841.00 | 21,171,500 | |
| ミニストップ | 7,600 | 1,759.00 | 13,368,400 | |
| アークス | 19,200 | 2,648.00 | 50,841,600 | |
| バローホールディングス | 22,100 | 3,035.00 | 67,073,500 | |
| 藤久 | 800 | 1,704.00 | 1,363,200 | |
| ベルク | 5,000 | 4,320.00 | 21,600,000 | |
| 大庄 | 5,500 | 1,517.00 | 8,343,500 | |
| ファーストリテイリング | 17,100 | 29,815.00 | 509,836,500 | |
| サンドラッグ | 21,600 | 9,340.00 | 201,744,000 | |
| サクスパー ホールディングス | 9,600 | 1,223.00 | 11,740,800 | |

| | | | | |
|---------------------|-----------|----------|---------------|--|
| ヤマザワ | 2,200 | 1,700.00 | 3,740,000 | |
| やまや | 2,100 | 1,852.00 | 3,889,200 | |
| ペルーナ | 25,600 | 602.00 | 15,411,200 | |
| 島根銀行 | 2,200 | 1,221.00 | 2,686,200 | |
| じもとホールディングス | 73,400 | 144.00 | 10,569,600 | |
| 足利ホールディングス | 75,100 | 334.00 | 25,083,400 | |
| 東京TYフィナンシャルグループ | 14,100 | 2,523.00 | 35,574,300 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 156,700 | 529.00 | 82,894,300 | |
| ゆうちょ銀行 | 262,300 | 1,256.00 | 329,448,800 | |
| 富山第一銀行 | 26,000 | 501.00 | 13,026,000 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 713,100 | 459.30 | 327,526,830 | |
| 新生銀行 | 886,000 | 158.00 | 139,988,000 | |
| あおぞら銀行 | 648,000 | 362.00 | 234,576,000 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 8,212,700 | 527.60 | 4,333,020,520 | |
| りそなホールディングス | 1,197,500 | 391.30 | 468,581,750 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,137,000 | 356.20 | 761,199,400 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 819,600 | 3,275.00 | 2,684,190,000 | |
| 第四銀行 | 129,000 | 355.00 | 45,795,000 | |
| 北越銀行 | 111,000 | 188.00 | 20,868,000 | |
| 西日本シティ銀行 | 334,000 | 207.00 | 69,138,000 | |
| 千葉銀行 | 395,000 | 525.00 | 207,375,000 | |
| 常陽銀行 | 370,000 | 393.00 | 145,410,000 | |
| 群馬銀行 | 227,000 | 412.00 | 93,524,000 | |
| 武蔵野銀行 | 16,300 | 2,509.00 | 40,896,700 | |
| 千葉興業銀行 | 28,100 | 413.00 | 11,605,300 | |
| 筑波銀行 | 42,500 | 283.00 | 12,027,500 | |
| 七十七銀行 | 160,000 | 364.00 | 58,240,000 | |
| 青森銀行 | 75,000 | 294.00 | 22,050,000 | |
| 秋田銀行 | 67,000 | 311.00 | 20,837,000 | |
| 山形銀行 | 57,000 | 410.00 | 23,370,000 | |
| 岩手銀行 | 7,100 | 4,150.00 | 29,465,000 | |
| 東邦銀行 | 91,000 | 344.00 | 31,304,000 | |
| 東北銀行 | 52,000 | 143.00 | 7,436,000 | |
| みちのく銀行 | 51,000 | 180.00 | 9,180,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 443,000 | 362.00 | 160,366,000 | |
| 静岡銀行 | 300,000 | 774.00 | 232,200,000 | |
| 十六銀行 | 128,000 | 289.00 | 36,992,000 | |
| スルガ銀行 | 97,200 | 2,384.00 | 231,724,800 | |
| 八十二銀行 | 185,200 | 469.00 | 86,858,800 | |
| 山梨中央銀行 | 63,000 | 371.00 | 23,373,000 | |
| 大垣共立銀行 | 137,000 | 307.00 | 42,059,000 | |
| 福井銀行 | 87,000 | 221.00 | 19,227,000 | |

| | | | |
|-----------------|------------|----------|---------------|
| 北國銀行 | 113,000 | 288.00 | 32,544,000 |
| 清水銀行 | 3,500 | 2,458.00 | 8,603,000 |
| 富山銀行 | 2,000 | 3,480.00 | 6,960,000 |
| 滋賀銀行 | 96,000 | 457.00 | 43,872,000 |
| 南都銀行 | 99,000 | 333.00 | 32,967,000 |
| 百五銀行 | 92,000 | 385.00 | 35,420,000 |
| 京都銀行 | 195,000 | 674.00 | 131,430,000 |
| 紀陽銀行 | 40,200 | 1,370.00 | 55,074,000 |
| 三重銀行 | 46,000 | 193.00 | 8,878,000 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 696,000 | 128.00 | 89,088,000 |
| 広島銀行 | 302,000 | 377.00 | 113,854,000 |
| 山陰合同銀行 | 61,700 | 658.00 | 40,598,600 |
| 中国銀行 | 72,600 | 1,146.00 | 83,199,600 |
| 鳥取銀行 | 33,000 | 174.00 | 5,742,000 |
| 伊予銀行 | 109,500 | 681.00 | 74,569,500 |
| 百十四銀行 | 112,000 | 309.00 | 34,608,000 |
| 四国銀行 | 79,000 | 208.00 | 16,432,000 |
| 阿波銀行 | 83,000 | 591.00 | 49,053,000 |
| 大分銀行 | 59,000 | 309.00 | 18,231,000 |
| 宮崎銀行 | 68,000 | 275.00 | 18,700,000 |
| 佐賀銀行 | 62,000 | 231.00 | 14,322,000 |
| 十八銀行 | 63,000 | 252.00 | 15,876,000 |
| 沖縄銀行 | 8,100 | 3,990.00 | 32,319,000 |
| 琉球銀行 | 21,100 | 1,145.00 | 24,159,500 |
| セブン銀行 | 383,500 | 363.00 | 139,210,500 |
| みずほフィナンシャルグループ | 14,508,500 | 163.30 | 2,369,238,050 |
| 高知銀行 | 40,000 | 105.00 | 4,200,000 |
| 山口フィナンシャルグループ | 96,000 | 1,020.00 | 97,920,000 |
| 長野銀行 | 34,000 | 191.00 | 6,494,000 |
| 名古屋銀行 | 86,000 | 337.00 | 28,982,000 |
| 北洋銀行 | 154,200 | 288.00 | 44,409,600 |
| 愛知銀行 | 3,400 | 4,885.00 | 16,609,000 |
| 第三銀行 | 58,000 | 162.00 | 9,396,000 |
| 中京銀行 | 42,000 | 233.00 | 9,786,000 |
| 大光銀行 | 36,000 | 190.00 | 6,840,000 |
| 愛媛銀行 | 60,000 | 238.00 | 14,280,000 |
| トマト銀行 | 39,000 | 143.00 | 5,577,000 |
| みなと銀行 | 93,000 | 164.00 | 15,252,000 |
| 京葉銀行 | 84,000 | 401.00 | 33,684,000 |
| 関西アーバン銀行 | 14,300 | 987.00 | 14,114,100 |
| 栃木銀行 | 55,000 | 381.00 | 20,955,000 |
| 北日本銀行 | 3,200 | 2,598.00 | 8,313,600 |

| | | | |
|--------------------------------|-----------|----------|---------------|
| 東和銀行 | 192,000 | 83.00 | 15,936,000 |
| 福島銀行 | 126,000 | 86.00 | 10,836,000 |
| 大東銀行 | 61,000 | 176.00 | 10,736,000 |
| トモニホールディングス | 78,500 | 326.00 | 25,591,000 |
| フィデアホールディングス | 83,500 | 147.00 | 12,274,500 |
| 池田泉州ホールディングス | 108,600 | 400.00 | 43,440,000 |
| F P G | 36,700 | 1,199.00 | 44,003,300 |
| S B I ホールディングス | 123,000 | 1,070.00 | 131,610,000 |
| ジャフコ | 17,200 | 2,946.00 | 50,671,200 |
| 大和証券グループ本社 | 958,000 | 601.90 | 576,620,200 |
| 野村ホールディングス | 1,969,600 | 434.90 | 856,579,040 |
| 岡三証券グループ | 87,000 | 501.00 | 43,587,000 |
| 丸三証券 | 30,400 | 952.00 | 28,940,800 |
| 東洋証券 | 40,000 | 214.00 | 8,560,000 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 117,600 | 488.00 | 57,388,800 |
| 光世証券 | 27,000 | 124.00 | 3,348,000 |
| 水戸証券 | 32,100 | 255.00 | 8,185,500 |
| いちよし証券 | 23,000 | 759.00 | 17,457,000 |
| 松井証券 | 50,200 | 910.00 | 45,682,000 |
| だいこう証券ビジネス | 5,100 | 712.00 | 3,631,200 |
| マネックスグループ | 120,000 | 261.00 | 31,320,000 |
| カブドットコム証券 | 90,400 | 342.00 | 30,916,800 |
| 極東証券 | 13,800 | 1,181.00 | 16,297,800 |
| 岩井コスモホールディングス | 9,700 | 946.00 | 9,176,200 |
| 藍澤證券 | 19,300 | 573.00 | 11,058,900 |
| マネースクウェアHD | 3,600 | 854.00 | 3,074,400 |
| マネーパートナーズグループ | 10,000 | 628.00 | 6,280,000 |
| かんぽ生命保険 | 41,700 | 2,307.00 | 96,201,900 |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 227,400 | 2,820.50 | 641,381,700 |
| アニコム ホールディングス | 6,900 | 2,967.00 | 20,472,300 |
| M S & A D インシュアランスグループホールディングス | 305,900 | 2,910.00 | 890,169,000 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 98,100 | 1,300.00 | 127,530,000 |
| 第一生命保険 | 655,800 | 1,295.00 | 849,261,000 |
| 東京海上ホールディングス | 414,700 | 3,572.00 | 1,481,308,400 |
| T & D ホールディングス | 373,100 | 1,002.00 | 373,846,200 |
| 全国保証 | 26,600 | 3,695.00 | 98,287,000 |
| クレディセゾン | 77,600 | 1,931.00 | 149,845,600 |
| アクリーティブ | 8,400 | 393.00 | 3,301,200 |
| 芙蓉総合リース | 11,700 | 4,460.00 | 52,182,000 |
| 興銀リース | 19,200 | 1,896.00 | 36,403,200 |
| 東京センチュリーリース | 24,000 | 3,570.00 | 85,680,000 |
| 日本証券金融 | 45,100 | 419.00 | 18,896,900 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| アイフル | 171,400 | 332.00 | 56,904,800 |
| ポケットカード | 10,200 | 530.00 | 5,406,000 |
| リコーリース | 8,000 | 2,896.00 | 23,168,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 67,100 | 2,258.00 | 151,511,800 |
| アコム | 205,600 | 561.00 | 115,341,600 |
| ジャックス | 56,000 | 466.00 | 26,096,000 |
| オリエントコーポレーション | 442,600 | 211.00 | 93,388,600 |
| 日立キャピタル | 24,100 | 2,327.00 | 56,080,700 |
| アプラスフィナンシャル | 49,100 | 100.00 | 4,910,000 |
| オリックス | 724,800 | 1,454.50 | 1,054,221,600 |
| 三菱UFJリース | 259,600 | 435.00 | 112,926,000 |
| 日本取引所グループ | 300,600 | 1,263.00 | 379,657,800 |
| イー・ギャランティ | 3,300 | 2,738.00 | 9,035,400 |
| アサックス | 1,800 | 1,332.00 | 2,397,600 |
| NECキャピタルソリューション | 4,200 | 1,462.00 | 6,140,400 |
| いちごグループホールディングス | 113,400 | 417.00 | 47,287,800 |
| 日本駐車場開発 | 123,500 | 127.00 | 15,684,500 |
| ヒューリック | 213,400 | 1,088.00 | 232,179,200 |
| 三栄建築設計 | 4,100 | 1,273.00 | 5,219,300 |
| 野村不動産ホールディングス | 67,900 | 1,919.00 | 130,300,100 |
| 三重交通グループホールディングス | 18,200 | 410.00 | 7,462,000 |
| サムティ | 7,400 | 1,035.00 | 7,659,000 |
| ディア・ライフ | 7,000 | 354.00 | 2,478,000 |
| エー・ディー・ワークス | 94,800 | 42.00 | 3,981,600 |
| 日本商業開発 | 4,500 | 1,795.00 | 8,077,500 |
| プレサンスコーポレーション | 3,500 | 4,005.00 | 14,017,500 |
| ユニゾホールディングス | 6,400 | 5,240.00 | 33,536,000 |
| 日本管理センター | 6,700 | 1,660.00 | 11,122,000 |
| サンセイランディック | 2,400 | 900.00 | 2,160,000 |
| エストラスト | 1,900 | 533.00 | 1,012,700 |
| フージャースホールディングス | 14,300 | 609.00 | 8,708,700 |
| オープンハウス | 14,800 | 2,936.00 | 43,452,800 |
| 東急不動産ホールディングス | 247,700 | 708.00 | 175,371,600 |
| 飯田グループホールディングス | 94,800 | 2,288.00 | 216,902,400 |
| ムゲンエステート | 1,500 | 2,270.00 | 3,405,000 |
| パーク24 | 51,700 | 3,490.00 | 180,433,000 |
| バラカ | 3,600 | 1,595.00 | 5,742,000 |
| 三井不動産 | 543,000 | 2,566.50 | 1,393,609,500 |
| 三菱地所 | 761,000 | 2,029.50 | 1,544,449,500 |
| 平和不動産 | 19,400 | 1,289.00 | 25,006,600 |
| 東京建物 | 111,800 | 1,346.00 | 150,482,800 |
| ダイビル | 26,400 | 991.00 | 26,162,400 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|
| 京阪神ビルディング | 17,000 | 577.00 | 9,809,000 |
| 住友不動産 | 245,000 | 2,888.50 | 707,682,500 |
| 大京 | 190,000 | 165.00 | 31,350,000 |
| テーオーシー | 39,700 | 900.00 | 35,730,000 |
| 東京楽天地 | 17,000 | 481.00 | 8,177,000 |
| レオパレス21 | 120,600 | 742.00 | 89,485,200 |
| スターツコーポレーション | 11,800 | 2,198.00 | 25,936,400 |
| フジ住宅 | 13,100 | 698.00 | 9,143,800 |
| 空港施設 | 12,500 | 539.00 | 6,737,500 |
| 明和地所 | 5,700 | 572.00 | 3,260,400 |
| 住友不動産販売 | 7,400 | 2,107.00 | 15,591,800 |
| ゴールドクレスト | 8,100 | 1,807.00 | 14,636,700 |
| 日本エスリード | 4,000 | 1,073.00 | 4,292,000 |
| 日神不動産 | 13,700 | 374.00 | 5,123,800 |
| タカラレーベン | 44,700 | 772.00 | 34,508,400 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 5,800 | 949.00 | 5,504,200 |
| イオンモール | 66,100 | 1,499.00 | 99,083,900 |
| ファースト住建 | 3,800 | 1,309.00 | 4,974,200 |
| トーセイ | 15,600 | 781.00 | 12,183,600 |
| 穴吹興産 | 11,000 | 258.00 | 2,838,000 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 63,600 | 1,071.00 | 68,115,600 |
| サンフロンティア不動産 | 12,400 | 1,125.00 | 13,950,000 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 9,000 | 504.00 | 4,536,000 |
| ランドビジネス | 6,900 | 255.00 | 1,759,500 |
| グランディハウス | 9,100 | 342.00 | 3,112,200 |
| 日本空港ビルデング | 32,700 | 3,755.00 | 122,788,500 |
| 日本工営 | 37,000 | 375.00 | 13,875,000 |
| ネクスト | 30,600 | 1,058.00 | 32,374,800 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 6,700 | 1,800.00 | 12,060,000 |
| 日本M&Aセンター | 16,700 | 7,020.00 | 117,234,000 |
| ノバレーゼ | 3,400 | 855.00 | 2,907,000 |
| アコーディア・ゴルフ | 30,500 | 1,031.00 | 31,445,500 |
| 中広 | 1,500 | 633.00 | 949,500 |
| タケエイ | 9,700 | 1,041.00 | 10,097,700 |
| トラスト・テック | 4,400 | 1,529.00 | 6,727,600 |
| パソナグループ | 9,400 | 729.00 | 6,852,600 |
| CDS | 2,900 | 866.00 | 2,511,400 |
| リンクアンドモチベーション | 24,200 | 180.00 | 4,356,000 |
| GCAサヴィアン | 9,600 | 951.00 | 9,129,600 |
| エス・エム・エス | 13,500 | 2,391.00 | 32,278,500 |
| テンプホールディングス | 75,900 | 1,775.00 | 134,722,500 |
| リニカル | 6,400 | 2,180.00 | 13,952,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| クックパッド | 24,200 | 1,543.00 | 37,340,600 |
| エスクリ | 5,700 | 590.00 | 3,363,000 |
| アイ・ケイ・ケイ | 6,400 | 600.00 | 3,840,000 |
| 学情 | 4,100 | 1,181.00 | 4,842,100 |
| スタジオアリス | 5,000 | 2,666.00 | 13,330,000 |
| シミックホールディングス | 5,800 | 1,631.00 | 9,459,800 |
| N J S | 2,400 | 1,192.00 | 2,860,800 |
| 総合警備保障 | 36,100 | 5,160.00 | 186,276,000 |
| カカクコム | 77,800 | 2,043.00 | 158,945,400 |
| アイロムグループ | 3,100 | 1,290.00 | 3,999,000 |
| ルネサンス | 6,000 | 1,164.00 | 6,984,000 |
| ディップ | 12,000 | 3,080.00 | 36,960,000 |
| オプトホールディング | 7,100 | 869.00 | 6,169,900 |
| ツクイ | 13,200 | 1,679.00 | 22,162,800 |
| キャリアデザインセンター | 3,200 | 1,005.00 | 3,216,000 |
| エムスリー | 93,800 | 3,480.00 | 326,424,000 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 8,600 | 724.00 | 6,226,400 |
| アウトソーシング | 5,100 | 5,210.00 | 26,571,000 |
| ウェルネット | 4,100 | 4,110.00 | 16,851,000 |
| ディー・エヌ・エー | 48,600 | 2,357.00 | 114,550,200 |
| 博報堂D Yホールディングス | 150,200 | 1,294.00 | 194,358,800 |
| ぐるなび | 12,500 | 3,015.00 | 37,687,500 |
| エスアールジータカミヤ | 12,400 | 443.00 | 5,493,200 |
| ファンコミュニケーションズ | 25,000 | 791.00 | 19,775,000 |
| ジェイコムホールディングス | 2,300 | 2,050.00 | 4,715,000 |
| W D Bホールディングス | 4,000 | 868.00 | 3,472,000 |
| ティア | 6,000 | 673.00 | 4,038,000 |
| バリューコマース | 10,400 | 410.00 | 4,264,000 |
| インフォマート | 21,000 | 1,050.00 | 22,050,000 |
| J Pホールディングス | 27,500 | 308.00 | 8,470,000 |
| E P Sホールディングス | 13,500 | 1,527.00 | 20,614,500 |
| レッグス | 2,400 | 713.00 | 1,711,200 |
| プレステージ・インターナショナル | 9,300 | 1,571.00 | 14,610,300 |
| アミューズ | 6,000 | 2,243.00 | 13,458,000 |
| ドリームインキュベータ | 3,700 | 2,152.00 | 7,962,400 |
| クイック | 5,600 | 769.00 | 4,306,400 |
| T A C | 9,900 | 206.00 | 2,039,400 |
| ケネディクス | 145,800 | 402.00 | 58,611,600 |
| 電通 | 120,700 | 5,230.00 | 631,261,000 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 6,500 | 445.00 | 2,892,500 |
| ぴあ | 3,300 | 2,142.00 | 7,068,600 |
| イオンファンタジー | 3,900 | 2,964.00 | 11,559,600 |

| | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|
| シーティーエス | 3,900 | 757.00 | 2,952,300 |
| ネクシィーズグループ | 3,900 | 2,712.00 | 10,576,800 |
| みらかホールディングス | 27,700 | 4,600.00 | 127,420,000 |
| アルプス技研 | 4,100 | 2,200.00 | 9,020,000 |
| ダイオーズ | 2,100 | 1,016.00 | 2,133,600 |
| 日本空調サービス | 9,900 | 512.00 | 5,068,800 |
| オリエンタルランド | 117,100 | 6,962.00 | 815,250,200 |
| ダスキン | 27,800 | 1,847.00 | 51,346,600 |
| 明光ネットワークジャパン | 13,500 | 1,296.00 | 17,496,000 |
| ファルコホールディングス | 5,000 | 1,318.00 | 6,590,000 |
| ラウンドワン | 34,100 | 816.00 | 27,825,600 |
| リゾートトラスト | 45,600 | 2,311.00 | 105,381,600 |
| ビー・エム・エル | 6,400 | 5,000.00 | 32,000,000 |
| ワタベウェディング | 4,300 | 421.00 | 1,810,300 |
| りらいあコミュニケーションズ | 18,000 | 1,160.00 | 20,880,000 |
| リソー教育 | 20,500 | 409.00 | 8,384,500 |
| 早稲田アカデミー | 2,000 | 854.00 | 1,708,000 |
| ユー・エス・エス | 131,100 | 1,776.00 | 232,833,600 |
| 東京個別指導学院 | 5,400 | 713.00 | 3,850,200 |
| サイバーエージェント | 28,500 | 5,720.00 | 163,020,000 |
| 楽天 | 506,900 | 1,127.00 | 571,276,300 |
| テー・オー・ダブリュー | 9,000 | 652.00 | 5,868,000 |
| セントラルスポーツ | 3,900 | 2,382.00 | 9,289,800 |
| フルキャストホールディングス | 9,900 | 857.00 | 8,484,300 |
| リゾートソリューション | 13,000 | 302.00 | 3,926,000 |
| テクノプロ・ホールディングス | 17,600 | 3,410.00 | 60,016,000 |
| インターワークス | 2,200 | 1,411.00 | 3,104,200 |
| K e e P e r 技研 | 1,300 | 1,543.00 | 2,005,900 |
| ファーストロジック | 500 | 2,408.00 | 1,204,000 |
| リブセンス | 7,300 | 490.00 | 3,577,000 |
| ジャパンマテリアル | 4,500 | 3,660.00 | 16,470,000 |
| ベクトル | 3,400 | 3,295.00 | 11,203,000 |
| ウチヤマホールディングス | 6,600 | 482.00 | 3,181,200 |
| サクセスホールディングス | 1,500 | 1,320.00 | 1,980,000 |
| キャリアリンク | 3,000 | 888.00 | 2,664,000 |
| I B J | 8,800 | 637.00 | 5,605,600 |
| アサンテ | 4,100 | 1,456.00 | 5,969,600 |
| N・フィールド | 5,100 | 1,829.00 | 9,327,900 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 1,500 | 2,438.00 | 3,657,000 |
| ライドオン・エクスプレス | 2,500 | 1,351.00 | 3,377,500 |
| E R Iホールディングス | 3,000 | 823.00 | 2,469,000 |
| アピスト | 1,800 | 2,255.00 | 4,059,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| ウィルグループ | 2,700 | 1,169.00 | 3,156,300 |
| 日本ビューホテル | 1,700 | 1,600.00 | 2,720,000 |
| リクルートホールディングス | 218,500 | 3,815.00 | 833,577,500 |
| エラン | 1,300 | 1,368.00 | 1,778,400 |
| 日本郵政 | 318,600 | 1,336.00 | 425,649,600 |
| ベルシステム24ホールディングス | 21,500 | 882.00 | 18,963,000 |
| リロ・ホールディング | 4,100 | 17,260.00 | 70,766,000 |
| 東祥 | 3,300 | 4,280.00 | 14,124,000 |
| エイチ・アイ・エス | 17,700 | 3,095.00 | 54,781,500 |
| ラックランド | 1,600 | 1,727.00 | 2,763,200 |
| 共立メンテナンス | 8,200 | 8,030.00 | 65,846,000 |
| イチネンホールディングス | 12,100 | 992.00 | 12,003,200 |
| 建設技術研究所 | 6,600 | 860.00 | 5,676,000 |
| スペース | 5,900 | 1,304.00 | 7,693,600 |
| 燦ホールディングス | 2,300 | 1,348.00 | 3,100,400 |
| スバル興業 | 9,000 | 402.00 | 3,618,000 |
| 東京テアトル | 41,000 | 117.00 | 4,797,000 |
| ナガワ | 2,000 | 3,505.00 | 7,010,000 |
| よみうりランド | 22,000 | 437.00 | 9,614,000 |
| 東京都競馬 | 75,000 | 213.00 | 15,975,000 |
| カナモト | 15,200 | 2,489.00 | 37,832,800 |
| 東京ドーム | 88,000 | 455.00 | 40,040,000 |
| 西尾レントオール | 8,800 | 2,436.00 | 21,436,800 |
| トランス・コスモス | 12,600 | 3,155.00 | 39,753,000 |
| 乃村工藝社 | 23,200 | 1,734.00 | 40,228,800 |
| 藤田観光 | 41,000 | 507.00 | 20,787,000 |
| KNT-CTホールディングス | 52,000 | 165.00 | 8,580,000 |
| 日本管財 | 9,300 | 1,565.00 | 14,554,500 |
| トーカイ | 4,900 | 3,205.00 | 15,704,500 |
| 白洋舎 | 14,000 | 253.00 | 3,542,000 |
| セコム | 112,700 | 8,279.00 | 933,043,300 |
| セントラル警備保障 | 4,900 | 2,141.00 | 10,490,900 |
| 丹青社 | 20,300 | 899.00 | 18,249,700 |
| メイテック | 13,400 | 3,775.00 | 50,585,000 |
| アサツー ディ・ケイ | 19,000 | 2,618.00 | 49,742,000 |
| 応用地質 | 10,400 | 1,153.00 | 11,991,200 |
| 船井総研ホールディングス | 15,100 | 1,557.00 | 23,510,700 |
| 進学会 | 5,300 | 520.00 | 2,756,000 |
| オオバ | 8,400 | 406.00 | 3,410,400 |
| 学究社 | 2,000 | 1,173.00 | 2,346,000 |
| ベネッセホールディングス | 36,300 | 2,464.00 | 89,443,200 |
| イオンディライト | 10,500 | 3,100.00 | 32,550,000 |

| | | | | |
|-------|-------------|----------|-----------------|--|
| ナック | 7,200 | 884.00 | 6,364,800 | |
| ニチイ学館 | 19,500 | 704.00 | 13,728,000 | |
| ダイセキ | 20,400 | 2,135.00 | 43,554,000 | |
| ステップ | 3,900 | 1,066.00 | 4,157,400 | |
| 合 計 | 171,632,600 | | 204,411,513,610 | |

(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28年 6月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 237,441,911 |
| コール・ローン | 1,450,708,578 |
| 国債証券 | 266,507,901,060 |
| 地方債証券 | 18,730,825,625 |
| 特殊債券 | 24,835,354,306 |
| 社債券 | 14,509,322,000 |
| 派生商品評価勘定 | 2,496,760 |
| 未収入金 | 1,804,101,900 |
| 未収利息 | 1,026,302,621 |
| 前払費用 | 23,103,947 |
| 流動資産合計 | 329,127,558,708 |
| 資産合計 | 329,127,558,708 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 1,483,578,881 |
| 未払利息 | 3,641 |
| その他未払費用 | 95,489 |
| 流動負債合計 | 1,483,678,011 |
| 負債合計 | 1,483,678,011 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 236,814,693,161 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 90,829,187,536 |

| | 平成28年 6月10日現在 |
|---------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 元本等合計 | 327,643,880,697 |
| 純資産合計 | 327,643,880,697 |
| 負債純資産合計 | 329,127,558,708 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成28年 6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28年 6月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 236,814,693,161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 106,698,000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 1.3835円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,835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28年 6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28年 6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28年 6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28年 6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12月11日 |
| 期首元本額 | 243,643,993,202円 |
| 期中追加設定元本額 | 19,525,271,189円 |
| 期中一部解約元本額 | 26,354,571,230円 |
| 期末元本額 | 236,814,693,161円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 日本債券インデックスファンド | 1,096,428,620円 |
| D C 日本債券インデックスファンド | 2,910,454,780円 |
| D C 日本債券インデックスファンド L | 32,817,634,911円 |
| D C バランスファンド 3 0 | 5,702,026,516円 |
| D C バランスファンド 5 0 | 3,766,243,578円 |
| D C バランスファンド 7 0 | 848,597,329円 |
| ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型） | 62,301,413円 |
| ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型） | 35,781,583円 |
| 日本債券インデックスファンド（SMA専用） | 330,534,371円 |
| 新生・4分散ファンド | 81,656,404円 |

| 区分 | 平成28年 6月10日現在 |
|---------------------------------|-----------------|
| 日本債券インデックス e | 1,819,790,190円 |
| インデックスコレクション（国内債券） | 12,068,429,445円 |
| インデックスコレクション（バランス株式30） | 10,864,455,703円 |
| インデックスコレクション（バランス株式50） | 1,685,527,027円 |
| インデックスコレクション（バランス株式70） | 639,172,265円 |
| 私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 43,351,234,019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） | 5,108,984,783円 |
| バランスVA30（適格機関投資家専用） | 1,379,178,783円 |
| バランスVA50（適格機関投資家専用） | 5,596,679,210円 |
| VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用） | 370,513,874円 |
| VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用） | 433,960,321円 |
| VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用） | 2,259,568,900円 |
| バランスVA25（適格機関投資家専用） | 6,642,632,006円 |
| バランスVA37.5（適格機関投資家専用） | 1,560,362,931円 |
| バランスVA50L（適格機関投資家専用） | 17,110,877,997円 |
| バランスVA75（適格機関投資家専用） | 203,726,385円 |
| VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用） | 11,992,805,335円 |
| VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用） | 4,029,777,626円 |
| VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用） | 334,866,419円 |
| バランスVA40（適格機関投資家専用） | 1,344,696,216円 |
| VAバランス株式40（適格機関投資家専用） | 168,062,792円 |
| バランスファンドVA（適格機関投資家専用） | 4,129,309,220円 |
| VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用） | 533,405,046円 |
| VAバランス50-50（適格機関投資家専用） | 1,130,298,995円 |
| バランスVA20（適格機関投資家専用） | 267,486,725円 |
| VAファンド25（適格機関投資家専用） | 3,470,208,165円 |
| バランスファンドVA2（適格機関投資家専用） | 5,468,057,053円 |
| バランスVA20L（適格機関投資家専用） | 341,688,381円 |
| バランスVA25L（適格機関投資家専用） | 2,444,642,517円 |
| バランスファンドVA3（適格機関投資家専用） | 40,446,520,584円 |
| 世界バランスVA25（適格機関投資家専用） | 783,132,717円 |
| 国内バランスVA30（適格機関投資家専用） | 225,295,384円 |
| 国内バランスVA25（適格機関投資家専用） | 52,808,324円 |
| VAバランス20-80（適格機関投資家専用） | 895,098,396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） | 4,643,284円 |
| 世界バランスVA20（適格機関投資家専用） | 5,136,638円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年 6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 | 13,046,995,310 |
| 地方債証券 | 229,350,247 |
| 特殊債券 | 488,978,926 |
| 社債券 | 125,982,000 |
| 合計 | 13,891,306,483 |

