

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年9月10日提出
【計算期間】	第16特定期間(自 平成26年12月11日至 平成27年6月10日)
【ファンド名】	ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートイング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0521
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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 ー バ ル (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ・ ショ ー ト型/ 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(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。

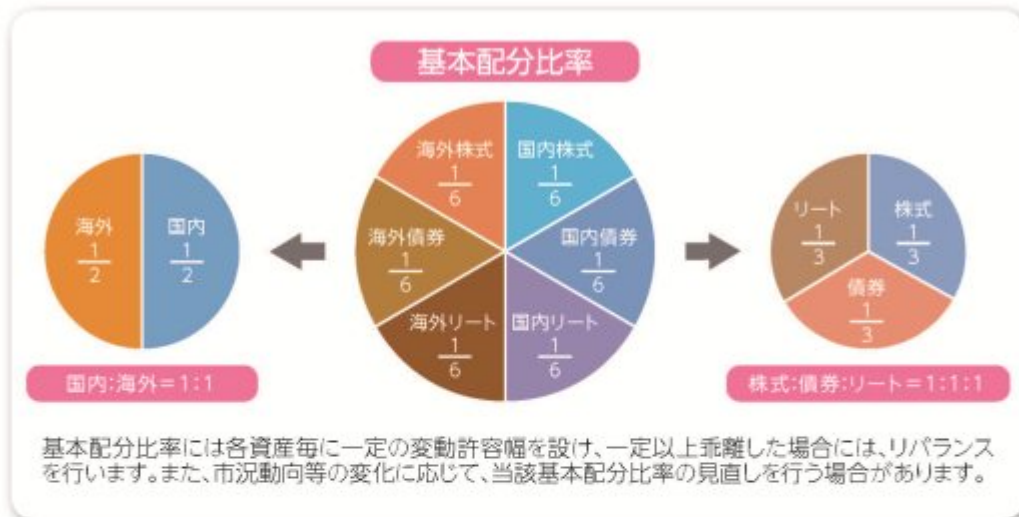
同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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。

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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

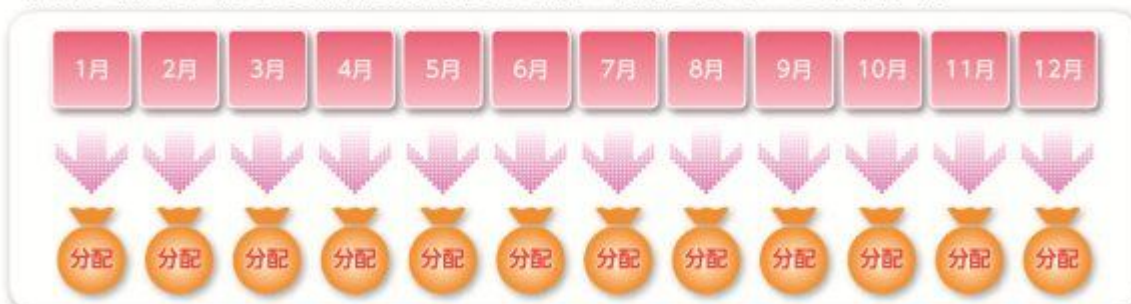
ファンドのしくみ

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



分配方針

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



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

主な投資制限

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

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

【収益分配金に関する留意事項】

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

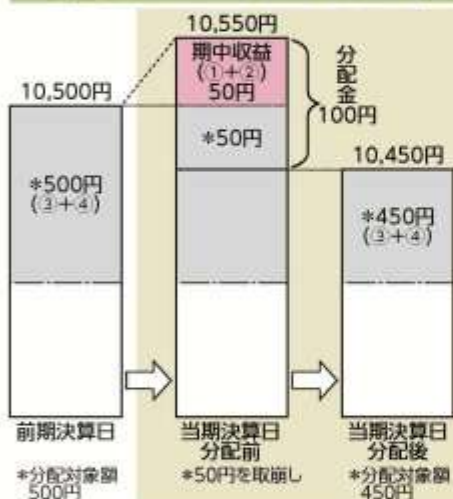
投資信託で分配金が支払われるイメージ



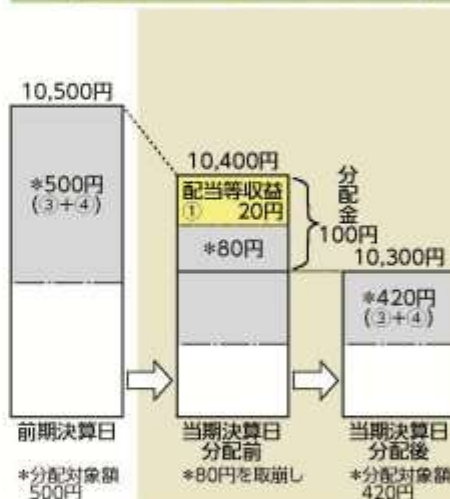
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）



（前期決算日から基準価額が下落した場合）

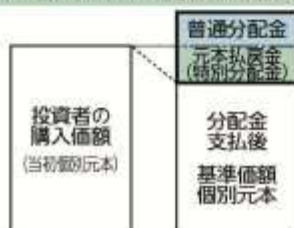


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

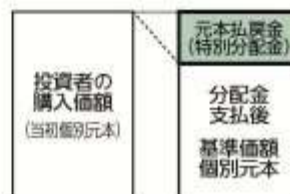
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）



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

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



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

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

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

（2）【ファンドの沿革】

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

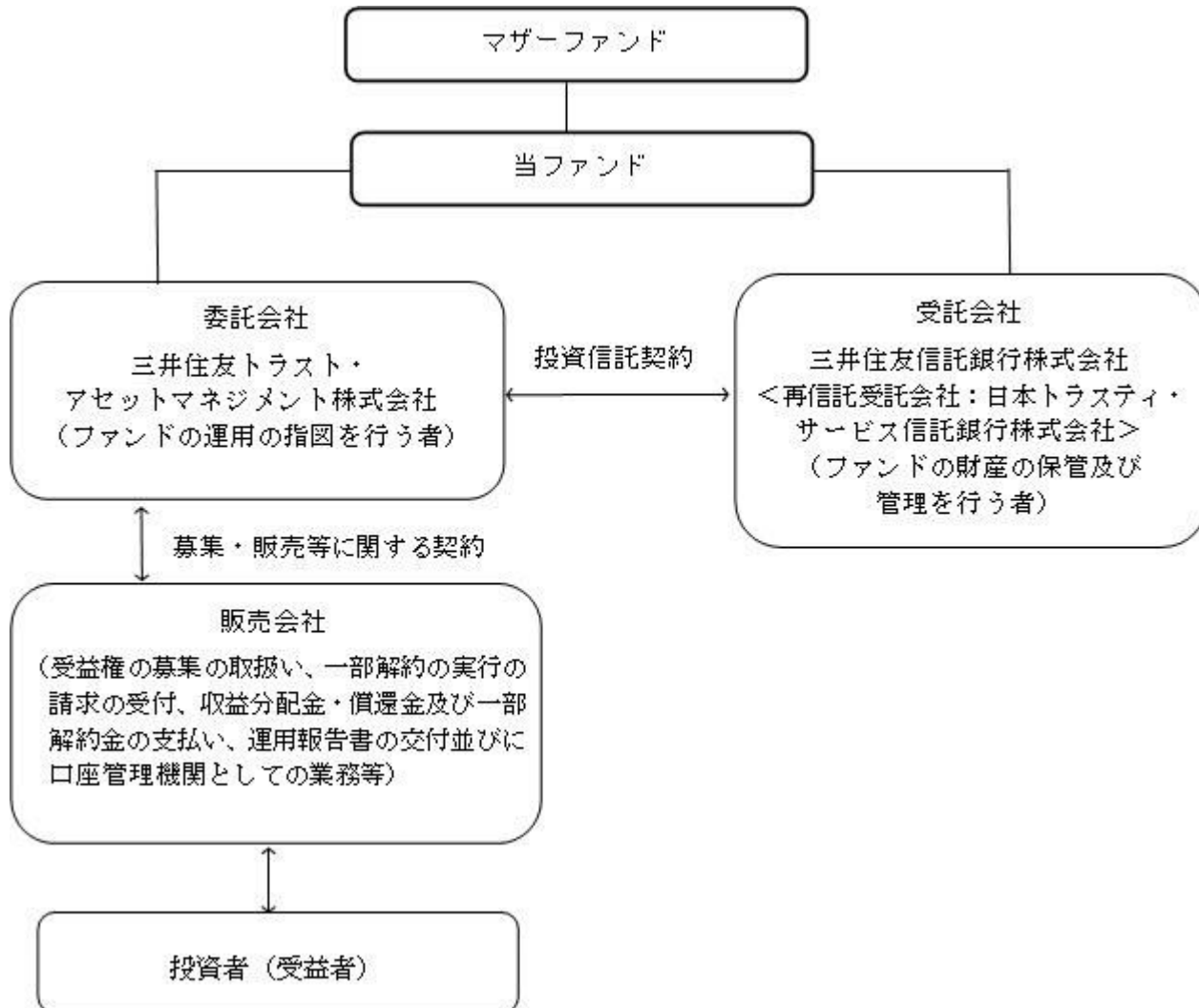
平成24年 4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

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

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

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年 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ることとし、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。