(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28年 6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 | 1,520,603,240 | - | 1,523,100,000 | 2,496,760 |
| | 合計 | 1,520,603,240 | - | 1,523,100,000 | 2,496,760 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|---------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 第355回利付国債(2年) | 910,000,000 | 914,104,100 | |
| | 第356回利付国債(2年) | 1,660,000,000 | 1,668,034,400 | |
| | 第358回利付国債(2年) | 1,330,000,000 | 1,337,301,700 | |
| | 第360回利付国債(2年) | 630,000,000 | 633,817,800 | |
| | 第362回利付国債(2年) | 3,400,000,000 | 3,422,712,000 | |
| | 第364回利付国債(2年) | 2,190,000,000 | 2,205,811,800 | |
| | 第106回利付国債(5年) | 3,920,000,000 | 3,943,441,600 | |
| | 第107回利付国債(5年) | 1,710,000,000 | 1,722,363,300 | |
| | 第108回利付国債(5年) | 880,000,000 | 885,095,200 | |
| | 第109回利付国債(5年) | 880,000,000 | 885,843,200 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第110回利付国債（5年） | 370,000,000 | 373,770,300 | |
| 第111回利付国債（5年） | 1,230,000,000 | 1,244,710,800 | |
| 第112回利付国債（5年） | 660,000,000 | 668,962,800 | |
| 第113回利付国債（5年） | 1,930,000,000 | 1,952,291,500 | |
| 第114回利付国債（5年） | 790,000,000 | 800,364,800 | |
| 第115回利付国債（5年） | 1,830,000,000 | 1,849,837,200 | |
| 第116回利付国債（5年） | 3,550,000,000 | 3,592,742,000 | |
| 第117回利付国債（5年） | 2,830,000,000 | 2,867,440,900 | |
| 第118回利付国債（5年） | 1,550,000,000 | 1,572,382,000 | |
| 第119回利付国債（5年） | 660,000,000 | 667,524,000 | |
| 第120回利付国債（5年） | 2,150,000,000 | 2,183,669,000 | |
| 第121回利付国債（5年） | 450,000,000 | 455,562,000 | |
| 第122回利付国債（5年） | 2,800,000,000 | 2,836,792,000 | |
| 第123回利付国債（5年） | 2,620,000,000 | 2,656,863,400 | |
| 第124回利付国債（5年） | 2,600,000,000 | 2,639,052,000 | |
| 第125回利付国債（5年） | 3,040,000,000 | 3,088,548,800 | |
| 第126回利付国債（5年） | 3,020,000,000 | 3,071,098,400 | |
| 第127回利付国債（5年） | 3,450,000,000 | 3,511,582,500 | |
| 第1回利付国債（40年） | 230,000,000 | 378,862,900 | |
| 第2回利付国債（40年） | 500,000,000 | 801,330,000 | |
| 第3回利付国債（40年） | 460,000,000 | 743,921,200 | |
| 第4回利付国債（40年） | 645,000,000 | 1,052,330,400 | |
| 第5回利付国債（40年） | 630,000,000 | 993,566,700 | |
| 第6回利付国債（40年） | 670,000,000 | 1,042,218,500 | |
| 第7回利付国債（40年） | 570,000,000 | 853,723,200 | |
| 第8回利付国債（40年） | 720,000,000 | 1,009,044,000 | |
| 第9回利付国債（40年） | 60,000,000 | 61,911,600 | |
| 第288回利付国債（10年） | 1,100,000,000 | 1,127,720,000 | |
| 第289回利付国債（10年） | 2,050,000,000 | 2,105,452,500 | |
| 第290回利付国債（10年） | 900,000,000 | 926,640,000 | |
| 第291回利付国債（10年） | 820,000,000 | 842,820,600 | |
| 第292回利付国債（10年） | 550,000,000 | 569,206,000 | |
| 第293回利付国債（10年） | 900,000,000 | 937,674,000 | |
| 第294回利付国債（10年） | 900,000,000 | 935,847,000 | |
| 第295回利付国債（10年） | 890,000,000 | 921,844,200 | |
| 第296回利付国債（10年） | 2,150,000,000 | 2,236,344,000 | |
| 第297回利付国債（10年） | 950,000,000 | 989,966,500 | |
| 第298回利付国債（10年） | 1,360,000,000 | 1,413,760,800 | |
| 第299回利付国債（10年） | 1,140,000,000 | 1,189,681,200 | |
| 第300回利付国債（10年） | 550,000,000 | 577,032,500 | |
| 第301回利付国債（10年） | 1,500,000,000 | 1,580,730,000 | |
| 第302回利付国債（10年） | 870,000,000 | 914,178,600 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|------------------------|
| 第303回利付国債(10年) | 1,640,000,000 | 1,730,298,400 | |
| 第304回利付国債(10年) | 740,000,000 | 778,309,800 | |
| 第305回利付国債(10年) | 2,200,000,000 | 2,321,836,000 | |
| 第306回利付国債(10年) | 1,370,000,000 | 1,457,008,700 | |
| 第307回利付国債(10年) | 970,000,000 | 1,027,909,000 | |
| 第308回利付国債(10年) | 970,000,000 | 1,031,410,700 | |
| 第309回利付国債(10年) | 1,040,000,000 | 1,097,626,400 | |
| 第310回利付国債(10年) | 1,400,000,000 | 1,476,454,000 | |
| 第311回利付国債(10年) | 670,000,000 | 700,799,900 | |
| 第312回利付国債(10年) | 2,037,000,000 | 2,173,438,260 | 代用有価証券 100,000,000円 |
| 第313回利付国債(10年) | 1,160,000,000 | 1,246,988,400 | |
| 第314回利付国債(10年) | 620,000,000 | 660,517,000 | |
| 第315回利付国債(10年) | 1,130,000,000 | 1,214,162,400 | |
| 第316回利付国債(10年) | 570,000,000 | 609,552,300 | |
| 第317回利付国債(10年) | 740,000,000 | 793,968,200 | |
| 第318回利付国債(10年) | 1,050,000,000 | 1,120,969,500 | |
| 第319回利付国債(10年) | 740,000,000 | 796,558,200 | |
| 第320回利付国債(10年) | 1,270,000,000 | 1,359,954,100 | |
| 第321回利付国債(10年) | 1,420,000,000 | 1,525,151,000 | |
| 第322回利付国債(10年) | 680,000,000 | 726,369,200 | |
| 第323回利付国債(10年) | 690,000,000 | 739,141,800 | |
| 第324回利付国債(10年) | 1,200,000,000 | 1,278,132,000 | |
| 第325回利付国債(10年) | 2,285,000,000 | 2,440,105,800 | |
| 第326回利付国債(10年) | 560,000,000 | 596,036,000 | |
| 第327回利付国債(10年) | 1,380,000,000 | 1,477,952,400 | |
| 第328回利付国債(10年) | 1,680,000,000 | 1,780,699,200 | |
| 第329回利付国債(10年) | 2,385,000,000 | 2,567,500,200 | |
| 第330回利付国債(10年) | 1,880,000,000 | 2,028,369,600 | |
| 第331回利付国債(10年) | 1,120,000,000 | 1,191,792,000 | |
| 第332回利付国債(10年) | 2,530,000,000 | 2,696,828,200 | |
| 第333回利付国債(10年) | 2,620,000,000 | 2,796,326,000 | |
| 第334回利付国債(10年) | 3,060,000,000 | 3,270,069,000 | |
| 第335回利付国債(10年) | 2,325,000,000 | 2,468,057,250 | |
| 第336回利付国債(10年) | 1,330,000,000 | 1,413,111,700 | |
| 第337回利付国債(10年) | 1,920,000,000 | 2,006,649,600 | |
| 第338回利付国債(10年) | 3,070,000,000 | 3,237,192,200 | |
| 第339回利付国債(10年) | 3,325,000,000 | 3,508,174,250 | |
| 第340回利付国債(10年) | 2,910,000,000 | 3,071,970,600 | |
| 第341回利付国債(10年) | 2,980,000,000 | 3,118,510,400 | |
| 第342回利付国債(10年) | 4,070,000,000 | 4,179,076,000 | |
| 第1回利付国債(30年) | 50,000,000 | 69,080,000 | |
| 第2回利付国債(30年) | 100,000,000 | 133,673,000 | |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 第3回利付国債(30年) | 140,000,000 | 185,894,800 |
| 第4回利付国債(30年) | 190,000,000 | 270,320,600 |
| 第5回利付国債(30年) | 180,000,000 | 239,128,200 |
| 第6回利付国債(30年) | 270,000,000 | 368,882,100 |
| 第7回利付国債(30年) | 390,000,000 | 530,368,800 |
| 第9回利付国債(30年) | 180,000,000 | 219,808,800 |
| 第10回利付国債(30年) | 170,000,000 | 199,178,800 |
| 第11回利付国債(30年) | 280,000,000 | 356,448,400 |
| 第12回利付国債(30年) | 370,000,000 | 497,305,900 |
| 第13回利付国債(30年) | 350,000,000 | 465,286,500 |
| 第14回利付国債(30年) | 350,000,000 | 490,934,500 |
| 第15回利付国債(30年) | 500,000,000 | 711,740,000 |
| 第16回利付国債(30年) | 250,000,000 | 357,002,500 |
| 第17回利付国債(30年) | 420,000,000 | 593,468,400 |
| 第18回利付国債(30年) | 540,000,000 | 754,644,600 |
| 第19回利付国債(30年) | 300,000,000 | 420,420,000 |
| 第20回利付国債(30年) | 290,000,000 | 418,409,100 |
| 第21回利付国債(30年) | 360,000,000 | 506,768,400 |
| 第22回利付国債(30年) | 380,000,000 | 550,882,200 |
| 第23回利付国債(30年) | 370,000,000 | 537,920,800 |
| 第24回利付国債(30年) | 260,000,000 | 379,067,000 |
| 第25回利付国債(30年) | 335,000,000 | 475,998,150 |
| 第26回利付国債(30年) | 790,000,000 | 1,142,182,000 |
| 第27回利付国債(30年) | 570,000,000 | 840,881,100 |
| 第28回利付国債(30年) | 690,000,000 | 1,024,194,600 |
| 第29回利付国債(30年) | 430,000,000 | 633,024,500 |
| 第30回利付国債(30年) | 890,000,000 | 1,298,349,800 |
| 第31回利付国債(30年) | 770,000,000 | 1,112,395,900 |
| 第32回利付国債(30年) | 900,000,000 | 1,328,760,000 |
| 第33回利付国債(30年) | 1,060,000,000 | 1,499,868,200 |
| 第34回利付国債(30年) | 980,000,000 | 1,440,766,600 |
| 第35回利付国債(30年) | 1,090,000,000 | 1,558,165,900 |
| 第36回利付国債(30年) | 1,145,000,000 | 1,645,948,950 |
| 第37回利付国債(30年) | 1,150,000,000 | 1,631,804,000 |
| 第38回利付国債(30年) | 885,000,000 | 1,240,000,050 |
| 第39回利付国債(30年) | 540,000,000 | 772,324,200 |
| 第40回利付国債(30年) | 720,000,000 | 1,012,644,000 |
| 第41回利付国債(30年) | 755,000,000 | 1,044,927,550 |
| 第42回利付国債(30年) | 690,000,000 | 955,953,600 |
| 第43回利付国債(30年) | 755,000,000 | 1,048,491,150 |
| 第44回利付国債(30年) | 760,000,000 | 1,057,935,200 |
| 第45回利付国債(30年) | 720,000,000 | 964,713,600 |
| 第46回利付国債(30年) | 910,000,000 | 1,221,793,300 |

| | | | |
|---------------|-------------|---------------|--|
| 第47回利付国債（30年） | 960,000,000 | 1,317,744,000 | |
| 第48回利付国債（30年） | 960,000,000 | 1,266,268,800 | |
| 第49回利付国債（30年） | 840,000,000 | 1,110,118,800 | |
| 第50回利付国債（30年） | 955,000,000 | 1,100,503,800 | |
| 第37回利付国債（20年） | 410,000,000 | 427,613,600 | |
| 第39回利付国債（20年） | 440,000,000 | 462,387,200 | |
| 第40回利付国債（20年） | 450,000,000 | 476,230,500 | |
| 第41回利付国債（20年） | 520,000,000 | 545,630,800 | |
| 第42回利付国債（20年） | 380,000,000 | 410,373,400 | |
| 第43回利付国債（20年） | 340,000,000 | 375,414,400 | |
| 第44回利付国債（20年） | 370,000,000 | 408,820,400 | |
| 第45回利付国債（20年） | 270,000,000 | 297,302,400 | |
| 第46回利付国債（20年） | 290,000,000 | 318,930,400 | |
| 第47回利付国債（20年） | 470,000,000 | 519,824,700 | |
| 第48回利付国債（20年） | 230,000,000 | 259,037,500 | |
| 第49回利付国債（20年） | 280,000,000 | 311,838,800 | |
| 第50回利付国債（20年） | 590,000,000 | 651,389,500 | |
| 第51回利付国債（20年） | 240,000,000 | 267,446,400 | |
| 第52回利付国債（20年） | 430,000,000 | 484,231,600 | |
| 第53回利付国債（20年） | 350,000,000 | 396,238,500 | |
| 第54回利付国債（20年） | 280,000,000 | 318,558,800 | |
| 第55回利付国債（20年） | 490,000,000 | 554,998,500 | |
| 第56回利付国債（20年） | 410,000,000 | 466,776,800 | |
| 第57回利付国債（20年） | 360,000,000 | 407,649,600 | |
| 第58回利付国債（20年） | 250,000,000 | 284,500,000 | |
| 第59回利付国債（20年） | 440,000,000 | 497,340,800 | |
| 第60回利付国債（20年） | 570,000,000 | 633,150,300 | |
| 第61回利付国債（20年） | 390,000,000 | 424,125,000 | |
| 第62回利付国債（20年） | 250,000,000 | 269,130,000 | |
| 第63回利付国債（20年） | 570,000,000 | 654,149,100 | |
| 第64回利付国債（20年） | 410,000,000 | 475,608,200 | |
| 第65回利付国債（20年） | 370,000,000 | 430,946,400 | |
| 第66回利付国債（20年） | 330,000,000 | 381,829,800 | |
| 第67回利付国債（20年） | 310,000,000 | 362,486,100 | |
| 第68回利付国債（20年） | 230,000,000 | 274,399,200 | |
| 第69回利付国債（20年） | 530,000,000 | 628,118,900 | |
| 第70回利付国債（20年） | 490,000,000 | 595,002,100 | |
| 第71回利付国債（20年） | 400,000,000 | 479,184,000 | |
| 第72回利付国債（20年） | 710,000,000 | 848,364,800 | |
| 第73回利付国債（20年） | 540,000,000 | 643,221,000 | |
| 第74回利付国債（20年） | 310,000,000 | 371,944,200 | |
| 第75回利付国債（20年） | 360,000,000 | 433,861,200 | |

| | | |
|----------------|-------------|---------------|
| 第76回利付国債(20年) | 340,000,000 | 403,692,200 |
| 第77回利付国債(20年) | 290,000,000 | 346,912,500 |
| 第78回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,834,400 |
| 第79回利付国債(20年) | 570,000,000 | 684,199,500 |
| 第80回利付国債(20年) | 250,000,000 | 302,380,000 |
| 第81回利付国債(20年) | 180,000,000 | 216,986,400 |
| 第82回利付国債(20年) | 485,000,000 | 589,226,500 |
| 第83回利付国債(20年) | 270,000,000 | 328,973,400 |
| 第84回利付国債(20年) | 590,000,000 | 713,168,400 |
| 第85回利付国債(20年) | 360,000,000 | 440,701,200 |
| 第86回利付国債(20年) | 240,000,000 | 298,562,400 |
| 第87回利付国債(20年) | 170,000,000 | 209,795,300 |
| 第88回利付国債(20年) | 530,000,000 | 661,710,300 |
| 第89回利付国債(20年) | 320,000,000 | 396,268,800 |
| 第90回利付国債(20年) | 620,000,000 | 770,740,600 |
| 第91回利付国債(20年) | 510,000,000 | 639,310,500 |
| 第92回利付国債(20年) | 790,000,000 | 977,332,700 |
| 第93回利付国債(20年) | 260,000,000 | 320,109,400 |
| 第94回利付国債(20年) | 545,000,000 | 676,939,050 |
| 第95回利付国債(20年) | 400,000,000 | 507,784,000 |
| 第96回利付国債(20年) | 300,000,000 | 374,142,000 |
| 第97回利付国債(20年) | 510,000,000 | 644,048,400 |
| 第98回利付国債(20年) | 450,000,000 | 563,148,000 |
| 第99回利付国債(20年) | 660,000,000 | 828,702,600 |
| 第100回利付国債(20年) | 730,000,000 | 928,764,400 |
| 第101回利付国債(20年) | 360,000,000 | 466,581,600 |
| 第102回利付国債(20年) | 370,000,000 | 481,621,600 |
| 第103回利付国債(20年) | 300,000,000 | 386,862,000 |
| 第104回利付国債(20年) | 360,000,000 | 455,493,600 |
| 第105回利付国債(20年) | 580,000,000 | 736,199,800 |
| 第106回利付国債(20年) | 310,000,000 | 397,327,000 |
| 第107回利付国債(20年) | 430,000,000 | 548,181,200 |
| 第108回利付国債(20年) | 620,000,000 | 774,727,200 |
| 第109回利付国債(20年) | 370,000,000 | 463,876,400 |
| 第110回利付国債(20年) | 665,000,000 | 850,854,200 |
| 第111回利付国債(20年) | 320,000,000 | 415,145,600 |
| 第112回利付国債(20年) | 730,000,000 | 937,473,300 |
| 第113回利付国債(20年) | 840,000,000 | 1,081,945,200 |
| 第114回利付国債(20年) | 600,000,000 | 775,566,000 |
| 第115回利付国債(20年) | 350,000,000 | 457,177,000 |
| 第116回利付国債(20年) | 400,000,000 | 524,008,000 |
| 第117回利付国債(20年) | 770,000,000 | 998,058,600 |
| 第118回利付国債(20年) | 500,000,000 | 643,320,000 |

| | | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|--|
| 第119回利付国債（20年） | 390,000,000 | 490,799,400 | |
| 第120回利付国債（20年） | 510,000,000 | 627,447,900 | |
| 第121回利付国債（20年） | 770,000,000 | 982,250,500 | |
| 第122回利付国債（20年） | 540,000,000 | 681,118,200 | |
| 第123回利付国債（20年） | 820,000,000 | 1,072,330,400 | |
| 第124回利付国債（20年） | 400,000,000 | 517,268,000 | |
| 第125回利付国債（20年） | 300,000,000 | 397,737,000 | |
| 第126回利付国債（20年） | 770,000,000 | 998,104,800 | |
| 第127回利付国債（20年） | 450,000,000 | 576,657,000 | |
| 第128回利付国債（20年） | 640,000,000 | 821,977,600 | |
| 第129回利付国債（20年） | 410,000,000 | 520,429,400 | |
| 第130回利付国債（20年） | 690,000,000 | 877,617,900 | |
| 第131回利付国債（20年） | 360,000,000 | 452,404,800 | |
| 第132回利付国債（20年） | 600,000,000 | 755,934,000 | |
| 第133回利付国債（20年） | 610,000,000 | 777,969,600 | |
| 第134回利付国債（20年） | 490,000,000 | 626,077,900 | |
| 第135回利付国債（20年） | 480,000,000 | 605,769,600 | |
| 第136回利付国債（20年） | 290,000,000 | 361,435,700 | |
| 第137回利付国債（20年） | 370,000,000 | 468,116,600 | |
| 第138回利付国債（20年） | 540,000,000 | 665,998,200 | |
| 第139回利付国債（20年） | 350,000,000 | 437,237,500 | |
| 第140回利付国債（20年） | 1,065,000,000 | 1,349,653,200 | |
| 第141回利付国債（20年） | 800,000,000 | 1,015,416,000 | |
| 第142回利付国債（20年） | 480,000,000 | 617,107,200 | |
| 第143回利付国債（20年） | 1,070,000,000 | 1,342,368,500 | |
| 第144回利付国債（20年） | 440,000,000 | 544,706,800 | |
| 第145回利付国債（20年） | 1,280,000,000 | 1,629,478,400 | |
| 第146回利付国債（20年） | 1,220,000,000 | 1,555,317,000 | |
| 第147回利付国債（20年） | 1,360,000,000 | 1,712,675,200 | |
| 第148回利付国債（20年） | 1,350,000,000 | 1,678,414,500 | |
| 第149回利付国債（20年） | 1,300,000,000 | 1,619,228,000 | |
| 第150回利付国債（20年） | 1,670,000,000 | 2,050,292,400 | |
| 第151回利付国債（20年） | 1,240,000,000 | 1,478,576,000 | |
| 第152回利付国債（20年） | 1,360,000,000 | 1,623,581,600 | |
| 第153回利付国債（20年） | 1,440,000,000 | 1,747,785,600 | |
| 第154回利付国債（20年） | 1,430,000,000 | 1,709,579,300 | |
| 第155回利付国債（20年） | 1,150,000,000 | 1,331,562,000 | |
| 第156回利付国債（20年） | 1,750,000,000 | 1,821,732,500 | |
| 第18回メキシコ合衆国円貨債券 | 100,000,000 | 100,946,000 | |
| 国債証券合計 | 233,442,000,000 | 266,507,901,060 | |
| 地方債証券 | | | |
| 第3回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 117,422,000 | |
| 第7回東京都公募公債（30年） | 200,000,000 | 287,826,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第11回東京都公募公債(20年) | 200,000,000 | 246,374,000 | |
| 第17回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 124,933,000 | |
| 第18回東京都公募公債(20年) | 200,000,000 | 253,962,000 | |
| 第20回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 125,349,000 | |
| 第21回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 127,995,000 | |
| 第657回東京都公募公債 | 100,000,000 | 103,242,000 | |
| 第696回東京都公募公債 | 100,000,000 | 105,896,000 | |
| 第703回東京都公募公債 | 100,000,000 | 105,389,000 | |
| 第714回東京都公募公債 | 200,000,000 | 209,458,000 | |
| 第722回東京都公募公債 | 200,000,000 | 210,804,000 | |
| 第740回東京都公募公債 | 100,000,000 | 103,777,000 | |
| 平成19年度第14回北海道公募公債(10年) | 100,000,000 | 102,847,000 | |
| 平成20年度第14回北海道公募公債 | 100,000,000 | 104,644,000 | |
| 平成21年度第6回北海道公募公債 | 100,000,000 | 104,993,000 | |
| 平成22年度第1回北海道公募公債 | 100,000,000 | 105,530,000 | |
| 平成22年度第8回北海道公募公債 | 100,000,000 | 103,963,000 | |
| 平成23年度第4回北海道公募公債 | 100,000,000 | 105,715,000 | |
| 第16回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 128,026,000 | |
| 第21回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 124,629,000 | |
| 第168回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 104,814,000 | |
| 第173回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 105,232,000 | |
| 第174回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 104,708,000 | |
| 第175回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 104,350,000 | |
| 第184回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 105,043,000 | |
| 第190回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 105,244,000 | |
| 第196回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 104,527,000 | |
| 第305回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 102,319,000 | |
| 第324回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 104,490,000 | |
| 第331回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 104,614,000 | |
| 第334回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 105,152,000 | |
| 第335回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 105,298,000 | |
| 第339回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 105,295,000 | |
| 第356回大阪府公募公債(10年) | 130,000,000 | 137,116,200 | |
| 第363回大阪府公募公債(10年) | 114,000,000 | 119,016,000 | |
| 第371回大阪府公募公債(10年) | 200,000,000 | 207,444,000 | |
| 第376回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 105,641,000 | |
| 平成20年度第6回京都府公募公債 | 100,000,000 | 104,171,000 | |
| 平成21年度第5回京都府公募公債 | 100,000,000 | 104,787,000 | |
| 平成27年度第4回京都府公募公債 | 100,000,000 | 104,758,000 | |
| 第4回兵庫県公募公債(15年) | 100,000,000 | 113,630,000 | |
| 平成21年度第1回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 104,572,000 | |
| 平成21年度第35回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 105,150,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 平成22年度第19回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 105,575,000 | |
| 平成25年度第14回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 105,284,000 | |
| 平成26年度第2回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 104,716,000 | |
| 平成19年度第4回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 102,388,000 | |
| 平成19年度第7回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 102,675,000 | |
| 平成22年度第3回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 105,455,000 | |
| 平成23年度第1回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 106,732,000 | |
| 平成23年度第5回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 105,767,000 | |
| 平成24年度第10回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,531,000 | |
| 平成25年度第1回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 103,893,000 | |
| 平成27年度第6回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,182,000 | |
| 平成20年度第6回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 104,246,000 | |
| 平成20年度第10回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 104,179,000 | |
| 平成22年度第1回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,508,000 | |
| 平成22年度第5回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,028,000 | |
| 平成22年度第14回愛知県公募公債（20年） | 100,000,000 | 127,677,000 | |
| 平成23年度第4回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,888,000 | |
| 平成23年度第8回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,582,000 | |
| 平成24年度第2回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,681,000 | |
| 平成25年度第16回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 104,892,000 | |
| 平成20年度第6回広島県公募公債 | 100,000,000 | 104,154,000 | |
| 平成20年度第1回広島県公募公債（20年） | 100,000,000 | 127,106,000 | |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 | 272,000,000 | 287,917,440 | |
| 平成24年度第2回広島県公募公債 | 100,000,000 | 105,048,000 | |
| 平成19年度第5回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 102,686,000 | |
| 平成19年度第7回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 102,861,000 | |
| 平成20年度第5回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 104,290,000 | |
| 平成21年度第2回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 104,664,000 | |
| 平成22年度第4回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 104,801,000 | |
| 平成23年度第9回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 105,489,000 | |
| 平成24年度第2回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 105,279,000 | |
| 平成24年度第6回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 105,007,000 | |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債（30年） | 100,000,000 | 144,540,000 | |
| 平成20年度第5回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,007,000 | |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債（30年） | 200,000,000 | 278,108,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 平成21年度第5回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,668,000 | |
| 平成22年度第2回福岡県公募公債（15年） | 100,000,000 | 116,926,000 | |
| 第6回千葉県公募公債（20年） | 100,000,000 | 127,352,000 | |
| 第8回千葉県公募公債（20年） | 100,000,000 | 128,262,000 | |
| 平成21年度第3回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 105,000,000 | |
| 平成22年度第4回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 104,812,000 | |
| 平成22年度第8回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 104,417,000 | |
| 平成22年度第9回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 105,496,000 | |
| 平成26年度第9回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 103,909,000 | |
| 平成20年度第2回新潟県公募公債 | 100,000,000 | 104,163,000 | |
| 平成21年度第2回新潟県公募公債 | 133,900,000 | 141,138,634 | |
| 平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年） | 139,630,000 | 146,656,181 | |
| 第56回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,529,000 | |
| 第67回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,598,000 | |
| 第70回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,757,000 | |
| 第74回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,667,000 | |
| 第76回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,404,000 | |
| 第77回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,945,000 | |
| 第78回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,627,000 | |
| 第79回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,555,000 | |
| 第82回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,191,000 | |
| 第83回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,345,000 | |
| 第84回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,228,000 | |
| 第85回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,614,000 | |
| 第87回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,233,000 | |
| 第88回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,842,000 | |
| 第93回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,657,000 | |
| 第95回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,985,000 | |
| 第96回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,129,000 | |
| 第98回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,796,000 | |
| 第99回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,844,000 | |
| 第100回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,138,000 | |
| 第101回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,414,000 | |
| 第102回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,393,000 | |
| 第103回共同発行市場公募地方債 | 177,400,000 | 186,837,680 | |
| 第105回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,872,000 | |
| 第110回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 315,627,000 | |
| 第111回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 210,690,000 | |
| 第116回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,099,000 | |
| 第117回共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 523,185,000 | |
| 第118回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 210,928,000 | |

| | | | |
|-----------------------|------------------------|----------------|-------------|
| 第120回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,549,000 | |
| 第125回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 211,598,000 | |
| 第140回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,101,000 | |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,000,000 | |
| 平成23年度第1回静岡市公募公債 | 100,000,000 | 105,622,000 | |
| 平成21年度第3回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 209,220,000 | |
| 平成21年度第7回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 105,320,000 | |
| 第1回名古屋市公募公債（20年） | 100,000,000 | 114,762,000 | |
| 第464回名古屋市公募公債（10年） | 100,000,000 | 103,704,000 | |
| 第482回名古屋市公募公債（10年） | 100,000,000 | 104,192,000 | |
| 第2回京都市公募公債（20年） | 100,000,000 | 119,435,000 | |
| 平成19年度第2回京都市公募公債 | 100,000,000 | 102,717,000 | |
| 平成21年度第5回京都市公募公債 | 100,000,000 | 105,364,000 | |
| 第5回横浜市公募公債（20年） | 100,000,000 | 119,418,000 | |
| 平成20年度第6回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 104,067,000 | |
| 平成22年度第4回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 104,143,000 | |
| 平成23年度第1回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 105,812,000 | |
| 平成25年度第6回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 105,175,000 | |
| 第25回横浜市公募公債（20年） | 100,000,000 | 124,584,000 | |
| 第26回横浜市公募公債（20年） | 100,000,000 | 125,888,000 | |
| 平成23年度第4回札幌市公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,043,000 | |
| 平成24年度第7回札幌市公募公債（10年） | 100,000,000 | 104,608,000 | |
| 第79回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 102,401,000 | |
| 平成19年度第3回福岡市公募公債 | 100,000,000 | 102,583,000 | |
| 平成19年度第5回福岡市公募公債 | 100,000,000 | 102,703,000 | |
| 平成20年度第5回福岡市公募公債 | 100,000,000 | 103,743,000 | |
| 平成23年度第5回広島市公募公債 | 151,900,000 | 160,573,490 | |
| 平成23年度第1回千葉市公募公債 | 100,000,000 | 106,640,000 | |
| 平成27年度第1回三重県公募公債 | 100,000,000 | 104,175,000 | |
| 平成24年度第1回福井県公募公債 | 100,000,000 | 105,034,000 | |
| 平成24年度第1回山梨県公募公債（10年） | 100,000,000 | 104,971,000 | |
| 平成23年度第2回岡山県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,769,000 | |
| 地方債証券合計 | 17,318,830,000 | 18,730,825,625 | |
| 特殊債券 | 第2回政府保証新関西国際空港債券 | 200,000,000 | 212,734,000 |
| | 第15回政府保証日本政策投資銀行債券 | 210,000,000 | 233,679,600 |
| | 第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 200,000,000 | 201,300,000 |
| | 第41回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 102,243,000 |
| | 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 165,179,000 |
| | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 150,000,000 | 184,629,000 |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 123,423,000 | |
| 第21回道路債券 | 100,000,000 | 140,364,000 | |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 312,762,000 | |
| 第27回道路債券 | 100,000,000 | 118,670,000 | |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 124,960,000 | |
| 第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 102,401,000 | |
| 第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 102,875,000 | |
| 第33回道路債券 | 100,000,000 | 144,608,000 | |
| 第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 102,946,000 | |
| 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 127,049,000 | |
| 第38回道路債券 | 100,000,000 | 118,360,000 | |
| 第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 126,926,000 | |
| 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 | 204,938,000 | |
| 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 | 125,550,000 | |
| 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 | 205,344,000 | |
| 第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,058,000 | |
| 第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,548,000 | |
| 第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 128,436,000 | |
| 第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,558,000 | |
| 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 | 102,659,000 | |
| 第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,008,000 | |
| 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 | 103,399,000 | |
| 第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,990,000 | |
| 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 | 103,484,000 | |
| 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 | 103,988,000 | |
| 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 | 103,584,000 | |
| 第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,096,000 | |
| 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 | 104,521,000 | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | 124,815,000 | |
| 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 | 104,388,000 | |
| 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 | 252,686,000 | |
| 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 | 104,139,000 | |
| 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 | 104,930,000 | |
| 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 | 104,330,000 | |
| 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 | 209,624,000 | |
| 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 | 257,246,000 | |
| 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 | 105,311,000 | |
| 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 | 144,132,000 | |
| 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 | 105,024,000 | |
| 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 | 105,555,000 | |
| 第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,883,000 | |
| 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 | 105,240,000 | |
| 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 | 142,189,000 | |
| 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 | 105,352,000 | |
| 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 | 126,411,000 | |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 170,000,000 | 177,077,100 | |
| 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 | 140,597,000 | |
| 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 | 106,453,000 | |
| 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 | 105,825,000 | |
| 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 | 105,560,000 | |
| 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 125,000,000 | 132,063,750 | |
| 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 | 105,331,000 | |
| 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 | 105,930,000 | |
| 第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,561,000 | |
| | 100,000,000 | 105,270,000 | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | | |
| 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 | 210,350,000 | |
| 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 | 124,407,000 | |
| 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 | 211,364,000 | |
| 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 | 125,295,000 | |
| 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 | 218,735,220 | |
| 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 | 207,728,000 | |
| 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 | 104,367,000 | |
| 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 | 106,681,000 | |
| 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 | 106,039,000 | |
| 第2回政府保証公営企業債券（15年） | 100,000,000 | 110,284,000 | |
| 第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 100,000,000 | 103,926,000 | |
| 第2回地方公営企業等金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 126,889,000 | |
| 第3回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,841,000 | |
| 第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 100,000,000 | 103,443,000 | |
| 第4回地方公共団体金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 125,679,000 | |
| 第5回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,095,000 | |
| 第5回公営企業債券（20年） | 100,000,000 | 115,377,000 | |
| 第5回地方公共団体金融機構債券（20年） | 200,000,000 | 254,330,000 | |
| 第6回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,887,000 | |
| 第7回地方公共団体金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 127,213,000 | |
| 第9回公営企業債券（20年） | 100,000,000 | 118,962,000 | |
| 第10回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,994,000 | |
| 第11回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,501,000 | |
| 第11回公営企業債券（20年） | 100,000,000 | 117,961,000 | |
| 第12回地方公共団体金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 126,472,000 | |
| 第13回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,291,000 | |
| 第14回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,646,000 | |
| 第15回公営企業債券（20年） | 100,000,000 | 119,299,000 | |
| 第15回地方公共団体金融機構債券（20年） | 300,000,000 | 379,392,000 | |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,354,000 | |
| 第17回公営企業債券（20年） | 200,000,000 | 244,832,000 | |
| 第17回地方公共団体金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 124,338,000 | |
| 第20回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,688,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,282,000 | |
| 第23回地方公共団体金融機構債券(20年) | 300,000,000 | 366,831,000 | |
| 第24回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 125,196,000 | |
| 第26回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,785,000 | |
| 第27回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,352,000 | |
| 第34回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 210,608,000 | |
| 第37回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 217,000,000 | 228,956,700 | |
| 第43回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,751,000 | |
| 第46回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,644,000 | |
| 第49回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,346,000 | |
| 第50回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 101,000,000 | 107,696,300 | |
| 第56回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 193,000,000 | 204,334,890 | |
| 第877回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 204,306,000 | |
| 第879回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 204,470,000 | |
| 第885回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 103,354,000 | |
| 第191回政府保証中小企業債券 | 200,000,000 | 204,422,000 | |
| 第16回国際協力銀行債券 | 100,000,000 | 106,819,000 | |
| 第19回国際協力銀行債券 | 100,000,000 | 106,339,000 | |
| 第16回都市再生債券 | 100,000,000 | 102,282,000 | |
| 第34回都市再生債券 | 100,000,000 | 104,590,000 | |
| 第43回都市再生債券 | 100,000,000 | 105,494,000 | |
| 第38回関西国際空港株式会社社債 | 100,000,000 | 106,136,000 | |
| 第18回政府保証中部国際空港債券 | 100,000,000 | 104,655,000 | |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 18,752,000 | 19,617,029 | |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 128,790,000 | 138,084,774 | |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 44,876,000 | 48,361,518 | |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 23,005,000 | 25,007,355 | |
| 第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 57,699,000 | 61,086,508 | |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 19,704,000 | 20,836,388 | |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 20,574,000 | 22,186,178 | |
| 第6回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 125,318,000 | |
| 第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,446,000 | 13,835,261 | |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 82,568,000 | 88,963,717 | |
| 第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 21,687,000 | 23,372,296 | |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 55,480,000 | 59,460,690 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 21,319,000 | 22,984,227 | |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 31,274,000 | 32,207,216 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 22,051,000 | 23,775,829 | |
| 第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 17,305,000 | 17,637,948 | |
| 第11回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 102,561,000 | |
| 第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 17,298,000 | 17,977,811 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 28,397,000 | 30,552,900 | |
| 第14回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 103,320,000 | |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 102,039,000 | 107,169,520 | |
| 第17回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 103,759,000 | |
| 第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 18,530,000 | 19,440,934 | |
| 第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 33,973,000 | 35,507,220 | |
| 第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 39,868,000 | 42,256,093 | |
| 第23回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 129,310,000 | |
| 第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 37,241,000 | 40,869,763 | |
| 第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 21,616,000 | 22,696,151 | |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,499,000 | 42,181,814 | |
| 第25回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,184,000 | |
| 第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,702,000 | 79,141,943 | |
| 第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 23,817,000 | 25,129,316 | |
| 第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 69,507,000 | 73,258,987 | |
| 第29回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,542,000 | |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 25,933,000 | 27,378,246 | |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 84,561,000 | 89,340,387 | |
| 第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 29,117,000 | 30,959,814 | |
| 第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 50,399,000 | 54,293,834 | |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 53,302,000 | 57,331,098 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 25,486,000 | 27,090,088 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 55,177,000 | 59,196,092 | |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 26,634,000 | 28,347,098 | |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 76,245,000 | 80,928,730 | |
| 第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 121,208,000 | 128,716,835 | |
| 第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 55,202,000 | 59,148,390 | |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 27,133,000 | 29,154,137 | |
| 第41回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 105,274,000 | |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 25,242,000 | 27,350,211 | |
| 第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 69,950,000 | 74,307,185 | |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 70,416,000 | 75,428,210 | |
| 第43回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 127,870,000 | |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 210,918,000 | 227,880,025 | |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 258,768,000 | 278,988,131 | |
| 第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 24,756,000 | 26,802,330 | |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 62,321,000 | 67,139,036 | |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 62,199,000 | 66,733,307 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 75,444,000 | 81,680,955 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 67,238,000 | 72,187,389 | |
| 第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 26,201,000 | 28,251,228 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 71,435,000 | 76,249,004 | |
| 第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,908,000 | 77,852,620 | |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 76,286,000 | 81,302,567 | |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 75,190,000 | 80,216,451 | |
| 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 81,472,000 | 85,677,584 | |
| 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 82,532,000 | 87,805,794 | |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 79,664,000 | 84,453,399 | |
| 第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 78,996,000 | 82,937,110 | |
| 第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 79,826,000 | 83,891,538 | |
| 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 83,087,000 | 88,549,970 | |
| 第85回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 123,903,000 | |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 124,360,000 | |
| 第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,264,000 | 102,703,567 | |
| 第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 201,458,000 | |
| い第758号商工債 | 100,000,000 | 100,819,000 | |
| い第770号商工債 | 100,000,000 | 100,624,000 | |
| い第771号商工債 | 100,000,000 | 100,642,000 | |
| い第773号商工債 | 200,000,000 | 201,282,000 | |
| い第786号商工債 | 100,000,000 | 100,941,000 | |
| い第749号農林債 | 100,000,000 | 100,407,000 | |
| い第751号農林債 | 100,000,000 | 100,458,000 | |
| い第765号農林債 | 100,000,000 | 100,748,000 | |
| い第766号農林債 | 300,000,000 | 302,349,000 | |
| い第769号農林債 | 100,000,000 | 100,884,000 | |
| 第275回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,407,000 | |
| 第278回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,473,000 | |
| 第280回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,341,000 | |
| 第288回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,690,000 | |
| 第295回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,761,000 | |
| 第299回信金中金債（5年） | 200,000,000 | 201,282,000 | |
| 第182号商工債（3年） | 100,000,000 | 100,233,000 | |
| 第183号商工債（3年） | 200,000,000 | 200,508,000 | |
| 第187号商工債（3年） | 200,000,000 | 200,642,000 | |
| 第21回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 101,167,000 | |
| 第5回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 104,215,000 | |
| 第6回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 104,335,000 | |
| 第20回政府保証中日本高速道路債券 | 100,000,000 | 102,515,000 | |
| 第45回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 105,685,000 | |
| 第18回西日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 212,176,000 | |
| 第20回政府保証西日本高速道路債券 | 100,000,000 | 104,482,000 | |
| 第21回政府保証西日本高速道路債券 | 100,000,000 | 105,055,000 | |

| 特殊債券合計 | | 22,620,527,000 | 24,835,354,306 | |
|---------------------|--------------------------------|----------------|----------------|--|
| 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 | 101,266,000 | |
| | 第5回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債 | 100,000,000 | 101,280,000 | |
| | 第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 101,446,000 | |
| | 第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 101,085,000 | |
| | 第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 100,217,000 | |
| | 第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債 | 100,000,000 | 100,783,000 | |
| | 第9回クレディ・スイス・エイ・ジー円貨社債 | 100,000,000 | 99,713,000 | |
| | 第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債 | 100,000,000 | 101,065,000 | |
| | 第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債 | 200,000,000 | 202,172,000 | |
| | 第11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 | 101,031,000 | |
| | 第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債 | 100,000,000 | 100,862,000 | |
| | 第21回ラボバンク・ネダーラント円貨社債 | 200,000,000 | 202,544,000 | |
| | 第20回株式会社大林組無担保社債 | 100,000,000 | 104,925,000 | |
| | 第20回清水建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,976,000 | |
| | 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 | 100,499,000 | |
| | 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 | 102,914,000 | |
| | 第21回株式会社ニチレイ無担保社債 | 100,000,000 | 102,540,000 | |
| | 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 | 103,909,000 | |
| | 第29回王子製紙株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,420,000 | |
| | 第43回住友化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,708,000 | |
| | 第9回宇部興産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,963,000 | |
| | 第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,848,000 | |
| | 第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,459,000 | |
| | 第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,673,000 | |
| | 第5回東海ゴム工業無担保社債 | 100,000,000 | 100,401,000 | |
| | 第14回旭硝子株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,120,000 | |
| | 第67回新日本製鐵株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,481,000 | |
| | 第23回日新製鋼株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,377,000 | |
| | 第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,877,000 | |
| | 第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,583,000 | |
| 第22回株式会社豊田自動織機無担保社債 | 100,000,000 | 104,758,000 | | |
| 第12回株式会社クボタ無担保社債 | 100,000,000 | 100,392,000 | | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第16回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 105,083,000 | |
| 第1回日本電産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,427,000 | |
| 第2回日本電産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,652,000 | |
| 第13回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,747,000 | |
| 第26回ソニー株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,542,000 | |
| 第4回株式会社堀場製作所無担保社債 | 100,000,000 | 102,102,000 | |
| 第22回三菱重工工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,507,000 | |
| 第24回三菱重工工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,744,000 | |
| 第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 101,394,000 | |
| 第57回日産自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,687,000 | |
| 第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,301,000 | |
| 第18回株式会社ニコン無担保社債 | 100,000,000 | 101,548,000 | |
| 第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,055,000 | |
| 第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,585,000 | |
| 第92回丸紅株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,968,000 | |
| 第69回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 124,628,000 | |
| 第39回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,124,000 | |
| 第70回三菱商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,950,000 | |
| 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 | 117,777,000 | |
| 第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 105,147,000 | |
| 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 | 106,511,000 | |
| 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 | 107,371,000 | |
| 第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 107,440,000 | |
| 第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 113,759,000 | |
| 第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 104,884,000 | |
| 第140回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,382,000 | |
| 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 | 103,493,000 | |
| 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 | 108,836,000 | |
| 第5回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,637,000 | |
| 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 | 105,480,000 | |
| 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 | 106,591,000 | |
| 第24回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 107,205,000 | |
| 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 | 118,383,000 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | 107,575,000 | |
| 第6回興銀リース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,184,000 | |
| 第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 100,519,000 | |
| 第9回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 102,200,000 | |
| 第50回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,496,000 | |
| 第163回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,779,000 | |
| 第167回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,648,000 | |
| 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 | 100,462,000 | |
| 第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,169,000 | |
| 第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債 | 100,000,000 | 104,367,000 | |
| 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 | 106,790,000 | |
| 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 | 101,298,000 | |
| 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 | 101,406,000 | |
| 第40回三井不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,859,000 | |
| 第47回三井不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 121,468,000 | |
| 第83回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 122,525,000 | |
| 第104回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,411,000 | |
| 第97回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,879,000 | |
| 第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,056,000 | |
| 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 | 106,094,000 | |
| 第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債 | 100,000,000 | 101,087,000 | |
| 第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,404,000 | |
| 第31回京王電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,008,000 | |
| 第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 112,465,000 | |
| 第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 108,268,000 | |
| 第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 122,529,000 | |
| 第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 102,956,000 | |
| 第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 127,409,000 | |
| 第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 105,153,000 | |
| 第7回西日本旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 106,046,000 | |
| 第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 116,904,000 | |
| 第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 101,835,000 | |

| | | | |
|---------------------------|----------------|-----------------|--|
| 第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 126,990,000 | |
| 第8回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 124,417,000 | |
| 第10回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 127,139,000 | |
| 第13回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 121,642,000 | |
| 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 | 105,180,000 | |
| 第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,050,000 | |
| 第53回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 100,000,000 | 102,350,000 | |
| 第18回KDDI株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,311,000 | |
| 第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債 | 100,000,000 | 103,956,000 | |
| 第457回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,143,000 | |
| 第521回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,072,000 | |
| 第522回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,414,000 | |
| 第539回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,244,000 | |
| 第542回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,359,000 | |
| 第544回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,337,000 | |
| 第482回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 106,372,000 | |
| 第490回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,282,000 | |
| 第500回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,454,000 | |
| 第448回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,105,000 | |
| 第463回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,852,000 | |
| 第495回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,796,000 | |
| 第370回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,266,000 | |
| 第377回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 106,813,000 | |
| 第303回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,082,000 | |
| 第307回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 107,303,000 | |
| 第479回東北電力株式会社社債 | 200,000,000 | 202,240,000 | |
| 第253回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,847,000 | |
| 第371回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 107,690,000 | |
| 第431回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,090,000 | |
| 第436回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,005,000 | |
| 第315回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,299,000 | |
| 第316回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,032,000 | |
| 第9回沖縄電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,535,000 | |
| 第33回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,243,000 | |
| 第38回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,683,000 | |
| 第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,700,000 | |
| 第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,696,000 | |
| 第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債 | 100,000,000 | 102,857,000 | |
| 社債券合計 | 13,800,000,000 | 14,509,322,000 | |
| 合計 | | 324,583,402,991 | |

(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28年 6月10日現在 |
|----------------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 6,079,280,219 |
| 金銭信託 | 159,602,578 |
| コール・ローン | 975,130,411 |
| 株式 | 202,772,232,886 |
| 投資信託受益証券 | 206,691,828 |
| 投資証券 | 5,539,317,568 |
| 派生商品評価勘定 | 336,279,190 |
| 未収入金 | 2,233,504 |
| 未収配当金 | 481,667,854 |
| 差入委託証拠金 | 2,455,201,170 |
| 流動資産合計 | 219,007,637,208 |
| 資産合計 | 219,007,637,208 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 21,513,172 |
| 前受金 | 333,826,847 |
| 未払金 | 12,663,937 |
| 未払解約金 | 240,555,524 |
| 未払利息 | 2,447 |
| その他未払費用 | 49,319 |
| 流動負債合計 | 608,611,246 |
| 負債合計 | 608,611,246 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 111,407,571,420 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 106,991,454,542 |
| 元本等合計 | 218,399,025,962 |
| 純資産合計 | 218,399,025,962 |
| 負債純資産合計 | 219,007,637,208 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成28年 6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 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> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | (1) 受取配当金 |

| | 平成28年 6月10日現在 |
|--|--|
| | <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 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 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28年 6月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 111,407,571,420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 1.9604円 (1万口当たり純資産額) (19,604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28年 6月10日現在 |
|-------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びそのリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p> |

| | 平成28年 6月10日現在 |
|------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p> |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 平成28年 6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ぬ。 |
| 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つた場合、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28年 6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12月11日 |
| 期首元本額 | 104,088,914,553円 |
| 期中追加設定元本額 | 14,059,231,895円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,740,575,028円 |
| 期末元本額 | 111,407,571,420円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国株式インデックスファンド | 2,323,840,055円 |
| DC外国株式インデックスファンド | 4,601,889,901円 |
| DC外国株式インデックスファンドL | 17,985,748,028円 |
| DCバランスファンド30 | 673,649,068円 |
| DCバランスファンド50 | 1,333,990,578円 |
| DCバランスファンド70 | 724,317,527円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型) | 45,754,208円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型) | 26,200,532円 |
| 新生・4分散ファンド | 60,114,620円 |
| グローバル・インデックス・バランス・ファンド | 496,334,796円 |
| 外国株式インデックスe | 6,919,900,945円 |
| インデックスコレクション(外国株式) | 4,205,922,263円 |
| インデックスコレクション(バランス株式30) | 1,269,428,297円 |
| インデックスコレクション(バランス株式50) | 585,518,383円 |
| インデックスコレクション(バランス株式70) | 542,274,370円 |
| 私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用) | 24,517,160,369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) | 1,212,340,456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) | 2,033,474,367円 |
| バランスVA30(適格機関投資家専用) | 422,228,393円 |
| バランスVA50(適格機関投資家専用) | 3,863,104,331円 |
| VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用) | 220,977,490円 |
| VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用) | 790,044,905円 |
| VAバランス株式30(適格機関投資家専用) | 56,031,352円 |
| VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用) | 5,207,816,501円 |
| バランスVA25(適格機関投資家専用) | 1,193,698,764円 |
| バランスVA37.5(適格機関投資家専用) | 661,088,038円 |
| バランスVA50L(適格機関投資家専用) | 12,478,054,440円 |
| バランスVA75(適格機関投資家専用) | 1,166,718,070円 |

| 区分 | 平成28年 6月10日現在 |
|---|----------------|
| V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用） | 9,952,303,118円 |
| V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用） | 1,858,110,810円 |
| V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用） | 57,896,450円 |
| バランスV A 4 0（適格機関投資家専用） | 616,354,008円 |
| V Aバランス株式 4 0（適格機関投資家専用） | 115,402,877円 |
| V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用） | 276,652,465円 |
| V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用） | 781,601,381円 |
| バランスV A 2 0（適格機関投資家専用） | 46,836,725円 |
| V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用） | 1,200,056,380円 |
| バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用） | 32,430,044円 |
| バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用） | 218,820,971円 |
| V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用） | 618,836,933円 |
| 私募外国株式インデックスファンド A L（適格機関投資家専用） | 14,648,211円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年 6月10日現在 |
|----------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 17,940,234,341 |
| 投資信託受益証券 | 10,242,727 |
| 投資証券 | 505,271,787 |
| 合計 | 18,455,748,855 |

(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28年 6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 | 9,413,867,709 | 9,747,694,556 | 333,826,847 |
| | 買建 | | | |
| 合計 | | 9,413,867,709 | 9,747,694,556 | 333,826,847 |

(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28年 6月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|-----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,006,620,199 | - | 987,294,160 | 19,326,039 |
| | アメリカドル | 773,016,571 | - | 758,912,160 | 14,104,411 |
| | ユーロ | 139,044,528 | - | 135,520,000 | 3,524,528 |
| | イギリスポンド | 94,559,100 | - | 92,862,000 | 1,697,100 |
| | 売建 | 180,166,210 | - | 179,901,000 | 265,210 |
| | アメリカドル | 80,319,000 | - | 80,310,000 | 9,000 |
| | カナダドル | 21,028,500 | - | 21,025,000 | 3,500 |
| | ユーロ | 42,590,170 | - | 42,350,000 | 240,170 |
| | オーストラリアドル | 23,808,990 | - | 23,805,000 | 3,990 |
| | 香港ドル | 12,419,550 | - | 12,411,000 | 8,550 |
| | 合計 | 1,186,786,409 | - | 1,167,195,160 | 19,060,829 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 (株) | 評価額 | | 備考 |
|--------|-------------------------|------------|--------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | ANADARKO PETROLEUM CORP | 33,356 | 54.48 | 1,817,234.88 | |
| | ANTERO RESOURCES CORP | 11,492 | 29.34 | 337,175.28 | |
| | APACHE CORP | 24,989 | 55.83 | 1,395,135.87 | |
| | BAKER HUGHES | 27,051 | 47.55 | 1,286,275.05 | |
| | CABOT OIL & GAS CORP | 29,537 | 25.90 | 765,008.30 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 12,972 | 36.55 | 474,126.60 | |
| | CHEVRON CORP | 123,356 | 102.81 | 12,682,230.36 | |
| | CIMAREX ENERGY CO | 5,950 | 120.33 | 715,963.50 | |
| | COLUMBIA PIPELINE GROUP | 24,756 | 25.54 | 632,268.24 | |
| | CONCHO RESOURCES INC | 8,575 | 124.47 | 1,067,330.25 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CONOCOPHILLIPS | 80,305 | 46.57 | 3,739,803.85 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 7,284 | 43.15 | 314,304.60 |
| CORE LABORATORIES N.V. | 2,361 | 131.20 | 309,763.20 |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 29,630 | 37.45 | 1,109,643.50 |
| EOG RESOURCES INC | 35,779 | 84.58 | 3,026,187.82 |
| EQT CORPORATION | 11,792 | 77.91 | 918,714.72 |
| EXXON MOBIL | 271,491 | 90.67 | 24,616,088.97 |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 13,591 | 28.27 | 384,217.57 |
| HALLIBURTON CO | 56,459 | 45.50 | 2,568,884.50 |
| HELMERICH & PAYNE | 7,418 | 67.24 | 498,786.32 |
| HESS CORP | 17,887 | 60.38 | 1,080,017.06 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 10,931 | 26.84 | 293,388.04 |
| KINDER MORGAN INC | 123,828 | 18.08 | 2,238,810.24 |
| MARATHON OIL CORP | 56,637 | 14.26 | 807,643.62 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 35,105 | 36.95 | 1,297,129.75 |
| MURPHY OIL CORP | 9,351 | 31.81 | 297,455.31 |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 23,957 | 36.34 | 870,597.38 |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 13,608 | 41.27 | 561,602.16 |
| NOBLE ENERGY INC | 26,454 | 37.48 | 991,495.92 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 49,653 | 75.60 | 3,753,766.80 |
| ONEOK INC | 14,928 | 46.53 | 694,599.84 |
| PHILLIPS 66 | 31,484 | 81.13 | 2,554,296.92 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES | 10,562 | 164.20 | 1,734,280.40 |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 22,274 | 10.94 | 243,677.56 |
| RANGE RESOURCES CORP | 11,219 | 46.21 | 518,429.99 |
| SCHLUMBERGER | 90,119 | 79.96 | 7,205,915.24 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 29,361 | 14.74 | 432,781.14 |
| SPECTRA ENERGY CORP | 43,853 | 33.76 | 1,480,477.28 |
| TESORO CORP | 7,780 | 78.75 | 612,675.00 |
| VALERO ENERGY CORP | 30,708 | 53.81 | 1,652,397.48 |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 60,382 | 6.76 | 408,182.32 |
| WILLIAMS COS | 48,896 | 23.28 | 1,138,298.88 |
| AIR PRODUCTS&CHEMICALS | 13,514 | 146.60 | 1,981,152.40 |
| ALBEMARLE CORP | 7,122 | 80.26 | 571,611.72 |
| ALCOA | 80,917 | 9.84 | 796,223.28 |
| ASHLAND INC | 4,346 | 117.23 | 509,481.58 |
| AVERY DENNISON CORP | 6,122 | 76.57 | 468,761.54 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 13,521 | 27.88 | 376,965.48 |
| BALL CORP | 9,456 | 74.88 | 708,065.28 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 9,613 | 70.92 | 681,753.96 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 15,652 | 29.79 | 466,273.08 |
| CROWN HOLDINGS INC | 9,048 | 54.25 | 490,854.00 |

| | | | |
|------------------------------------|--------|--------|--------------|
| DOW CHEMICAL CO | 73,036 | 53.59 | 3,913,999.24 |
| DU PONT (E. I.) DE NEMOURS | 57,664 | 67.90 | 3,915,385.60 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 9,372 | 71.78 | 672,722.16 |
| ECOLAB INC | 17,545 | 120.79 | 2,119,260.55 |
| FMC CORP | 7,713 | 50.35 | 388,349.55 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 74,799 | 10.90 | 815,309.10 |
| INT'L PAPER CO | 24,778 | 43.59 | 1,080,073.02 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 5,157 | 129.80 | 669,378.60 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 24,500 | 79.92 | 1,958,040.00 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 4,254 | 189.23 | 804,984.42 |
| MONSANTO CO | 29,200 | 109.99 | 3,211,708.00 |
| MOSAIC CO/THE | 20,918 | 27.53 | 575,872.54 |
| NEWMONT MINING CORP | 33,828 | 35.90 | 1,214,425.20 |
| NUCOR CORP | 19,724 | 50.55 | 997,048.20 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 6,215 | 69.64 | 432,812.60 |
| PPG INDUSTRIES INC | 17,537 | 110.43 | 1,936,610.91 |
| PRAXAIR INC | 18,413 | 113.44 | 2,088,770.72 |
| SEALED AIR CORP | 13,014 | 47.19 | 614,130.66 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 5,200 | 293.03 | 1,523,756.00 |
| VALSPAR CORP/THE | 5,158 | 108.46 | 559,436.68 |
| VULCAN MATERIALS CO | 8,251 | 116.83 | 963,964.33 |
| WESTROCK CO | 16,359 | 40.30 | 659,267.70 |
| WR GRACE & CO | 4,719 | 77.53 | 365,864.07 |
| 3 M COMPANY | 39,460 | 170.13 | 6,713,329.80 |
| ACUITY BRANDS INC | 2,799 | 258.40 | 723,261.60 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 12,272 | 39.14 | 480,326.08 |
| AGCO CORP | 3,843 | 54.54 | 209,597.22 |
| AMETEK INC | 15,343 | 48.79 | 748,584.97 |
| B/E AEROSPACE INC | 7,322 | 50.10 | 366,832.20 |
| BOEING CO | 41,223 | 133.10 | 5,486,781.30 |
| CATERPILLAR | 38,120 | 77.16 | 2,941,339.20 |
| CUMMINS INC | 10,611 | 118.64 | 1,258,889.04 |
| DANAHER CORP | 40,027 | 100.39 | 4,018,310.53 |
| DEERE&CO | 17,966 | 86.95 | 1,562,143.70 |
| DOVER CORP | 9,943 | 72.08 | 716,691.44 |
| EATON CORP | 30,241 | 62.77 | 1,898,227.57 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 42,713 | 53.59 | 2,288,989.67 |
| FASTENAL CO | 19,954 | 45.35 | 904,913.90 |
| FLOWSERVE CORP | 7,966 | 52.27 | 416,382.82 |
| FLUOR CORP | 9,602 | 53.36 | 512,362.72 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 9,904 | 58.56 | 579,978.24 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 17,007 | 141.98 | 2,414,653.86 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| GENERAL ELECTRIC CO | 609,227 | 30.24 | 18,423,024.48 |
| GRAINGER (WW) INC | 3,721 | 227.17 | 845,299.57 |
| HONEYWELL INTL INC | 47,630 | 117.21 | 5,582,712.30 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 21,165 | 108.80 | 2,302,752.00 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 16,344 | 65.69 | 1,073,637.36 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 8,534 | 52.51 | 448,120.34 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 16,000 | 55.42 | 886,720.00 |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS | 5,138 | 147.90 | 759,910.20 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 17,946 | 240.67 | 4,319,063.82 |
| MASCO CORP | 22,573 | 31.84 | 718,724.32 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 10,955 | 218.58 | 2,394,543.90 |
| PACCAR INC | 22,055 | 56.02 | 1,235,521.10 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 8,767 | 115.36 | 1,011,361.12 |
| PENTAIR PLC | 11,156 | 60.16 | 671,144.96 |
| RAYTHEON COMPANY | 19,772 | 136.61 | 2,701,052.92 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 8,345 | 118.74 | 990,885.30 |
| ROCKWELL COLLIN | 8,295 | 90.45 | 750,282.75 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 6,904 | 174.25 | 1,203,022.00 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 10,829 | 36.63 | 396,666.27 |
| SMITH (A.O.) CORP | 5,197 | 85.22 | 442,888.34 |
| SNAP-ON INC | 3,870 | 160.35 | 620,554.50 |
| STANLEY BLACK&DECKER | 9,486 | 114.37 | 1,084,913.82 |
| TEXTRON | 17,560 | 39.37 | 691,337.20 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 3,294 | 266.23 | 876,961.62 |
| UNITED RENTALS INC | 6,427 | 74.11 | 476,304.97 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 52,243 | 102.32 | 5,345,503.76 |
| WABCO HOLDINGS INC | 3,642 | 108.68 | 395,812.56 |
| WABTEC CORP | 6,188 | 77.04 | 476,723.52 |
| XYLEM INC | 11,733 | 46.30 | 543,237.90 |
| CINTAS CORP | 5,410 | 95.54 | 516,871.40 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 2,153 | 127.43 | 274,356.79 |
| EQUIFAX INC | 7,486 | 125.94 | 942,786.84 |
| IHS INC-CLASS A | 4,624 | 118.45 | 547,712.80 |
| MANPOWER GROUP | 4,737 | 79.19 | 375,123.03 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 24,514 | 54.98 | 1,347,779.72 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 15,628 | 49.80 | 778,274.40 |
| ROBERT HALF INTL INC | 7,911 | 40.99 | 324,271.89 |
| STERICYCLE INC | 5,353 | 100.86 | 539,903.58 |
| TYCO INTERNATIONAL PLC | 26,388 | 43.69 | 1,152,891.72 |
| VERISK ANALYTICS INC | 9,877 | 79.58 | 786,011.66 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 7,954 | 72.79 | 578,971.66 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 29,958 | 62.62 | 1,875,969.96 |

| | | | |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|
| AMERCO | 376 | 374.91 | 140,966.16 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 9,742 | 33.40 | 325,382.80 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 9,220 | 74.11 | 683,294.20 |
| CSX CORP | 64,606 | 27.05 | 1,747,592.30 |
| DELTA AIR LINES INC | 13,038 | 42.40 | 552,811.20 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 12,578 | 49.98 | 628,648.44 |
| FEDEX CORP | 17,061 | 164.11 | 2,799,880.71 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 5,521 | 81.73 | 451,231.33 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 7,039 | 90.18 | 634,777.02 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 19,796 | 85.60 | 1,694,537.60 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 10,905 | 44.19 | 481,891.95 |
| UNION PACIFIC CORP | 55,423 | 89.39 | 4,954,261.97 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 5,600 | 46.70 | 261,520.00 |
| UNITED PARCEL SERVICE B | 45,156 | 104.97 | 4,740,025.32 |
| AUTOLIV INC | 5,464 | 124.86 | 682,235.04 |
| BORGWARNER INC | 14,286 | 34.66 | 495,152.76 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 18,416 | 68.93 | 1,269,414.88 |
| FORD MOTOR COMPANY | 240,893 | 13.26 | 3,194,241.18 |
| GENERAL MOTORS CO | 90,570 | 29.36 | 2,659,135.20 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 17,142 | 27.74 | 475,519.08 |
| HARLEY-DAVIDSON | 12,832 | 45.15 | 579,364.80 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 42,954 | 44.89 | 1,928,205.06 |
| LEAR CORP | 4,994 | 117.73 | 587,943.62 |
| TESLA MOTORS INC | 6,453 | 229.36 | 1,480,060.08 |
| COACH INC | 18,590 | 38.64 | 718,317.60 |
| DR HORTON INC | 22,736 | 31.73 | 721,413.28 |
| GARMIN LTD | 6,761 | 43.24 | 292,345.64 |
| HANESBRANDS INC | 25,195 | 26.83 | 675,981.85 |
| HARMAN INTL INDS INC | 4,546 | 79.45 | 361,179.70 |
| HASBRO INC | 6,950 | 87.07 | 605,136.50 |
| LEGGETT & PLATT INC | 8,617 | 50.87 | 438,346.79 |
| LENNAR CORP-CL A | 11,135 | 47.66 | 530,694.10 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 6,418 | 72.32 | 464,149.76 |
| MATTEL INC | 21,658 | 31.99 | 692,839.42 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 12,355 | 50.74 | 626,892.70 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 3,834 | 199.47 | 764,767.98 |
| NEWELL BRANDS INC | 28,568 | 48.96 | 1,398,689.28 |
| NIKE B | 88,193 | 54.94 | 4,845,323.42 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 3,977 | 84.53 | 336,175.81 |
| PULTE GROUP INC | 17,706 | 19.58 | 346,683.48 |
| PVH CORP | 4,835 | 97.21 | 470,010.35 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 3,612 | 96.18 | 347,402.16 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| TOLL BROTHERS INC | 10,429 | 29.43 | 306,925.47 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 11,148 | 38.66 | 430,981.68 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 11,148 | 36.14 | 402,888.72 |
| VF CORP | 22,417 | 63.16 | 1,415,857.72 |
| WHIRLPOOL CORP | 4,901 | 179.69 | 880,660.69 |
| ARAMARK | 14,632 | 33.87 | 495,585.84 |
| BLOCK H & R INC | 13,183 | 21.54 | 283,961.82 |
| CARNIVAL CORPORATION | 28,176 | 48.03 | 1,353,293.28 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 1,910 | 415.79 | 794,158.90 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 7,389 | 68.33 | 504,890.37 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 3,502 | 127.48 | 446,434.96 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 37,714 | 21.60 | 814,622.40 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 29,502 | 47.27 | 1,394,559.54 |
| MARRIOTT INTL A | 13,685 | 67.22 | 919,905.70 |
| MCDONALD'S CORP | 58,856 | 122.79 | 7,226,928.24 |
| MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR | 16,011 | 13.92 | 222,873.12 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 28,831 | 25.09 | 723,369.79 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 10,214 | 45.61 | 465,860.54 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 10,964 | 76.24 | 835,895.36 |
| STARBUCKS CORP | 96,539 | 55.58 | 5,365,637.62 |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 10,756 | 74.52 | 801,537.12 |
| WYMDHAM WORLDWIDE CORP | 7,682 | 68.38 | 525,295.16 |
| WYNN RESORTS LTD | 5,326 | 100.79 | 536,807.54 |
| YUM BRANDS INC | 26,926 | 83.73 | 2,254,513.98 |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 11,519 | 34.70 | 399,709.30 |
| CBS CORP-CL B | 28,471 | 53.00 | 1,508,963.00 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 14,292 | 222.97 | 3,186,687.24 |
| COMCAST CORP-CL A | 159,014 | 62.93 | 10,006,751.02 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 10,616 | 27.33 | 290,135.28 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 15,717 | 26.29 | 413,199.93 |
| DISH NETWORK CORPORATION-A | 13,850 | 55.36 | 766,736.00 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS | 27,462 | 24.19 | 664,305.78 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 19,900 | 38.16 | 759,384.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C | 39,255 | 36.61 | 1,437,125.55 |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 13,035 | 31.73 | 413,600.55 |
| LIBERTY SIRIUSXM-A | 4,837 | 32.31 | 156,283.47 |
| NEWS CORP-CLASS A | 22,501 | 11.69 | 263,036.69 |
| OMNICOM GROUP | 15,064 | 84.40 | 1,271,401.60 |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 6,082 | 64.86 | 394,478.52 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 134,011 | 3.98 | 534,033.83 |
| TEGNA INC | 12,439 | 22.50 | 279,877.50 |
| THE WALT DISNEY CO | 101,503 | 97.84 | 9,931,053.52 |

| | | | |
|--------------------------------------|--------|----------|---------------|
| TIME WARNER INC | 51,950 | 75.01 | 3,896,769.50 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A | 73,091 | 29.32 | 2,143,028.12 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B | 27,151 | 29.41 | 798,510.91 |
| VIACOM INC-CLASS B | 21,671 | 44.41 | 962,409.11 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 4,524 | 156.78 | 709,272.72 |
| AMAZON.COM | 26,177 | 727.65 | 19,047,694.05 |
| AUTONATION INC | 5,903 | 50.34 | 297,157.02 |
| AUTOZONE INC | 1,927 | 760.07 | 1,464,654.89 |
| BED BATH & BEYOND INC | 11,112 | 44.00 | 488,928.00 |
| BEST BUY COMPANY INC | 19,607 | 30.10 | 590,170.70 |
| CARMAX INC | 13,083 | 51.81 | 677,830.23 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 5,631 | 42.43 | 238,923.33 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 18,382 | 91.69 | 1,685,445.58 |
| DOLLAR TREE INC | 15,845 | 91.97 | 1,457,264.65 |
| EXPEDIA INC | 7,771 | 109.11 | 847,893.81 |
| FOOT LOCKER INC | 8,666 | 55.65 | 482,262.90 |
| GAP | 14,100 | 19.31 | 272,271.00 |
| GENUINE PARTS CO | 9,408 | 97.23 | 914,739.84 |
| HOME DEPOT | 83,105 | 129.30 | 10,745,476.50 |
| KOHL'S CORP | 13,132 | 37.44 | 491,662.08 |
| L BRANDS INC | 15,442 | 69.02 | 1,065,806.84 |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP-A | 27,359 | 25.99 | 711,060.41 |
| LKQ CORP | 20,599 | 33.11 | 682,032.89 |
| LOWES COMPANIES | 59,453 | 78.67 | 4,677,167.51 |
| MACY'S INC | 20,817 | 33.60 | 699,451.20 |
| NETFLIX INC | 28,381 | 97.09 | 2,755,511.29 |
| NORDSTROM INC | 9,072 | 39.57 | 358,979.04 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 6,525 | 262.35 | 1,711,833.75 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 3,228 | 1,340.07 | 4,325,745.96 |
| ROSS STORES INC | 25,696 | 54.22 | 1,393,237.12 |
| SIGNET JEWELERS LTD | 4,782 | 89.60 | 428,467.20 |
| STAPLES INC | 41,105 | 8.75 | 359,668.75 |
| TARGET (DAYTON HUDSON) | 38,076 | 67.69 | 2,577,364.44 |
| TIFFANY & CO | 8,650 | 62.52 | 540,798.00 |
| TJX COMPANIES INC | 43,490 | 77.31 | 3,362,211.90 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 8,448 | 93.83 | 792,675.84 |
| TRIPADVISOR INC | 7,575 | 69.47 | 526,235.25 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 3,778 | 240.01 | 906,757.78 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 28,390 | 154.05 | 4,373,479.50 |
| CVS HEALTH CORP | 71,687 | 96.99 | 6,952,922.13 |
| KROGER CO | 60,316 | 36.58 | 2,206,359.28 |
| RITE AID CORP | 62,097 | 7.57 | 470,074.29 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| SYSCO CORP | 35,185 | 49.00 | 1,724,065.00 |
| WAL-MART STORES | 103,787 | 71.09 | 7,378,217.83 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 60,393 | 79.01 | 4,771,650.93 |
| WHOLE FOODS MKT INC | 22,540 | 34.78 | 783,941.20 |
| ALTRIA GROUP INC | 126,905 | 65.86 | 8,357,963.30 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 39,226 | 43.83 | 1,719,275.58 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 7,664 | 98.89 | 757,892.96 |
| BUNGE LIMITED | 8,891 | 66.16 | 588,228.56 |
| CAMPBELL SOUP CO (US) | 13,936 | 62.51 | 871,139.36 |
| COCA-COLA CO | 269,606 | 45.76 | 12,337,170.56 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 14,450 | 39.50 | 570,775.00 |
| CONAGRA | 26,895 | 47.15 | 1,268,099.25 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 11,290 | 154.10 | 1,739,789.00 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 11,892 | 92.37 | 1,098,464.04 |
| GENERAL MILLS INC | 38,989 | 65.34 | 2,547,541.26 |
| HERSHEY FOODS CORPORATION | 9,296 | 96.42 | 896,320.32 |
| HORMEL FOODS CORP | 17,982 | 34.90 | 627,571.80 |
| INGREDION INC | 4,931 | 123.05 | 606,759.55 |
| JM SMUCKER CO | 7,694 | 143.23 | 1,102,011.62 |
| KELLOGG CO | 17,304 | 77.69 | 1,344,347.76 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 39,444 | 85.62 | 3,377,195.28 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 7,303 | 100.10 | 731,030.30 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY | 12,720 | 84.17 | 1,070,642.40 |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 12,795 | 103.38 | 1,322,747.10 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 102,241 | 45.22 | 4,623,338.02 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 9,628 | 155.01 | 1,492,436.28 |
| PEPSICO INC | 94,412 | 103.66 | 9,786,747.92 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 101,614 | 101.78 | 10,342,272.92 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 55,832 | 51.06 | 2,850,781.92 |
| TYSON FOODS INC | 18,965 | 61.28 | 1,162,175.20 |
| WHITEWAVE FOODS CO | 11,185 | 45.96 | 514,062.60 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 8,101 | 99.83 | 808,722.83 |
| CLOROX COMPANY | 8,049 | 130.91 | 1,053,694.59 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 55,292 | 72.34 | 3,999,823.28 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 3,372 | 82.95 | 279,707.40 |
| ESTEE LAUDER CO-CL A | 14,620 | 92.28 | 1,349,133.60 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 23,614 | 130.69 | 3,086,113.66 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 177,148 | 83.17 | 14,733,399.16 |
| ABBOTT LABORATORIES | 97,323 | 38.87 | 3,782,945.01 |
| AETNA INC | 22,874 | 121.27 | 2,773,929.98 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 12,031 | 76.17 | 916,401.27 |
| ANTHEM INC | 17,031 | 133.75 | 2,277,896.25 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|--------------|
| BARD C R INC | 4,582 | 226.52 | 1,037,914.64 |
| BAXTER INTERNATIONAL | 32,905 | 44.75 | 1,472,498.75 |
| BECTON DICKINSON & CO | 13,889 | 170.23 | 2,364,324.47 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 87,798 | 23.32 | 2,047,449.36 |
| CARDINAL HEALTH | 21,770 | 79.29 | 1,726,143.30 |
| CENTENE CORP | 11,673 | 68.36 | 797,966.28 |
| CERNER CORP | 19,065 | 56.96 | 1,085,942.40 |
| CIGNA CORP | 16,810 | 129.25 | 2,172,692.50 |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 10,780 | 77.21 | 832,323.80 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 15,960 | 64.43 | 1,028,302.80 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 14,126 | 102.48 | 1,447,632.48 |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 11,897 | 27.80 | 330,736.60 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING | 44,250 | 76.93 | 3,404,152.50 |
| HCA HOLDINGS INC | 20,519 | 81.03 | 1,662,654.57 |
| HENRY SCHEIN INC | 5,299 | 180.71 | 957,582.29 |
| HOLOGIC INC | 15,396 | 34.95 | 538,090.20 |
| HUMANA INC | 9,804 | 188.35 | 1,846,583.40 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 6,151 | 90.25 | 555,127.75 |
| IMS HEALTH HOLDINGS INC | 11,324 | 25.83 | 292,498.92 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 2,456 | 648.20 | 1,591,979.20 |
| LABORATORY CRP OF AMER | 6,240 | 131.19 | 818,625.60 |
| MCKESSON CORP | 14,959 | 186.88 | 2,795,537.92 |
| MEDNAX INC | 6,215 | 70.02 | 435,174.30 |
| MEDTRONIC PLC | 91,472 | 85.78 | 7,846,468.16 |
| PATTERSON COMPANIES INC | 5,902 | 50.32 | 296,988.64 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 8,931 | 78.75 | 703,316.25 |
| RESMED INC | 8,274 | 60.50 | 500,577.00 |
| ST JUDE MEDICAL INC | 19,140 | 78.07 | 1,494,259.80 |
| STRYKER CORP | 22,082 | 115.33 | 2,546,717.06 |
| THE COOPER COS INC | 2,821 | 165.20 | 466,029.20 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 61,684 | 140.68 | 8,677,705.12 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 5,799 | 138.00 | 800,262.00 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 6,433 | 85.57 | 550,471.81 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 12,752 | 119.40 | 1,522,588.80 |
| ABBVIE INC | 105,836 | 60.75 | 6,429,537.00 |
| AGILENT TECHNOLOGIES | 21,016 | 46.09 | 968,627.44 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 14,867 | 138.24 | 2,055,214.08 |
| ALKERMES PLC | 9,466 | 43.82 | 414,800.12 |
| ALLERGAN PLC | 25,523 | 247.40 | 6,314,390.20 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 4,880 | 65.41 | 319,200.80 |
| AMGEN | 48,834 | 156.78 | 7,656,194.52 |
| BIOGEN INC | 14,251 | 250.46 | 3,569,305.46 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 9,979 | 82.94 | 827,658.26 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 109,681 | 72.73 | 7,977,099.13 |
| CELGENE CORP | 51,125 | 106.13 | 5,425,896.25 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 12,669 | 18.00 | 228,042.00 |
| GILEAD SCIENCES INC | 89,670 | 85.77 | 7,690,995.90 |
| ILLUMINA INC | 9,459 | 143.42 | 1,356,609.78 |
| INCYTE CORP | 11,596 | 81.61 | 946,349.56 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 6,863 | 21.45 | 147,211.35 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 3,889 | 156.02 | 606,761.78 |
| JOHNSON & JOHNSON | 180,474 | 117.00 | 21,115,458.00 |
| LILLY (ELI) & CO | 64,702 | 74.43 | 4,815,769.86 |
| MALLINCKRODT PLC | 7,532 | 62.53 | 470,975.96 |
| MEDIVATION INC | 11,481 | 60.10 | 690,008.10 |
| MERCK & CO | 180,562 | 57.18 | 10,324,535.16 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,739 | 385.50 | 670,384.50 |
| MYLAN NV | 27,498 | 45.76 | 1,258,308.48 |
| PERRIGO CO PLC | 9,573 | 100.48 | 961,895.04 |
| PFIZER | 404,232 | 35.31 | 14,273,431.92 |
| QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD | 6,097 | 66.54 | 405,694.38 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 4,991 | 381.08 | 1,901,970.28 |
| SHIRE PLC-ADR | 6,677 | 183.95 | 1,228,234.15 |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUS | 1,344 | 148.44 | 199,503.36 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 25,935 | 154.15 | 3,997,880.25 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 2,948 | 113.13 | 333,507.24 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 16,655 | 92.49 | 1,540,420.95 |
| WATERS CORP | 5,270 | 140.05 | 738,063.50 |
| ZOETIS INC | 31,142 | 48.14 | 1,499,175.88 |
| BANK OF AMERICA CORP | 674,890 | 14.19 | 9,576,689.10 |
| BB&T CORP | 51,654 | 36.18 | 1,868,841.72 |
| CIT GROUP INC | 11,573 | 33.85 | 391,746.05 |
| CITIGROUP | 192,786 | 45.01 | 8,677,297.86 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 36,131 | 22.88 | 826,677.28 |
| COMERICA INC | 10,500 | 45.29 | 475,545.00 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 50,118 | 18.73 | 938,710.14 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 9,040 | 69.92 | 632,076.80 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 51,590 | 10.17 | 524,670.30 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 240,250 | 64.75 | 15,556,187.50 |
| KEY CORP | 52,579 | 12.44 | 654,082.76 |
| M & T BANK CORP | 9,515 | 118.37 | 1,126,290.55 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 28,490 | 15.46 | 440,455.40 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 19,390 | 15.74 | 305,198.60 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 33,257 | 88.33 | 2,937,590.81 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| REGIONS FINL CORP | 82,936 | 9.70 | 804,479.20 |
| SIGNATURE BANK | 3,479 | 132.34 | 460,410.86 |
| SUNTRUST BANKS | 33,681 | 42.97 | 1,447,272.57 |
| US BANCORP | 113,382 | 42.54 | 4,823,270.28 |
| WELLS FARGO & CO | 315,779 | 49.14 | 15,517,380.06 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 3,494 | 166.51 | 581,785.94 |
| ALLY FINANCIAL INC | 26,873 | 17.82 | 478,876.86 |
| AMERICAN EXPRESS | 53,417 | 65.71 | 3,510,031.07 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 11,553 | 100.67 | 1,163,040.51 |
| BANK NEW YORK CO | 70,115 | 41.65 | 2,920,289.75 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 78,030 | 142.23 | 11,098,206.90 |
| BLACKROCK INC | 8,005 | 357.96 | 2,865,469.80 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 34,551 | 70.87 | 2,448,629.37 |
| CME GROUP INC | 22,595 | 95.03 | 2,147,202.85 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 26,965 | 56.80 | 1,531,612.00 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 18,489 | 26.48 | 489,588.72 |
| EATON VANCE CORP | 6,907 | 36.39 | 251,345.73 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 25,068 | 34.42 | 862,840.56 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 24,933 | 153.17 | 3,818,987.61 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 7,679 | 262.52 | 2,015,891.08 |
| INVESCO LTD | 26,852 | 29.07 | 780,587.64 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 20,553 | 17.69 | 363,582.57 |
| MOODY'S CORP | 11,796 | 101.07 | 1,192,221.72 |
| MORGAN STANLEY | 94,742 | 26.08 | 2,470,871.36 |
| MSCI INC | 6,368 | 78.07 | 497,149.76 |
| NASDAQ INC | 6,939 | 65.66 | 455,614.74 |
| NAVIENT CORP | 20,947 | 13.21 | 276,709.87 |
| NORTHERN TRUST CORP | 13,696 | 71.87 | 984,331.52 |
| PRICE T ROWE GROUP INC | 16,605 | 74.37 | 1,234,913.85 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 7,527 | 54.23 | 408,189.21 |
| S&P GLOBAL INC | 17,010 | 110.04 | 1,871,780.40 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 77,380 | 29.09 | 2,250,984.20 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 9,366 | 51.21 | 479,632.86 |
| STATE STREET CORP | 25,505 | 60.29 | 1,537,696.45 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 56,068 | 31.41 | 1,761,095.88 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 15,844 | 30.85 | 488,787.40 |
| VOYA FINANCIAL INC | 14,298 | 30.94 | 442,380.12 |
| AFLAC | 26,808 | 69.70 | 1,868,517.60 |
| ALLEGHANY CORP | 944 | 540.23 | 509,977.12 |
| ALLSTATE CORP | 24,958 | 67.79 | 1,691,902.82 |
| AMERICAN INT'L GROUP | 75,691 | 56.10 | 4,246,265.10 |
| AON PLC | 17,432 | 109.86 | 1,915,079.52 |