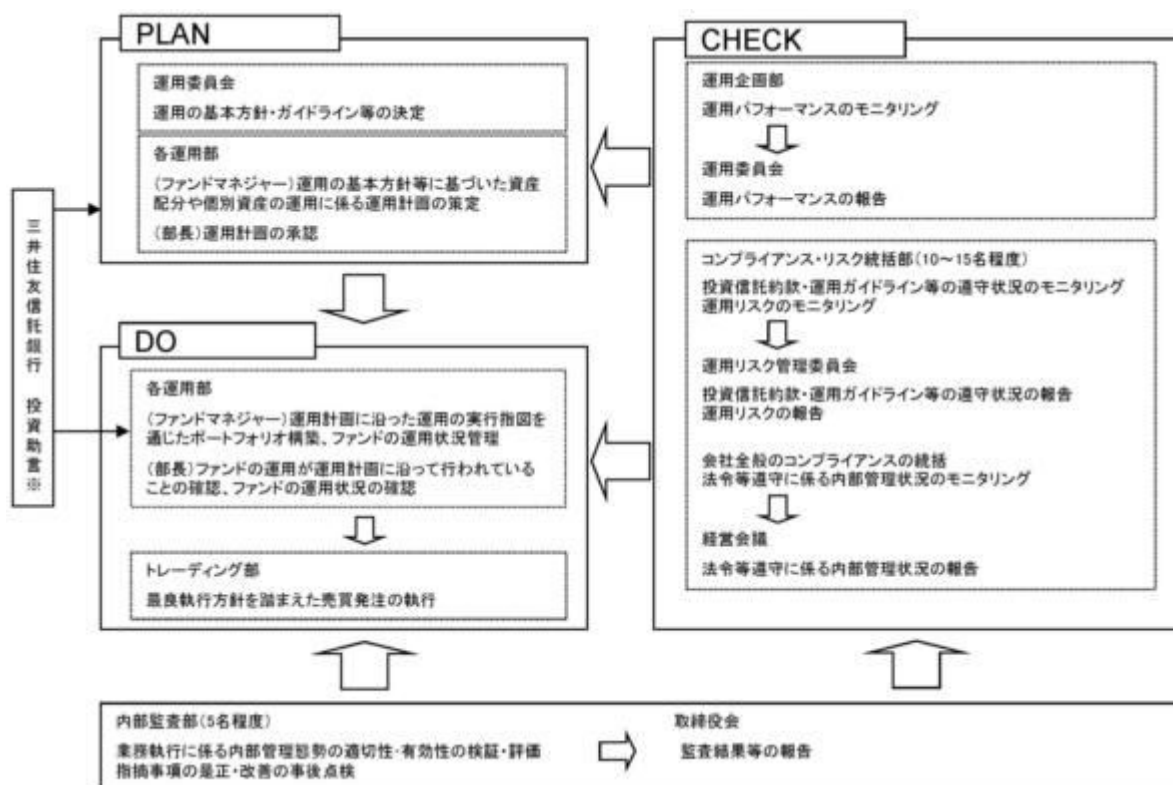
株式への直接投資は行いません。

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）で金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとして、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権

証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

H．信用取引の運用指図

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

I．先物取引等の運用指図

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

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

J．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

K．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり担保の提供あるいは受入れが必要

と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

M．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

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

N．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

O．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

P．外国為替予約取引の指図

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

ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みません。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではあ

りません。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

Q．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図

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

R．再投資の指図

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

S．資金の借入れ

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

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

ハ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

T．受託会社による資金の立替え

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

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

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

U．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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

ます。

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

A．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2010年7月～2015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ロクサイ・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・ディバシファイド(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国内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却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ロクサイ・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、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

*5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売却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されていますが、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、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益及び申告分
離課税を選択した上場株式等の配当所得から控除することが可能です。また、一部解約時及び償
還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能です。

なお、平成28年1月1日以降は、損益通算の対象に特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等が追加
され、これら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となります。

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

NISAをご利用の場合、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27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27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	680,584,866	99.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,003,198	0.44
合計(純資産総額)		683,588,064	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	75,387,264	1.5893	119,812,979	1.5927	120,069,295	17.56
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	52,496,593	2.3021	120,852,407	2.2455	117,881,099	17.24
日本	親投資信託受益証券	Jリートマザーファンド(M)	48,577,421	2.3817	115,696,844	2.3460	113,962,629	16.67
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	45,562,180	2.4791	112,953,201	2.4457	111,431,423	16.30
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	84,877,052	1.2843	109,007,598	1.2894	109,440,470	16.01
日本	親投資信託受益証券	海外リートマザーファンド	93,665,784	1.1821	110,722,324	1.1509	107,799,950	15.77

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.56
合計	99.56

(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
平成26年 6月末日	918,526,562		9,110	
7月末日	898,377,725		9,217	
8月末日	879,262,108		9,300	
9月末日	860,280,060		9,452	
10月末日	855,910,391		9,585	
11月末日	844,324,706		10,279	
12月末日	819,958,074		10,465	
平成27年 1月末日	788,760,924		10,385	
2月末日	778,796,766		10,571	
3月末日	757,221,493		10,592	
4月末日	730,810,564		10,604	
5月末日	717,372,797		10,826	
6月末日	683,588,064		10,506	

【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

【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

(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

(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	239,819,715,980	98.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,446,677,427	1.42
合計(純資産総額)		243,266,393,407	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	2,934,900,000	1.21

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

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	1,386,400	7,585.00	10,515,844,000	8,203.00	11,372,639,200	4.67
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,957,700	614.70	4,891,598,190	879.80	7,001,184,460	2.88
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	750,100	4,048.00	3,036,404,800	5,459.00	4,094,795,900	1.68
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	524,500	7,056.00	3,700,872,000	7,209.00	3,781,120,500	1.55
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,831,400	196.15	2,713,029,110	265.00	3,665,321,000	1.51
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	904,300	3,652.50	3,302,955,750	3,961.50	3,582,384,450	1.47
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	776,200	3,362.00	2,609,584,400	4,433.50	3,441,282,700	1.41
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,007,500	2,743.33	2,763,904,975	2,954.00	2,976,155,000	1.22
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	624,000	3,335.00	2,081,040,000	4,360.50	2,720,952,000	1.12
日本	株式	ファナック	電気機器	104,600	20,130.00	2,105,598,000	25,080.00	2,623,368,000	1.08
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	394,400	5,556.00	2,191,286,400	5,911.00	2,331,298,400	0.96
日本	株式	キヤノン	電気機器	582,600	3,880.50	2,260,779,300	3,982.50	2,320,204,500	0.95
日本	株式	ソニー	電気機器	657,000	2,618.50	1,720,354,500	3,461.50	2,274,205,500	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	105,400	12,950.00	1,364,930,000	21,360.00	2,251,344,000	0.93
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	414,900	4,255.00	1,765,399,500	5,260.00	2,182,374,000	0.90
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,224,600	1,325.00	1,622,595,000	1,681.50	2,059,164,900	0.85
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,178,100	1,817.00	2,140,607,700	1,745.50	2,056,373,550	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	401,800	3,807.50	1,529,853,500	5,094.00	2,046,769,200	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	760,100	2,112.00	1,605,331,200	2,692.00	2,046,189,200	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	184,200	9,169.00	1,688,929,800	11,010.00	2,028,042,000	0.83
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	90,000	19,050.00	1,714,500,000	22,105.00	1,989,450,000	0.82
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,413,000	883.80	2,132,609,400	806.80	1,946,808,400	0.80
日本	株式	三菱地所	不動産業	738,000	2,373.50	1,751,643,000	2,636.50	1,945,737,000	0.80
日本	株式	三井不動産	不動産業	526,000	3,091.50	1,626,129,000	3,427.00	1,802,602,000	0.74
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,410,500	1,032.50	1,456,341,250	1,275.00	1,798,387,500	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	764,900	1,981.50	1,515,649,350	2,344.00	1,792,925,600	0.74
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,027,900	625.40	1,268,248,660	830.60	1,684,373,740	0.69
日本	株式	花王	化学	283,100	5,111.00	1,446,924,100	5,693.00	1,611,688,300	0.66
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,005,000	1,366.00	1,372,830,000	1,582.00	1,589,910,000	0.65
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	342,000	4,231.50	1,447,173,000	4,508.00	1,541,736,000	0.63

(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	0.07
		鉱業	0.39
		建設業	2.58
		食料品	4.09
		繊維製品	0.75
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.84
		医薬品	4.64
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.84
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.41
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.61
		機械	4.92
		電気機器	12.55
		輸送用機器	11.06
		精密機器	1.34
		その他製品	1.51
		電気・ガス業	2.08
		陸運業	3.92
		海運業	0.28
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.20
		情報・通信業	6.75
		卸売業	4.12
		小売業	4.61
		銀行業	9.58
		証券、商品先物取引業	1.36
		保険業	2.73
		その他金融業	1.30
不動産業	2.78		
サービス業	3.08		
	小計	98.58	
合計		98.58	

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	180円		2,983,962,240	2,934,900,000	1.21

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

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	260,996,921,540	79.67
	メキシコ	101,001,000	0.03
	小計	261,097,922,540	79.70
地方債証券	日本	19,560,002,658	5.97
特殊債券	日本	26,764,330,790	8.17
	韓国	102,205,000	0.03
	小計	26,866,535,790	8.20
社債券	日本	15,408,041,650	4.70
	オーストラリア	506,905,000	0.15
	アメリカ	308,173,000	0.09
	フランス	301,177,000	0.09
	オランダ	202,374,000	0.06
	スウェーデン	201,484,000	0.06
	ノルウェー	100,875,000	0.03
	韓国	100,446,000	0.03
小計	17,129,475,650	5.23	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,958,366,760	0.90
合計(純資産総額)		327,612,303,398	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	1,616,670,000	0.49