| | | | |
|------------------------------------|--------|--------|---------------|
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 8,734 | 71.86 | 627,625.24 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 10,452 | 48.36 | 505,458.72 |
| ASSURANT INC | 4,255 | 85.04 | 361,845.20 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 6,257 | 56.13 | 351,205.41 |
| CHUBB LTD | 29,949 | 126.50 | 3,788,548.50 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 10,938 | 70.74 | 773,754.12 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 2,861 | 180.42 | 516,181.62 |
| FNF GROUP | 16,127 | 35.90 | 578,959.30 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS | 27,071 | 44.48 | 1,204,118.08 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 16,647 | 44.33 | 737,961.51 |
| LOEWS CORP | 18,501 | 40.10 | 741,890.10 |
| MARKEL CORP | 887 | 948.18 | 841,035.66 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 34,810 | 66.63 | 2,319,390.30 |
| METLIFE INC | 61,539 | 43.78 | 2,694,177.42 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 18,205 | 43.14 | 785,363.70 |
| PROGRESSIVE CORP | 39,727 | 32.86 | 1,305,429.22 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 29,220 | 75.15 | 2,195,883.00 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 2,888 | 115.86 | 334,603.68 |
| TORCHMARK CORP | 8,075 | 60.64 | 489,668.00 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 19,237 | 114.22 | 2,197,250.14 |
| UNUM GROUP | 16,300 | 35.69 | 581,747.00 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 8,155 | 129.58 | 1,056,724.90 |
| WR BERKLEY CORP | 6,561 | 56.44 | 370,302.84 |
| XL GROUP PLC | 19,247 | 33.58 | 646,314.26 |
| CBRE GROUP INC-A | 18,907 | 30.75 | 581,390.25 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 84,100 | 6.09 | 512,169.00 |
| JONES LANG LASALLE INC | 2,910 | 122.30 | 355,893.00 |
| REALOGY HOLDINGS CORP | 7,960 | 32.27 | 256,869.20 |
| WEYERHAEUSER CO | 51,780 | 30.37 | 1,572,558.60 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 40,535 | 119.44 | 4,841,500.40 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 39,254 | 38.54 | 1,512,849.16 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 32,631 | 98.07 | 3,200,122.17 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES, INC | 11,160 | 55.44 | 618,710.40 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 3,830 | 222.61 | 852,596.30 |
| ALPHABET INC-CL A | 19,152 | 742.52 | 14,220,743.04 |
| ALPHABET INC-CL C | 20,357 | 728.58 | 14,831,703.06 |
| ANSYS INC | 5,935 | 88.99 | 528,155.65 |
| AUTODESK INC | 13,656 | 57.79 | 789,180.24 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 30,231 | 87.63 | 2,649,142.53 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC | 8,174 | 63.78 | 521,337.72 |
| CA INC | 21,156 | 32.93 | 696,667.08 |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS | 20,883 | 24.86 | 519,151.38 |

| | | | |
|--|---------|--------|---------------|
| CDK GLOBAL INC | 8,454 | 58.14 | 491,515.56 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 9,116 | 85.20 | 776,683.20 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 10,055 | 87.68 | 881,622.40 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 39,638 | 60.99 | 2,417,521.62 |
| EBAY | 74,999 | 24.33 | 1,824,725.67 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 20,893 | 76.25 | 1,593,091.25 |
| FACEBOOK INC-A | 150,104 | 118.56 | 17,796,330.24 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 20,735 | 75.14 | 1,558,027.90 |
| FISERV INC | 14,994 | 107.34 | 1,609,455.96 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 6,329 | 150.00 | 949,350.00 |
| FORTINET INC | 11,019 | 34.46 | 379,714.74 |
| GARTNER INC | 5,328 | 101.16 | 538,980.48 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 10,717 | 76.60 | 820,922.20 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 59,748 | 153.42 | 9,166,538.16 |
| INTUIT INC | 16,237 | 107.52 | 1,745,802.24 |
| LINKEDIN CORP - A | 7,855 | 136.52 | 1,072,364.60 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 64,355 | 97.02 | 6,243,722.10 |
| MICROSOFT CORP | 489,628 | 51.62 | 25,274,597.36 |
| MOBILEYE NV | 12,632 | 37.38 | 472,184.16 |
| NETSUITE INC | 2,299 | 83.93 | 192,955.07 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 13,610 | 17.36 | 236,269.60 |
| ORACLE CORP | 205,643 | 39.05 | 8,030,359.15 |
| PAYCHEX INC | 20,178 | 55.21 | 1,114,027.38 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 72,016 | 37.13 | 2,673,954.08 |
| RED HAT INC | 11,321 | 78.23 | 885,641.83 |
| SABRE CORP | 14,319 | 28.69 | 410,812.11 |
| SALESFORCE.COM INC | 41,273 | 82.73 | 3,414,515.29 |
| SERVICENOW INC | 11,169 | 75.56 | 843,929.64 |
| SPLUNK INC | 8,088 | 59.01 | 477,272.88 |
| SYMANTEC CORP | 42,648 | 17.39 | 741,648.72 |
| SYNOPSYS INC | 9,205 | 53.08 | 488,601.40 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 10,702 | 53.37 | 571,165.74 |
| TWITTER INC | 39,137 | 14.60 | 571,400.20 |
| VANTIV INC - CL A | 10,199 | 53.52 | 545,850.48 |
| VERISIGN INC | 6,144 | 85.10 | 522,854.40 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 125,256 | 81.26 | 10,178,302.56 |
| VMWARE INC-CLASS A | 4,467 | 64.00 | 285,888.00 |
| WESTERN UNION CO | 32,001 | 19.64 | 628,499.64 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 6,886 | 79.89 | 550,122.54 |
| XEROX CORP | 58,604 | 10.12 | 593,072.48 |
| YAHOO | 59,132 | 37.35 | 2,208,580.20 |
| ZILLOW GROUP INC-C | 9,179 | 32.28 | 296,298.12 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| AMPHENOL CORPORATION | 21,026 | 59.98 | 1,261,139.48 |
| APPLE INC | 362,274 | 99.65 | 36,100,604.10 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 6,467 | 67.99 | 439,691.33 |
| AVNET INC | 8,830 | 42.77 | 377,659.10 |
| CDW CORP/DE | 9,896 | 42.89 | 424,439.44 |
| CISCO SYSTEMS | 328,136 | 29.14 | 9,561,883.04 |
| CORNING | 73,349 | 21.03 | 1,542,529.47 |
| EMC CORP | 126,070 | 27.87 | 3,513,570.90 |
| F5 NETWORKS INC | 4,529 | 119.68 | 542,030.72 |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 31,468 | 12.92 | 406,566.56 |
| FLIR SYSTEMS INC | 8,767 | 31.41 | 275,371.47 |
| HARRIS CORP | 7,806 | 81.22 | 634,003.32 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 114,242 | 19.55 | 2,233,431.10 |
| HP INC | 111,598 | 13.84 | 1,544,516.32 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 22,906 | 23.45 | 537,145.70 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 10,301 | 68.56 | 706,236.56 |
| NETAPP INC | 16,995 | 24.90 | 423,175.50 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 6,161 | 134.84 | 830,749.24 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 20,097 | 24.14 | 485,141.58 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 24,070 | 62.27 | 1,498,838.90 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 16,540 | 26.23 | 433,844.20 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 17,571 | 48.17 | 846,395.07 |
| AT&T INC | 402,594 | 40.09 | 16,139,993.46 |
| CENTURYLINK INC | 35,386 | 27.00 | 955,422.00 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 74,843 | 5.12 | 383,196.16 |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 20,786 | 53.08 | 1,103,320.88 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 8,086 | 103.84 | 839,650.24 |
| SPRINT CORP | 49,920 | 3.81 | 190,195.20 |
| T-MOBILE US INC | 17,774 | 43.08 | 765,703.92 |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 266,761 | 51.95 | 13,858,233.95 |
| AES CORP | 40,128 | 11.44 | 459,064.32 |
| AGL RESOURCES INC | 7,805 | 65.90 | 514,349.50 |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION | 14,712 | 39.42 | 579,947.04 |
| AMEREN CORPORATION | 15,103 | 50.89 | 768,591.67 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 32,335 | 66.96 | 2,165,151.60 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 11,155 | 77.47 | 864,177.85 |
| ATMOS ENERGY CORP | 6,648 | 76.39 | 507,840.72 |
| CALPINE CORP | 21,631 | 15.60 | 337,443.60 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 25,372 | 23.39 | 593,451.08 |
| CMS ENERGY CORP | 17,738 | 43.39 | 769,651.82 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 19,880 | 76.54 | 1,521,615.20 |
| DOMINION RESOURCES | 38,723 | 73.74 | 2,855,434.02 |

| | | | |
|---------------------------|------------|--------|------------------|
| DTE ENERGY COMPANY | 12,310 | 94.05 | 1,157,755.50 |
| DUKE ENERGY CORP | 44,691 | 81.26 | 3,631,590.66 |
| EDISON INTL | 21,112 | 73.66 | 1,555,109.92 |
| ENERGY CORP | 11,375 | 78.68 | 894,985.00 |
| EVERSOURCE ENERGY | 21,677 | 56.88 | 1,232,987.76 |
| EXELON CORP | 60,558 | 35.14 | 2,128,008.12 |
| FIRSTENERGY CORP | 26,040 | 34.25 | 891,870.00 |
| NEXTERA ENERGY INC | 29,902 | 123.98 | 3,707,249.96 |
| NISOURCE INC | 22,055 | 25.02 | 551,816.10 |
| NRG ENERGY INC | 18,649 | 16.59 | 309,386.91 |
| OGE ENERGY CORP | 11,648 | 31.48 | 366,679.04 |
| PG&E CORP | 32,391 | 62.98 | 2,039,985.18 |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 6,883 | 77.17 | 531,161.11 |
| PPL CORPORATION | 43,383 | 39.25 | 1,702,782.75 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 32,783 | 44.62 | 1,462,777.46 |
| SCANA CORP | 9,149 | 71.67 | 655,708.83 |
| SEMPRA ENERGY | 15,650 | 110.00 | 1,721,500.00 |
| SOUTHERN CO | 59,093 | 50.86 | 3,005,469.98 |
| TECO ENERGY INC | 15,421 | 27.69 | 427,007.49 |
| UGI CORP | 11,838 | 43.94 | 520,161.72 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 19,673 | 62.32 | 1,226,021.36 |
| WESTAR ENERGY INC | 9,751 | 56.11 | 547,128.61 |
| XCEL ENERGY INC | 33,061 | 42.70 | 1,411,704.70 |
| ANALOG DEVICES | 19,339 | 57.56 | 1,113,152.84 |
| APPLIED MATERIALS | 74,519 | 24.42 | 1,819,753.98 |
| BROADCOM LTD | 25,346 | 164.14 | 4,160,292.44 |
| INTEL CORP | 309,835 | 31.94 | 9,896,129.90 |
| KLA-TENCOR CORP | 10,699 | 73.41 | 785,413.59 |
| LAM RESEARCH CORP | 9,865 | 83.63 | 825,009.95 |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP | 16,450 | 47.71 | 784,829.50 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 28,157 | 10.26 | 288,890.82 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 17,776 | 37.86 | 672,999.36 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 13,462 | 52.77 | 710,389.74 |
| MICRON TECHNOLOGY | 66,504 | 12.51 | 831,965.04 |
| NVIDIA CORP | 36,213 | 47.38 | 1,715,771.94 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 19,775 | 90.29 | 1,785,484.75 |
| QORVO INC | 8,400 | 56.07 | 470,988.00 |
| QUALCOMM | 97,478 | 54.98 | 5,359,340.44 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 11,900 | 67.97 | 808,843.00 |
| TEXAS INSTRUMENTS | 66,229 | 62.14 | 4,115,470.06 |
| XILINX INC | 16,007 | 47.03 | 752,809.21 |
| | 20,519,632 | | 1,228,104,356.42 |

| | アメリカドル 小計 | | | (131,529,976,572) |
|-------|------------------------------|---------|--------|-------------------|
| カナダドル | ALTAGAS INCOME LTD | 10,943 | 30.60 | 334,855.80 |
| | ARC RESOURCES LTD | 20,535 | 21.73 | 446,225.55 |
| | CAMECO CORP | 27,283 | 15.27 | 416,611.41 |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 71,517 | 38.08 | 2,723,367.36 |
| | CENOVUS ENERGY INC | 53,472 | 19.28 | 1,030,940.16 |
| | CRESCENT POINT ENERGY CORP | 33,864 | 22.48 | 761,262.72 |
| | ENBRIDGE | 59,756 | 53.93 | 3,222,641.08 |
| | ENCANA CORP | 49,366 | 11.04 | 545,000.64 |
| | HUSKY ENERGY INC | 18,846 | 16.13 | 303,985.98 |
| | IMPERIAL OIL | 19,461 | 40.53 | 788,754.33 |
| | INTER PIPELINE LTD | 22,850 | 27.71 | 633,173.50 |
| | KEYERA CORP | 13,825 | 38.00 | 525,350.00 |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 22,522 | 39.82 | 896,826.04 |
| | PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 12,644 | 34.99 | 442,413.56 |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 16,641 | 25.32 | 421,350.12 |
| | SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 15,297 | 26.20 | 400,781.40 |
| | SUNCOR ENERGY | 105,309 | 35.18 | 3,704,770.62 |
| | TOURMALINE OIL CORP | 12,981 | 33.15 | 430,320.15 |
| | TRANSCANADA CORP | 46,339 | 55.15 | 2,555,595.85 |
| | VERESEN INC | 27,382 | 10.91 | 298,737.62 |
| | VERMILION ENERGY INC | 9,108 | 44.50 | 405,306.00 |
| | AGNICO EAGLE MINES | 15,271 | 64.97 | 992,156.87 |
| | AGRIUM INC | 8,965 | 120.42 | 1,079,565.30 |
| | BARRICK GOLD CORP | 75,063 | 24.91 | 1,869,819.33 |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 1,570 | 234.63 | 368,369.10 |
| | ELDORADO GOLD CORP | 38,874 | 5.86 | 227,801.64 |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 48,914 | 9.18 | 449,030.52 |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 10,778 | 89.88 | 968,726.64 |
| | GOLDCORP INC | 53,693 | 23.81 | 1,278,430.33 |
| | KINROSS GOLD CORP | 88,355 | 6.75 | 596,396.25 |
| | METHANEX CORP | 4,891 | 43.99 | 215,155.09 |
| | POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 54,811 | 21.87 | 1,198,716.57 |
| | SILVER WHEATON CORP | 28,040 | 27.07 | 759,042.80 |
| | TECK RESOURCES LTD-CL B | 38,531 | 15.16 | 584,129.96 |
| | TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 48,543 | 3.74 | 181,550.82 |
| | WEST FRASER TIMBER CO LTD | 5,014 | 41.21 | 206,626.94 |
| | YAMANA GOLD INC | 62,705 | 6.70 | 420,123.50 |
| | BOMBARDIER B | 104,404 | 2.00 | 208,808.00 |
| | CAE INC | 14,339 | 16.65 | 238,744.35 |
| | FINNING INTERNATIONAL INC | 10,642 | 22.52 | 239,657.84 |
| | SNC-LAVALIN GROUP INC | 8,775 | 53.02 | 465,250.50 |

| | | | |
|--|---------|--------|--------------|
| WASTE CONNECTIONS INC | 4,210 | 92.59 | 389,803.90 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 51,789 | 76.56 | 3,964,965.84 |
| CP RAILWAY LIMITED | 9,309 | 170.63 | 1,588,394.67 |
| LINAMAR CORP | 2,700 | 51.98 | 140,346.00 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 26,635 | 52.41 | 1,395,940.35 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 13,580 | 38.47 | 522,422.60 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 13,467 | 54.00 | 727,218.00 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 27,159 | 24.68 | 670,284.12 |
| THOMSON REUTERS CORP | 22,357 | 53.98 | 1,206,830.86 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 4,929 | 137.93 | 679,856.97 |
| DOLLARAMA INC | 7,306 | 92.30 | 674,343.80 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 26,159 | 55.81 | 1,459,933.79 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 13,645 | 21.69 | 295,960.05 |
| JEAN COUTU GROUP INC A | 9,300 | 19.91 | 185,163.00 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 13,707 | 71.69 | 982,654.83 |
| METRO INC | 16,294 | 44.85 | 730,785.90 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 3,660 | 113.62 | 415,849.20 |
| SAPUTO INC | 17,950 | 38.88 | 697,896.00 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 19,503 | 32.19 | 627,801.57 |
| BANK MONTREAL | 41,836 | 83.51 | 3,493,724.36 |
| BANK NOVA SCOTIA | 78,182 | 66.32 | 5,185,030.24 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK | 25,921 | 103.55 | 2,684,119.55 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 21,045 | 45.73 | 962,387.85 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 96,265 | 79.34 | 7,637,665.10 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 120,141 | 57.20 | 6,872,065.20 |
| CI FINANCIAL CORP | 16,463 | 27.89 | 459,153.07 |
| ELEMENT FINANCIAL CORP | 21,290 | 14.91 | 317,433.90 |
| IGM FINANCIAL INC | 6,544 | 37.20 | 243,436.80 |
| ONEX CORP | 5,865 | 81.57 | 478,408.05 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,405 | 649.00 | 911,845.00 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 21,584 | 34.96 | 754,576.64 |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 6,595 | 42.40 | 279,628.00 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 8,448 | 90.06 | 760,826.88 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 128,885 | 18.55 | 2,390,816.75 |
| POWER CORP OF CANADA | 21,838 | 28.83 | 629,589.54 |
| POWER FINANCIAL CORP | 16,819 | 31.57 | 530,975.83 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 39,206 | 44.41 | 1,741,138.46 |
| BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A | 59,657 | 45.64 | 2,722,745.48 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 7,000 | 21.68 | 151,760.00 |
| CGI GROUP INC - CL A | 14,411 | 60.48 | 871,577.28 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,107 | 532.00 | 588,924.00 |
| OPEN TEXT CORP | 8,394 | 77.54 | 650,870.76 |

| | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| | BLACKBERRY LIMITED | 35,123 | 9.34 | 328,048.82 |
| | BCE INC | 9,538 | 60.24 | 574,569.12 |
| | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 23,939 | 49.87 | 1,193,837.93 |
| | TELUS CORP | 11,560 | 40.83 | 471,994.80 |
| | ATCO LTD -CLASS I | 4,372 | 44.79 | 195,821.88 |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 8,973 | 37.46 | 336,128.58 |
| | FORTIS INC | 18,416 | 41.99 | 773,287.84 |
| | HYDRO ONE LTD | 14,136 | 24.44 | 345,483.84 |
| | カナダドル 小計 | 2,590,736 | | 96,730,695.24 (8,136,018,776) |
| ユーロ | ENI | 169,781 | 14.06 | 2,387,120.86 |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 27,776 | 12.27 | 340,811.52 |
| | NESTE OIL OYJ | 8,021 | 30.96 | 248,330.16 |
| | OMV AG | 8,029 | 25.24 | 202,651.96 |
| | REPSOL SA | 66,931 | 11.65 | 780,080.80 |
| | SAIPEM | 527,619 | 0.38 | 205,613.12 |
| | TECHNIP S.A. | 8,053 | 50.19 | 404,180.07 |
| | TENARIS SA | 32,091 | 12.73 | 408,518.43 |
| | TOTAL SA | 145,265 | 42.84 | 6,223,878.92 |
| | VOPAK | 3,661 | 48.12 | 176,185.62 |
| | AIR LIQUIDE | 22,172 | 94.11 | 2,086,606.92 |
| | AKZO NOBEL | 16,259 | 60.97 | 991,311.23 |
| | ARCELORMITTAL | 129,593 | 4.77 | 618,158.61 |
| | ARKEMA | 5,054 | 71.38 | 360,754.52 |
| | BASF SE | 59,599 | 69.55 | 4,145,110.45 |
| | COVESTRO AG | 5,760 | 39.74 | 228,931.20 |
| | CRH | 55,608 | 26.82 | 1,491,406.56 |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 9,556 | 26.34 | 251,705.04 |
| | FUCHS PETROLUB SE -PREF | 4,446 | 36.17 | 160,811.82 |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 8,988 | 74.80 | 672,302.40 |
| | IMERYS SA | 2,111 | 63.40 | 133,837.40 |
| | K+S AG | 11,391 | 21.23 | 241,830.93 |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 12,200 | 55.75 | 680,150.00 |
| | LANXESS | 6,287 | 41.97 | 263,865.39 |
| | LINDE AG | 11,766 | 130.75 | 1,538,404.50 |
| | OCI NV | 5,100 | 12.88 | 65,688.00 |
| | SOLVAY SA | 5,145 | 89.12 | 458,522.40 |
| | STORA ENSO OYJ R | 39,297 | 7.70 | 302,783.38 |
| | SYMRISE AG | 7,200 | 57.11 | 411,192.00 |
| | THYSSEN KRUPP | 25,163 | 19.48 | 490,301.05 |
| | UMICORE | 6,967 | 46.45 | 323,617.15 |
| | UPM KYMMENE CORP | 36,257 | 17.34 | 628,696.38 |

| | | | |
|---------------------------|--------|--------|--------------|
| VOESTALPINE AG | 9,024 | 31.57 | 284,932.80 |
| ACS ACTIV. CONST. Y SVCS | 14,359 | 29.01 | 416,554.59 |
| AIRBUS GROUP SE | 37,633 | 53.40 | 2,009,602.20 |
| ALSTOM | 8,179 | 22.10 | 180,755.90 |
| ANDRITZ AG | 5,387 | 43.15 | 232,475.98 |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | 4,606 | 31.25 | 143,960.53 |
| BOUYGUES ORD | 12,252 | 28.28 | 346,486.56 |
| BRENTAG AG | 10,244 | 47.05 | 481,980.20 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 73,342 | 6.83 | 501,292.57 |
| EIFFAGE | 4,326 | 65.90 | 285,083.40 |
| FERROVIAL SA | 31,764 | 18.44 | 585,728.16 |
| GEA GROUP AG | 12,583 | 42.94 | 540,376.93 |
| HOCHTIEF AG | 1,739 | 116.45 | 202,506.55 |
| KONE OYJ-B | 22,221 | 41.47 | 921,504.87 |
| KONINKLIJKE PHILIPS | 62,330 | 23.14 | 1,442,627.85 |
| LEGRAND SA | 17,002 | 49.59 | 843,214.19 |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA | 22,011 | 9.73 | 214,167.03 |
| MAN SE | 2,675 | 94.87 | 253,777.25 |
| METSO OYJ | 9,136 | 21.60 | 197,337.60 |
| OSRAM LICHT AG | 5,181 | 47.59 | 246,563.79 |
| PRYSMIAN SPA | 11,275 | 21.77 | 245,456.75 |
| REXEL SA | 17,749 | 13.15 | 233,488.09 |
| SAFRAN SA | 19,663 | 61.00 | 1,199,443.00 |
| SAINT-GOBAIN | 31,852 | 39.17 | 1,247,642.84 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 36,762 | 56.11 | 2,062,715.82 |
| SIEMENS | 50,300 | 95.62 | 4,809,686.00 |
| THALES SA | 7,538 | 75.11 | 566,179.18 |
| VINCI S.A. | 33,452 | 65.79 | 2,200,807.08 |
| WARTSILA OYJ | 10,047 | 38.51 | 386,909.97 |
| ZARDOYA OTIS SA | 8,907 | 9.38 | 83,547.66 |
| ZODIAC AEROSPACE | 11,896 | 20.88 | 248,388.48 |
| BUREAU VERITAS SA | 16,438 | 19.87 | 326,705.25 |
| EDENRED | 16,653 | 17.25 | 287,347.51 |
| RANDSTAD HOLDING NV | 7,832 | 47.31 | 370,531.92 |
| SOCIETE BIC SA | 1,751 | 119.00 | 208,369.00 |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS | 31,202 | 13.62 | 425,127.25 |
| ADP | 1,532 | 106.60 | 163,311.20 |
| AENA SA | 4,472 | 121.95 | 545,360.40 |
| ATLANTIA SPA | 27,102 | 23.59 | 639,336.18 |
| BOLLORE | 52,200 | 3.16 | 165,213.00 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 16,113 | 12.00 | 193,356.00 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 63,399 | 26.57 | 1,684,828.42 |

| | | | |
|------------------------------------|--------|--------|--------------|
| FRAPORT AG | 2,688 | 50.29 | 135,179.52 |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR | 26,998 | 11.29 | 304,807.42 |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE | 53,552 | 6.55 | 350,765.60 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 21,482 | 71.84 | 1,543,266.88 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 3,141 | 63.31 | 198,856.71 |
| CONTINENTAL AG | 6,995 | 186.20 | 1,302,469.00 |
| DAIMLER AG | 62,408 | 58.78 | 3,668,342.24 |
| FERRARI NV | 8,411 | 38.24 | 321,636.64 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 55,116 | 6.32 | 348,333.12 |
| MICHELIN | 11,494 | 92.13 | 1,058,942.22 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 8,657 | 32.50 | 281,352.50 |
| PEUGEOT SA | 29,888 | 13.67 | 408,568.96 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 10,520 | 47.99 | 504,854.80 |
| RENAULT SA | 13,179 | 79.57 | 1,048,653.03 |
| SCHAEFFLER AG | 13,849 | 14.30 | 198,040.70 |
| VALEO SA | 16,308 | 45.53 | 742,584.78 |
| VOLKSWAGEN AG-PFD | 12,160 | 128.25 | 1,559,520.00 |
| VOLKSWAGEN STAMM | 2,477 | 133.75 | 331,298.75 |
| ADIDAS AG | 12,586 | 119.40 | 1,502,768.40 |
| CHRISTIAN DIOR | 3,315 | 149.65 | 496,089.75 |
| HERMES INTERNATIONAL | 1,616 | 331.10 | 535,057.60 |
| HUGO BOSS AG | 4,478 | 55.75 | 249,648.50 |
| KERING | 4,827 | 154.15 | 744,082.05 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 10,161 | 47.20 | 479,599.20 |
| LVMH | 18,296 | 145.75 | 2,666,642.00 |
| ACCOR | 12,765 | 38.77 | 494,962.87 |
| PADDY POWER PLC | 5,606 | 119.00 | 667,114.00 |
| SODEXO | 6,162 | 93.89 | 578,550.18 |
| ALTICE NV -A | 24,819 | 15.25 | 378,489.75 |
| ALTICE NV -B | 4,665 | 15.22 | 71,024.62 |
| AXEL SPRINGER SE | 3,427 | 49.34 | 169,088.18 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 12,435 | 16.18 | 201,198.30 |
| JC DECAUX SA | 3,750 | 35.46 | 132,975.00 |
| LAGADERE S.C.A | 6,893 | 20.80 | 143,374.40 |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 13,820 | 44.21 | 610,982.20 |
| PUBLICIS GROUPE | 11,662 | 62.37 | 727,358.94 |
| RELX NV | 64,770 | 15.13 | 980,293.95 |
| RTL GROUP | 2,176 | 79.87 | 173,808.00 |
| SES | 23,567 | 18.93 | 446,123.31 |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 4,249 | 43.08 | 183,046.92 |
| VIVENDI | 77,162 | 16.25 | 1,254,268.31 |
| WOLTERS KLUWER | 19,739 | 35.04 | 691,753.25 |

| | | | |
|--|-----------|--------|--------------|
| INDITEX | 71,670 | 29.55 | 2,118,206.85 |
| ZALANDO SE | 4,525 | 26.56 | 120,184.00 |
| CARREFOUR | 38,335 | 23.90 | 916,206.50 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 3,298 | 53.22 | 175,519.56 |
| COLRUYT SA | 5,212 | 54.26 | 282,803.12 |
| DELHAIZE GROUP | 6,627 | 95.01 | 629,631.27 |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT | 32,188 | 5.28 | 170,242.33 |
| JERONIMO MARTINS | 18,556 | 14.31 | 265,536.36 |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 55,201 | 20.18 | 1,114,232.18 |
| METRO STAMM | 12,138 | 29.53 | 358,435.14 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | 52,061 | 114.25 | 5,947,969.25 |
| DANONE (GROUPE) | 38,106 | 62.79 | 2,392,675.74 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 6,086 | 73.14 | 445,130.04 |
| HEINEKEN NV | 15,135 | 82.50 | 1,248,637.50 |
| KERRY GROUP PLC-A | 10,993 | 79.81 | 877,351.33 |
| PERNOD-RICARD | 14,101 | 96.78 | 1,364,694.78 |
| REMY COINTREAU | 1,720 | 74.19 | 127,606.80 |
| BEIERSDORF AG | 6,463 | 82.12 | 530,741.56 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 7,009 | 94.04 | 659,126.36 |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD | 11,562 | 103.70 | 1,198,979.40 |
| LOREAL | 16,504 | 166.85 | 2,753,692.40 |
| UNILEVER NV-CVA | 105,576 | 40.56 | 4,282,162.56 |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 13,302 | 118.40 | 1,574,956.80 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | 13,668 | 76.01 | 1,038,904.68 |
| FRESENIUS SE&CO KGAA | 27,438 | 65.69 | 1,802,402.22 |
| BAYER | 53,543 | 90.23 | 4,831,184.89 |
| GRIFOLS SA | 17,540 | 20.08 | 352,290.90 |
| MERCK KGAA | 8,185 | 90.21 | 738,368.85 |
| ORION OYJ-CLASS B | 5,393 | 34.01 | 183,415.93 |
| QIAGEN N.V. | 15,072 | 19.66 | 296,315.52 |
| SANOFI | 76,351 | 72.35 | 5,523,994.85 |
| UCB (GROUPE) | 8,162 | 67.67 | 552,322.54 |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA | 17,461 | 17.90 | 312,551.90 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA | 433,256 | 5.57 | 2,414,102.43 |
| BANCO DE SABADELL SA | 329,263 | 1.48 | 489,943.34 |
| BANCO POPULAR ESPANOL | 119,990 | 1.41 | 169,905.84 |
| BANCO POPULAR ESPANOL - RTS | 119,990 | 0.14 | 17,398.55 |
| BANCO SANTANDER SA | 936,902 | 4.06 | 3,809,443.53 |
| BANK OF IRELAND | 1,696,027 | 0.24 | 422,310.72 |
| BANKIA SA | 269,344 | 0.74 | 201,738.65 |
| BANKINTER SA | 46,663 | 6.47 | 302,189.58 |
| BNP PARIBAS | 69,240 | 45.87 | 3,176,385.00 |

| | | | |
|----------------------------------|---------|--------|--------------|
| CAIXABANK | 167,029 | 2.33 | 389,177.57 |
| COMMERZBANK AG | 71,288 | 7.04 | 502,152.67 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 63,731 | 8.45 | 538,590.68 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 20,426 | 22.50 | 459,585.00 |
| ING GROEP NV-CVA | 251,449 | 10.73 | 2,699,305.01 |
| INTESA SANPAOLO | 850,547 | 2.19 | 1,867,801.21 |
| INTESA SANPAOLO-RNC | 44,487 | 2.07 | 92,266.03 |
| KBC GROEP NV | 15,724 | 53.20 | 836,516.80 |
| NATIXIS | 50,808 | 4.20 | 213,800.06 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 7,866 | 11.51 | 90,537.66 |
| SOCIETE GENERALE | 51,400 | 34.20 | 1,758,137.00 |
| UNICREDIT SPA | 313,808 | 2.54 | 797,699.93 |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC | 46,528 | 3.04 | 141,631.23 |
| DEUTSCHE BANK NAMEN | 90,359 | 14.73 | 1,330,988.07 |
| DEUTSCHE BOERSE | 12,021 | 78.60 | 944,850.60 |
| EURAZEO | 2,022 | 57.65 | 116,568.30 |
| EXOR SPA | 8,502 | 33.04 | 280,906.08 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 5,501 | 75.64 | 416,095.64 |
| MEDIOBANCA | 41,000 | 6.48 | 265,680.00 |
| WENDEL | 1,767 | 101.95 | 180,145.65 |
| AEGON | 120,452 | 4.28 | 516,498.17 |
| AGEAS | 12,106 | 35.20 | 426,131.20 |
| ALLIANZ SE-REG | 29,729 | 139.85 | 4,157,600.65 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 76,125 | 12.89 | 981,251.25 |
| AXA | 128,128 | 21.20 | 2,716,954.24 |
| CNP ASSURANCES | 11,327 | 14.86 | 168,319.22 |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 3,639 | 99.08 | 360,552.12 |
| MAPFRE SA | 92,857 | 2.16 | 201,406.83 |
| MUENCHENER RUECKVERSICH. | 11,203 | 159.50 | 1,786,878.50 |
| NN GROUP NV | 22,270 | 28.42 | 632,913.40 |
| POSTE ITALIANE SPA | 40,033 | 7.00 | 280,231.00 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 29,359 | 39.11 | 1,148,230.49 |
| SCOR SE | 9,111 | 28.86 | 262,989.01 |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA | 59,209 | 1.69 | 100,240.83 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 21,706 | 29.73 | 645,319.38 |
| VONOVIA SE | 30,353 | 32.20 | 977,518.36 |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 29,049 | 40.92 | 1,188,685.08 |
| ATOS SE | 5,386 | 80.47 | 433,411.42 |
| CAP GEMINI SA | 11,049 | 87.63 | 968,223.87 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 8,365 | 68.52 | 573,169.80 |
| GEMALTO | 5,414 | 54.41 | 294,575.74 |
| SAP SE | 63,730 | 71.33 | 4,545,860.90 |

| | | | | |
|---------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|
| | UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 8,582 | 40.45 | 347,141.90 |
| | INGENICO GROUP | 3,351 | 102.85 | 344,650.35 |
| | NOKIA OYJ | 376,399 | 5.02 | 1,891,404.97 |
| | DEUTSCHE TELEKOM | 209,482 | 14.95 | 3,131,755.90 |
| | ELISA A | 9,776 | 34.23 | 334,632.48 |
| | ILIAD SA | 1,579 | 187.15 | 295,509.85 |
| | KPN (KON.) | 237,451 | 3.46 | 823,005.16 |
| | NUMERICABLE-SFR | 5,697 | 27.67 | 157,635.99 |
| | ORANGE | 128,052 | 15.21 | 1,948,311.18 |
| | PROXIMUS | 10,483 | 28.80 | 301,910.40 |
| | TELECOM ITALIA ORD | 691,701 | 0.85 | 590,020.95 |
| | TELECOM ITALIA RNC | 345,204 | 0.69 | 238,363.36 |
| | TELEFONICA | 293,029 | 9.01 | 2,642,242.49 |
| | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 58,116 | 3.91 | 227,233.56 |
| | E.ON SE | 136,636 | 8.70 | 1,189,689.65 |
| | ELECTRICITE DE FRANCE | 12,828 | 11.61 | 148,997.22 |
| | ENAGAS | 14,877 | 27.54 | 409,786.96 |
| | ENDESA | 21,382 | 18.06 | 386,265.83 |
| | ENEL | 505,473 | 4.12 | 2,083,559.70 |
| | ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 157,290 | 2.98 | 469,667.94 |
| | ENGIE | 99,106 | 14.31 | 1,418,206.86 |
| | FORTUM OYJ | 30,558 | 14.04 | 429,034.32 |
| | GAS NATURAL SDG SA | 23,717 | 18.03 | 427,617.51 |
| | IBERDROLA SA | 358,114 | 6.07 | 2,176,616.89 |
| | RED ELECTRICA CORPORACION SA | 7,116 | 79.38 | 564,868.08 |
| | RWE STAMM | 33,408 | 13.30 | 444,493.44 |
| | SNAM SPA | 169,608 | 5.05 | 856,520.40 |
| | SUEZ | 24,412 | 14.93 | 364,471.16 |
| | TERNA SPA | 101,213 | 4.99 | 505,457.72 |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 29,560 | 20.48 | 605,388.80 |
| | ASML HOLDING NV | 24,584 | 88.26 | 2,169,783.84 |
| | INFINEON TECHNOLOGIES | 73,597 | 13.48 | 992,455.54 |
| | STMICROELECTRONICS | 43,328 | 5.31 | 230,331.64 |
| | ユーロ 小計 | 15,031,972 | | 208,060,131.73 (25,177,356,540) |
| イギリスポンド | BP PLC | 1,216,824 | 3.74 | 4,552,746.99 |
| | PETROFAC LTD | 14,944 | 7.43 | 111,033.92 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 276,796 | 17.84 | 4,939,424.62 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 246,499 | 17.96 | 4,428,354.53 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 98,144 | 6.66 | 653,639.04 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 21,571 | 4.23 | 91,331.61 |
| | BHP BILLITTON PLC | 140,395 | 8.60 | 1,207,537.39 |

| | | | |
|-----------------------------|---------|-------|--------------|
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 9,926 | 29.50 | 292,817.00 |
| FRESNILLO PLC | 14,610 | 12.11 | 176,927.10 |
| GLENCORE PLC | 780,581 | 1.37 | 1,076,811.48 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 12,196 | 29.75 | 362,831.00 |
| MONDI PLC | 22,464 | 13.52 | 303,713.28 |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 6,740 | 66.25 | 446,525.00 |
| REXAM PLC | 52,366 | 6.38 | 334,356.91 |
| RIO TINTO PLC REG | 81,702 | 19.67 | 1,607,486.85 |
| ASHTREAD GROUP PLC | 29,500 | 9.80 | 289,247.50 |
| BAE SYSTEMS PLC | 210,663 | 4.85 | 1,022,768.86 |
| BUNZL PLC | 23,267 | 20.64 | 480,230.88 |
| COBHAM PLC | 68,649 | 1.42 | 97,618.87 |
| DCC PLC | 6,242 | 63.65 | 397,303.30 |
| IMI PLC | 14,582 | 10.04 | 146,403.28 |
| MEGGITT PLC | 43,669 | 3.86 | 168,649.67 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 126,606 | 5.99 | 759,002.97 |
| SMITHS GROUP PLC | 23,298 | 11.23 | 261,636.54 |
| TRAVIS PERKINS PLC | 15,153 | 18.51 | 280,482.03 |
| WEIR GROUP PLC/THE | 12,587 | 12.74 | 160,358.38 |
| WOLSELEY LTD | 17,752 | 36.96 | 656,113.92 |
| AGGREKO PLC | 15,294 | 12.11 | 185,210.34 |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 14,809 | 10.35 | 153,273.15 |
| CAPITA GROUP PLC | 40,800 | 10.54 | 430,032.00 |
| EXPERIAN PLC | 65,109 | 13.00 | 846,417.00 |
| G4S PLC | 93,926 | 1.85 | 173,950.95 |
| INTERTEK GROUP PLC | 9,459 | 32.60 | 308,363.40 |
| EASYJET PLC | 9,909 | 14.88 | 147,445.92 |
| ROYAL MAIL PLC | 64,905 | 5.35 | 347,241.75 |
| NEW GKN | 112,301 | 2.75 | 309,052.35 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 61,521 | 5.67 | 349,131.67 |
| BURBERRY GROUP PLC | 27,384 | 10.90 | 298,485.60 |
| PERSIMMON PLC | 18,455 | 20.19 | 372,606.45 |
| TAYLOR WIMPAY PLC | 201,733 | 1.88 | 380,670.17 |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 8,202 | 32.24 | 264,432.48 |
| CARNIVAL PLC | 11,381 | 34.10 | 388,092.10 |
| COMPASS GROUP PLC | 108,748 | 12.99 | 1,412,636.52 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 13,670 | 26.24 | 358,700.80 |
| MERLIN ENTERTAINME | 43,424 | 4.27 | 185,550.75 |
| TUI AG-DI | 35,779 | 10.22 | 365,661.38 |
| WHITBREAD PLC | 11,113 | 41.08 | 456,522.04 |
| WILLIAM HILL | 56,109 | 3.02 | 169,785.83 |
| ITV PLC | 238,861 | 2.08 | 498,264.04 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|-------|--------------|
| PEARSON | 50,577 | 8.18 | 413,972.74 |
| RELX PLC | 69,350 | 12.50 | 866,875.00 |
| SKY PLC | 63,549 | 9.55 | 606,892.95 |
| WPP PLC | 83,664 | 15.74 | 1,316,871.36 |
| DIXONS CARPHONE PLC | 65,594 | 4.22 | 277,200.24 |
| KINGFISHER PLC | 145,305 | 3.66 | 532,978.74 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 100,935 | 3.79 | 382,846.45 |
| NEXT PLC | 8,896 | 54.75 | 487,056.00 |
| MORRISON SUPERMARKETS | 164,922 | 1.86 | 307,579.53 |
| SAINSBURY (J) PLC | 102,944 | 2.47 | 254,786.40 |
| TESCO | 542,196 | 1.57 | 856,127.48 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 22,390 | 29.40 | 658,266.00 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO | 120,701 | 42.72 | 5,156,950.22 |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 12,065 | 14.44 | 174,218.60 |
| DIAGEO | 162,096 | 18.49 | 2,997,155.04 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 62,688 | 37.28 | 2,337,322.08 |
| SABMILLER PLC | 63,424 | 42.95 | 2,724,377.92 |
| TATE & LYLE | 29,097 | 6.34 | 184,474.98 |
| RECKITT BENCKISER PLC | 41,614 | 68.63 | 2,855,968.82 |
| UNILEVER PLC | 83,800 | 32.12 | 2,691,656.00 |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 21,500 | 8.94 | 192,317.50 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 55,192 | 11.63 | 641,882.96 |
| ASTRAZENECA | 82,004 | 39.53 | 3,241,618.12 |
| GLAXOSMITHKLINE | 315,252 | 14.40 | 4,541,205.06 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 10,716 | 22.64 | 242,610.24 |
| SHIRE PLC | 38,980 | 42.95 | 1,674,191.00 |
| BARCLAYS | 1,104,577 | 1.76 | 1,944,607.80 |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 1,293,295 | 4.43 | 5,736,409.97 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,239,740 | 0.69 | 2,930,084.31 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND | 216,999 | 2.22 | 481,737.78 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 221,188 | 5.35 | 1,184,240.55 |
| 3I GROUP PLC | 70,528 | 5.64 | 398,130.56 |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC | 55,195 | 2.72 | 150,130.40 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 19,956 | 13.12 | 261,822.72 |
| ICAP PLC | 30,718 | 4.17 | 128,339.80 |
| INVESTEC PLC | 47,991 | 4.72 | 226,517.52 |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 19,116 | 26.34 | 503,515.44 |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC | 8,699 | 28.12 | 244,615.88 |
| SCHRODERS PLC | 7,525 | 26.30 | 197,907.50 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 12,465 | 19.72 | 245,809.80 |
| AVIVA PIC | 268,073 | 4.34 | 1,165,581.40 |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 85,800 | 3.58 | 307,593.00 |

| | | | | |
|--------|-----------------------------------|------------|-----------|------------------------------------|
| | LEGAL & GENERAL GROUP | 404,906 | 2.30 | 933,308.33 |
| | OLD MUTUAL PLC | 302,181 | 1.86 | 563,567.56 |
| | PRUDENTIAL | 168,389 | 12.89 | 2,171,376.15 |
| | RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 65,577 | 4.77 | 312,933.44 |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 32,728 | 8.82 | 288,824.60 |
| | STANDARD LIFE PLC | 124,112 | 3.30 | 410,314.27 |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 60,396 | 4.24 | 256,139.43 |
| | SAGE GROUP PLC | 67,660 | 6.27 | 424,566.50 |
| | WORLDPAY GROUP PLC | 105,272 | 2.79 | 293,919.42 |
| | BT GROUP PLC | 553,573 | 4.25 | 2,354,069.18 |
| | INMARSAT PLC | 27,245 | 7.02 | 191,259.90 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,727,244 | 2.19 | 3,793,891.44 |
| | CENTRICA PLC | 341,505 | 2.07 | 709,988.89 |
| | NATIONAL GRID PLC | 241,196 | 9.83 | 2,373,127.44 |
| | SEVERN TRENT PLC | 17,102 | 22.83 | 390,438.66 |
| | SSE PLC | 67,111 | 15.47 | 1,038,207.17 |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 47,522 | 9.69 | 460,725.79 |
| | ARM HOLDINGS PLC | 93,874 | 9.94 | 933,576.93 |
| | イギリスポンド 小計 | 19,519,527 | | 104,331,560.57 (16,150,525,576) |
| スイスフラン | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 607 | 486.50 | 295,305.50 |
| | GIVAUDAN-REG | 599 | 1,857.00 | 1,112,343.00 |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 29,281 | 43.53 | 1,274,601.93 |
| | SIKA AG-BR | 146 | 4,234.00 | 618,164.00 |
| | SYNGENTA AG | 6,050 | 391.80 | 2,370,390.00 |
| | ABB LTD | 130,767 | 20.37 | 2,663,723.79 |
| | GEBERIT AG-REG | 2,617 | 377.50 | 987,917.50 |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1,611 | 183.00 | 294,813.00 |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 3,050 | 182.00 | 555,100.00 |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 10,993 | 59.60 | 655,182.80 |
| | SGS SA | 363 | 2,162.00 | 784,806.00 |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 3,638 | 137.40 | 499,861.20 |
| | CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD) | 33,828 | 60.65 | 2,051,668.20 |
| | SWATCH GROUP AG(BEARER) | 1,990 | 304.20 | 605,358.00 |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 3,004 | 59.50 | 178,738.00 |
| | DUFREY AG-REG | 3,372 | 126.00 | 424,872.00 |
| | ARYZTA AG | 6,169 | 39.58 | 244,169.02 |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 129 | 1,182.00 | 152,478.00 |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 56 | 5,830.00 | 326,480.00 |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-REG | 6 | 71,000.00 | 426,000.00 |
| | NESTLE SA - REGISTERED | 208,792 | 73.00 | 15,241,816.00 |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 3,574 | 127.90 | 457,114.60 |

| | | | | | |
|----------------|---------------------------------|-----------|----------|----------------------------------|--|
| | ACTELION LTD-REG | 6,532 | 164.80 | 1,076,473.60 | |
| | GALENICA AG-REG | 219 | 1,292.00 | 282,948.00 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 3,783 | 166.40 | 629,491.20 | |
| | NOVARTIS | 149,186 | 77.80 | 11,606,670.80 | |
| | ROCHE HOLDING GENUSS | 46,055 | 256.50 | 11,813,107.50 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG | 125,212 | 12.55 | 1,571,410.60 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 13,528 | 42.62 | 576,563.36 | |
| | PARGESA HOLDING SA-BR | 2,289 | 65.70 | 150,387.30 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,090 | 412.50 | 449,625.00 | |
| | UBS GROUP AG | 236,327 | 14.23 | 3,362,933.21 | |
| | BALOISE HOLDING AG | 3,505 | 114.20 | 400,271.00 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 2,156 | 243.90 | 525,848.40 | |
| | SWISS RE LTD | 22,110 | 85.90 | 1,899,249.00 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 9,800 | 227.50 | 2,229,500.00 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 4,615 | 85.70 | 395,505.50 | |
| | SWISSCOM | 1,690 | 467.40 | 789,906.00 | |
| | スイスフラン 小計 | 1,078,739 | | 69,980,793.01 (7,769,267,639) | |
| スウェーデンク ローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 13,543 | 159.10 | 2,154,691.30 | |
| | BOLIDEN AB | 15,596 | 156.50 | 2,440,774.00 | |
| | ALFA LAVAL AB | 17,624 | 130.10 | 2,292,882.40 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 65,273 | 169.80 | 11,083,355.40 | |
| | ATLAS COPCO A | 44,278 | 213.50 | 9,453,353.00 | |
| | ATLAS COPCO B | 23,611 | 195.10 | 4,606,506.10 | |
| | SANDVIK AB | 71,073 | 83.45 | 5,931,041.85 | |
| | SKANSKA B | 22,627 | 180.60 | 4,086,436.20 | |
| | SKF AB-B | 29,300 | 148.20 | 4,342,260.00 | |
| | VOLVO B | 96,421 | 93.70 | 9,034,647.70 | |
| | SECURITAS B | 18,644 | 125.10 | 2,332,364.40 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 14,061 | 222.20 | 3,124,354.20 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 21,841 | 65.45 | 1,429,493.45 | |
| | HENNES & MAURITZ B | 60,121 | 251.20 | 15,102,395.20 | |
| | ICA GRUPPEN AB | 5,879 | 292.90 | 1,721,959.10 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 13,067 | 282.20 | 3,687,507.40 | |
| | SCA SV CELLULOSA B | 39,460 | 258.70 | 10,208,302.00 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 14,126 | 171.90 | 2,428,259.40 | |
| | NORDEA BANK AB | 198,544 | 78.40 | 15,565,849.60 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A | 99,678 | 77.90 | 7,764,916.20 | |
| | SVENSKA HANDELSBK A | 96,048 | 102.00 | 9,796,896.00 | |
| | SWEDBANK AB-A | 57,994 | 179.90 | 10,433,120.60 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 8,631 | 136.30 | 1,176,405.30 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 29,721 | 283.60 | 8,428,875.60 | |

| | | | | | |
|-----------|-----------------------------|-----------|--------------|-----------------------------------|--|
| | KINNEVIK AB - B | 13,657 | 200.30 | 2,735,497.10 | |
| | KINNEVIK AB- RED | 13,657 | 17.90 | 244,460.30 | |
| | ERICSSON (LM) B | 191,045 | 62.40 | 11,921,208.00 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 16,813 | 316.50 | 5,321,314.50 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 3,878 | 497.40 | 1,928,917.20 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 18,919 | 70.80 | 1,339,465.20 | |
| | TELIA CO AB | 163,614 | 38.23 | 6,254,963.22 | |
| | スウェーデンクローナ 小計 | 1,498,744 | | 178,372,471.92 (2,331,328,207) | |
| ノルウェークローネ | STATOIL ASA | 72,493 | 138.00 | 10,004,034.00 | |
| | NORSK HYDRO | 99,818 | 32.07 | 3,201,163.26 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 10,504 | 288.70 | 3,032,504.80 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 4,706 | 235.90 | 1,110,145.40 | |
| | SCHIBSTED ASA-CL A | 3,934 | 250.40 | 985,073.60 | |
| | MARINE HARVEST | 27,465 | 142.60 | 3,916,509.00 | |
| | ORKLA | 54,484 | 74.55 | 4,061,782.20 | |
| | DNB ASA | 68,332 | 105.10 | 7,181,693.20 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 16,016 | 143.40 | 2,296,694.40 | |
| | TELENOR ASA | 47,761 | 134.10 | 6,404,750.10 | |
| | ノルウェークローネ 小計 | 405,513 | | 42,194,349.96 (553,589,871) | |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 6,724 | 417.10 | 2,804,580.40 | |
| | NOVOZYMES A/S | 15,009 | 310.10 | 4,654,290.90 | |
| | VESTAS WIND SYSYEMS | 15,454 | 464.10 | 7,172,201.40 | |
| | ISS A/S | 10,315 | 261.30 | 2,695,309.50 | |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 232 | 8,335.00 | 1,933,720.00 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 423 | 8,675.00 | 3,669,525.00 | |
| | DSV A/S | 11,421 | 297.60 | 3,398,889.60 | |
| | PANDORA A/S | 7,981 | 979.50 | 7,817,389.50 | |
| | CARLSBERG AS-B | 7,145 | 633.00 | 4,522,785.00 | |
| | COLOPLAST-B | 8,627 | 486.90 | 4,200,486.30 | |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 10,685 | 137.20 | 1,465,982.00 | |
| | GENMAB A/S | 3,673 | 1,233.00 | 4,528,809.00 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 122,045 | 374.70 | 45,730,261.50 | |
| | DANSKE BANK A/S | 46,412 | 188.50 | 8,748,662.00 | |
| | TRYG A/S | 10,192 | 123.80 | 1,261,769.60 | |
| TDC A/S | 43,672 | 33.23 | 1,451,220.56 | | |
| | デンマーククローネ 小計 | 320,010 | | 106,055,882.26 (1,726,589,763) | |
| オーストラリアドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 18,413 | 33.19 | 611,127.47 | |
| | OIL SEARCH LTD | 92,814 | 7.00 | 649,698.00 | |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 128,665 | 6.00 | 771,990.00 | |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|--------------|
| SANTOS | 109,387 | 4.81 | 526,151.47 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 48,631 | 27.35 | 1,330,057.85 |
| ALUMINA LIMITED | 135,453 | 1.44 | 195,729.58 |
| AMCOR | 71,708 | 14.85 | 1,064,863.80 |
| BHP BILLITON LTD | 208,915 | 19.61 | 4,096,823.15 |
| BORAL LIMITED | 48,785 | 6.58 | 321,005.30 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 81,907 | 3.27 | 267,835.89 |
| INCITEC PIVOT LTD | 118,256 | 3.38 | 399,705.28 |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 32,125 | 20.59 | 661,453.75 |
| NEWCREST MINING LIMITED | 46,131 | 22.03 | 1,016,265.93 |
| ORICA LTD | 19,570 | 13.10 | 256,367.00 |
| RIO TINTO LTD | 28,074 | 45.44 | 1,275,682.56 |
| SOUTH32 LTD | 307,797 | 1.67 | 515,559.97 |
| CIMIC GROUP LIMITED | 6,260 | 36.71 | 229,804.60 |
| BRAMBLES LTD | 103,107 | 12.61 | 1,300,179.27 |
| SEEK LTD | 17,113 | 15.67 | 268,160.71 |
| ASCIANO GROUP | 41,236 | 8.88 | 366,175.68 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 144,504 | 4.58 | 661,828.32 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 32,962 | 3.01 | 99,215.62 |
| TRANSURBAN GROUP | 132,240 | 11.88 | 1,571,011.20 |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 38,499 | 13.22 | 508,956.78 |
| CROWN RESORTS LTD | 22,372 | 11.73 | 262,423.56 |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 4,974 | 69.23 | 344,350.02 |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 2,988 | 31.96 | 95,496.48 |
| TABCORP HOLDINGS | 46,982 | 4.41 | 207,190.62 |
| TATTS GROUP LTD | 87,232 | 3.87 | 337,587.84 |
| REA GROUP LTD | 3,000 | 55.99 | 167,970.00 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 37,021 | 4.56 | 168,815.76 |
| WESFARMERS LTD | 73,421 | 41.07 | 3,015,400.47 |
| WOOLWORTHS LTD | 83,410 | 21.73 | 1,812,499.30 |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED | 35,080 | 8.74 | 306,599.20 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 40,720 | 10.07 | 410,050.40 |
| COCHLEAR LIMITED | 3,095 | 121.68 | 376,599.60 |
| HEALTHSCOPE LTD | 92,574 | 2.81 | 260,132.94 |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 10,361 | 73.49 | 761,429.89 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 27,585 | 21.69 | 598,318.65 |
| CSL LIMITED | 30,307 | 116.33 | 3,525,613.31 |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | 188,938 | 24.50 | 4,628,981.00 |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 19,098 | 11.13 | 212,560.74 |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 37,943 | 9.38 | 355,905.34 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUST | 110,555 | 76.30 | 8,435,346.50 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK | 170,681 | 26.41 | 4,507,685.21 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--|
| | WESTPAC BANKING | 215,482 | 30.33 | 6,535,569.06 | |
| | ASX LTD | 13,876 | 45.16 | 626,640.16 | |
| | CHALLENGER FINANCIAL SERVICE | 30,531 | 9.27 | 283,022.37 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 19,990 | 74.18 | 1,482,858.20 | |
| | PLATINUM ASSET MANAGEMENT | 4,900 | 6.43 | 31,507.00 | |
| | AMP LTD | 196,396 | 5.47 | 1,074,286.12 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GRP. | 163,334 | 5.80 | 947,337.20 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 157,000 | 3.18 | 499,260.00 | |
| | QBE INSURANCE GROUP | 96,134 | 12.09 | 1,162,260.06 | |
| | SUNCORP GROUP LIMITED | 78,058 | 12.56 | 980,408.48 | |
| | COMPUTERSHARE LIMITED | 28,680 | 10.39 | 297,985.20 | |
| | TELSTRA CORP | 278,965 | 5.47 | 1,525,938.55 | |
| | TPG TELECOM LTD | 22,697 | 11.97 | 271,683.09 | |
| | VOCUS COMMUNICATIONS LTD | 26,200 | 9.28 | 243,136.00 | |
| | AGL ENERGY LTD | 44,633 | 18.93 | 844,902.69 | |
| | AUSNET SERVICES | 117,666 | 1.57 | 184,735.62 | |
| | オーストラリアドル 小計 | 4,635,431 | | 66,748,135.81 (5,298,467,020) | |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 40,101 | 8.64 | 346,472.64 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 73,163 | 6.39 | 467,511.57 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 22,000 | 9.63 | 211,860.00 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 105,967 | 3.31 | 350,750.77 | |
| | CONTACT ENERGY LTD | 36,737 | 5.35 | 196,542.95 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 107,684 | 2.63 | 283,208.92 | |
| | MIGHTY RIVER POWER | 74,731 | 3.01 | 225,313.96 | |
| | ニュージーランドドル 小計 | 460,383 | | 2,081,660.81 (158,560,103) | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 175,948 | 92.50 | 16,275,190.00 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 73,500 | 12.18 | 895,230.00 | |
| | CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 108,000 | 12.28 | 1,326,240.00 | |
| | MTR CORP | 100,500 | 37.95 | 3,813,975.00 | |
| | LI & FUNG | 377,400 | 4.08 | 1,539,792.00 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 84,000 | 30.90 | 2,595,600.00 | |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 47,000 | 31.45 | 1,478,150.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 163,000 | 24.90 | 4,058,700.00 | |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 60,400 | 10.78 | 651,112.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 161,000 | 27.25 | 4,387,250.00 | |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD | 90,000 | 8.77 | 789,300.00 | |
| | SJM HOLDINGS LTD | 140,000 | 4.83 | 676,200.00 | |
| | WYNN MACAU LTD | 107,200 | 11.82 | 1,267,104.00 | |
| | WH GROUP LTD | 438,000 | 6.13 | 2,684,940.00 | |
| BANK EAST ASIA | 67,964 | 29.35 | 1,994,743.40 | | |

| | | | | | |
|----------|------------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
| | BOC HONG KONG HOLDINGS -R | 237,000 | 23.85 | 5,652,450.00 | |
| | HANG SENG BANK | 50,300 | 139.90 | 7,036,970.00 | |
| | FIRST PACIFIC CO | 112,000 | 5.27 | 590,240.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 73,100 | 191.50 | 13,998,650.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 784,600 | 46.50 | 36,483,900.00 | |
| | CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 168,948 | 49.45 | 8,354,478.60 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 157,000 | 15.44 | 2,424,080.00 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMEN | 73,522 | 42.65 | 3,135,713.30 | |
| | HYSAN DEVELOPMENT CO | 31,000 | 33.95 | 1,052,450.00 | |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 37,000 | 19.40 | 717,800.00 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 305,000 | 7.52 | 2,293,600.00 | |
| | SINO LAND CO | 186,600 | 12.26 | 2,287,716.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 99,000 | 94.05 | 9,310,950.00 | |
| | SWIRE PACIFIC A | 39,500 | 88.20 | 3,483,900.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 67,000 | 21.55 | 1,443,850.00 | |
| | WHARF HOLDINGS | 88,000 | 46.00 | 4,048,000.00 | |
| | WHEELLOCK & CO LTD | 49,000 | 36.60 | 1,793,400.00 | |
| | PCCW LTD | 348,000 | 5.20 | 1,809,600.00 | |
| | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 44,000 | 74.05 | 3,258,200.00 | |
| | CLP HOLDINGS | 112,500 | 76.55 | 8,611,875.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 450,933 | 15.60 | 7,034,554.80 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 87,500 | 77.50 | 6,781,250.00 | |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 11,700 | 59.50 | 696,150.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 5,807,115 | | 176,733,304.10 (2,438,919,596) | |
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 97,600 | 5.71 | 557,296.00 | |
| | NOBLE GROUP LTD | 292,145 | 0.26 | 77,418.42 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 62,000 | 2.95 | 182,900.00 | |
| | SEMBCORP MARINE LTD | 49,400 | 1.71 | 84,474.00 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 108,100 | 3.17 | 342,677.00 | |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING | 83,600 | 0.91 | 76,076.00 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 156,200 | 2.73 | 426,426.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES | 32,500 | 10.60 | 344,500.00 | |
| | GENTING SINGAPORE PLC | 419,400 | 0.76 | 318,744.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 116,150 | 3.93 | 456,469.50 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 7,200 | 34.26 | 246,672.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 486,720 | 0.38 | 184,953.60 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 133,000 | 3.40 | 452,200.00 | |
| | DBS GROUP | 115,700 | 15.90 | 1,839,630.00 | |
| | OCBC BANK | 206,250 | 8.74 | 1,802,625.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 86,600 | 18.74 | 1,622,884.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 59,400 | 7.70 | 457,380.00 | |

| | | | | | |
|-----------|------------------------------|------------|--------|--------------------------------------|--|
| | CAPITALAND LTD | 149,000 | 3.05 | 454,450.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 22,000 | 8.80 | 193,600.00 | |
| | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 177,000 | 1.85 | 327,450.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 19,400 | 5.61 | 108,834.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 522,880 | 3.95 | 2,065,376.00 | |
| | STARHUB LTD | 21,000 | 3.63 | 76,230.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | 3,423,245 | | 12,699,265.52 (1,004,638,895) | |
| イスラエルシェケル | ISRAEL CHEMICALS LTD | 28,484 | 15.86 | 451,756.24 | |
| | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 59,396 | 207.60 | 12,330,609.60 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 64,237 | 19.11 | 1,227,569.07 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 82,035 | 13.65 | 1,119,777.75 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 4,565 | 44.50 | 203,142.50 | |
| | AZRIELI GROUP | 3,267 | 161.50 | 527,620.50 | |
| | NICE SYSTEMS LTD | 4,492 | 243.00 | 1,091,556.00 | |
| | BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP | 117,181 | 7.24 | 848,624.80 | |
| | イスラエルシェケル 小計 | 363,657 | | 17,800,656.46 (496,994,328) | |
| | 合 計 | 75,654,704 | | 202,772,232,886 (202,772,232,886) | |