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	5,280,000,000	100.54	5,308,512,000	100.43	5,302,809,600	0.200	2017/9/20	1.62
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,805,000,000	100.00	3,805,060,700	100.02	3,805,875,150	0.100	2020/3/20	1.16
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,522,000,000	100.51	3,540,138,300	100.40	3,536,193,660	0.200	2017/6/20	1.08
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,540,000,000	100.26	3,549,216,000	99.67	3,528,424,200	0.400	2025/3/20	1.08
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	3,440,000,000	102.88	3,539,072,000	101.95	3,507,114,400	0.600	2024/6/20	1.07
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,360,000,000	103.00	3,460,800,000	102.14	3,431,904,000	0.600	2023/12/20	1.05
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,345,000,000	101.87	3,407,551,500	100.93	3,376,242,300	0.500	2024/9/20	1.03
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	3,330,000,000	100.14	3,334,667,700	100.08	3,332,963,700	0.100	2019/12/20	1.02
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	3,080,000,000	102.94	3,170,552,000	102.07	3,143,786,800	0.600	2024/3/20	0.96
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,090,000,000	100.68	3,111,012,000	100.58	3,108,200,100	0.200	2018/12/20	0.95
日本	国債証券	第345回利付国債(2年)	3,090,000,000	100.21	3,096,569,000	100.13	3,094,171,500	0.100	2016/10/15	0.94
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,070,000,000	100.72	3,092,104,000	100.57	3,087,621,800	0.200	2019/3/20	0.94
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,735,000,000	104.67	2,862,943,300	104.01	2,844,673,500	0.800	2022/9/20	0.87
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,735,000,000	104.69	2,863,408,250	103.89	2,841,391,500	0.800	2023/6/20	0.87
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,730,000,000	100.68	2,748,564,000	100.52	2,744,277,900	0.300	2017/3/20	0.84
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,427,000,000	106.63	2,587,950,100	105.80	2,567,984,430	1.200	2020/12/20	0.78
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	2,490,000,000	103.68	2,581,632,000	102.92	2,562,807,600	1.700	2017/3/20	0.78
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	2,535,000,000	100.61	2,550,640,950	100.44	2,546,331,450	0.300	2016/12/20	0.78
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	2,400,000,000	103.27	2,478,624,000	102.50	2,460,072,000	1.700	2016/12/20	0.75
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,395,000,000	103.12	2,469,724,000	102.37	2,451,929,150	0.600	2023/3/20	0.75
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,200,000,000	106.08	2,333,760,000	105.43	2,319,504,000	1.300	2019/12/20	0.71
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	2,310,000,000	99.71	2,303,449,400	98.95	2,285,791,200	0.300	2024/12/20	0.70
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,150,000,000	105.41	2,266,444,000	104.76	2,252,361,500	1.500	2018/9/20	0.69

日本	国債証券	第353回利付国債（2年）	2,180,000,000	100.20	2,184,464,800	100.20	2,184,469,000	0.100	2017/6/15	0.67
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	2,080,000,000	104.70	2,177,760,000	103.84	2,159,955,200	0.800	2023/9/20	0.66
日本	国債証券	第113回利付国債（5年）	2,130,000,000	100.99	2,151,164,000	100.84	2,147,998,500	0.300	2018/6/20	0.66
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	104.39	2,140,056,500	103.68	2,125,624,500	1.500	2017/12/20	0.65
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	1,970,000,000	100.67	1,983,277,800	100.57	1,981,406,300	0.200	2018/9/20	0.60
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	1,900,000,000	102.84	1,954,074,000	102.07	1,939,482,000	1.700	2016/9/20	0.59
日本	国債証券	第99回利付国債（5年）	1,880,000,000	100.70	1,893,178,800	100.49	1,889,268,400	0.400	2016/9/20	0.58

(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	79.70
地方債証券	5.97
特殊債券	8.20
社債券	5.23
合計	99.10

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	11円		1,615,693,564	1,616,670,000	0.49

(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	122,055,716,473	56.84

	イギリス	17,585,710,007	8.19
	スイス	8,895,416,804	4.14
	カナダ	8,290,008,479	3.86
	フランス	8,157,715,939	3.80
	ドイツ	8,037,159,956	3.74
	オーストラリア	5,480,074,745	2.55
	オランダ	3,635,020,438	1.69
	アイルランド	3,620,869,509	1.69
	スペイン	3,173,906,233	1.48
	スウェーデン	2,648,369,987	1.23
	香港	2,080,807,973	0.97
	イタリア	1,959,283,226	0.91
	デンマーク	1,509,679,519	0.70
	シンガポール	1,361,457,421	0.63
	ジャージー	1,216,789,864	0.57
	ベルギー	1,176,483,745	0.55
	バミューダ	829,920,777	0.39
	フィンランド	752,539,042	0.35
	キュラソー	752,160,506	0.35
	ケイマン	574,402,365	0.27
	イスラエル	544,074,065	0.25
	ノルウェー	531,387,221	0.25
	ルクセンブルク	345,353,711	0.16
	オーストリア	164,422,595	0.08
	パナマ	139,706,462	0.07
	ポルトガル	127,574,293	0.06
	ニュージーランド	101,702,765	0.05
	リベリア	94,571,835	0.04
	英ヴァージン諸島	57,286,052	0.03
	マン島	24,169,124	0.01
	モーリシャス	17,926,238	0.01
	小計	205,941,667,369	95.90
投資信託受益証券	オーストラリア	111,595,466	0.05
	香港	23,448,150	0.01
	シンガポール	23,065,906	0.01
	小計	158,109,522	0.07

投資証券	アメリカ	3,486,861,423	1.62
	オーストラリア	485,248,082	0.23
	イギリス	307,314,621	0.14
	フランス	281,047,885	0.13
	シンガポール	90,843,239	0.04
	香港	89,087,180	0.04
	カナダ	30,581,298	0.01
	小計	4,770,983,728	2.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,873,236,663	1.80
合計(純資産総額)		214,743,997,282	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	2,134,211,662	0.99
	買建	カナダ	148,814,323	0.07
	買建	ドイツ	579,603,871	0.27
	買建	イギリス	329,580,108	0.15
	買建	オーストラリア	202,099,788	0.09

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

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		986,826,620	0.45
	売建		481,977,600	0.22

(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	326,034	14,562.97	4,748,026,133	15,248.69	4,971,594,167	2.32
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	234,550	11,204.17	2,627,939,246	10,141.30	2,378,644,026	1.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	436,381	5,193.10	2,266,172,135	5,433.10	2,370,904,448	1.10
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	273,922	6,667.40	1,826,348,227	6,864.54	1,880,350,443	0.88
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	155,774	12,379.69	1,928,434,609	11,960.91	1,863,199,729	0.87
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	562,472	3,002.47	1,688,807,556	3,262.06	1,834,821,912	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	208,418	7,088.63	1,477,398,192	8,228.64	1,714,996,692	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	180,877	9,395.65	1,699,457,346	9,117.94	1,649,227,080	0.77
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	129,084	12,146.24	1,567,885,760	12,205.75	1,575,567,291	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	151,248	10,482.94	1,585,524,389	9,590.28	1,450,511,274	0.68
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	343,653	4,061.66	1,395,803,878	4,113.09	1,413,477,608	0.66
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	39,387	33,152.56	1,305,780,196	34,832.01	1,371,928,614	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	232,267	6,040.45	1,402,999,174	5,726.98	1,330,189,973	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	289,808	4,269.83	1,237,431,327	4,380.03	1,269,369,618	0.59
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	90,139	12,492.34	1,126,047,846	13,842.97	1,247,791,698	0.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	104,954	13,421.74	1,408,665,773	11,839.69	1,242,622,877	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	589,521	2,019.20	1,190,361,098	2,068.18	1,219,235,837	0.57
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,077,962	1,194.86	1,288,017,987	1,112.18	1,198,895,452	0.56
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	112,438	9,118.85	1,025,305,425	10,506.21	1,181,297,240	0.55
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	83,238	11,936.42	993,564,228	14,137.46	1,176,774,291	0.55

アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	22,110	45,830.58	1,013,314,256	52,636.35	1,163,789,853	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	169,877	6,017.19	1,022,182,695	6,720.05	1,141,582,953	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	158,999	7,198.83	1,144,607,645	7,015.16	1,115,403,504	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	231,086	5,075.55	1,172,889,125	4,824.53	1,114,881,340	0.52
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	17,110	64,855.04	1,109,669,885	63,860.12	1,092,646,722	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	64,780	18,389.54	1,191,274,466	16,715.64	1,082,839,775	0.50
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,025	65,372.38	1,047,592,414	66,276.06	1,062,073,902	0.49
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	52,618	19,190.36	1,009,758,573	19,955.67	1,050,027,786	0.49
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	73,770	13,351.94	984,973,204	13,535.62	998,522,909	0.46
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	265,707	4,076.36	1,083,117,519	3,721.25	988,763,635	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	7.71
		素材	4.92
		資本財	7.02
		商業・専門サービス	0.88
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.81
		耐久消費財・アパレル	1.77
		消費者サービス	1.68
		メディア	3.27
		小売	3.52
		食品・生活必需品小売り	2.09
		食品・飲料・タバコ	5.88
		家庭用品・パーソナル用品	1.83
		ヘルスケア機器・サービス	3.67
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.16
		銀行	9.53
		各種金融	4.10
保険	4.18		
不動産	0.69		
ソフトウェア・サービス	7.14		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.35
		電気通信サービス	3.05
		公益事業	3.06
		半導体・半導体製造装置	1.75
		小計	95.90
投資信託受益証券			0.07
投資証券			2.22
合計			98.20

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	34	アメリカドル	17,758,353	2,174,510,324	17,429,250	2,134,211,662	0.99
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	9	カナダドル	1,536,016.5	151,466,587	1,509,120	148,814,323	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	15	スイスフラン	1,335,005	176,541,061	1,325,700	175,310,568	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	85	ユーロ	2,908,232.5	399,096,746	2,946,100	404,293,303	0.19
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	16	オーストラリアドル	2,216,512	208,196,972	2,151,600	202,099,788	0.09
	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	26	イギリスポンド	1,724,547.5	332,354,794	1,710,150	329,580,108	0.15