(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 | 136,045.00 | |
| | | アメリカドル 小計 | 299,000 | 136,045.00 (14,570,419) | |
| | オーストラリアドル | APA GROUP | 67,084 | 589,668.36 | |
| | | DUET GROUP | 125,970 | 297,289.20 | |
| | | LENDLEASE GROUP | 37,728 | 516,873.60 | |
| | | SYDNEY AIRPORT | 76,180 | 539,354.40 | |
| | オーストラリアドル 小計 | 306,962 | 1,943,185.56 (154,250,069) | | |
| | 香港ドル | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 130,000 | 899,600.00 | |
| | | HKT TRUST AND HKT LTD | 165,000 | 1,844,700.00 | |
| | | 香港ドル 小計 | 295,000 | 2,744,300.00 (37,871,340) | |
| | 投資信託受益証券合計 | 900,962 | 206,691,828 (206,691,828) | | |
| 投資証券 | アメリカドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 5,064 | 497,082.24 | |
| | | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 22,610 | 431,172.70 | |

| | | | | |
|-------|---------------------------------------|-----------|----------------------------------|--|
| | AMERICAN TOWER CORPORATION | 27,746 | 3,026,256.22 | |
| | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 58,573 | 632,588.40 | |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 8,962 | 1,525,780.50 | |
| | BOSTON PROPERTIES | 10,056 | 1,297,022.88 | |
| | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 11,670 | 304,353.60 | |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 5,153 | 416,413.93 | |
| | CROWN CASTLE INTL CORP | 22,049 | 2,081,866.58 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 9,734 | 1,001,044.56 | |
| | DUKE REALTY CORP | 22,673 | 561,383.48 | |
| | EQUINIX INC | 4,633 | 1,729,081.93 | |
| | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 23,516 | 1,515,841.36 | |
| | ESSEX PROPERTY TRUST | 4,035 | 844,364.10 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 7,863 | 705,075.21 | |
| | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 4,351 | 683,629.12 | |
| | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 36,060 | 994,895.40 | |
| | HCP INC | 31,992 | 1,103,084.16 | |
| | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 47,605 | 742,161.95 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 17,640 | 654,620.40 | |
| | KIMCO REALTY CORP | 25,975 | 760,548.00 | |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 10,075 | 388,895.00 | |
| | MACERICH CO/THE | 8,542 | 668,411.50 | |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 4,925 | 485,014.00 | |
| | PROLOGIS INC | 34,046 | 1,697,874.02 | |
| | PUBLIC STORAGE | 9,654 | 2,369,381.22 | |
| | REALTY INCOME CORP | 16,582 | 1,060,916.36 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 6,164 | 490,592.76 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP | 20,181 | 4,069,498.65 | |
| | SL GREEN REALTY CORP | 6,716 | 681,539.68 | |
| | UDR INC | 16,191 | 545,798.61 | |
| | VENTAS INC | 21,609 | 1,478,487.78 | |
| | VEREIT INC | 53,870 | 532,235.60 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 10,567 | 1,026,901.06 | |
| | WELLTOWER INC | 23,227 | 1,675,828.05 | |
| | アメリカドル 小計 | 650,309 | 38,679,641.01 (4,142,589,552) | |
| カナダドル | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT | 9,959 | 219,894.72 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 12,945 | 360,129.90 | |
| | SMART REAL ESTATE INVSTMENT | 2,942 | 105,676.64 | |
| | カナダドル 小計 | 25,846 | 685,701.26 (57,674,332) | |
| ユーロ | BGP HOLDINGS PLC | 1,605,584 | - | |

| | | | |
|---------------|------------------------------|-----------|----------------------------------|
| | FONCIERE DES REGIONS | 1,902 | 155,488.50 |
| | GECINA SA | 3,085 | 401,975.50 |
| | ICADE | 1,843 | 123,278.27 |
| | KLEPIERRE | 14,451 | 608,965.14 |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 6,531 | 1,576,909.95 |
| | ユーロ 小計 | 1,633,396 | 2,866,617.36 (346,889,366) |
| イギリスポ ンド | BRITISH LAND CO PLC | 58,762 | 435,426.42 |
| | HAMMERSON PLC | 57,863 | 336,473.34 |
| | INTU PROPERTIES PLC | 53,831 | 164,130.71 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 49,503 | 576,709.95 |
| | SEGRO PLC | 45,745 | 203,199.29 |
| | イギリスポンド 小計 | 265,704 | 1,715,939.71 (265,627,467) |
| オーストラ リアドル | DEXUS PROPERTY GROUP | 66,717 | 596,449.98 |
| | GOODMAN GROUP | 120,988 | 882,002.52 |
| | GPT GROUP | 106,799 | 582,054.55 |
| | MIRVAC GROUP | 229,116 | 462,814.32 |
| | SCENTRE GROUP | 347,021 | 1,630,998.70 |
| | STOCKLAND | 160,120 | 762,171.20 |
| | VICINITY CENTERS | 198,963 | 658,567.53 |
| | WESTFIELD CORP | 125,943 | 1,353,887.25 |
| | オーストラリアドル 小計 | 1,355,667 | 6,928,946.05 (550,019,737) |
| 香港ドル | LINK REIT | 139,000 | 6,901,350.00 |
| | 香港ドル 小計 | 139,000 | 6,901,350.00 (95,238,630) |
| シンガポ ールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 166,800 | 390,312.00 |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 110,000 | 155,100.00 |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 144,600 | 294,984.00 |
| | SUNTEC REIT | 113,000 | 187,015.00 |
| | シンガポールドル 小計 | 534,400 | 1,027,411.00 (81,278,484) |
| | 投資証券合計 | 4,604,322 | 5,539,317,568 (5,539,317,568) |
| | 合計 | | 5,746,009,396 (5,746,009,396) |

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 597銘柄 | 96.9% | | | 63.1% |
| | 投資信託受 益証券 1銘柄 | | 0.0% | | 0.0% |
| | 投資証券 35銘柄 | | | 3.1% | 2.0% |
| カナダドル | 株式 91銘柄 | 99.3% | | | 3.9% |
| | 投資証券 3銘柄 | | | 0.7% | 0.0% |
| ユーロ | 株式 233銘柄 | 98.6% | | | 12.1% |
| | 投資証券 6銘柄 | | | 1.4% | 0.2% |
| イギリスポンド | 株式 109銘柄 | 98.4% | | | 7.7% |
| | 投資証券 5銘柄 | | | 1.6% | 0.1% |
| スイスフラン | 株式 38銘柄 | 100.0% | | | 3.7% |
| スウェーデンクローナ | 株式 31銘柄 | 100.0% | | | 1.1% |
| ノルウェークローネ | 株式 10銘柄 | 100.0% | | | 0.3% |
| デンマーククローネ | 株式 16銘柄 | 100.0% | | | 0.8% |
| オーストラリアドル | 株式 61銘柄 | 88.3% | | | 2.5% |
| | 投資信託受 益証券 4銘柄 | | 2.6% | | 0.1% |
| | 投資証券 8銘柄 | | | 9.2% | 0.3% |
| 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 | 94.8% | | | 1.2% |
| | 投資信託受 益証券 2銘柄 | | 1.5% | | 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 | 92.5% | | | 0.5% |
| | 投資証券 4銘柄 | | | 7.5% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 株式 8銘柄 | 100.0% | | | 0.2% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

| | 平成28年 6月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 142,182,756 |
| 金銭信託 | 233,383,870 |
| コール・ローン | 1,425,914,995 |
| 国債証券 | 165,855,121,011 |
| 派生商品評価勘定 | 5,380,999 |
| 未収入金 | 15,233,928 |
| 未収利息 | 1,337,294,871 |
| 前払費用 | 67,195,143 |
| 差入委託証拠金 | 185,106,156 |
| 流動資産合計 | 169,266,813,729 |
| 資産合計 | 169,266,813,729 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 18,733,597 |
| 前受金 | 5,380,999 |
| 未払金 | 35,869,626 |
| 未払解約金 | 665,685,388 |
| 未払利息 | 3,579 |
| その他未払費用 | 140,337 |
| 流動負債合計 | 725,813,526 |
| 負債合計 | 725,813,526 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 74,640,797,505 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 93,900,202,698 |
| 元本等合計 | 168,541,000,203 |
| 純資産合計 | 168,541,000,203 |
| 負債純資産合計 | 169,266,813,729 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成28年 6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> |

| | 平成28年 6月10日現在 |
|------------------------|---|
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <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> <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> <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28年 6月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 74,640,797,505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 2.2580円 (1万口当たり純資産額) (22,580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28年 6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。 |

| 平成28年 6月10日現在 | |
|------------------|---|
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p> |

2.金融商品の時価等に関する事項

| 平成28年 6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28年 6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12月11日 |
| 期首元本額 | 78,266,297,921円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,327,064,924円 |
| 期中一部解約元本額 | 8,952,565,340円 |
| 期末元本額 | 74,640,797,505円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券インデックスファンド | 2,811,770,692円 |
| D C 外国債券インデックスファンド | 1,828,578,165円 |
| D C 外国債券インデックスファンド L | 10,320,696,389円 |
| 物価連動債組入世界債券ファンド | 29,559,948円 |
| D C バランスファンド 3 0 | 539,745,474円 |
| D C バランスファンド 5 0 | 541,243,200円 |
| D C バランスファンド 7 0 | 94,338,613円 |
| ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型） | 37,411,173円 |
| ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型） | 21,223,916円 |
| 新生・4分散ファンド | 48,267,007円 |
| グローバル・インデックス・バランス・ファンド | 422,007,687円 |
| 外国債券インデックス e | 1,698,229,015円 |
| インデックスコレクション（外国債券） | 2,494,278,826円 |
| インデックスコレクション（バランス株式 3 0） | 1,068,189,952円 |
| インデックスコレクション（バランス株式 5 0） | 244,091,775円 |
| インデックスコレクション（バランス株式 7 0） | 73,569,595円 |
| 私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 2,901,765,672円 |
| 外国債券パッシブファンド私募 A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用） | 2,766,235,402円 |
| 外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用） | 1,875,842,070円 |

| 区分 | 平成28年 6月10日現在 |
|---------------------------------|-----------------|
| バランスVA30（適格機関投資家専用） | 826,023,068円 |
| バランスVA50（適格機関投資家専用） | 3,240,231,804円 |
| VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用） | 926,369,784円 |
| VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用） | 1,103,995,592円 |
| VAバランス株式30（適格機関投資家専用） | 24,929,489円 |
| VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用） | 2,274,521,601円 |
| バランスVA25（適格機関投資家専用） | 3,489,859,994円 |
| バランスVA37.5（適格機関投資家専用） | 1,012,052,145円 |
| バランスVA50L（適格機関投資家専用） | 10,181,099,147円 |
| バランスVA75（適格機関投資家専用） | 461,523,871円 |
| VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用） | 10,141,739,159円 |
| VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用） | 2,434,354,583円 |
| VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用） | 202,286,169円 |
| バランスVA40（適格機関投資家専用） | 786,188,606円 |
| VAバランス株式40（適格機関投資家専用） | 193,877,459円 |
| VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用） | 161,100,463円 |
| VAバランス50-50（適格機関投資家専用） | 75,857,563円 |
| バランスVA20（適格機関投資家専用） | 157,345,750円 |
| VAファンド25（適格機関投資家専用） | 4,192,716,047円 |
| バランスVA20L（適格機関投資家専用） | 18,210,485円 |
| バランスVA25L（適格機関投資家専用） | 423,605,462円 |
| 世界バランスVA25（適格機関投資家専用） | 134,615,602円 |
| VAバランス20-80（適格機関投資家専用） | 2,342,536,136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） | 18,429,764円 |
| 世界バランスVA20（適格機関投資家専用） | 283,191円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年 6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 | 1,917,283,884 |
| 合計 | 1,917,283,884 |

(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28年 6月10日現在）

| | | | |
|--|--|--|--|
| | | | |
|--|--|--|--|

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|--------------|-------------|-------|-------------|-------------|
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 755,718,810 | - | 761,099,809 | 5,380,999 |
| | 合計 | 755,718,810 | - | 761,099,809 | 5,380,999 |

(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28年 6月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------------|-------------|-------|-------------|-------------|
| | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | 928,111,397 | - | 909,377,800 | 18,733,597 |
| | アメリカドル | 430,468,918 | - | 421,855,800 | 8,613,118 |
| | カナダドル | 49,836,078 | - | 49,613,100 | 222,978 |
| | ユーロ | 357,473,041 | - | 349,690,000 | 7,783,041 |
| | イギリスポンド | 90,333,360 | - | 88,218,900 | 2,114,460 |
| | 合計 | 928,111,397 | - | 909,377,800 | 18,733,597 |

(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 | 6,995,624.03 | |
| | | T 0.625% 04/30/18 | 2,850,000.00 | 2,842,708.01 | |

| | | | |
|-------------------|--------------|--------------|--|
| T 0.625% 05/31/17 | 3,000,000.00 | 2,999,707.02 | |
| T 0.625% 08/31/17 | 2,500,000.00 | 2,497,900.40 | |
| T 0.625% 09/30/17 | 3,250,000.00 | 3,246,762.70 | |
| T 0.625% 11/30/17 | 5,000,000.00 | 4,992,382.80 | |
| T 0.75% 02/28/18 | 4,500,000.00 | 4,500,175.77 | |
| T 0.75% 03/31/18 | 5,000,000.00 | 4,999,218.75 | |
| T 0.75% 06/30/17 | 4,000,000.00 | 4,003,828.12 | |
| T 0.75% 10/31/17 | 1,600,000.00 | 1,600,656.25 | |
| T 0.75% 12/31/17 | 5,000,000.00 | 5,000,976.55 | |
| T 0.875% 01/31/18 | 2,000,000.00 | 2,004,140.62 | |
| T 0.875% 06/15/17 | 4,550,000.00 | 4,560,664.06 | |
| T 0.875% 07/15/17 | 4,000,000.00 | 4,009,218.76 | |
| T 0.875% 07/31/19 | 5,000,000.00 | 4,992,480.45 | |
| T 0.875% 10/15/18 | 6,000,000.00 | 6,007,148.46 | |
| T 1.125% 03/31/20 | 2,000,000.00 | 2,005,390.62 | |
| T 1.125% 05/31/19 | 2,850,000.00 | 2,869,315.41 | |
| T 1.125% 06/15/18 | 1,900,000.00 | 1,913,210.94 | |
| T 1.125% 12/31/19 | 5,200,000.00 | 5,219,804.66 | |
| T 1.25% 01/31/20 | 4,000,000.00 | 4,030,546.88 | |
| T 1.25% 03/31/21 | 2,300,000.00 | 2,303,773.44 | |
| T 1.25% 04/30/19 | 2,000,000.00 | 2,021,132.82 | |
| T 1.25% 11/15/18 | 9,000,000.00 | 9,090,527.31 | |
| T 1.25% 12/15/18 | 5,500,000.00 | 5,555,429.71 | |
| T 1.375% 02/28/19 | 4,050,000.00 | 4,105,371.11 | |
| T 1.375% 04/30/20 | 8,250,000.00 | 8,341,684.56 | |
| T 1.375% 04/30/21 | 3,000,000.00 | 3,021,796.89 | |
| T 1.375% 05/31/20 | 5,000,000.00 | 5,054,296.90 | |
| T 1.375% 06/30/18 | 3,500,000.00 | 3,542,109.37 | |
| T 1.375% 07/31/18 | 3,000,000.00 | 3,037,031.25 | |
| T 1.375% 09/30/18 | 2,520,000.00 | 2,552,041.39 | |
| T 1.375% 09/30/20 | 5,200,000.00 | 5,246,718.77 | |
| T 1.375% 10/31/20 | 6,000,000.00 | 6,052,734.36 | |
| T 1.375% 11/30/18 | 3,000,000.00 | 3,039,902.34 | |
| T 1.375% 12/31/18 | 3,700,000.00 | 3,749,574.22 | |
| T 1.5% 01/31/19 | 1,900,000.00 | 1,931,654.30 | |
| T 1.5% 01/31/22 | 5,000,000.00 | 5,041,796.90 | |
| T 1.5% 02/28/19 | 5,900,000.00 | 6,000,253.91 | |
| T 1.5% 02/28/23 | 2,900,000.00 | 2,905,494.13 | |
| T 1.5% 03/31/23 | 4,000,000.00 | 4,005,781.24 | |
| T 1.5% 05/31/19 | 1,350,000.00 | 1,373,519.53 | |
| T 1.5% 08/31/18 | 2,500,000.00 | 2,538,525.40 | |
| T 1.5% 10/31/19 | 3,200,000.00 | 3,255,562.49 | |
| | | | |

| | | |
|-------------------|--------------|--------------|
| T 1.5% 11/30/19 | 5,000,000.00 | 5,085,253.90 |
| T 1.5% 12/31/18 | 2,500,000.00 | 2,541,113.27 |
| T 1.625% 03/31/19 | 4,400,000.00 | 4,490,406.27 |
| T 1.625% 04/30/19 | 4,000,000.00 | 4,082,890.64 |
| T 1.625% 04/30/23 | 8,100,000.00 | 8,176,886.73 |
| T 1.625% 06/30/19 | 4,000,000.00 | 4,085,859.36 |
| T 1.625% 07/31/19 | 3,500,000.00 | 3,575,332.04 |
| T 1.625% 08/15/22 | 1,400,000.00 | 1,418,402.34 |
| T 1.625% 11/15/22 | 4,000,000.00 | 4,044,765.64 |
| T 1.75% 02/28/22 | 3,650,000.00 | 3,728,845.69 |
| T 1.75% 05/15/22 | 4,600,000.00 | 4,696,042.98 |
| T 1.75% 05/15/23 | 1,750,000.00 | 1,781,958.01 |
| T 1.75% 10/31/18 | 1,800,000.00 | 1,839,515.63 |
| T 1.875% 05/31/22 | 7,250,000.00 | 7,452,348.66 |
| T 1.875% 06/30/20 | 3,200,000.00 | 3,297,000.00 |
| T 1.875% 08/31/17 | 2,000,000.00 | 2,028,632.82 |
| T 1.875% 08/31/22 | 2,600,000.00 | 2,670,128.91 |
| T 1.875% 09/30/17 | 1,210,000.00 | 1,228,362.69 |
| T 1.875% 10/31/17 | 4,900,000.00 | 4,978,285.14 |
| T 1.875% 11/30/21 | 3,500,000.00 | 3,603,359.37 |
| T 1% 03/15/19 | 7,250,000.00 | 7,274,072.24 |
| T 1% 05/15/18 | 7,000,000.00 | 7,030,351.58 |
| T 1% 05/31/18 | 1,000,000.00 | 1,004,414.06 |
| T 1% 06/30/19 | 1,200,000.00 | 1,203,515.62 |
| T 1% 08/31/19 | 2,800,000.00 | 2,804,484.36 |
| T 1% 09/15/17 | 4,100,000.00 | 4,115,615.21 |
| T 1% 09/15/18 | 2,350,000.00 | 2,359,914.06 |
| T 1% 09/30/19 | 5,000,000.00 | 5,007,128.90 |
| T 1% 11/30/19 | 6,100,000.00 | 6,101,072.25 |
| T 1% 12/15/17 | 6,000,000.00 | 6,024,023.46 |
| T 2.125% 01/31/21 | 5,000,000.00 | 5,209,570.30 |
| T 2.125% 05/15/25 | 5,250,000.00 | 5,461,640.62 |
| T 2.125% 06/30/21 | 3,000,000.00 | 3,129,316.41 |
| T 2.125% 08/15/21 | 2,900,000.00 | 3,024,156.25 |
| T 2.125% 08/31/20 | 1,000,000.00 | 1,040,273.44 |
| T 2.125% 12/31/22 | 5,950,000.00 | 6,197,413.07 |
| T 2.25% 03/31/21 | 6,900,000.00 | 7,235,162.11 |
| T 2.25% 04/30/21 | 4,700,000.00 | 4,929,400.37 |
| T 2.25% 07/31/18 | 1,500,000.00 | 1,546,845.70 |
| T 2.25% 07/31/21 | 4,500,000.00 | 4,721,132.83 |
| T 2.25% 11/15/24 | 5,000,000.00 | 5,254,492.20 |
| T 2.25% 11/15/25 | 3,000,000.00 | 3,151,699.23 |
| T 2.25% 11/30/17 | 2,000,000.00 | 2,044,609.38 |

| | | |
|-------------------|---------------|---------------|
| T 2.375% 05/31/18 | 1,500,000.00 | 1,547,285.16 |
| T 2.375% 06/30/18 | 2,500,000.00 | 2,581,787.10 |
| T 2.375% 07/31/17 | 2,000,000.00 | 2,038,359.38 |
| T 2.375% 08/15/24 | 6,700,000.00 | 7,107,234.37 |
| T 2.375% 12/31/20 | 7,200,000.00 | 7,578,843.76 |
| T 2.5% 02/15/45 | 5,350,000.00 | 5,374,346.67 |
| T 2.5% 02/15/46 | 6,300,000.00 | 6,327,070.33 |
| T 2.5% 05/15/24 | 5,800,000.00 | 6,207,472.67 |
| T 2.5% 06/30/17 | 3,200,000.00 | 3,262,000.00 |
| T 2.5% 08/15/23 | 5,000,000.00 | 5,347,851.55 |
| T 2.625% 01/31/18 | 4,300,000.00 | 4,431,855.45 |
| T 2.625% 04/30/18 | 3,600,000.00 | 3,725,929.69 |
| T 2.625% 08/15/20 | 5,000,000.00 | 5,304,492.20 |
| T 2.625% 11/15/20 | 2,350,000.00 | 2,496,599.60 |
| T 2.75% 02/15/19 | 2,000,000.00 | 2,101,484.38 |
| T 2.75% 02/15/24 | 9,000,000.00 | 9,797,167.98 |
| T 2.75% 02/28/18 | 290,000.00 | 299,940.42 |
| T 2.75% 05/31/17 | 4,900,000.00 | 4,999,914.08 |
| T 2.75% 08/15/42 | 3,150,000.00 | 3,359,302.72 |
| T 2.75% 11/15/23 | 7,950,000.00 | 8,646,867.18 |
| T 2.75% 11/15/42 | 2,900,000.00 | 3,086,800.77 |
| T 2.75% 12/31/17 | 5,300,000.00 | 5,463,761.73 |
| T 2.875% 03/31/18 | 5,050,000.00 | 5,242,235.36 |
| T 2.875% 05/15/43 | 7,300,000.00 | 7,942,314.44 |
| T 2.875% 08/15/45 | 5,000,000.00 | 5,417,285.14 |
| T 2% 02/15/22 | 3,100,000.00 | 3,212,435.54 |
| T 2% 02/15/23 | 6,500,000.00 | 6,725,087.91 |
| T 2% 02/15/25 | 7,550,000.00 | 7,777,827.13 |
| T 2% 02/28/21 | 1,550,000.00 | 1,606,581.06 |
| T 2% 05/31/21 | 3,000,000.00 | 3,111,914.07 |
| T 2% 07/31/20 | 4,000,000.00 | 4,140,546.88 |
| T 2% 07/31/22 | 6,000,000.00 | 6,206,835.96 |
| T 2% 08/15/25 | 11,150,000.00 | 11,476,877.97 |
| T 2% 08/31/21 | 4,200,000.00 | 4,353,316.42 |
| T 2% 11/15/21 | 4,300,000.00 | 4,457,638.68 |
| T 2% 11/30/20 | 2,800,000.00 | 2,899,585.94 |
| T 2% 11/30/22 | 500,000.00 | 516,933.59 |
| T 3.125% 02/15/42 | 1,800,000.00 | 2,061,246.09 |
| T 3.125% 02/15/43 | 2,600,000.00 | 2,967,808.58 |
| T 3.125% 05/15/19 | 3,620,000.00 | 3,853,744.52 |
| T 3.125% 05/15/21 | 4,190,000.00 | 4,570,537.09 |
| T 3.125% 08/15/44 | 7,700,000.00 | 8,765,517.60 |

| | | |
|-------------------|--------------|---------------|
| T 3.125% 11/15/41 | 2,150,000.00 | 2,462,001.95 |
| T 3.375% 05/15/44 | 1,500,000.00 | 1,788,720.70 |
| T 3.375% 11/15/19 | 5,900,000.00 | 6,375,572.27 |
| T 3.5% 02/15/18 | 3,650,000.00 | 3,817,671.87 |
| T 3.5% 02/15/39 | 1,600,000.00 | 1,959,250.00 |
| T 3.5% 05/15/20 | 4,050,000.00 | 4,423,833.99 |
| T 3.625% 02/15/20 | 9,800,000.00 | 10,718,558.60 |
| T 3.625% 02/15/21 | 4,050,000.00 | 4,495,816.42 |
| T 3.625% 02/15/44 | 6,500,000.00 | 8,116,240.21 |
| T 3.625% 08/15/19 | 5,500,000.00 | 5,966,748.04 |
| T 3.625% 08/15/43 | 3,200,000.00 | 4,000,437.50 |
| T 3.75% 08/15/41 | 1,100,000.00 | 1,392,917.96 |
| T 3.75% 11/15/18 | 2,000,000.00 | 2,141,601.56 |
| T 3.75% 11/15/43 | 1,400,000.00 | 1,789,675.77 |
| T 3.875% 05/15/18 | 1,150,000.00 | 1,220,212.89 |
| T 3.875% 08/15/40 | 950,000.00 | 1,224,665.03 |
| T 3% 05/15/42 | 2,450,000.00 | 2,739,071.28 |
| T 3% 05/15/45 | 1,000,000.00 | 1,110,527.34 |
| T 3% 11/15/44 | 2,050,000.00 | 2,277,982.42 |
| T 4.0% 08/15/18 | 300,000.00 | 321,468.75 |
| T 4.25% 05/15/39 | 1,200,000.00 | 1,631,390.62 |
| T 4.25% 11/15/17 | 1,350,000.00 | 1,418,080.08 |
| T 4.25% 11/15/40 | 2,000,000.00 | 2,721,171.88 |
| T 4.375% 02/15/38 | 700,000.00 | 970,046.87 |
| T 4.375% 05/15/40 | 1,600,000.00 | 2,212,468.75 |
| T 4.375% 05/15/41 | 1,350,000.00 | 1,872,281.25 |
| T 4.375% 11/15/39 | 650,000.00 | 898,586.91 |
| T 4.5% 02/15/36 | 1,800,000.00 | 2,526,539.05 |
| T 4.5% 05/15/38 | 1,000,000.00 | 1,408,964.84 |
| T 4.5% 08/15/39 | 1,250,000.00 | 1,758,715.82 |
| T 4.625% 02/15/40 | 1,500,000.00 | 2,144,501.95 |
| T 4.75% 02/15/41 | 2,300,000.00 | 3,355,035.16 |
| T 4.75% 08/15/17 | 3,000,000.00 | 3,143,554.68 |
| T 5.0% 05/15/37 | 1,150,000.00 | 1,721,136.72 |
| T 5.25% 02/15/29 | 500,000.00 | 694,023.44 |
| T 5.25% 11/15/28 | 900,000.00 | 1,243,916.01 |
| T 5.375% 02/15/31 | 1,450,000.00 | 2,105,586.91 |
| T 5.5% 08/15/28 | 250,000.00 | 351,059.57 |
| T 6.0% 02/15/26 | 600,000.00 | 833,472.65 |
| T 6.125% 11/15/27 | 1,050,000.00 | 1,524,735.35 |
| T 6.25% 05/15/30 | 1,200,000.00 | 1,850,531.25 |
| T 6.25% 08/15/23 | 2,500,000.00 | 3,317,138.67 |
| T 6.5% 11/15/26 | 450,000.00 | 657,061.52 |

| | | | |
|-------------------|----------------------|----------------|------------------------------------|
| | T 8.0% 11/15/21 | 2,600,000.00 | 3,515,992.19 |
| | T 8.75% 08/15/20 | 1,800,000.00 | 2,360,847.65 |
| アメリカドル 小計 | | 623,490,000.00 | 658,706,718.84 (70,547,489,587) |
| カナダドル | CAN 0.25% 05/01/18 | 750,000.00 | 746,306.25 |
| | CAN 0.25% 11/01/17 | 420,000.00 | 418,452.30 |
| | CAN 1.25% 02/01/18 | 700,000.00 | 708,326.50 |
| | CAN 1.25% 03/01/18 | 1,700,000.00 | 1,721,683.50 |
| | CAN 1.25% 08/01/17 | 400,000.00 | 403,298.00 |
| | CAN 1.25% 09/01/18 | 1,050,000.00 | 1,067,283.00 |
| | CAN 1.5% 03/01/20 | 1,880,000.00 | 1,943,957.60 |
| | CAN 1.5% 06/01/23 | 1,750,000.00 | 1,825,223.75 |
| | CAN 1.5% 06/01/26 | 920,000.00 | 947,834.60 |
| | CAN 1.5% 09/01/17 | 2,230,000.00 | 2,256,525.85 |
| | CAN 1.75% 03/01/19 | 1,550,000.00 | 1,602,134.25 |
| | CAN 1.75% 09/01/19 | 700,000.00 | 726,659.50 |
| | CAN 2.25% 06/01/25 | 900,000.00 | 990,765.00 |
| | CAN 2.5% 06/01/24 | 1,350,000.00 | 1,508,989.50 |
| | CAN 2.75% 06/01/22 | 1,300,000.00 | 1,451,352.50 |
| | CAN 2.75% 12/01/48 | 710,000.00 | 865,447.40 |
| | CAN 2.75% 12/01/64 | 400,000.00 | 520,090.00 |
| | CAN 3.25% 06/01/21 | 1,700,000.00 | 1,916,622.50 |
| | CAN 3.5% 06/01/20 | 2,640,000.00 | 2,940,999.60 |
| | CAN 3.5% 12/01/45 | 1,680,000.00 | 2,311,789.20 |
| | CAN 3.75% 06/01/19 | 2,300,000.00 | 2,516,234.50 |
| | CAN 4.0% 06/01/41 | 1,680,000.00 | 2,397,897.60 |
| | CAN 4.25% 06/01/18 | 1,650,000.00 | 1,770,417.00 |
| | CAN 4% 06/01/17 | 1,500,000.00 | 1,550,310.00 |
| | CAN 5.75% 06/01/29 | 850,000.00 | 1,276,368.50 |
| | CAN 5.75% 06/01/33 | 1,180,000.00 | 1,881,964.30 |
| | CAN 5% 06/01/37 | 1,300,000.00 | 2,017,054.00 |
| CAN 8.0% 06/01/27 | 650,000.00 | 1,096,023.50 | |
| カナダドル 小計 | | 35,840,000.00 | 41,380,010.20 (3,480,472,657) |
| メキシコペ ソ | MBONO 10% 11/20/36 | 6,400,000.00 | 8,780,768.00 |
| | MBONO 10% 12/05/24 | 22,800,000.00 | 29,087,100.00 |
| | MBONO 4.75% 06/14/18 | 25,400,000.00 | 25,434,544.00 |
| | MBONO 5.75% 03/05/26 | 3,150,000.00 | 3,093,552.00 |
| | MBONO 5% 06/15/17 | 15,000,000.00 | 15,126,525.00 |
| | MBONO 5% 12/11/19 | 9,650,000.00 | 9,609,856.00 |
| | MBONO 6.5% 06/09/22 | 10,400,000.00 | 10,853,596.00 |
| | MBONO 6.5% 06/10/21 | 20,900,000.00 | 21,867,565.50 |

| | | | |
|-----|----------------------|----------------|-----------------------------------|
| | MBONO 7.5% 06/03/27 | 7,300,000.00 | 8,056,353.00 |
| | MBONO 7.75% 05/29/31 | 18,850,000.00 | 21,096,920.00 |
| | MBONO 7.75% 11/13/42 | 14,500,000.00 | 16,331,495.00 |
| | MBONO 7.75% 11/23/34 | 4,400,000.00 | 4,912,072.00 |
| | MBONO 7.75% 12/14/17 | 11,600,000.00 | 12,216,366.00 |
| | MBONO 8.5% 05/31/29 | 11,900,000.00 | 14,108,759.00 |
| | MBONO 8.5% 11/18/38 | 9,950,000.00 | 11,981,441.75 |
| | MBONO 8.5% 12/13/18 | 16,750,000.00 | 18,185,140.00 |
| | MBONO 8% 06/11/20 | 13,900,000.00 | 15,280,617.50 |
| | MBONO 8% 12/07/23 | 11,750,000.00 | 13,296,887.50 |
| | メキシコペソ 小計 | 234,600,000.00 | 259,319,558.25 (1,519,612,611) |
| ユーロ | BGB 0.8% 06/22/25 | 1,430,000.00 | 1,496,823.90 |
| | BGB 1.25% 06/22/18 | 850,000.00 | 879,716.00 |
| | BGB 1.6% 06/22/47 | 390,000.00 | 415,911.60 |
| | BGB 1.9% 06/22/38 | 410,000.00 | 474,673.40 |
| | BGB 1% 06/22/26 | 570,000.00 | 602,472.90 |
| | BGB 1% 06/22/31 | 200,000.00 | 205,647.00 |
| | BGB 2.15% 06/22/66 | 370,000.00 | 422,149.65 |
| | BGB 2.25% 06/22/23 | 1,650,000.00 | 1,917,291.75 |
| | BGB 2.6% 06/22/24 | 1,350,000.00 | 1,618,569.00 |
| | BGB 3.5% 06/28/17 | 950,000.00 | 989,771.75 |
| | BGB 3.75% 06/22/45 | 800,000.00 | 1,296,052.00 |
| | BGB 3.75% 09/28/20 | 1,540,000.00 | 1,814,612.80 |
| | BGB 3% 06/22/34 | 650,000.00 | 876,850.00 |
| | BGB 3% 09/28/19 | 1,470,000.00 | 1,637,043.45 |
| | BGB 4.0% 03/28/19 | 1,450,000.00 | 1,632,141.75 |
| | BGB 4.25% 03/28/41 | 1,580,000.00 | 2,659,700.90 |
| | BGB 4.25% 09/28/21 | 1,750,000.00 | 2,171,155.00 |
| | BGB 4.25% 09/28/22 | 1,900,000.00 | 2,429,055.00 |
| | BGB 4.5% 03/28/26 | 950,000.00 | 1,337,044.25 |
| | BGB 4% 03/28/18 | 1,150,000.00 | 1,243,224.75 |
| | BGB 4% 03/28/22 | 790,000.00 | 984,035.85 |
| | BGB 4% 03/28/32 | 760,000.00 | 1,124,678.40 |
| | BGB 5.5% 03/28/28 | 1,850,000.00 | 2,911,002.75 |
| | BGB 5.5% 09/28/17 | 1,500,000.00 | 1,617,060.00 |
| | BGB 5% 03/28/35 | 2,050,000.00 | 3,502,271.25 |
| | BTNS 1% 07/25/17 | 2,800,000.00 | 2,847,166.00 |
| | BTPS 0.1% 04/15/19 | 400,000.00 | 400,440.00 |
| | BTPS 0.25% 05/15/18 | 1,200,000.00 | 1,206,624.00 |
| | BTPS 0.3% 10/15/18 | 1,300,000.00 | 1,309,581.00 |
| | BTPS 1.45% 09/15/22 | 1,700,000.00 | 1,782,101.50 |
| | BTPS 1.5% 06/01/25 | 1,750,000.00 | 1,793,680.00 |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 1.5% 08/01/19 | 850,000.00 | 888,335.00 | |
| BTPS 1.6% 06/01/26 | 500,000.00 | 510,385.00 | |
| BTPS 2.15% 12/15/21 | 1,400,000.00 | 1,525,853.00 | |
| BTPS 2.25% 09/01/36 | 670,000.00 | 686,254.20 | |
| BTPS 2.5% 05/01/19 | 1,000,000.00 | 1,070,195.00 | |
| BTPS 2.5% 12/01/24 | 1,800,000.00 | 1,997,334.00 | |
| BTPS 2.7% 03/01/47 | 1,000,000.00 | 1,054,465.00 | |
| BTPS 3.25% 09/01/46 | 1,300,000.00 | 1,534,702.00 | |
| BTPS 3.5% 03/01/30 | 1,720,000.00 | 2,096,370.40 | |
| BTPS 3.5% 06/01/18 | 150,000.00 | 160,404.00 | |
| BTPS 3.5% 11/01/17 | 2,900,000.00 | 3,043,492.00 | |
| BTPS 3.5% 12/01/18 | 1,800,000.00 | 1,956,042.00 | |
| BTPS 3.75% 03/01/21 | 3,750,000.00 | 4,351,125.00 | |
| BTPS 3.75% 05/01/21 | 1,350,000.00 | 1,569,854.25 | |
| BTPS 3.75% 08/01/21 | 2,400,000.00 | 2,806,848.00 | |
| BTPS 3.75% 09/01/24 | 2,400,000.00 | 2,896,740.00 | |
| BTPS 4.25% 02/01/19 | 3,250,000.00 | 3,613,658.75 | |
| BTPS 4.25% 03/01/20 | 3,400,000.00 | 3,919,078.00 | |
| BTPS 4.25% 09/01/19 | 3,150,000.00 | 3,573,297.00 | |
| BTPS 4.5% 02/01/18 | 4,400,000.00 | 4,727,118.00 | |
| BTPS 4.5% 02/01/20 | 2,600,000.00 | 3,012,945.00 | |
| BTPS 4.5% 03/01/19 | 4,250,000.00 | 4,768,032.50 | |
| BTPS 4.5% 03/01/24 | 2,410,000.00 | 3,035,623.95 | |
| BTPS 4.5% 03/01/26 | 2,250,000.00 | 2,899,698.75 | |
| BTPS 4.5% 05/01/23 | 100,000.00 | 124,875.00 | |
| BTPS 4.5% 08/01/18 | 1,950,000.00 | 2,138,370.00 | |
| BTPS 4.75% 08/01/23 | 2,850,000.00 | 3,626,240.25 | |
| BTPS 4.75% 09/01/21 | 3,550,000.00 | 4,341,312.75 | |
| BTPS 4.75% 09/01/28 | 2,050,000.00 | 2,761,544.75 | |
| BTPS 4.75% 09/01/44 | 1,400,000.00 | 2,076,473.00 | |
| BTPS 4% 02/01/37 | 2,600,000.00 | 3,403,621.00 | |
| BTPS 4% 09/01/20 | 3,670,000.00 | 4,252,539.10 | |
| BTPS 5.0% 08/01/39 | 1,700,000.00 | 2,545,818.00 | |
| BTPS 5.25% 08/01/17 | 950,000.00 | 1,007,755.25 | |
| BTPS 5.25% 11/01/29 | 3,100,000.00 | 4,411,672.00 | |
| BTPS 5.5% 09/01/22 | 3,500,000.00 | 4,532,972.50 | |
| BTPS 5.5% 11/01/22 | 3,350,000.00 | 4,348,099.00 | |
| BTPS 5.75% 02/01/33 | 2,350,000.00 | 3,623,993.75 | |
| BTPS 5% 03/01/22 | 3,200,000.00 | 3,998,352.00 | |
| BTPS 5% 03/01/25 | 2,300,000.00 | 3,028,007.50 | |
| BTPS 5% 08/01/34 | 2,700,000.00 | 3,916,228.50 | |
| BTPS 5% 09/01/40 | 2,100,000.00 | 3,142,944.00 | |