(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	5,862,000.00	720,531,247	717,567,420	0.33
	ユーロ	買建	1,120,000.00	155,666,224	153,675,200	0.07
	イギリスポンド	買建	600,000.00	114,329,580	115,584,000	0.05
	アメリカドル	売建	2,500,000.00	306,058,000	306,100,000	0.14
	カナダドル	売建	230,000.00	22,674,090	22,678,000	0.01

ユーロ	売建	500,000.00	68,601,850	68,610,000	0.03
イギリスポンド	売建	150,000.00	28,901,280	28,905,000	0.01
スイスフラン	売建	200,000.00	26,446,400	26,448,000	0.01
オーストラリアドル	売建	160,000.00	15,023,680	15,025,600	0.00
香港ドル	売建	900,000.00	14,207,580	14,211,000	0.00

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

外国債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	88,836,840,003	40.89
	イタリア	20,253,010,865	9.32
	フランス	20,192,625,537	9.29
	イギリス	18,218,450,127	8.39
	ドイツ	16,222,844,761	7.47
	スペイン	10,964,516,826	5.05
	ベルギー	5,404,565,238	2.49
	オランダ	5,397,511,886	2.48
	カナダ	4,883,278,121	2.25
	オーストラリア	3,721,000,570	1.71
	オーストリア	3,358,397,150	1.55
	メキシコ	2,250,748,878	1.04
	アイルランド	1,650,062,326	0.76
	デンマーク	1,465,585,716	0.67
	フィンランド	1,247,435,191	0.57
	ポーランド	1,208,392,338	0.56
	南アフリカ	1,114,430,695	0.51
	マレーシア	1,095,005,672	0.50
	スウェーデン	1,047,079,272	0.48
	シンガポール	804,102,915	0.37
スイス	695,353,836	0.32	
ノルウェー	627,967,811	0.29	
	小計	210,659,205,734	96.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,598,527,003	3.04
合計(純資産総額)		217,257,732,737	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	986,654,301	0.45
	買建	ドイツ	1,543,992,569	0.71

(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		3,810,410,600	1.75

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	9,800,000	13,519.48	1,324,909,476	13,380.53	1,311,292,183	3.625	2020/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	9,000,000	13,097.60	1,178,784,541	12,727.14	1,145,443,219	2.750	2024/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	9,000,000	12,250.02	1,102,502,017	12,271.54	1,104,439,211	0.625	2016/12/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/15/16	8,500,000	12,254.32	1,041,617,817	12,275.13	1,043,386,408	0.625	2016/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	7,950,000	13,095.45	1,041,088,558	12,741.01	1,012,910,940	2.750	2023/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	8,250,000	12,194.91	1,006,080,730	12,116.57	999,617,108	1.375	2020/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	7,750,000	12,905.00	1,000,137,926	12,797.22	991,784,615	2.625	2020/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,700,000	13,781.60	1,061,183,506	12,280.15	945,572,050	3.125	2044/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,950,000	12,127.33	964,122,994	11,852.05	942,238,763	1.750	2023/5/15	0.43
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000	15,677.49	932,811,148	15,349.44	913,292,273	4.250	2019/2/1	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 12/31/20	7,200,000	12,740.53	917,318,868	12,629.33	909,311,787	2.375	2020/12/31	0.42
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	4,350,000	22,131.08	962,702,071	20,410.42	887,853,433	5.500	2029/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	6,500,000	15,039.82	977,588,665	13,477.63	876,046,042	3.625	2044/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,000,000	18,143.17	907,158,915	17,402.89	870,144,553	4.250	2023/10/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	7,000,000	12,274.65	859,225,914	12,281.35	859,694,664	0.625	2016/7/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.5% 07/31/17	7,010,000	12,138.09	850,880,486	12,204.10	855,507,666	0.500	2017/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	7,300,000	13,105.25	956,683,916	11,682.73	852,839,614	2.875	2043/5/15	0.39

アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	12,701.07	850,972,251	12,324.87	825,766,927	2.375	2024/8/15	0.38
ドイツ	国債証券	DBR 3.75% 01/04/19	5,300,000	15,830.85	839,035,198	15,578.07	825,637,982	3.750	2019/1/4	0.38
イギリス	国債証券	JKT 3.75% 09/07/20	3,750,000	21,853.19	819,494,825	21,443.95	804,148,290	3.750	2020/9/7	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.625% 07/31/19	6,500,000	12,352.62	802,920,432	12,355.97	803,138,070	1.625	2019/7/31	0.37
フランス	国債証券	FRTR 5% 10/25/16	5,410,000	14,922.73	807,319,870	14,660.69	793,143,469	5.000	2016/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	12,386.34	805,112,338	12,120.87	787,856,931	2.000	2023/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	4,950,000	16,164.32	800,133,924	15,825.77	783,375,877	3.500	2020/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	5,900,000	13,333.65	786,685,764	13,227.94	780,448,947	3.375	2019/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 10/25/19	4,900,000	16,130.01	790,370,696	15,823.09	775,331,866	3.750	2019/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	4,700,000	16,740.89	786,821,997	16,314.45	766,779,212	3.750	2021/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	T 1% 10/31/16	6,200,000	12,337.79	764,943,240	12,336.35	764,854,270	1.000	2016/10/31	0.35
フランス	国債証券	FRTR 2.75% 10/25/27	4,850,000	16,847.72	817,114,765	15,668.99	759,946,016	2.750	2027/10/25	0.35
イギリス	国債証券	JKT 3.75% 09/07/21	3,500,000	22,170.41	775,964,435	21,659.31	758,076,165	3.750	2021/9/7	0.35

(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	96.96
合計	96.96

(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	35	アメリカ ドル	4,165,593.21	510,076,888	4,175,390.8	511,276,603	0.24
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	20	アメリカ ドル	2,516,720.63	308,172,441	2,524,062.6	309,071,465	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカ ドル	1,347,786	165,036,396	1,358,156.25	166,306,233	0.08
	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	2,224,560	305,276,369	2,225,300	305,377,919	0.14
	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	3,102,096	425,700,634	3,106,800	426,346,164	0.20
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	39	ユーロ	5,906,216	810,510,021	5,919,030	812,268,486	0.37

(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	14,140,000.00	1,738,234,152	1,730,877,400	0.79
	カナダドル	買建	1,140,000.00	114,605,539	112,358,400	0.05
	ユーロ	買建	11,880,000.00	1,660,330,956	1,630,054,800	0.75
	イギリスポンド	買建	1,750,000.00	341,680,890	337,120,000	0.15

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

Jリートマザーファンド(M)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	87,177,119,100	99.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		803,457,646	0.91
合計(純資産総額)		87,980,576,746	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,882	571,509.09	7,362,180,125	556,000	7,162,392,000	8.14
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	13,009	567,909.47	7,387,934,405	536,000	6,972,824,000	7.93
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	18,692	224,282.66	4,192,291,480	244,900	4,577,670,800	5.20
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	12,463	253,592.69	3,160,525,768	299,900	3,737,653,700	4.25
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,396	168,485.13	3,436,422,711	173,100	3,530,547,600	4.01

日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	19,333	144,441.59	2,792,489,296	176,400	3,410,341,200	3.88
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	14,582	241,124.62	3,516,079,254	225,400	3,286,782,800	3.74
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	13,359	188,332.52	2,515,934,234	237,700	3,175,434,300	3.61
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	2,935	956,768.25	2,808,114,825	1,037,000	3,043,595,000	3.46
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	32,274	62,639.96	2,021,642,349	81,500	2,630,331,000	2.99
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	16,351	131,248.79	2,146,048,965	155,600	2,544,215,600	2.89
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,446	561,959.3	2,498,471,087	548,000	2,436,408,000	2.77
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,232	369,377.09	2,301,958,063	380,500	2,371,276,000	2.70
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	14,946	154,178.98	2,304,359,035	158,400	2,367,446,400	2.69
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	3,755	564,100.43	2,118,197,143	586,000	2,200,430,000	2.50
日本	投資証券	プレミア投資法人	3,091	513,541.23	1,587,355,955	674,000	2,083,334,000	2.37
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,362	397,690.3	1,734,725,111	473,000	2,063,226,000	2.35
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,327	240,660.81	2,003,982,638	246,200	2,050,107,400	2.33
日本	投資証券	G L P 投資法人	16,989	114,806.88	1,950,454,114	116,900	1,986,014,100	2.26
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,771	465,790.25	1,756,495,036	516,000	1,945,836,000	2.21
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,476	454,782.09	1,580,822,546	553,000	1,922,228,000	2.18
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	3,370	521,753.41	1,758,309,017	555,000	1,870,350,000	2.13
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	6,426	242,132.93	1,555,946,254	277,700	1,784,500,200	2.03
日本	投資証券	イオンリート投資法人	9,934	143,630.44	1,426,824,790	163,500	1,624,209,000	1.85
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	10,624	141,105.66	1,499,106,531	141,400	1,502,233,600	1.71
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,296	174,520.78	1,447,824,390	174,400	1,446,822,400	1.64
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	3,764	272,257.77	1,024,778,263	362,500	1,364,450,000	1.55
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,195	312,428.12	998,207,862	374,500	1,196,527,500	1.36
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	2,554	343,578.81	877,500,288	465,500	1,188,887,000	1.35
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,231	200,842.56	849,764,881	263,800	1,116,137,800	1.27

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.09
合計	99.09

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	353,093,817	65.79
	オーストラリア	41,875,182	7.80
	イギリス	36,898,329	6.87
	フランス	25,327,248	4.72
	シンガポール	18,010,681	3.36
	カナダ	10,856,991	2.02
	香港	9,060,302	1.69
	オランダ	2,746,286	0.51
	ベルギー	2,508,880	0.47
	ニュージーランド	2,279,540	0.42
	スペイン	1,405,208	0.26
	アイルランド	1,277,526	0.24
	ドイツ	779,868	0.15
	イタリア	548,302	0.10
	マン島	470,555	0.09
	イスラエル	241,381	0.04
	小計	507,380,096	94.53

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29,336,356	5.47
合計(純資産総額)		536,716,452	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		5,229,650	0.97

(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	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	1,348	21,115.27	28,463,395	20,938.95	28,225,705	5.26
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	628	21,456.91	13,474,942	22,405.90	14,070,906	2.62
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	1,574	8,222.51	12,942,242	8,586.19	13,514,669	2.52
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	424	28,379.16	12,032,766	31,562.90	13,382,670	2.49
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	1,511	8,231.08	12,437,175	8,052.31	12,167,043	2.27
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	571	19,081.38	10,895,470	19,479.34	11,122,707	2.07
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1,431	8,040.06	11,505,336	7,638.43	10,930,595	2.04
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	2,216	5,063.30	11,220,289	4,550.24	10,083,336	1.88
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	662	14,865.42	9,840,914	14,795.63	9,794,709	1.82
アメリカ	投資証券	HCP INC	1,997	5,286.16	10,556,475	4,498.81	8,984,130	1.67
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	756	11,844.58	8,954,509	11,619.28	8,784,176	1.64
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	2,718	3,039.20	8,260,570	3,148.18	8,556,779	1.59
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	23,356	332.51	7,766,155	353.17	8,248,797	1.54
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,494	2,054.39	7,178,057	2,347.32	8,201,570	1.53
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	3,271	2,766.14	9,048,062	2,395.12	7,834,444	1.46
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	281	23,805.50	6,689,347	25,774.50	7,242,635	1.35
香港	投資証券	LINK REIT	10,000	740.55	7,405,510	718.44	7,184,450	1.34
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	8,386	721.38	6,049,513	850.06	7,128,658	1.33

イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	4,455	1,385.65	6,173,101	1,547.54	6,894,298	1.28
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	424	13,375.21	5,671,091	13,473.17	5,712,626	1.06
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	607	8,096.39	4,914,511	9,183.74	5,574,536	1.04
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	977	5,464.94	5,339,250	5,433.10	5,308,145	0.99
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	1,810	2,849.41	5,157,435	2,775.94	5,024,454	0.94
フランス	投資証券	KLEPIERRE	898	5,201.01	4,670,514	5,426.76	4,873,231	0.91
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	594	8,249.45	4,900,177	8,068.23	4,792,529	0.89
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	301	15,334.41	4,615,658	15,654.00	4,711,856	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	1,135	3,693.09	4,191,660	3,939.21	4,471,011	0.83
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	3,440	1,156.32	3,977,741	1,194.86	4,110,332	0.77
オーストラリア	投資証券	FEDERATION CENTRES	14,904	252.67	3,765,794	271.45	4,045,806	0.75
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	6,845	515.67	3,529,800	589.88	4,037,731	0.75

(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、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	94.53
合計	94.53

(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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	20,000.00	2,458,770	2,448,800	0.45
	ユーロ	売建	10,000.00	1,372,037	1,372,200	0.25
	オーストラリアドル	売建	15,000.00	1,408,470	1,408,650	0.26

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2007年8月31日
作成基準日：2015年6月30日

基準価額・純資産の推移



基準価額	10,506円
純資産総額	6.84億円

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

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:1,450円 直近1年間分配金合計額:120円

決算期	2015年2月	2015年3月	2015年4月	2015年5月	2015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	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	17.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
外国株式マザーファンド	17.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	-	-	0.4%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.2%
リートマザーファンド(A)	16.7%	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.4%
		日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.3%
外国債券マザーファンド	16.3%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	3.625%	2020/02/15	0.1%
		T 2.75% 02/15/24	アメリカ	国債	-	2.750%	2024/02/15	0.1%
日本債券マザーファンド	16.0%	第105回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.200%	2017/09/20	0.3%
		第123回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2020/03/20	0.2%
海外リートマザーファンド	15.8%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。
※2007年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2015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、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。

< お問い合わせ先 >

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、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す。

<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つき、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1万口当たりには換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

イ．国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

ハ．公社債等

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

1．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

2．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

3．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成19年 8月31日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎月11日から翌月10日までとします。

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

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、

ファンドを繰上償還させます。

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社が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て）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの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16特定期間(平成26年12月11日から平成27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15特定期間 （平成26年12月10日現在）	第16特定期間 （平成27年 6月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,572,105	3,508,501
親投資信託受益証券	826,356,702	699,324,632
未収入金	8,410,600	1,200,000
未収利息	1	5
流動資産合計	836,339,408	704,033,138
資産合計	836,339,408	704,033,138
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	806,015	660,373
未払解約金	3,444,001	-
未払受託者報酬	30,094	25,425
未払委託者報酬	677,082	572,077
その他未払費用	3,752	3,170
流動負債合計	4,960,944	1,261,045
負債合計	4,960,944	1,261,045
純資産の部		
元本等		
元本	806,015,183	660,373,314
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,363,281	42,398,779
（分配準備積立金）	28,521,694	47,400,624
元本等合計	831,378,464	702,772,093
純資産合計	831,378,464	702,772,093
負債純資産合計	836,339,408	704,033,138

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日	第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日
営業収益		
受取利息	842	928
有価証券売買等損益	123,547,550	32,472,063
営業収益合計	123,548,392	32,472,991
営業費用		
受託者報酬	189,460	164,949
委託者報酬	4,262,698	3,711,205
その他費用	23,620	20,557
営業費用合計	4,475,778	3,896,711
営業利益又は営業損失（ ）	119,072,614	28,576,280
経常利益又は経常損失（ ）	119,072,614	28,576,280
当期純利益又は当期純損失（ ）	119,072,614	28,576,280
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（ ）	4,175,844	864,797
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	100,762,477	25,363,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,714,055	19,949
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,714,055	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	19,949
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,477	6,389,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,389,572
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,477	-
分配金	5,477,590	4,306,362
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,363,281	42,398,779

（ 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15特定期間 (平成26年12月10日現在)	第16特定期間 (平成27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	806,015,183口	660,373,314口
2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0315円 (10,315円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0642円 (10,642円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日	第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日																																																												
分配金の計算過程 第82期 自 平成26年 6月11日 至 平成26年 7月10日	分配金の計算過程 第88期 自 平成26年12月11日 至 平成27年 1月13日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,863,352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>16,348,230円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>21,888,662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>40,100,244円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,003,456,535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>399円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>1,003,456円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,863,352円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	16,348,230円	分配準備積立金額	D	21,888,662円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	40,100,244円	当ファンドの期末残存口数	F	1,003,456,535口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	399円	1万口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,003,456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>1,741,690円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>2,706,596円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>12,749,539円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>27,631,751円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>44,829,576円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>781,334,601口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>573円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>781,334円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,741,690円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,706,596円	収益調整金額	C	12,749,539円	分配準備積立金額	D	27,631,751円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,829,576円	当ファンドの期末残存口数	F	781,334,601口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	573円	1万口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	781,334円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,863,352円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	16,348,230円																																																											
分配準備積立金額	D	21,888,662円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	40,100,244円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,003,456,535口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	399円																																																											
1万口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,003,456円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,741,690円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,706,596円																																																											
収益調整金額	C	12,749,539円																																																											
分配準備積立金額	D	27,631,751円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,829,576円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	781,334,601口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	573円																																																											
1万口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	781,334円																																																											
第83期 自 平成26年 7月11日 至 平成26年 8月11日	第89期 自 平成27年 1月14日 至 平成27年 2月10日																																																												

第15特定期間

自 平成26年 6月11日

至 平成26年12月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	557,078円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	15,644,172円
分配準備積立金額	D	21,768,862円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	37,970,112円
当ファンドの期末残存口数	F	960,242,476口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	395円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	960,242円

第84期

自 平成26年 8月12日

至 平成26年 9月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,767,631円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	15,095,332円
分配準備積立金額	D	20,615,581円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	37,478,544円
当ファンドの期末残存口数	F	926,540,429口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	404円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	926,540円

第85期

自 平成26年 9月11日

至 平成26年10月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,774,434円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	14,740,417円
分配準備積立金額	D	20,945,607円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	37,460,458円
当ファンドの期末残存口数	F	904,583,588口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	414円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	904,583円

第86期

自 平成26年10月11日

第16特定期間

自 平成26年12月11日

至 平成27年 6月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	418,598円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	12,211,196円
分配準備積立金額	D	29,977,131円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	42,606,925円
当ファンドの期末残存口数	F	748,342,951口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	569円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	748,342円

第90期

自 平成27年 2月11日

至 平成27年 3月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,465,424円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	6,011,762円
収益調整金額	C	11,900,837円
分配準備積立金額	D	28,893,874円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	48,271,897円
当ファンドの期末残存口数	F	729,323,348口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	661円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	729,323円

第91期

自 平成27年 3月11日

至 平成27年 4月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,346,649円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,069,293円
収益調整金額	C	11,458,103円
分配準備積立金額	D	34,313,986円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,188,031円
当ファンドの期末残存口数	F	702,162,794口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	885円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	702,162円

第92期

自 平成27年 4月11日

第15特定期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日			第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日		
至 平成26年11月10日			至 平成27年 5月11日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,149,074円	費用控除後の配当等収益額	A	627,783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	14,286,935円	収益調整金額	C	11,175,244円
分配準備積立金額	D	21,144,315円	分配準備積立金額	D	48,792,756円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	36,580,324円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,595,783円
当ファンドの期末残存口数	F	876,754,971口	当ファンドの期末残存口数	F	684,828,866口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	417円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	884円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	876,754円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	684,828円
第87期 自 平成26年11月11日 至 平成26年12月10日			第93期 自 平成27年 5月12日 至 平成27年 6月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,300,886円	費用控除後の配当等収益額	A	1,065,653円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	8,338,193円	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	13,134,192円	収益調整金額	C	10,776,171円
分配準備積立金額	D	19,688,630円	分配準備積立金額	D	46,995,344円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	42,461,901円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	58,837,168円
当ファンドの期末残存口数	F	806,015,183口	当ファンドの期末残存口数	F	660,373,314口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	526円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	890円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	806,015円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	660,373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16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27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。