| | | |
|---------------------|--------------|--------------|
| BTPS 6.5% 11/01/27 | 2,900,000.00 | 4,392,166.00 |
| BTPS 6% 05/01/31 | 3,200,000.00 | 4,951,088.00 |
| BTPS 7.25% 11/01/26 | 350,000.00 | 547,205.75 |
| BTPS 9% 11/01/23 | 1,800,000.00 | 2,839,257.00 |
| DBR 0.5% 02/15/26 | 2,350,000.00 | 2,457,829.75 |
| DBR 1.5% 02/15/23 | 1,950,000.00 | 2,188,806.75 |
| DBR 1.5% 05/15/23 | 2,010,000.00 | 2,263,822.80 |
| DBR 1.5% 05/15/24 | 2,750,000.00 | 3,126,200.00 |
| DBR 1.5% 09/04/22 | 1,600,000.00 | 1,787,320.00 |
| DBR 1.75% 02/15/24 | 1,800,000.00 | 2,076,606.00 |
| DBR 1.75% 07/04/22 | 2,450,000.00 | 2,767,336.25 |
| DBR 1% 08/15/24 | 2,300,000.00 | 2,522,674.50 |
| DBR 1% 08/15/25 | 2,500,000.00 | 2,739,850.00 |
| DBR 2.25% 09/04/20 | 1,900,000.00 | 2,125,159.50 |
| DBR 2.25% 09/04/21 | 1,950,000.00 | 2,227,192.50 |
| DBR 2.5% 01/04/21 | 2,650,000.00 | 3,014,852.00 |
| DBR 2.5% 07/04/44 | 1,650,000.00 | 2,457,378.00 |
| DBR 2.5% 08/15/46 | 1,350,000.00 | 2,045,128.50 |
| DBR 2% 01/04/22 | 1,870,000.00 | 2,121,346.70 |
| DBR 2% 08/15/23 | 1,800,000.00 | 2,098,170.00 |
| DBR 3.25% 01/04/20 | 2,850,000.00 | 3,239,139.00 |
| DBR 3.25% 07/04/21 | 1,050,000.00 | 1,248,114.00 |
| DBR 3.25% 07/04/42 | 1,670,000.00 | 2,752,886.45 |
| DBR 3.5% 07/04/19 | 4,500,000.00 | 5,061,667.50 |
| DBR 3.75% 01/04/19 | 2,630,000.00 | 2,923,245.00 |
| DBR 3% 07/04/20 | 2,250,000.00 | 2,573,651.25 |
| DBR 4.0% 01/04/18 | 2,850,000.00 | 3,054,430.50 |
| DBR 4.0% 01/04/37 | 2,300,000.00 | 3,900,823.00 |
| DBR 4.25% 07/04/17 | 2,750,000.00 | 2,890,387.50 |
| DBR 4.25% 07/04/18 | 2,650,000.00 | 2,914,165.25 |
| DBR 4.25% 07/04/39 | 1,250,000.00 | 2,267,456.25 |
| DBR 4.75% 07/04/28 | 800,000.00 | 1,250,564.00 |
| DBR 4.75% 07/04/34 | 1,900,000.00 | 3,359,580.00 |
| DBR 4.75% 07/04/40 | 1,530,000.00 | 2,989,008.00 |
| DBR 5.5% 01/04/31 | 1,530,000.00 | 2,684,132.55 |
| DBR 5.625% 01/04/28 | 1,700,000.00 | 2,796,279.00 |
| DBR 6.25% 01/04/24 | 1,100,000.00 | 1,647,013.50 |
| DBR 6.25% 01/04/30 | 1,000,000.00 | 1,824,995.00 |
| DBR 6.5% 07/04/27 | 1,100,000.00 | 1,889,431.50 |
| FRTR 0.25% 11/25/20 | 2,050,000.00 | 2,098,031.50 |
| FRTR 0.5% 05/25/25 | 3,950,000.00 | 4,040,613.00 |
| FRTR 0.5% 05/25/26 | 350,000.00 | 354,165.00 |
| FRTR 0.5% 11/25/19 | 1,500,000.00 | 1,545,570.00 |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| FRTR 0% 02/25/19 | 500,000.00 | 505,662.50 | |
| FRTR 0% 05/25/20 | 1,500,000.00 | 1,520,002.50 | |
| FRTR 1.25% 05/25/36 | 650,000.00 | 676,097.50 | |
| FRTR 1.5% 05/25/31 | 1,200,000.00 | 1,329,216.00 | |
| FRTR 1.75% 05/25/23 | 3,000,000.00 | 3,373,155.00 | |
| FRTR 1.75% 05/25/66 | 200,000.00 | 211,457.00 | |
| FRTR 1.75% 11/25/24 | 2,550,000.00 | 2,889,532.50 | |
| FRTR 1% 05/25/18 | 2,400,000.00 | 2,468,184.00 | |
| FRTR 1% 05/25/19 | 2,330,000.00 | 2,427,592.05 | |
| FRTR 1% 11/25/18 | 2,900,000.00 | 3,003,283.50 | |
| FRTR 1% 11/25/25 | 2,240,000.00 | 2,385,118.40 | |
| FRTR 2.25% 05/25/24 | 3,100,000.00 | 3,632,998.50 | |
| FRTR 2.25% 10/25/22 | 1,850,000.00 | 2,126,945.00 | |
| FRTR 2.5% 05/25/30 | 2,650,000.00 | 3,303,781.50 | |
| FRTR 2.5% 10/25/20 | 4,600,000.00 | 5,166,007.00 | |
| FRTR 2.75% 10/25/27 | 3,700,000.00 | 4,626,332.00 | |
| FRTR 3.25% 05/25/45 | 1,750,000.00 | 2,612,741.25 | |
| FRTR 3.25% 10/25/21 | 4,250,000.00 | 5,041,413.75 | |
| FRTR 3.5% 04/25/20 | 4,950,000.00 | 5,693,490.00 | |
| FRTR 3.5% 04/25/26 | 4,350,000.00 | 5,695,846.50 | |
| FRTR 3.75% 04/25/21 | 3,600,000.00 | 4,304,880.00 | |
| FRTR 3.75% 10/25/19 | 3,250,000.00 | 3,705,195.00 | |
| FRTR 3% 04/25/22 | 3,750,000.00 | 4,446,318.75 | |
| FRTR 4.25% 04/25/19 | 3,400,000.00 | 3,858,201.00 | |
| FRTR 4.25% 10/25/17 | 3,000,000.00 | 3,195,525.00 | |
| FRTR 4.25% 10/25/18 | 2,800,000.00 | 3,113,362.00 | |
| FRTR 4.25% 10/25/23 | 3,900,000.00 | 5,127,096.00 | |
| FRTR 4.5% 04/25/41 | 2,600,000.00 | 4,528,550.00 | |
| FRTR 4.75% 04/25/35 | 2,500,000.00 | 4,177,575.00 | |
| FRTR 4% 04/25/18 | 3,450,000.00 | 3,738,885.75 | |
| FRTR 4% 04/25/55 | 1,470,000.00 | 2,617,504.05 | |
| FRTR 4% 04/25/60 | 1,150,000.00 | 2,089,607.50 | |
| FRTR 4% 10/25/38 | 2,600,000.00 | 4,136,171.00 | |
| FRTR 5.5% 04/25/29 | 3,150,000.00 | 5,090,636.25 | |
| FRTR 5.75% 10/25/32 | 2,700,000.00 | 4,788,814.50 | |
| FRTR 6.0% 10/25/25 | 2,250,000.00 | 3,453,401.25 | |
| FRTR 8.5% 04/25/23 | 1,800,000.00 | 2,860,713.00 | |
| FRTR 8.5% 10/25/19 | 1,350,000.00 | 1,757,004.75 | |
| IRISH 0.8% 03/15/22 | 200,000.00 | 207,929.00 | |
| IRISH 1% 05/15/26 | 420,000.00 | 431,123.70 | |
| IRISH 2.4% 05/15/30 | 750,000.00 | 877,125.00 | |
| IRISH 2% 02/18/45 | 520,000.00 | 569,228.40 | |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| IRISH 3.4% 03/18/24 | 850,000.00 | 1,037,607.75 |
| IRISH 3.9% 03/20/23 | 350,000.00 | 434,551.25 |
| IRISH 4.4% 06/18/19 | 750,000.00 | 855,967.50 |
| IRISH 4.5% 04/18/20 | 1,150,000.00 | 1,355,694.75 |
| IRISH 4.5% 10/18/18 | 970,000.00 | 1,080,332.65 |
| IRISH 5.4% 03/13/25 | 1,300,000.00 | 1,823,412.50 |
| IRISH 5.5% 10/18/17 | 400,000.00 | 431,822.00 |
| IRISH 5.9% 10/18/19 | 700,000.00 | 842,579.50 |
| IRISH 5% 10/18/20 | 1,030,000.00 | 1,257,856.60 |
| NETHER 0.25% 07/15/25 | 550,000.00 | 556,459.75 |
| NETHER 0.5% 07/15/26 | 450,000.00 | 461,616.75 |
| NETHER 1.25% 01/15/18 | 1,350,000.00 | 1,387,975.50 |
| NETHER 1.25% 01/15/19 | 1,700,000.00 | 1,777,324.50 |
| NETHER 1.75% 07/15/23 | 1,920,000.00 | 2,175,302.40 |
| NETHER 2.25% 07/15/22 | 1,800,000.00 | 2,075,508.00 |
| NETHER 2.5% 01/15/33 | 1,220,000.00 | 1,615,475.20 |
| NETHER 2.75% 01/15/47 | 550,000.00 | 851,116.75 |
| NETHER 2% 07/15/24 | 1,600,000.00 | 1,860,592.00 |
| NETHER 3.25% 07/15/21 | 200,000.00 | 236,918.00 |
| NETHER 3.5% 07/15/20 | 1,570,000.00 | 1,825,156.40 |
| NETHER 3.75% 01/15/23 | 1,620,000.00 | 2,042,617.50 |
| NETHER 3.75% 01/15/42 | 2,100,000.00 | 3,643,552.50 |
| NETHER 4.0% 07/15/18 | 2,100,000.00 | 2,298,481.50 |
| NETHER 4.5% 07/15/17 | 1,800,000.00 | 1,899,153.00 |
| NETHER 4% 01/15/37 | 1,420,000.00 | 2,379,792.20 |
| NETHER 4% 07/15/19 | 2,490,000.00 | 2,836,819.65 |
| NETHER 5.5% 01/15/28 | 1,350,000.00 | 2,162,517.75 |
| NETHER 7.5% 01/15/23 | 700,000.00 | 1,057,255.50 |
| OBL 0.25% 04/13/18 | 2,250,000.00 | 2,283,547.50 |
| OBL 0.25% 10/16/20 | 1,800,000.00 | 1,858,590.00 |
| OBL 0.5% 02/23/18 | 3,050,000.00 | 3,104,945.75 |
| OBL 0.5% 04/12/19 | 850,000.00 | 875,725.25 |
| OBL 0.5% 10/13/17 | 1,700,000.00 | 1,723,902.00 |
| OBL 0% 04/17/20 | 1,050,000.00 | 1,071,241.50 |
| OBL 1% 02/22/19 | 1,500,000.00 | 1,563,900.00 |
| OBL 1% 10/12/18 | 1,450,000.00 | 1,503,200.50 |
| RAGB 0.25% 10/18/19 | 100,000.00 | 102,297.50 |
| RAGB 1.15% 10/19/18 | 800,000.00 | 830,920.00 |
| RAGB 1.2% 10/20/25 | 1,350,000.00 | 1,472,944.50 |
| RAGB 1.65% 10/21/24 | 800,000.00 | 904,832.00 |
| RAGB 1.75% 10/20/23 | 700,000.00 | 794,391.50 |
| RAGB 1.95% 06/18/19 | 750,000.00 | 804,431.25 |
| RAGB 2.4% 05/23/34 | 610,000.00 | 780,125.95 |

| | | |
|----------------------|--------------|--------------|
| RAGB 3.15% 06/20/44 | 650,000.00 | 996,810.75 |
| RAGB 3.4% 11/22/22 | 1,300,000.00 | 1,600,976.00 |
| RAGB 3.5% 09/15/21 | 1,140,000.00 | 1,369,362.30 |
| RAGB 3.65% 04/20/22 | 800,000.00 | 982,856.00 |
| RAGB 3.8% 01/26/62 | 400,000.00 | 760,948.00 |
| RAGB 3.9% 07/15/20 | 1,250,000.00 | 1,471,950.00 |
| RAGB 4.15% 03/15/37 | 1,200,000.00 | 1,966,332.00 |
| RAGB 4.3% 09/15/17 | 960,000.00 | 1,018,276.80 |
| RAGB 4.35% 03/15/19 | 1,800,000.00 | 2,039,697.00 |
| RAGB 4.65% 01/15/18 | 1,100,000.00 | 1,190,695.00 |
| RAGB 4.85% 03/15/26 | 900,000.00 | 1,304,019.00 |
| RAGB 6.25% 07/15/27 | 630,000.00 | 1,038,000.60 |
| RFGB 0.5% 04/15/26 | 380,000.00 | 386,361.20 |
| RFGB 0.75% 04/15/31 | 390,000.00 | 399,976.20 |
| RFGB 0.875% 09/15/25 | 250,000.00 | 264,220.00 |
| RFGB 1.125% 09/15/18 | 550,000.00 | 570,187.75 |
| RFGB 1.5% 04/15/23 | 400,000.00 | 443,032.00 |
| RFGB 1.625% 09/15/22 | 350,000.00 | 388,557.75 |
| RFGB 2.625% 07/04/42 | 430,000.00 | 617,609.00 |
| RFGB 2.75% 07/04/28 | 530,000.00 | 678,426.50 |
| RFGB 2% 04/15/24 | 480,000.00 | 554,335.20 |
| RFGB 3.375% 04/15/20 | 900,000.00 | 1,031,067.00 |
| RFGB 3.5% 04/15/21 | 1,000,000.00 | 1,184,975.00 |
| RFGB 3.875% 09/15/17 | 640,000.00 | 675,632.00 |
| RFGB 4.375% 07/04/19 | 300,000.00 | 344,740.50 |
| RFGB 4% 07/04/25 | 650,000.00 | 874,204.50 |
| SPGB 0.25% 01/31/19 | 400,000.00 | 402,710.00 |
| SPGB 0.75% 07/30/21 | 500,000.00 | 507,767.50 |
| SPGB 1.15% 07/30/20 | 1,360,000.00 | 1,411,204.00 |
| SPGB 1.4% 01/31/20 | 1,500,000.00 | 1,566,645.00 |
| SPGB 1.6% 04/30/25 | 1,250,000.00 | 1,288,525.00 |
| SPGB 1.95% 04/30/26 | 1,270,000.00 | 1,331,798.20 |
| SPGB 1.95% 07/30/30 | 1,350,000.00 | 1,373,166.00 |
| SPGB 2.15% 10/31/25 | 2,350,000.00 | 2,517,649.00 |
| SPGB 2.75% 04/30/19 | 2,100,000.00 | 2,264,125.50 |
| SPGB 2.75% 10/31/24 | 2,850,000.00 | 3,209,313.75 |
| SPGB 2.9% 10/31/46 | 500,000.00 | 534,790.00 |
| SPGB 3.45% 07/30/66 | 300,000.00 | 326,482.50 |
| SPGB 3.75% 10/31/18 | 2,550,000.00 | 2,783,031.75 |
| SPGB 3.8% 04/30/24 | 2,900,000.00 | 3,491,948.00 |
| SPGB 4.1% 07/30/18 | 3,100,000.00 | 3,377,403.50 |
| SPGB 4.2% 01/31/37 | 1,650,000.00 | 2,187,273.00 |

| | | | | |
|--------------------|---------------------|----------------|------------------------------------|--|
| | SPGB 4.3% 10/31/19 | 2,400,000.00 | 2,739,084.00 | |
| | SPGB 4.4% 10/31/23 | 1,300,000.00 | 1,622,829.00 | |
| | SPGB 4.5% 01/31/18 | 2,450,000.00 | 2,634,546.25 | |
| | SPGB 4.6% 07/30/19 | 2,900,000.00 | 3,309,726.50 | |
| | SPGB 4.65% 07/30/25 | 1,850,000.00 | 2,386,342.75 | |
| | SPGB 4.7% 07/30/41 | 1,450,000.00 | 2,077,451.25 | |
| | SPGB 4.8% 01/31/24 | 1,400,000.00 | 1,794,086.00 | |
| | SPGB 4.85% 10/31/20 | 2,150,000.00 | 2,575,194.75 | |
| | SPGB 4.9% 07/30/40 | 1,450,000.00 | 2,124,692.25 | |
| | SPGB 4% 04/30/20 | 2,050,000.00 | 2,349,002.75 | |
| | SPGB 5.15% 10/31/28 | 1,400,000.00 | 1,938,979.00 | |
| | SPGB 5.15% 10/31/44 | 1,150,000.00 | 1,770,678.00 | |
| | SPGB 5.4% 01/31/23 | 1,900,000.00 | 2,473,638.50 | |
| | SPGB 5.5% 04/30/21 | 1,800,000.00 | 2,245,896.00 | |
| | SPGB 5.5% 07/30/17 | 2,900,000.00 | 3,084,367.50 | |
| | SPGB 5.75% 07/30/32 | 1,850,000.00 | 2,833,839.25 | |
| | SPGB 5.85% 01/31/22 | 2,400,000.00 | 3,113,436.00 | |
| | SPGB 5.9% 07/30/26 | 650,000.00 | 921,085.75 | |
| | SPGB 6.0% 01/31/29 | 2,650,000.00 | 3,948,433.75 | |
| | ユーロ 小計 | 453,460,000.00 | 559,004,503.40 (67,645,134,956) | |
| イギリスボ ンド | UKT 1.25% 07/22/18 | 2,700,000.00 | 2,749,639.50 | |
| | UKT 1.5% 01/22/21 | 1,400,000.00 | 1,447,306.00 | |
| | UKT 1.5% 07/22/26 | 730,000.00 | 738,891.40 | |
| | UKT 1.75% 07/22/19 | 2,900,000.00 | 3,010,185.50 | |
| | UKT 1.75% 09/07/22 | 2,600,000.00 | 2,731,638.00 | |
| | UKT 1% 09/07/17 | 3,050,000.00 | 3,073,103.75 | |
| | UKT 2.25% 09/07/23 | 2,270,000.00 | 2,462,541.40 | |
| | UKT 2.5% 07/22/65 | 1,110,000.00 | 1,337,439.00 | |
| | UKT 2.75% 09/07/24 | 2,120,000.00 | 2,385,943.40 | |
| | UKT 2% 07/22/20 | 3,050,000.00 | 3,215,615.00 | |
| | UKT 2% 09/07/25 | 1,450,000.00 | 1,545,410.00 | |
| | UKT 3.25% 01/22/44 | 3,050,000.00 | 3,800,635.50 | |
| | UKT 3.5% 01/22/45 | 1,150,000.00 | 1,503,487.00 | |
| | UKT 3.5% 07/22/68 | 1,900,000.00 | 2,931,073.00 | |
| | UKT 3.75% 07/22/52 | 1,480,000.00 | 2,175,614.80 | |
| | UKT 3.75% 09/07/19 | 850,000.00 | 940,236.00 | |
| | UKT 3.75% 09/07/20 | 3,300,000.00 | 3,734,115.00 | |
| | UKT 3.75% 09/07/21 | 750,000.00 | 865,286.25 | |
| | UKT 4.25% 03/07/36 | 2,220,000.00 | 3,055,130.70 | |
| | UKT 4.25% 06/07/32 | 1,900,000.00 | 2,551,092.00 | |
| UKT 4.25% 09/07/39 | 1,300,000.00 | 1,833,442.00 | | |
| UKT 4.25% 12/07/27 | 1,050,000.00 | 1,364,821.50 | | |

| | | | |
|------------|----------------------|---------------|-----------------------------------|
| | UKT 4.25% 12/07/40 | 1,600,000.00 | 2,283,144.00 |
| | UKT 4.25% 12/07/46 | 1,950,000.00 | 2,922,972.00 |
| | UKT 4.25% 12/07/49 | 1,300,000.00 | 2,021,201.00 |
| | UKT 4.25% 12/07/55 | 1,630,000.00 | 2,708,970.35 |
| | UKT 4.5% 03/07/19 | 2,500,000.00 | 2,783,775.00 |
| | UKT 4.5% 09/07/34 | 2,180,000.00 | 3,055,389.90 |
| | UKT 4.5% 12/07/42 | 2,040,000.00 | 3,063,978.00 |
| | UKT 4.75% 03/07/20 | 1,190,000.00 | 1,375,949.40 |
| | UKT 4.75% 12/07/30 | 1,900,000.00 | 2,649,911.00 |
| | UKT 4.75% 12/07/38 | 1,550,000.00 | 2,318,575.25 |
| | UKT 4% 01/22/60 | 1,090,000.00 | 1,784,662.45 |
| | UKT 4% 03/07/22 | 2,050,000.00 | 2,419,235.75 |
| | UKT 5% 03/07/18 | 1,000,000.00 | 1,082,115.00 |
| | UKT 5% 03/07/25 | 2,350,000.00 | 3,105,055.00 |
| | UKT 6.0% 12/07/28 | 1,200,000.00 | 1,825,800.00 |
| | UKT 8.75% 08/25/17 | 770,000.00 | 849,052.05 |
| | UKT 8% 06/07/21 | 1,300,000.00 | 1,764,535.50 |
| | イギリスポンド 小計 | 69,930,000.00 | 87,466,968.35 (13,539,886,700) |
| スイスフラン | SWISS 2.25% 07/06/20 | 500,000.00 | 566,437.50 |
| | SWISS 2% 04/28/21 | 250,000.00 | 286,218.75 |
| | SWISS 3% 01/08/18 | 730,000.00 | 776,344.05 |
| | SWISS 3% 05/12/19 | 550,000.00 | 615,191.50 |
| | SWISS 4.25% 06/05/17 | 570,000.00 | 599,286.60 |
| | SWISS 4% 02/11/23 | 380,000.00 | 503,716.60 |
| | SWISS 4% 04/08/28 | 600,000.00 | 916,407.00 |
| | スイスフラン 小計 | 3,580,000.00 | 4,263,602.00 (473,345,094) |
| スウェーデンクローナ | SGB 1.5% 11/13/23 | 7,250,000.00 | 7,984,606.25 |
| | SGB 1% 11/12/26 | 4,160,000.00 | 4,367,563.20 |
| | SGB 2.5% 05/12/25 | 6,000,000.00 | 7,167,180.00 |
| | SGB 3.5% 03/30/39 | 4,740,000.00 | 6,692,169.00 |
| | SGB 3.5% 06/01/22 | 8,900,000.00 | 10,797,925.00 |
| | SGB 3.75% 08/12/17 | 7,250,000.00 | 7,622,505.00 |
| | SGB 4.25% 03/12/19 | 8,950,000.00 | 10,137,888.75 |
| | SGB 5% 12/01/20 | 7,920,000.00 | 9,827,888.40 |
| | スウェーデンクローナ 小計 | 55,170,000.00 | 64,597,725.60 (844,292,273) |
| ノルウェークローネ | NGB 1.5% 02/19/26 | 2,000,000.00 | 2,057,970.00 |
| | NGB 1.75% 03/13/25 | 2,900,000.00 | 3,053,294.00 |
| | NGB 2% 05/24/23 | 5,350,000.00 | 5,739,881.25 |
| | NGB 3.75% 05/25/21 | 7,350,000.00 | 8,421,078.75 |

| | | | |
|---------------|----------------------|---------------|----------------------------------|
| | NGB 3% 03/14/24 | 5,490,000.00 | 6,305,319.90 |
| | NGB 4.5% 05/22/19 | 6,450,000.00 | 7,202,811.75 |
| ノルウェークローネ 小計 | | 29,540,000.00 | 32,780,355.65 (430,078,266) |
| デンマーク クローネ | DGB 0.25% 11/15/18 | 2,660,000.00 | 2,706,669.70 |
| | DGB 1.5% 11/15/23 | 7,050,000.00 | 7,814,396.25 |
| | DGB 1.75% 11/15/25 | 5,210,000.00 | 5,926,192.65 |
| | DGB 3% 11/15/21 | 10,000,000.00 | 11,744,300.00 |
| | DGB 4.5% 11/15/39 | 12,250,000.00 | 22,183,770.00 |
| | DGB 4% 11/15/17 | 5,150,000.00 | 5,485,599.75 |
| | DGB 4% 11/15/19 | 9,070,000.00 | 10,447,869.05 |
| | DGB 7% 11/10/24 | 2,650,000.00 | 4,201,098.00 |
| デンマーククローネ 小計 | | 54,040,000.00 | 70,509,895.40 (1,147,901,097) |
| ポーランド ズロチ | POLGB 1.5% 04/25/20 | 1,050,000.00 | 1,027,215.00 |
| | POLGB 2.5% 07/25/18 | 3,720,000.00 | 3,779,836.20 |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 1,600,000.00 | 1,522,056.00 |
| | POLGB 2% 04/25/21 | 2,860,000.00 | 2,823,778.10 |
| | POLGB 3.25% 07/25/19 | 3,250,000.00 | 3,381,690.00 |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 2,700,000.00 | 2,766,528.00 |
| | POLGB 3.75% 04/25/18 | 2,450,000.00 | 2,543,234.75 |
| | POLGB 4% 10/25/23 | 3,070,000.00 | 3,320,650.15 |
| | POLGB 5.25% 10/25/17 | 2,350,000.00 | 2,465,819.75 |
| | POLGB 5.25% 10/25/20 | 1,940,000.00 | 2,188,843.80 |
| | POLGB 5.5% 10/25/19 | 2,200,000.00 | 2,451,779.00 |
| | POLGB 5.75% 04/25/29 | 1,150,000.00 | 1,448,787.25 |
| | POLGB 5.75% 09/23/22 | 1,800,000.00 | 2,130,093.00 |
| | POLGB 5.75% 10/25/21 | 3,030,000.00 | 3,538,933.95 |
| ポーランドズロチ 小計 | | 33,170,000.00 | 35,389,244.95 (988,067,719) |
| オーストラ リアドル | ACGB 1.75% 11/21/20 | 800,000.00 | 802,032.00 |
| | ACGB 2.25% 05/21/28 | 900,000.00 | 895,788.00 |
| | ACGB 2.75% 04/21/24 | 2,600,000.00 | 2,738,905.00 |
| | ACGB 2.75% 06/21/35 | 550,000.00 | 552,909.50 |
| | ACGB 2.75% 10/21/19 | 1,000,000.00 | 1,037,270.00 |
| | ACGB 2.75% 11/21/27 | 1,100,000.00 | 1,157,414.50 |
| | ACGB 3.25% 04/21/25 | 2,680,000.00 | 2,934,184.60 |
| | ACGB 3.25% 04/21/29 | 1,230,000.00 | 1,352,225.10 |
| | ACGB 3.25% 06/21/39 | 50,000.00 | 53,266.25 |
| | ACGB 3.25% 10/21/18 | 1,050,000.00 | 1,089,070.50 |
| | ACGB 3.75% 04/21/37 | 1,230,000.00 | 1,422,876.30 |
| | ACGB 4.25% 04/21/26 | 2,400,000.00 | 2,854,272.00 |
| | ACGB 4.25% 07/21/17 | 1,850,000.00 | 1,901,753.75 |

| | | | | |
|------------------|----------------------|---------------|----------------------------------|--|
| | ACGB 4.5% 04/15/20 | 2,900,000.00 | 3,209,517.00 | |
| | ACGB 4.5% 04/21/33 | 1,000,000.00 | 1,266,690.00 | |
| | ACGB 4.75% 04/21/27 | 1,750,000.00 | 2,183,378.75 | |
| | ACGB 5.25% 03/15/19 | 3,260,000.00 | 3,580,735.10 | |
| | ACGB 5.5% 01/21/18 | 2,300,000.00 | 2,438,770.50 | |
| | ACGB 5.5% 04/21/23 | 2,350,000.00 | 2,887,926.75 | |
| | ACGB 5.75% 05/15/21 | 2,250,000.00 | 2,672,932.50 | |
| | ACGB 5.75% 07/15/22 | 1,800,000.00 | 2,202,525.00 | |
| | オーストラリアドル 小計 | 35,050,000.00 | 39,234,443.10 (3,114,430,093) | |
| シンガポールドル | SIGB 0.5% 04/01/18 | 350,000.00 | 347,600.75 | |
| | SIGB 1.625% 10/01/19 | 100,000.00 | 101,810.50 | |
| | SIGB 2.25% 06/01/21 | 720,000.00 | 747,637.20 | |
| | SIGB 2.375% 06/01/25 | 150,000.00 | 156,443.25 | |
| | SIGB 2.5% 06/01/19 | 850,000.00 | 885,721.25 | |
| | SIGB 2.75% 03/01/46 | 230,000.00 | 247,195.95 | |
| | SIGB 2.75% 04/01/42 | 400,000.00 | 429,666.00 | |
| | SIGB 2.75% 07/01/23 | 530,000.00 | 565,125.75 | |
| | SIGB 2.875% 07/01/29 | 200,000.00 | 216,340.00 | |
| | SIGB 2.875% 09/01/30 | 290,000.00 | 312,595.35 | |
| | SIGB 2% 07/01/20 | 100,000.00 | 103,020.00 | |
| | SIGB 3.125% 09/01/22 | 500,000.00 | 544,382.50 | |
| | SIGB 3.25% 09/01/20 | 620,000.00 | 670,288.20 | |
| | SIGB 3.375% 09/01/33 | 200,000.00 | 230,237.00 | |
| | SIGB 3.5% 03/01/27 | 550,000.00 | 626,898.25 | |
| | SIGB 3% 09/01/24 | 700,000.00 | 761,792.50 | |
| SIGB 4% 09/01/18 | 700,000.00 | 747,617.50 | | |
| | シンガポールドル 小計 | 7,190,000.00 | 7,694,371.95 (608,701,764) | |
| マレーシアリンギット | MGS 3.26% 03/01/18 | 1,200,000.00 | 1,208,328.00 | |
| | MGS 3.418% 08/15/22 | 1,950,000.00 | 1,912,092.00 | |
| | MGS 3.48% 03/15/23 | 1,600,000.00 | 1,570,880.00 | |
| | MGS 3.492% 03/31/20 | 2,040,000.00 | 2,044,110.60 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 670,000.00 | 635,964.00 | |
| | MGS 3.58% 09/28/18 | 1,800,000.00 | 1,821,105.00 | |
| | MGS 3.759% 03/15/19 | 200,000.00 | 203,039.00 | |
| | MGS 3.844% 04/15/33 | 630,000.00 | 595,220.85 | |
| | MGS 3.889% 07/31/20 | 1,950,000.00 | 1,983,296.25 | |
| | MGS 3.892% 03/15/27 | 640,000.00 | 630,198.40 | |
| | MGS 4.127% 04/15/32 | 1,080,000.00 | 1,060,009.20 | |
| | MGS 4.16% 07/15/21 | 2,000,000.00 | 2,054,390.00 | |
| | MGS 4.181% 07/15/24 | 2,800,000.00 | 2,860,228.00 | |
| | MGS 4.24% 02/07/18 | 3,580,000.00 | 3,660,997.50 | |

| | | | | |
|------------------|----------------------|----------------|--------------------------------------|--|
| | MGS 4.378% 11/29/19 | 2,800,000.00 | 2,893,366.00 | |
| | MGS 4.392% 04/15/26 | 950,000.00 | 986,461.00 | |
| | MGS 4.498% 04/15/30 | 1,100,000.00 | 1,133,247.50 | |
| | MGS 4.935% 09/30/43 | 1,120,000.00 | 1,161,647.20 | |
| | MGS 5.248% 09/15/28 | 950,000.00 | 1,045,441.75 | |
| | マレーシアリングット 小計 | 29,060,000.00 | 29,460,022.25 (776,860,786) | |
| 南アフリカ ランド | SAGB 10.5% 12/21/26 | 18,700,000.00 | 20,544,755.00 | |
| | SAGB 6.25% 03/31/36 | 10,300,000.00 | 7,281,894.00 | |
| | SAGB 6.5% 02/28/41 | 9,250,000.00 | 6,491,048.75 | |
| | SAGB 6.75% 03/31/21 | 6,550,000.00 | 6,091,500.00 | |
| | SAGB 7.25% 01/15/20 | 6,350,000.00 | 6,127,877.00 | |
| | SAGB 7.75% 02/28/23 | 5,750,000.00 | 5,445,796.25 | |
| | SAGB 7% 02/28/31 | 8,840,000.00 | 7,128,973.80 | |
| | SAGB 8.25% 03/31/32 | 4,950,000.00 | 4,432,477.50 | |
| | SAGB 8.25% 09/15/17 | 4,900,000.00 | 4,928,910.00 | |
| | SAGB 8.5% 01/31/37 | 6,600,000.00 | 5,897,958.00 | |
| | SAGB 8.75% 01/31/44 | 3,450,000.00 | 3,113,883.75 | |
| | SAGB 8.75% 02/28/48 | 14,150,000.00 | 12,733,585.00 | |
| | SAGB 8.875% 02/28/35 | 2,800,000.00 | 2,616,516.00 | |
| | SAGB 8% 01/31/30 | 4,900,000.00 | 4,369,771.00 | |
| SAGB 8% 12/21/18 | 5,000,000.00 | 4,986,950.00 | | |
| | 南アフリカランド 小計 | 112,490,000.00 | 102,191,896.05 (738,847,408) | |
| | 合計 | | 165,855,121,011 (165,855,121,011) | |

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 174銘柄 | 100.0% | 42.5% |
| カナダドル | 国債証券 28銘柄 | 100.0% | 2.1% |
| メキシコペソ | 国債証券 18銘柄 | 100.0% | 0.9% |
| ユーロ | 国債証券 262銘柄 | 100.0% | 40.8% |
| イギリスポンド | 国債証券 39銘柄 | 100.0% | 8.2% |
| 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 8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 | 8銘柄 | 100.0% | 0.7% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 | 14銘柄 | 100.0% | 0.6% |
| オーストラリアドル | 国債証券 | 21銘柄 | 100.0% | 1.9% |
| シンガポールドル | 国債証券 | 17銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| マレーシアリングット | 国債証券 | 19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28年 6月10日現在 |
|--------------|----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 60,524,163 |
| コール・ローン | 369,786,956 |
| 投資証券 | 86,480,093,100 |
| 未収配当金 | 533,997,890 |
| 流動資産合計 | 87,444,402,109 |
| 資産合計 | 87,444,402,109 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 14,817,532 |
| 未払利息 | 928 |
| その他未払費用 | 10,772 |
| 流動負債合計 | 14,829,232 |
| 負債合計 | 14,829,232 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 34,340,374,106 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 53,089,198,771 |
| 元本等合計 | 87,429,572,877 |
| 純資産合計 | 87,429,572,877 |
| 負債純資産合計 | 87,444,402,109 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成28年 6月10日現在 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | 平成28年 6月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 34,340,374,106口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | <p>1口当たり純資産額 2.5460円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (25,460円)</p> |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| | 平成28年 6月10日現在 |
|-------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及びそのリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p> |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 平成28年 6月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 平成28年 6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12月11日 |
| 期首元本額 | 40,443,614,087円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,685,347,207円 |
| 期中一部解約元本額 | 7,788,587,188円 |
| 期末元本額 | 34,340,374,106円 |

| 区分 | 平成28年 6月10日現在 |
|----------------------|-----------------|
| 期末元本額の内訳 | |
| Jリートファンド | 32,245,602,319円 |
| 3資産バランスオープン | 532,054,900円 |
| 3資産バランスオープンアルファ | 94,665,475円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型） | 35,719,542円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型） | 20,657,109円 |
| Jリートアクティブファンド（1年決算型） | 1,411,674,761円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年 6月10日現在 |
|------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 投資証券 | 7,214,887,214 |
| 合計 | 7,214,887,214 |