	第16特定期間 自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第16特定期間 (平成27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15特定期間	第16特定期間
	自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日	自 平成26年12月11日 至 平成27年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,055,214,767円	806,015,183円
期中追加設定元本額	124,890円	479,267円
期中一部解約元本額	249,324,474円	146,121,136円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15特定期間 （平成26年12月10日現在）	第16特定期間 （平成27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	39,417,334	4,124,176
合計	39,417,334	4,124,176

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	77,041,132	122,441,471	
	日本債券マザーファンド	85,834,521	110,237,275	
	外国株式マザーファンド	53,191,077	122,451,178	

外国債券マザーファンド	46,212,455	114,565,297	
Jリートマザーファンド(M)	49,256,153	117,313,379	
海外リートマザーファンド	95,013,986	112,316,032	
合計	406,549,324	699,324,632	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)」は、「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド(M)」、「海外リートマザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。
各マザーファンドの平成27年6月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

項目	平成27年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,427,643,137
株式	241,220,667,440
派生商品評価勘定	12,035,000
未収入金	5,746,000
未収配当金	1,734,267,119
未収利息	3,600
前払金	52,244,000
差入委託証拠金	40,226,000
流動資産合計	245,492,832,296
資産合計	245,492,832,296
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	64,279,000
未払解約金	473,115,452
流動負債合計	537,394,452
負債合計	537,394,452
純資産の部	
元本等	
元本	154,128,092,512

	平成27年 6月10日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	90,827,345,332
元本等合計	244,955,437,844
純資産合計	244,955,437,844
負債純資産合計	245,492,832,296

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 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27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	154,128,092,512口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 5,822,000,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5893円 (1万口当たり純資産額) (15,893円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	平成27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27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27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27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26年12月11日
期首元本額	184,209,623,849円
期中追加設定元本額	5,154,235,669円
期中一部解約元本額	35,235,767,006円
期末元本額	154,128,092,512円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	1,140,722,281円
D C 日本株式インデックスファンド	349,213,902円
D C 日本株式インデックスファンド L	48,457,767,694円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,322,180,196円
D C バランスファンド 3 0	1,369,068,860円
D C バランスファンド 5 0	2,187,482,282円
D C バランスファンド 7 0	1,222,878,848円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	77,041,132円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	42,547,506円
新生・4分散ファンド	87,724,796円

区分	平成27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	675,129,504円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	17,106,007円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	66,489,897円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	24,652,493円
日本株式インデックスe	2,003,913,665円
インデックスコレクション(国内株式)	6,194,928,912円
インデックスコレクション(バランス株式30)	941,469,633円
インデックスコレクション(バランス株式50)	995,861,507円
インデックスコレクション(バランス株式70)	976,996,516円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	7,876,520,412円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	5,932,679,529円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	965,742,337円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	8,892,328,074円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	2,397,338,744円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,321,004,332円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	555,306,222円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,663,877,955円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,957,849,633円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,160,660,608円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	20,071,675,914円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	1,513,491,870円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	5,399,699,294円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,727,342,732円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	83,529,937円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,009,665,535円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	181,348,767円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	4,499,753,040円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	138,045,429円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	121,522,751円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	70,140,066円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,668,782,819円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	1,719,896,732円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	49,154,705円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	751,699,336円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	11,606,785,484円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	241,028,753円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	89,775,669円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	22,990,933円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	277,996,576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)	6,644,737円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	637,956円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		35,298,200,834
合計		35,298,200,834

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 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	3,579,524,000	-	3,527,280,000	52,244,000
	合計	3,579,524,000	-	3,527,280,000	52,244,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	48,000	286.00	13,728,000	
日本水産	139,400	351.00	48,929,400	
マルハニチロ	22,500	1,954.00	43,965,000	
サカタのタネ	18,300	2,233.00	40,863,900	
ホクト	12,600	2,436.00	30,693,600	
住石ホールディングス	31,500	125.00	3,937,500	
日鉄鉱業	32,000	590.00	18,880,000	
三井松島産業	74,000	137.00	10,138,000	
国際石油開発帝石	597,500	1,530.50	914,473,750	
日本海洋掘削	3,400	3,865.00	13,141,000	

石油資源開発	16,200	3,930.00	63,666,000
K&Oエナジーグループ	7,500	1,586.00	11,895,000
ショーボンドホールディングス	11,000	5,200.00	57,200,000
ミライト・ホールディングス	34,900	1,419.00	49,523,100
タマホーム	8,500	561.00	4,768,500
サンヨーホームズ	1,200	633.00	759,600
ダイセキ環境ソリューション	1,300	1,972.00	2,563,600
安藤・間	76,100	682.00	51,900,200
東急建設	40,800	836.00	34,108,800
コムシスホールディングス	50,500	1,878.00	94,839,000
ミサワホーム	14,000	1,115.00	15,610,000
高松コンストラクショングループ	8,700	2,704.00	23,524,800
東建コーポレーション	4,300	6,730.00	28,939,000
ヤマウラ	6,100	496.00	3,025,600
大成建設	589,000	689.00	405,821,000
大林組	340,000	842.00	286,280,000
清水建設	347,000	988.00	342,836,000
飛島建設	77,200	227.00	17,524,400
長谷工コーポレーション	142,100	1,398.00	198,655,800
松井建設	13,000	659.00	8,567,000
銭高組	16,000	372.00	5,952,000
鹿島建設	499,000	550.00	274,450,000
不動テトラ	87,300	205.00	17,896,500
大末建設	4,300	819.00	3,521,700
鉄建建設	70,000	397.00	27,790,000
日鉄住金テックスエンジ	22,000	698.00	15,356,000
西松建設	123,000	481.00	59,163,000
三井住友建設	460,200	166.00	76,393,200
大豊建設	32,000	612.00	19,584,000
前田建設工業	76,000	887.00	67,412,000
佐田建設	42,000	136.00	5,712,000
ナカノフドー建設	9,500	509.00	4,835,500
奥村組	108,000	585.00	63,180,000
大和小田急建設	6,500	1,137.00	7,390,500
東鉄工業	13,600	2,650.00	36,040,000
イチケン	15,000	290.00	4,350,000
浅沼組	36,000	187.00	6,732,000
戸田建設	143,000	505.00	72,215,000
熊谷組	143,000	366.00	52,338,000
青木あすなろ建設	7,500	839.00	6,292,500
北野建設	25,000	319.00	7,975,000
植木組	16,000	246.00	3,936,000

三井ホーム	15,000	542.00	8,130,000
矢作建設工業	14,000	855.00	11,970,000
ピーエス三菱	12,900	422.00	5,443,800
日本ハウスホールディングス	14,500	560.00	8,120,000
大東建託	42,400	12,400.00	525,760,000
新日本建設	13,500	585.00	7,897,500
N I P P O	26,000	2,053.00	53,378,000
東亜道路工業	21,000	476.00	9,996,000
前田道路	36,000	2,334.00	84,024,000
日本道路	34,000	631.00	21,454,000
東亜建設工業	85,000	213.00	18,105,000
若築建設	65,000	180.00	11,700,000
東洋建設	34,000	484.00	16,456,000
五洋建設	125,900	512.00	64,460,800
大林道路	13,000	692.00	8,996,000
世紀東急工業	16,500	550.00	9,075,000
福田組	17,000	797.00	13,549,000
住友林業	83,700	1,536.00	128,563,200
日本基礎技術	13,600	419.00	5,698,400
日成ビルド工業	32,000	384.00	12,288,000
巴コーポレーション	15,100	415.00	6,266,500
パナホーム	42,000	900.00	37,800,000
大和ハウス工業	332,200	2,874.00	954,742,800
ライト工業	18,200	1,044.00	19,000,800
積水ハウス	356,500	1,968.00	701,592,000
日特建設	15,200	502.00	7,630,400
北陸電気工事	6,000	1,144.00	6,864,000
ユアテック	18,000	895.00	16,110,000
西部電気工業	9,000	456.00	4,104,000
四電工	10,000	457.00	4,570,000
中電工	16,400	2,413.00	39,573,200
関電工	52,000	775.00	40,300,000
きんでん	75,000	1,682.00	126,150,000
東京エネシス	13,000	1,200.00	15,600,000
トーエネック	16,000	673.00	10,768,000
住友電設	9,000	1,592.00	14,328,000
日本電設工業	18,500	2,134.00	39,479,000
協和エクシオ	48,100	1,483.00	71,332,300
新日本空調	9,800	1,125.00	11,025,000
N D S	19,000	306.00	5,814,000
九電工	21,000	1,891.00	39,711,000
三機工業	23,300	990.00	23,067,000