(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 | 4,330 | 1,959,325,000 | |
| | MCUBS MidCity投資法人 | 3,332 | 1,237,838,000 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 13,983 | 2,304,398,400 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 2,674 | 1,524,180,000 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 4,588 | 2,775,740,000 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 12,284 | 3,523,051,200 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル投資法人 | 2,727 | 816,463,800 | |

| | | | |
|-----------------------|---------|----------------|--|
| アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 5,921 | 3,380,891,000 | |
| GLP投資法人 | 14,004 | 1,786,910,400 | |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 372 | 88,312,800 | |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 16,627 | 3,940,599,000 | |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 994 | 1,316,056,000 | |
| イオンリート投資法人 | 5,221 | 725,719,000 | |
| ヒューリックリート投資法人 | 8,496 | 1,571,760,000 | |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 8,692 | 834,432,000 | |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 10,171 | 1,393,427,000 | |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 4,444 | 1,308,758,000 | |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 27,122 | 4,556,496,000 | |
| ラサールロジポート投資法人 | 6,103 | 619,454,500 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 12,773 | 8,046,990,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 12,423 | 7,727,106,000 | |
| 日本リテールファンド投資法人 | 18,769 | 4,793,602,600 | |
| オリックス不動産投資法人 | 15,834 | 2,905,539,000 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 5,899 | 2,710,590,500 | |
| プレミア投資法人 | 11,388 | 1,620,512,400 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 109 | 16,895,000 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 3,454 | 1,417,867,000 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 22,674 | 4,162,946,400 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 12,398 | 2,567,625,800 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 4,649 | 2,436,076,000 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7,900 | 1,950,510,000 | |
| 福岡リート投資法人 | 1,545 | 318,424,500 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 598 | 383,318,000 | |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 1,440 | 170,784,000 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 2,044 | 1,357,216,000 | |
| 阪急リート投資法人 | 5,842 | 783,412,200 | |
| トップリート投資法人 | 1,305 | 567,022,500 | |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人 | 6,207 | 1,719,339,000 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 32,863 | 3,220,574,000 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 12,671 | 1,939,930,100 | |
| 合計 | 344,870 | 86,480,093,100 | |

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートマザーファンド

貸借対照表

| | 平成28年 6月10日現在 |
|-------------|---------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 15,497,731 |
| 金銭信託 | 205,411 |
| コール・ローン | 1,255,010 |
| 投資証券 | 419,415,262 |
| 未収入金 | 5,318 |
| 未収配当金 | 482,368 |
| 流動資産合計 | 436,861,100 |
| 資産合計 | 436,861,100 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 542,644 |
| 未払利息 | 3 |
| その他未払費用 | 47 |
| 流動負債合計 | 542,694 |
| 負債合計 | 542,694 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 382,705,012 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 53,613,394 |
| 元本等合計 | 436,318,406 |
| 純資産合計 | 436,318,406 |
| 負債純資産合計 | 436,861,100 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成28年 6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> |

| 平成28年 6月10日現在 | |
|------------------------|---|
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 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。 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。 |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (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28年 6月10日現在 | |
|---------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 382,705,012口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額 | 1口当たり純資産額 1.1401円 (1万口当たり純資産額) (11,401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28年 6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。 |

| | 平成28年 6月10日現在 |
|------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>運用部門から独立したコンプライアンス・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。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p> |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 平成28年 6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ぬ。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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28年 6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12月11日 |
| 期首元本額 | 407,762,566円 |
| 期中追加設定元本額 | 450,001円 |
| 期中一部解約元本額 | 25,507,555円 |
| 期末元本額 | 382,705,012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 | 259,773,769円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型） | 76,858,490円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型） | 46,072,753円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年 6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 | 50,963,612 |
| 合計 | 50,963,612 |

(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 | 234 | 8,005.14 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 86 | 3,831.30 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 15 | 5,503.05 | |

| | | | |
|------------------------------|-------|-----------|--|
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 260 | 25,521.60 | |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 141 | 5,826.12 | |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 432 | 20,550.24 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 777 | 14,048.16 | |
| APARTMENT INVEST & MGMT | 564 | 23,078.88 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 545 | 10,055.25 | |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES | 110 | 1,439.90 | |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 113 | 1,448.66 | |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 378 | 2,026.08 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 501 | 85,295.25 | |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 50 | 615.50 | |
| BOSTON PROPERTIES | 561 | 72,357.78 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 598 | 9,771.32 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 639 | 16,665.12 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 318 | 25,697.58 | |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 321 | 8,577.12 | |
| CARETRUST REIT INC | 187 | 2,586.21 | |
| CBL & ASSOCIATES PRTYS | 588 | 6,097.56 | |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 363 | 2,570.04 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 166 | 3,534.14 | |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 245 | 5,833.45 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 45 | 532.80 | |
| COLONY STARWOOD HOMES | 150 | 4,236.00 | |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 484 | 10,865.80 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST | 10 | 197.60 | |
| CORESITE REALTY CORP | 106 | 8,817.08 | |
| CORPORATE OFFICE PPTYS | 367 | 10,169.57 | |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA | 452 | 15,571.40 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 798 | 8,833.86 | |
| CUBESMART | 644 | 19,204.08 | |
| CYRUSONE INC | 260 | 13,767.00 | |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 342 | 15,598.62 | |
| DDR CORPORATION | 1,158 | 20,276.58 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 774 | 7,043.40 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 528 | 54,299.52 | |
| DOUGLAS EMMETT INC-W/I | 527 | 18,091.91 | |
| DUKE REALTY CORP | 1,255 | 31,073.80 | |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC | 254 | 11,826.24 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 30 | 568.50 | |
| EASTGROUP PROPERTIES, INC | 126 | 8,589.42 | |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 188 | 8,008.80 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 432 | 8,445.60 | |

| | | |
|------------------------------------|-------|-----------|
| EPR PROPERTIES | 220 | 16,405.40 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 429 | 12,591.15 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 281 | 20,484.90 |
| EQUITY ONE INC | 286 | 8,640.06 |
| EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 1,338 | 86,247.48 |
| ESSEX PROPERTY TRUST | 242 | 50,640.92 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 446 | 39,992.82 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 251 | 39,437.12 |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 462 | 3,030.72 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 429 | 11,342.76 |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 225 | 2,148.75 |
| FOREST CITY REALTY TRUST-A | 790 | 17,917.20 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 191 | 3,858.20 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP | 340 | 4,158.20 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 359 | 12,195.23 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES | 2,146 | 59,208.14 |
| GEO GROUP INC/THE | 289 | 9,805.77 |
| GETTY REALTY CORP | 114 | 2,421.36 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 89 | 1,504.99 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 630 | 5,392.80 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 276 | 5,702.16 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST INC | 1,641 | 15,113.61 |
| HCP INC | 1,707 | 58,857.36 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 385 | 12,909.05 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 484 | 15,105.64 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 130 | 2,403.70 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 368 | 18,267.52 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 582 | 15,492.84 |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 2,761 | 43,043.99 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 245 | 6,977.60 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 156 | 1,215.24 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 528 | 3,421.44 |
| IRON MOUNTAIN INC | 725 | 26,904.75 |
| KILROY REALTY CORPORATION | 328 | 20,509.84 |
| KIMCO REALTY CORP | 1,520 | 44,505.60 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 320 | 8,371.20 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 434 | 10,012.38 |
| LEXINGTON CORP PROPERTIES | 825 | 8,134.50 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 528 | 20,380.80 |
| LTC PROPERTIES INC | 147 | 7,210.35 |
| MACERICH CO/THE | 492 | 38,499.00 |

| | | |
|-------------------------------------|-------|------------|
| MACK-CALI REALTY CORP | 336 | 9,038.40 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 883 | 13,333.30 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 272 | 26,786.56 |
| MONMOUTH REIT -CL A | 286 | 3,677.96 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I | 650 | 6,389.50 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 520 | 24,918.40 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 90 | 1,907.10 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 127 | 9,063.99 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 291 | 3,043.86 |
| NEW YORK REIT INC | 630 | 5,947.20 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 100 | 1,513.00 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 216 | 2,406.24 |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE | 650 | 9,035.00 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 623 | 20,639.99 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 82 | 1,949.14 |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 316 | 5,681.68 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 275 | 7,213.25 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 265 | 5,896.25 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 290 | 5,736.20 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST | 497 | 10,392.27 |
| POST PROPERTIES | 187 | 10,877.79 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 110 | 1,581.80 |
| PROLOGIS INC | 1,916 | 95,550.92 |
| PS BUSINESS PARKS INC | 78 | 8,080.02 |
| PUBLIC STORAGE | 541 | 132,777.63 |
| QTS REALTY TRUST INC | 132 | 7,186.08 |
| RAMCO-GERSHENSON PRYS | 242 | 4,515.72 |
| REALTY INCOME CORP | 902 | 57,709.96 |
| REGENCY CENTERS CORP | 338 | 26,901.42 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 398 | 8,298.30 |
| RETAIL PROPERTISE OF AME-A | 916 | 14,967.44 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 160 | 3,315.20 |
| RLJ LODGING TRUST | 439 | 9,227.78 |
| ROUSE PROPERTIES INC | 152 | 2,793.76 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 198 | 10,099.98 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 260 | 5,759.00 |
| SAUL CENTERS INC | 49 | 2,876.30 |
| SELECT INCOME REIT | 247 | 6,291.09 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 912 | 17,373.60 |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 50 | 2,461.50 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 164 | 2,656.80 |

| | | | | |
|-------|--------------------------------------|--------|-------------------------------|--|
| | SIMON PROPERTY GROUP | 1,137 | 229,276.05 | |
| | SL GREEN REALTY CORP | 361 | 36,634.28 | |
| | SOVRAN SELF STORAGE INC | 126 | 13,010.76 | |
| | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 1,566 | 18,651.06 | |
| | STAG INDUSTRIAL INC | 283 | 6,429.76 | |
| | STORE CAPITAL CORP | 310 | 8,301.80 | |
| | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 348 | 4,276.92 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 208 | 14,420.64 | |
| | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 830 | 9,827.20 | |
| | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 324 | 12,023.64 | |
| | TAUBMAN CENTERS INC | 208 | 14,699.36 | |
| | TERRENO REALTY CORP | 164 | 4,055.72 | |
| | UDR INC | 965 | 32,530.15 | |
| | UMH PROPERTIES INC | 100 | 1,050.00 | |
| | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 58 | 3,267.72 | |
| | URBAN EDGE PROPERTIES | 358 | 10,174.36 | |
| | URSTADT BIDDLE - CL A | 123 | 2,844.99 | |
| | VENTAS INC | 1,227 | 83,951.34 | |
| | VEREIT INC | 3,263 | 32,238.44 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 646 | 62,778.28 | |
| | WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT | 265 | 8,154.05 | |
| | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 394 | 15,385.70 | |
| | WELLTOWER INC | 1,296 | 93,506.40 | |
| | WHITESTONE REIT | 136 | 1,982.88 | |
| | WINTHROP REALTY TRUST | 120 | 1,160.40 | |
| | WP CAREY INC | 345 | 23,325.45 | |
| | WP GLIMCHER INC | 712 | 8,123.92 | |
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 430 | 7,099.30 | |
| | アメリカドル 小計 | 73,354 | 2,792,467.52 (299,073,271) | |
| カナダドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE | 150 | 5,586.00 | |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 234 | 3,063.06 | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 105 | 5,748.75 | |
| | BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES | 63 | 1,825.74 | |
| | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 229 | 7,060.07 | |
| | CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 104 | 4,862.00 | |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 151 | 2,097.39 | |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 269 | 4,626.80 | |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 110 | 1,668.70 | |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 120 | 1,786.80 | |

| | | |
|--|---------|--------------------------|
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 178 | 1,634.04 |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR | 160 | 1,296.00 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 222 | 4,211.34 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 89 | 3,496.81 |
| H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT | 511 | 11,282.88 |
| INVEST REAL ESTATE INVESTME | 241 | 1,636.39 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 141 | 1,109.67 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 90 | 1,101.60 |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE | 100 | 1,841.00 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL | 10 | 124.40 |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS | 160 | 2,422.40 |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE | 75 | 1,608.00 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 90 | 882.90 |
| ONEREIT | 283 | 1,058.42 |
| PLAZA RETAIL REIT | 100 | 480.00 |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | 260 | 1,313.00 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 575 | 15,996.50 |
| SLATE RETAIL REIT | 40 | 541.20 |
| SMART REAL ESTATE INVSTMENT | 239 | 8,584.88 |
| カナダドル 小計 | 5,099 | 98,946.74 (8,322,410) |
| ユーロ | | |
| AEDIFICA | 47 | 3,181.90 |
| AFFINE | 15 | 244.05 |
| ALSTRIA OFFICE REIT -AG | 316 | 3,803.06 |
| ALTAREA | 8 | 1,430.00 |
| ANF IMMOBILIER | 57 | 1,322.40 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | 190 | 2,403.50 |
| BEFIMMO S.C.A. | 75 | 4,560.75 |
| BENI STABILI SPA | 3,832 | 2,504.21 |
| BGP HOLDINGS PLC | 900,544 | - |
| COFINIMMO | 76 | 8,451.20 |
| EUROCOMMERCIAL | 158 | 6,620.99 |
| FONCIERE DES MURS | 25 | 681.25 |
| FONCIERE DES REGIONS | 154 | 12,589.50 |
| GECINA SA | 138 | 17,981.40 |
| GREEN REIT PLC | 2,622 | 3,854.34 |
| HAMBORNER REIT AG | 230 | 2,254.00 |
| HIBERNIA REIT PLC | 2,635 | 3,393.88 |

| | | | |
|---------------------|--------------------------------|----------|----------------------------|
| | ICADE | 134 | 8,963.26 |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 1,084 | 873.70 |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 40 | 1,025.00 |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 1,200 | 1,386.00 |
| | KLEPIERRE | 683 | 28,781.62 |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 250 | 2,127.50 |
| | MERCIALYS | 71 | 1,433.13 |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 1,060 | 10,207.80 |
| | NSI NV | 439 | 1,742.83 |
| | RETAIL ESTATES | 25 | 1,997.50 |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 359 | 86,680.55 |
| | VASTNED RETAIL | 71 | 2,783.55 |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 52 | 4,540.12 |
| | WERELDHAVE BELGIUM | 10 | 1,194.00 |
| | WERELDHAVE NV | 155 | 7,106.75 |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 10 | 357.00 |
| | ユーロ 小計 | 916,765 | 236,476.74 (28,616,050) |
| イギリスポ ンド | ASSURA PLC | 3,988 | 2,291.10 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 481 | 4,220.77 |
| | BRITISH LAND CO PLC | 3,765 | 27,898.65 |
| | DERWENT LONDON PLC | 397 | 13,112.91 |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 820 | 904.05 |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 1,321 | 9,801.82 |
| | HAMMERSON PLC | 2,840 | 16,514.60 |
| | HANSTEEN HOLDINGS PLC | 2,883 | 3,009.85 |
| | INTU PROPERTIES PLC | 3,076 | 9,378.72 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 2,914 | 33,948.10 |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 2,470 | 3,989.05 |
| | MCKAY SECURITIES PLC-ORD | 390 | 847.27 |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 2,044 | 2,207.52 |
| | REDEFINE INTERNATIONAL PLC | 3,700 | 1,729.75 |
| | REGIONAL REIT LTD | 600 | 636.00 |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 908 | 3,268.80 |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 2,000 | 1,160.00 |
| | SEGRO PLC | 2,862 | 12,713.00 |
| | SHAFTESBURY PLC | 1,064 | 9,847.32 |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 2,380 | 3,303.44 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 488 | 4,243.16 | |
| | イギリスポンド 小計 | 41,391 | 165,025.88 (25,546,006) |
| オーストラ リアドル | 360 CAPITAL GROUP LTD | 1,200 | 1,080.00 |

| | | | |
|------------|------------------------------|---------|----------------------------|
| | 360 CAPITAL OFFICE FUND | 256 | 583.68 |
| | ABACUS PROPERTY GROUP | 1,107 | 3,630.96 |
| | ALE PROPERTY GROUP | 764 | 3,361.60 |
| | ARENA REIT | 1,000 | 2,030.00 |
| | ASPEN GROUP | 520 | 631.80 |
| | ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | 165 | 1,135.20 |
| | BWP TRUST | 1,954 | 7,210.26 |
| | CHARTER HALL GROUP | 1,204 | 6,333.04 |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 1,207 | 5,938.44 |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 5,265 | 5,607.22 |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 3,440 | 30,753.60 |
| | FOLKESTONE EDUCATION TRUST | 1,000 | 2,630.00 |
| | GALILEO JAPAN TRUST | 500 | 1,280.00 |
| | GDI PROPERTY GROUP | 2,400 | 2,184.00 |
| | GOODMAN GROUP | 5,695 | 41,516.55 |
| | GPT GROUP | 6,440 | 35,098.00 |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUS | 754 | 2,548.52 |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 700 | 2,233.00 |
| | INDUSTRIA REIT | 466 | 992.58 |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 638 | 1,894.86 |
| | INVESTA OFFICE FUND | 2,202 | 9,534.66 |
| | MIRVAC GROUP | 13,220 | 26,704.40 |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 1,335 | 2,509.80 |
| | SCENTRE GROUP | 19,456 | 91,443.20 |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 2,498 | 5,945.24 |
| | STOCKLAND | 8,653 | 41,188.28 |
| | VICINITY CENTERS | 11,804 | 39,071.24 |
| | WESTFIELD CORP | 6,936 | 74,562.00 |
| | オーストラリアドル 小計 | 102,779 | 449,632.13 (35,691,798) |
| ニュージーランドドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 3,500 | 4,165.00 |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 4,259 | 5,685.76 |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 4,006 | 6,009.00 |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 3,400 | 4,386.00 |
| | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 2,131 | 3,558.77 |
| | STRIDE PROPERTY LTD | 1,208 | 2,687.80 |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 1,309 | 2,984.52 |
| | ニュージーランドドル 小計 | 19,813 | 29,476.85 (2,245,251) |
| 香港ドル | CHAMPION REIT | 8,000 | 32,640.00 |
| | FORTUNE REIT | 5,000 | 43,750.00 |
| | LINK REIT | 8,000 | 397,200.00 |
| | NEW CENTURY REIT | 2,000 | 4,740.00 |

| | | | | |
|-------------------------------|---------------------------------------|-----------|----------------------------|--|
| | PROSPERITY REIT | 5,000 | 15,350.00 | |
| | REGAL REAL ESTATE INVESTMENT | 4,000 | 7,760.00 | |
| | SPRING REAL ESTATE INVESTMENT | 3,000 | 10,050.00 | |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,000 | 12,690.00 | |
| | YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT | 5,000 | 22,100.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 43,000 | 546,280.00 (7,538,664) | |
| シンガポールドル | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL | 2,400 | 3,300.00 | |
| | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 4,000 | 2,660.00 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 7,800 | 18,252.00 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 2,800 | 3,192.00 | |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 2,400 | 2,076.00 | |
| | CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 3,800 | 2,090.00 | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 7,900 | 11,139.00 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 9,900 | 20,196.00 | |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 2,200 | 3,388.00 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 2,400 | 3,420.00 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 4,000 | 2,440.00 | |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,500 | 3,150.00 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 1,900 | 3,800.00 | |
| | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 2,400 | 3,108.00 | |
| | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 2,000 | 1,570.00 | |
| | KEPPEL DC REIT | 2,500 | 2,687.50 | |
| | KEPPEL REIT | 7,000 | 7,420.00 | |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 8,000 | 2,720.00 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 4,200 | 6,069.00 | |
| | MAPLETREE GREATER CHINA COM | 5,400 | 5,373.00 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 4,700 | 7,567.00 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 6,000 | 5,940.00 | |
| | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 2,000 | 1,330.00 | |
| | QUE HOSPITALITY TRUST | 2,200 | 1,485.00 | |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 1,600 | 3,936.00 | | |
| SABANA SHARIAH COMP IND REI | 3,000 | 1,800.00 | | |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 2,000 | 1,390.00 | | |
| SPH REIT | 3,300 | 3,069.00 | | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 6,000 | 4,650.00 | | |
| SUNTEC REIT | 8,700 | 14,398.50 | | |
| | シンガポールドル 小計 | 125,000 | 153,616.00 (12,152,561) | |

| | | | | | |
|----|---------------|------------|-----------|------------------------------|--|
| | イスラエル シェケル | REIT 1 LTD | 700 | 8,211.00 | |
| | イスラエルシェケル 小計 | | 700 | 8,211.00 (229,251) | |
| 合計 | | | 1,327,901 | 419,415,262 (419,415,262) | |

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 155銘柄 | 100.0% | 71.3% |
| カナダドル | 投資証券 29銘柄 | 100.0% | 2.0% |
| ユーロ | 投資証券 33銘柄 | 100.0% | 6.8% |
| イギリスポンド | 投資証券 21銘柄 | 100.0% | 6.1% |
| オーストラリアドル | 投資証券 29銘柄 | 100.0% | 8.5% |
| 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% | 1.8% |
| 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28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 511,233,003円 |
| 負債総額 | 743,903円 |
| 純資産総額（ - ） | 510,489,100円 |
| 発行済口数 | 535,179,851口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.9539円 |
| （1万口当たり純資産額） | （9,539円） |

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 198,612,829,272円 |
| 負債総額 | 2,266,474,798円 |
| 純資産総額（ - ） | 196,346,354,474円 |
| 発行済口数 | 157,921,963,936口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2433円 |
| （1万口当たり純資産額） | （12,433円） |

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 327,966,960,993円 |
| 負債総額 | 3,059,373,416円 |
| 純資産総額（ - ） | 324,907,587,577円 |
| 発行済口数 | 232,880,284,019口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3952円 |
| （1万口当たり純資産額） | （13,952円） |

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 206,221,226,962円 |
| 負債総額 | 231,272,328円 |
| 純資産総額（ - ） | 205,989,954,634円 |
| 発行済口数 | 112,782,586,222口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.8264円 |
| （1万口当たり純資産額） | （18,264円） |

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 162,927,805,435円 |
| 負債総額 | 139,063,158円 |
| 純資産総額（ - ） | 162,788,742,277円 |
| 発行済口数 | 75,036,223,231口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.1695円 |
| （1万口当たり純資産額） | （21,695円） |

Jリートマザーファンド（M）

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 87,196,845,770円 |
| 負債総額 | 412,772,883円 |
| 純資産総額（ - ） | 86,784,072,887円 |
| 発行済口数 | 34,521,242,276口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5139円 |
| （1万口当たり純資産額） | （25,139円） |

海外リートマザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 425,093,048円 |
| 負債総額 | 59,173円 |
| 純資産総額（ - ） | 425,033,875円 |
| 発行済口数 | 381,812,656口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1132円 |
| （1万口当たり純資産額） | （11,132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、

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、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、

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、

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28年 6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、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、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 9月 9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28年6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 | 458 | 7,883,500 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 36 | 153,379 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 合計 | 494 | 8,036,878 |

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。

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (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、当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）の財務諸表について、有限責任 必ず監査法人により監査を受けておりま

す。

(1)【貸借対照表】

| | (単位：千円) | |
|------------|-------------------------|-------------------------|
| | 前事業年度 (平成27年3月31日現在) | 当事業年度 (平成28年3月31日現在) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 12,314,170 | 16,534,066 |
| 前払費用 | 125,306 | 102,445 |
| 未収委託者報酬 | 4,518,944 | 5,528,610 |
| 繰延税金資産 | 116,728 | 121,367 |
| その他 | 8,789 | 5,566 |
| 流動資産合計 | 17,083,939 | 22,292,056 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 57,461 | 1 55,487 |
| 器具備品 | 1 116,879 | 1 90,924 |
| その他 | - | 1 3,748 |
| 有形固定資産合計 | 174,341 | 150,160 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | 197,641 | 215,175 |
| その他 | 7,648 | 5,886 |
| 無形固定資産合計 | 205,290 | 221,062 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 60,277 | 63,797 |
| 長期前払費用 | 5,425 | 8,021 |
| 長期貸付金 | 25,838 | 22,838 |
| 会員権 | 25,000 | 25,000 |
| 繰延税金資産 | 114,415 | 123,235 |
| その他 | 463 | 235 |
| 貸倒引当金 | 25,838 | 22,838 |
| 投資その他の資産合計 | 205,581 | 220,289 |
| 固定資産合計 | 585,213 | 591,512 |
| 資産合計 | 17,669,152 | 22,883,569 |

| | (単位：千円) | |
|------|-------------------------|-------------------------|
| | 前事業年度 (平成27年3月31日現在) | 当事業年度 (平成28年3月31日現在) |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 13,868 | 14,543 |
| 未払金 | 2,578,595 | 3,057,975 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 未払手数料 | 1,896,826 | 2,223,498 |
| その他未払金 | 681,769 | 834,477 |
| 未払費用 | 52,291 | 64,411 |
| 未払法人税等 | 924,882 | 1,445,329 |
| 未払消費税等 | 354,256 | 246,748 |
| 賞与引当金 | 94,769 | 98,630 |
| その他 | 56,222 | 3,100 |
| 流動負債合計 | 4,074,887 | 4,930,740 |
| 固定負債 | | |
| 資産除去債務 | 12,707 | 12,926 |
| 退職給付引当金 | 342,831 | 389,941 |
| その他 | - | 3,056 |
| 固定負債合計 | 355,538 | 405,924 |
| 負債合計 | 4,430,425 | 5,336,665 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 300,000 | 300,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | 350,000 | 350,000 |
| 資本剰余金合計 | 350,000 | 350,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 65,500 | 68,500 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 2,100,000 | 2,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | 10,419,991 | 14,729,555 |
| 利益剰余金合計 | 12,585,491 | 16,898,055 |
| 株主資本合計 | 13,235,491 | 17,548,055 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 3,235 | 1,151 |
| 評価・換算差額等合計 | 3,235 | 1,151 |
| 純資産合計 | 13,238,726 | 17,546,904 |
| 負債・純資産合計 | 17,669,152 | 22,883,569 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|--------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 28,159,652 | 32,163,066 |
| 運用受託報酬 | 8,732 | - |

| | | |
|----------|------------|------------|
| 営業収益合計 | 28,168,384 | 32,163,066 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 12,922,655 | 14,102,687 |
| 広告宣伝費 | 130,384 | 126,914 |
| 公告費 | 880 | 2,765 |
| 調査費 | 5,994,577 | 6,758,898 |
| 調査費 | 279,702 | 331,886 |
| 委託調査費 | 5,712,946 | 6,425,175 |
| 図書費 | 1,928 | 1,836 |
| 営業雑経費 | 1,299,065 | 1,399,773 |
| 通信費 | 17,456 | 17,552 |
| 印刷費 | 330,921 | 349,902 |
| 協会費 | 23,182 | 26,659 |
| 諸会費 | 105 | 105 |
| 情報機器関連費 | 857,009 | 927,524 |
| その他営業雑経費 | 70,390 | 78,029 |
| 営業費用合計 | 20,347,563 | 22,391,039 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 2,185,555 | 2,123,392 |
| 役員報酬 | 89,055 | 89,280 |
| 給料・手当 | 1,839,000 | 1,759,320 |
| 賞与 | 257,499 | 274,792 |
| 退職給付費用 | 71,270 | 73,742 |
| 福利費 | 212,286 | 222,276 |
| 交際費 | 4,491 | 6,004 |
| 旅費交通費 | 55,788 | 67,392 |
| 租税公課 | 42,868 | 73,989 |
| 不動産賃借料 | 130,938 | 125,339 |
| 減価償却費 | 129,285 | 126,985 |
| 業務委託費 | 1 45,054 | 1 209,510 |
| 諸経費 | 167,290 | 217,580 |
| 一般管理費合計 | 3,044,830 | 3,246,214 |
| 営業利益 | 4,775,990 | 6,525,812 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|-----------|---|---|
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 6,802 | 8,092 |
| 収益分配金 | 4,617 | 2,026 |
| 投資有価証券売却益 | 1,846 | 350 |
| 貸倒引当金戻入 | 3,000 | 3,000 |
| その他 | 1,936 | 5,272 |
| 営業外収益合計 | 18,203 | 18,742 |
| 営業外費用 | | |

| | | | | |
|--------------|---|-----------|---|-----------|
| 長期前払費用償却 | 1 | 27,866 | 1 | 27,866 |
| 支払補償費 | | 7,656 | | 1,893 |
| 投資有価証券売却損 | | 117 | | 365 |
| その他 | | 3,283 | | 14 |
| 営業外費用合計 | | 38,924 | | 30,139 |
| 経常利益 | | 4,755,269 | | 6,514,415 |
| 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 | | 4,699,047 | | 6,514,415 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 1,667,610 | | 2,183,255 |
| 法人税等調整額 | | 30,739 | | 11,403 |
| 法人税等合計 | | 1,698,349 | | 2,171,851 |
| 当期純利益 | | 3,000,697 | | 4,342,563 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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 | | | | 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 | 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 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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 | 65,500 | 2,100,000 | 10,419,991 | 12,585,491 | 13,235,491 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,000 | | 33,000 | 30,000 | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 4,342,563 | 4,342,563 | 4,342,563 |
| 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 | - | 4,309,563 | 4,312,563 | 4,312,563 |
| 当期末残高 | 68,500 | 2,100,000 | 14,729,555 | 16,898,055 | 17,548,055 |

| | 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 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 4,342,563 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 4,386 | 4,386 | 4,386 |
| 当期変動額合計 | 4,386 | 4,386 | 4,308,177 |
| 当期末残高 | 1,151 | 1,151 | 17,546,904 |

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。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

「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。）等を当事業年度から適用し、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、当事業年度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事業年度の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、当事業年度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。

未適用の会計基準等

・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1) 概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

(分類2)に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

(分類3)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

(分類4)に係る分類の要件を満たす企業が(分類2)又は(分類3)に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

表示方法の変更

(損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた212,345千円は、「業務委託費」45,054千円、「諸経費」167,290千円として組み替えております。

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27年3月31日) | | 当事業年度 (平成28年3月31日) | |
|-------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 建 物 | 45,415 | 千円 | 54,302 | 千円 |
| 器具備品 | 218,270 | " | 263,257 | " |
| そ の 他 | - | " | 841 | " |
| 計 | 263,685 | " | 318,401 | " |

(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26年4月1日 至平成27年3月31日) | | 当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) | |
|----------|--------------------------------------|----|--------------------------------------|----|
| 業務委託費 | 37,614 | 千円 | 39,733 | 千円 |
| 長期前払費用償却 | 27,866 | " | 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28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

| 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 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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 |

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28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28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28年3月31日 | 平成28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）

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。

当事業年度（平成28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 | 16,534,066 | 16,534,066 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 5,528,610 | 5,528,610 | - |
| (3) 投資有価証券 其他有価証券 | 63,794 | 63,794 | - |
| (4) 未払金 | (3,057,975) | (3,057,975) | - |
| (5) 未払法人税等 | (1,445,329) | (1,445,329) | - |

(*) 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27年3月31日 | 平成28年3月31日 |
|-------|------------|------------|
| 非上場株式 | 3 | 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) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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 | - |

当事業年度(平成28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 | 16,534,066 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 5,528,610 | - | - | - |
| 投資有価証券 投資信託 | - | 6,265 | 17,912 | - |

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(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 |

当事業年度(平成28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 | 10,329 | 9,998 | 330 |
| 小計 | 10,329 | 9,998 | 330 |

| | | | |
|----------------------|--------|--------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 53,465 | 55,455 | 1,989 |
| 小計 | 53,465 | 55,455 | 1,989 |
| 合計 | 63,794 | 65,453 | 1,659 |

（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 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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 |
| 20,015 | 350 | 365 |

（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27年3月31日） | 当事業年度 （平成28年3月31日） |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) 退職給付債務 | 342,831 | 389,941 |
| (2) 退職給付引当金 | 342,831 | 389,941 |

（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27年3月31日） | 当事業年度 （平成28年3月31日） |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) 退職給付費用 | 71,270 | 73,742 |

（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14,089千円、当事業年度で14,434千円であります。

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27年3月31日） | | 当事業年度 （平成28年3月31日） | |
|------------------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 繰延税金資産 | | | | |
| 未払事業税 | 64,846 | 千円 | 86,931 | 千円 |
| 貸倒引当金繰入限度超過額 | 8,356 | " | 6,993 | " |
| 賞与引当金損金算入限度超過額 | 31,368 | " | 30,437 | " |
| 退職給付引当金損金算入限度超過額 | 110,871 | " | 119,400 | " |

| | | | | |
|-----------------|---------|---|---------|---|
| 外国税関連費用損金不算入額 | 18,609 | 〃 | - | 〃 |
| その他 | 5,855 | 〃 | 7,674 | 〃 |
| 繰延税金資産 合計 | 239,908 | 〃 | 251,436 | 〃 |
| 繰延税金負債 | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 1,546 | 〃 | - | 〃 |
| 投資有価証券売却益益金不算入額 | 7,217 | 〃 | 6,833 | 〃 |
| 繰延税金負債 合計 | 8,763 | 〃 | 6,833 | 〃 |
| 繰延税金資産の純額 | 231,144 | 〃 | 244,602 | 〃 |

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%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15,263千円、その他有価証券評価差額金が27千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が15,236千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・リアルコース） | 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いません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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） | 3,979,867千円 |

（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

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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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 | 10,100,152 | 未払手数料 | 1,682,049 |
| | | | | | | | 投資助言費用の支払 | 4,834,722 | その他未払金 | 460,620 |

（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）

当事業年度（平成28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27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 1株当たり純資産額 | 4,412,908円85銭 | 5,848,968円06銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 1,000,232円56銭 | 1,447,521円33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26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|--------------|---|---|
| 当期純利益 | 3,000,697千円 | 4,342,563千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益 | 3,000,697千円 | 4,342,563千円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 3,000株 | 3,000株 |

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以

下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成28年6月30日に社外取締役との責任限定契約に係る規定を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成28年 9月 9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28年3月末日現在)

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

(2)販売会社

| 名称 | 資本金の額(百万円) (平成28年3月末日現在) | 事業の内容 |
|------------|-----------------------------|--------------------|
| 株式会社愛知銀行 | 18,000 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社青森銀行 | 19,562 | |
| 株式会社秋田銀行 | 14,100 | |
| 株式会社岩手銀行 | 12,089 | |
| 株式会社京都銀行 | 42,103 | |
| 株式会社四国銀行 | 25,000 | |
| 株式会社荘内銀行 | 8,500 | |
| 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28年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等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まれます。）を掲載することがあります。また、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28年 6 月 3 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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

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28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. X B R 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8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

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12月11日から平成28年6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28年6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

- 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。
- XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。