日揮	114,000	2,425.50	276,507,000
中外炉工業	35,000	280.00	9,800,000
ヤマト	11,000	402.00	4,422,000
太平電業	15,000	1,121.00	16,815,000
高砂熱学工業	31,300	1,499.00	46,918,700
三晃金属工業	13,000	247.00	3,211,000
朝日工業社	13,000	442.00	5,746,000
明星工業	18,700	647.00	12,098,900
大気社	16,200	3,115.00	50,463,000
ダイダン	16,000	893.00	14,288,000
日比谷総合設備	14,600	1,667.00	24,338,200
東芝プラントシステム	18,400	1,524.00	28,041,600
O S J Bホールディングス	15,400	270.00	4,158,000
東洋エンジニアリング	56,000	308.00	17,248,000
千代田化工建設	82,000	1,107.00	90,774,000
新興プランテック	23,300	1,043.00	24,301,900
日本製粉	70,000	700.00	49,000,000
日清製粉グループ本社	124,400	1,585.00	197,174,000
日東富士製粉	9,000	341.00	3,069,000
昭和産業	47,000	493.00	23,171,000
鳥越製粉	9,100	710.00	6,461,000
中部飼料	10,900	920.00	10,028,000
フィード・ワンホールディングス	68,600	133.00	9,123,800
東洋精糖	18,000	104.00	1,872,000
日本甜菜製糖	58,000	197.00	11,426,000
三井製糖	45,000	474.00	21,330,000
塩水港精糖	12,300	264.00	3,247,200
森永製菓	102,000	456.00	46,512,000
中村屋	26,000	463.00	12,038,000
江崎グリコ	26,200	5,600.00	146,720,000
名糖産業	5,100	1,276.00	6,507,600
不二家	65,000	195.00	12,675,000
山崎製パン	83,000	1,967.00	163,261,000
第一屋製パン	15,000	122.00	1,830,000
モロゾフ	17,000	397.00	6,749,000
亀田製菓	6,300	4,510.00	28,413,000
寿スピリッツ	2,700	2,760.00	7,452,000
カルビー	42,000	4,895.00	205,590,000
森永乳業	102,000	431.00	43,962,000
六甲バター	5,100	1,280.00	6,528,000
ヤクルト本社	60,800	6,680.00	406,144,000
明治ホールディングス	33,600	14,780.00	496,608,000

雪印メグミルク	26,700	1,562.00	41,705,400
プリマハム	65,000	357.00	23,205,000
日本ハム	83,000	2,662.00	220,946,000
伊藤ハム	62,000	640.00	39,680,000
丸大食品	58,000	445.00	25,810,000
米久	3,700	1,913.00	7,078,100
S Foods	7,100	2,351.00	16,692,100
サッポロホールディングス	186,000	465.00	86,490,000
アサヒグループホールディングス	228,000	4,055.50	924,654,000
キリンホールディングス	459,700	1,748.50	803,785,450
宝ホールディングス	89,000	959.00	85,351,000
オエノンホールディングス	29,000	220.00	6,380,000
養命酒製造	7,000	1,020.00	7,140,000
コカ・コーラウエスト	38,400	2,166.00	83,174,400
コカ・コーライーストジャパン	34,500	2,236.00	77,142,000
サントリー食品インターナショナル	68,000	5,040.00	342,720,000
ダイドードリンコ	5,700	5,410.00	30,837,000
伊藤園	33,700	2,648.00	89,237,600
キーコーヒー	10,000	1,979.00	19,790,000
ユニカフェ	3,100	902.00	2,796,200
ジャパンフーズ	1,500	1,116.00	1,674,000
日清オイリオグループ	55,000	500.00	27,500,000
不二製油	30,300	1,887.00	57,176,100
かどや製油	1,100	2,700.00	2,970,000
J - オイルミルズ	48,000	424.00	20,352,000
キッコーマン	93,000	3,480.00	323,640,000
味の素	262,000	2,495.00	653,690,000
キューピー	57,700	2,608.00	150,481,600
ハウス食品グループ本社	42,000	2,289.00	96,138,000
カゴメ	43,900	1,965.00	86,263,500
焼津水産化学工業	5,400	1,010.00	5,454,000
アリアケジャパン	10,300	4,445.00	45,783,500
エバラ食品工業	1,900	2,019.00	3,836,100
ニチレイ	121,000	696.00	84,216,000
東洋水産	59,300	4,040.00	239,572,000
イトアンド	1,200	1,960.00	2,352,000
日清食品ホールディングス	48,000	5,200.00	249,600,000
永谷園	11,000	1,112.00	12,232,000
一正蒲鉾	4,000	1,167.00	4,668,000
フジッコ	11,000	2,075.00	22,825,000
ロック・フィールド	5,900	2,566.00	15,139,400
日本たばこ産業	628,600	4,324.00	2,718,066,400

ケンコーマヨネーズ	3,700	1,643.00	6,079,100
わらべや日洋	6,700	2,733.00	18,311,100
なとり	5,200	1,491.00	7,753,200
ユーグレナ	38,000	1,795.00	68,210,000
ミヨシ油脂	39,000	144.00	5,616,000
理研ビタミン	3,400	3,945.00	13,413,000
片倉工業	13,400	1,367.00	18,317,800
ゲンゼ	86,000	327.00	28,122,000
東洋紡	420,000	208.00	87,360,000
ユニチカ	309,000	60.00	18,540,000
富士紡ホールディングス	52,000	294.00	15,288,000
日清紡ホールディングス	67,000	1,422.00	95,274,000
倉敷紡績	109,000	264.00	28,776,000
シキボウ	61,000	133.00	8,113,000
日本毛織	33,000	924.00	30,492,000
トーア紡コーポレーション	48,000	77.00	3,696,000
ダイドーリミテッド	12,300	512.00	6,297,600
帝国繊維	11,100	1,725.00	19,147,500
帝人	433,000	457.00	197,881,000
東レ	820,000	983.20	806,224,000
サカイオーベックス	28,000	214.00	5,992,000
住江織物	28,000	336.00	9,408,000
日本フェルト	6,000	529.00	3,174,000
イチカワ	7,000	359.00	2,513,000
日本バイリーン	14,000	888.00	12,432,000
芦森工業	27,000	202.00	5,454,000
アツギ	91,000	116.00	10,556,000
ダイニック	20,000	183.00	3,660,000
セーレン	26,400	1,325.00	34,980,000
東海染工	15,000	138.00	2,070,000
小松精練	18,600	562.00	10,453,200
ワコールホールディングス	63,000	1,451.00	91,413,000
ホギメディカル	6,700	6,280.00	42,076,000
レナウン	25,500	201.00	5,125,500
クラウディア	3,600	626.00	2,253,600
T S Iホールディングス	48,000	870.00	41,760,000
三陽商会	57,000	347.00	19,779,000
オンワードホールディングス	77,000	832.00	64,064,000
ルック	21,000	220.00	4,620,000
ゴールドウイン	25,000	896.00	22,400,000
デサント	24,600	1,746.00	42,951,600
キング	5,500	432.00	2,376,000

ヤマトインターナショナル	7,100	427.00	3,031,700
特種東海製紙	62,000	286.00	17,732,000
王子ホールディングス	435,000	542.00	235,770,000
日本製紙	51,200	2,115.00	108,288,000
三菱製紙	162,000	98.00	15,876,000
北越紀州製紙	65,800	687.00	45,204,600
中越パルプ工業	40,000	248.00	9,920,000
巴川製紙所	16,000	248.00	3,968,000
大王製紙	47,000	1,409.00	66,223,000
レンゴー	94,000	541.00	50,854,000
トーモク	33,000	298.00	9,834,000
ザ・パック	7,500	2,513.00	18,847,500
クラレ	180,500	1,565.00	282,482,500
旭化成	661,000	1,043.00	689,423,000
共和レザー	6,900	994.00	6,858,600
コープケミカル	16,000	90.00	1,440,000
昭和電工	706,000	167.00	117,902,000
住友化学	781,000	758.00	591,998,000
日本化成	20,000	156.00	3,120,000
住友精化	22,000	816.00	17,952,000
日産化学工業	69,500	2,586.00	179,727,000
ラサ工業	40,000	147.00	5,880,000
クレハ	74,000	505.00	37,370,000
多木化学	7,000	717.00	5,019,000
テイカ	18,000	504.00	9,072,000
石原産業	178,000	135.00	24,030,000
片倉チッカリン	7,000	288.00	2,016,000
日本曹達	68,000	745.00	50,660,000
東ソー	265,000	760.00	201,400,000
トクヤマ	165,000	268.00	44,220,000
セントラル硝子	108,000	550.00	59,400,000
東亜合成	133,000	534.00	71,022,000
ダイソー	42,000	425.00	17,850,000
関東電化工業	25,000	851.00	21,275,000
電気化学工業	220,000	567.00	124,740,000
信越化学工業	190,100	7,310.00	1,389,631,000
日本カーバイド工業	36,000	233.00	8,388,000
堺化学工業	43,000	432.00	18,576,000
エア・ウォーター	94,000	2,195.00	206,330,000
大陽日酸	136,100	1,430.00	194,623,000
日本化学工業	39,000	255.00	9,945,000
日本パーカライジング	50,000	1,300.00	65,000,000

高压ガス工業	16,000	630.00	10,080,000
チタン工業	12,000	240.00	2,880,000
四国化成工業	15,000	1,033.00	15,495,000
戸田工業	21,000	359.00	7,539,000
ステラ ケミファ	5,400	1,348.00	7,279,200
保土谷化学工業	32,000	201.00	6,432,000
日本触媒	83,000	1,734.00	143,922,000
大日精化工業	44,000	647.00	28,468,000
カネカ	143,000	886.00	126,698,000
三菱瓦斯化学	182,000	746.00	135,772,000
三井化学	482,000	423.00	203,886,000
J S R	104,700	2,165.00	226,675,500
東京応化工業	22,000	3,625.00	79,750,000
大阪有機化学工業	7,600	532.00	4,043,200
三菱ケミカルホールディングス	662,800	729.20	483,313,760
日本合成化学工業	25,000	872.00	21,800,000
ダイセル	149,100	1,551.00	231,254,100
住友ベークライト	99,000	575.00	56,925,000
積水化学工業	245,000	1,558.00	381,710,000
日本ゼオン	91,000	1,118.00	101,738,000
アイカ工業	31,900	2,651.00	84,566,900
宇部興産	534,000	223.00	119,082,000
積水樹脂	16,400	1,591.00	26,092,400
タキロン	22,000	544.00	11,968,000
旭有機材工業	37,000	268.00	9,916,000
日立化成	52,400	2,439.00	127,803,600
ニチバン	10,000	528.00	5,280,000
リケンテクノス	17,100	492.00	8,413,200
大倉工業	25,000	357.00	8,925,000
積水化成品工業	30,000	469.00	14,070,000
群栄化学工業	28,000	337.00	9,436,000
タイガースポリマー	5,200	872.00	4,534,400
ミライアル	3,800	1,452.00	5,517,600
ダイキアクシス	1,300	1,050.00	1,365,000
ダイキョーニシカワ	2,700	4,145.00	11,191,500
日本化薬	69,000	1,370.00	94,530,000
カーリットホールディングス	8,700	628.00	5,463,600
日本精化	8,800	952.00	8,377,600
A D E K A	48,900	1,685.00	82,396,500
日油	87,000	962.00	83,694,000
ハリマ化成グループ	9,400	484.00	4,549,600
花王	285,100	5,712.00	1,628,491,200

第一工業製薬	24,000	377.00	9,048,000
ニイタカ	1,600	1,569.00	2,510,400
三洋化成工業	33,000	892.00	29,436,000
大日本塗料	61,000	187.00	11,407,000
日本ペイントホールディングス	91,800	3,545.00	325,431,000
関西ペイント	129,000	2,034.00	262,386,000
神東塗料	8,000	227.00	1,816,000
中国塗料	30,000	953.00	28,590,000
日本特殊塗料	8,200	928.00	7,609,600
藤倉化成	14,400	599.00	8,625,600
太陽ホールディングス	8,600	5,070.00	43,602,000
D I C	425,000	335.00	142,375,000
サカタインクス	21,600	1,235.00	26,676,000
東洋インキＳＣホールディングス	105,000	524.00	55,020,000
T & K T O K A	3,500	2,300.00	8,050,000
富士フィルムホールディングス	242,600	4,593.50	1,114,383,100
資生堂	188,600	2,608.50	491,963,100
ライオン	122,000	909.00	110,898,000
高砂香料工業	35,000	576.00	20,160,000
マンダム	10,600	4,785.00	50,721,000
ミルボン	6,200	3,935.00	24,397,000
ファンケル	24,600	1,447.00	35,596,200
コーセー	17,100	8,370.00	143,127,000
コタ	3,600	1,400.00	5,040,000
ドクターシーラボ	7,200	4,280.00	30,816,000
シーボン	1,200	2,701.00	3,241,200
ポーラ・オルビスホールディングス	12,600	6,510.00	82,026,000
ノエビアホールディングス	6,700	2,467.00	16,528,900
アジュバンコスメジャパン	2,000	906.00	1,812,000
エステー	7,300	1,075.00	7,847,500
アグロ カネショウ	2,800	913.00	2,556,400
コニシ	8,300	2,406.00	19,969,800
長谷川香料	13,400	1,747.00	23,409,800
星光P M C	5,800	1,060.00	6,148,000
小林製薬	17,400	8,000.00	139,200,000
荒川化学工業	8,900	1,470.00	13,083,000
メック	8,300	933.00	7,743,900
日本高純度化学	3,000	2,508.00	7,524,000
J C U	2,900	5,130.00	14,877,000
新田ゼラチン	6,600	764.00	5,042,400
アース製薬	7,600	4,590.00	34,884,000
イハラケミカル工業	16,300	1,646.00	26,829,800

北興化学工業	11,000	491.00	5,401,000
大成ラミック	3,000	2,871.00	8,613,000
クミアイ化学工業	21,900	970.00	21,243,000
日本農薬	24,200	1,133.00	27,418,600
アキレス	90,000	159.00	14,310,000
有沢製作所	17,900	1,033.00	18,490,700
日東電工	81,900	9,360.00	766,584,000
レック	3,700	1,327.00	4,909,900
きもと	18,900	287.00	5,424,300
藤森工業	9,100	3,790.00	34,489,000
前澤化成工業	7,400	1,226.00	9,072,400
J S P	7,900	2,024.00	15,989,600
エフピコ	9,400	4,580.00	43,052,000
天馬	8,200	2,089.00	17,129,800
信越ポリマー	20,800	584.00	12,147,200
東リ	28,000	337.00	9,436,000
ニフコ	23,700	5,030.00	119,211,000
日本バルカー工業	44,000	339.00	14,916,000
ユニ・チャーム	214,700	2,896.50	621,878,550
協和発酵キリン	127,000	1,647.00	209,169,000
武田薬品工業	397,300	6,040.00	2,399,692,000
アステラス製薬	1,207,500	1,763.50	2,129,426,250
大日本住友製薬	75,000	1,331.00	99,825,000
塩野義製薬	165,600	4,260.00	705,456,000
田辺三菱製薬	123,500	1,876.00	231,686,000
わかもと製薬	12,000	288.00	3,456,000
あすか製薬	12,500	1,249.00	15,612,500
日本新薬	24,000	3,640.00	87,360,000
バイオフェルミン製薬	1,700	2,876.00	4,889,200
中外製薬	105,600	3,760.00	397,056,000
科研製薬	37,000	3,945.00	145,965,000
エーザイ	139,800	7,715.00	1,078,557,000
ロート製薬	48,200	1,801.00	86,808,200
小野薬品工業	48,200	12,940.00	623,708,000
久光製薬	29,900	4,730.00	141,427,000
有機合成薬品工業	7,000	282.00	1,974,000
持田製薬	7,300	6,890.00	50,297,000
参天製薬	194,800	1,689.00	329,017,200
扶桑薬品工業	36,000	296.00	10,656,000
日本ケミファ	13,000	626.00	8,138,000
ツムラ	33,400	2,592.00	86,572,800
日医工	24,800	2,897.00	71,845,600

キッセイ薬品工業	19,700	3,175.00	62,547,500
生化学工業	20,300	1,930.00	39,179,000
栄研化学	8,900	2,569.00	22,864,100
日水製薬	4,300	1,404.00	6,037,200
鳥居薬品	7,200	3,290.00	23,688,000
JCRファーマ	8,200	2,925.00	23,985,000
東和薬品	5,400	6,850.00	36,990,000
富士製薬工業	2,900	2,220.00	6,438,000
沢井製薬	16,800	6,970.00	117,096,000
ゼリア新薬工業	21,700	1,806.00	39,190,200
第一三共	356,600	2,320.00	827,312,000
キョーリン製薬ホールディングス	28,300	2,521.00	71,344,300
大幸薬品	4,700	1,790.00	8,413,000
ダイト	4,700	2,506.00	11,778,200
大塚ホールディングス	210,400	3,858.00	811,723,200
大正製薬ホールディングス	25,500	8,230.00	209,865,000
日本コークス工業	95,000	118.00	11,210,000
昭和シェル石油	94,800	1,176.00	111,484,800
コスモ石油	293,000	213.00	62,409,000
ニチレキ	13,000	1,070.00	13,910,000
東燃ゼネラル石油	160,000	1,209.00	193,440,000
ユシロ化学工業	5,700	1,555.00	8,863,500
ピーピー・カストロール	4,300	1,379.00	5,929,700
富士石油	24,600	497.00	12,226,200
MORESCO	2,700	2,231.00	6,023,700
出光興産	50,300	2,522.00	126,856,600
JXホールディングス	1,176,600	558.10	656,660,460
横浜ゴム	117,000	1,334.00	156,078,000
東洋ゴム工業	48,000	2,723.00	130,704,000
ブリヂストン	332,200	4,703.50	1,562,502,700
住友ゴム工業	82,700	2,035.00	168,294,500
藤倉ゴム工業	8,800	734.00	6,459,200
オカモト	36,000	457.00	16,452,000
フコク	4,400	1,247.00	5,486,800
ニッタ	10,500	3,330.00	34,965,000
住友理工	19,600	1,060.00	20,776,000
三ツ星ベルト	26,000	987.00	25,662,000
バンドー化学	39,000	519.00	20,241,000
日東紡績	78,000	519.00	40,482,000
旭硝子	522,000	776.00	405,072,000
日本板硝子	511,000	134.00	68,474,000
石塚硝子	14,000	256.00	3,584,000

日本山村硝子	45,000	199.00	8,955,000
日本電気硝子	203,000	641.00	130,123,000
オハラ	4,200	616.00	2,587,200
住友大阪セメント	197,000	438.00	86,286,000
太平洋セメント	661,000	367.00	242,587,000
デイ・シイ	11,900	455.00	5,414,500
日本ヒューム	11,100	802.00	8,902,200
日本コンクリート工業	18,700	528.00	9,873,600
三谷セキサン	5,300	1,800.00	9,540,000
ジャパンパイル	14,200	667.00	9,471,400
東海カーボン	92,000	394.00	36,248,000
日本カーボン	56,000	387.00	21,672,000
東洋炭素	5,900	2,119.00	12,502,100
ノリタケカンパニーリミテド	60,000	304.00	18,240,000
TOTO	156,000	2,123.00	331,188,000
日本碍子	134,000	3,110.00	416,740,000
日本特殊陶業	91,400	3,810.00	348,234,000
MARUWA	3,100	2,650.00	8,215,000
品川リフラクトリーズ	28,000	293.00	8,204,000
黒崎播磨	25,000	267.00	6,675,000
ヨータイ	7,000	378.00	2,646,000
イソライト工業	5,600	232.00	1,299,200
東京窯業	14,000	220.00	3,080,000
ニッカトー	4,200	420.00	1,764,000
フジインコーポレーテッド	10,300	1,924.00	19,817,200
ニチアス	47,000	756.00	35,532,000
ニチハ	14,100	1,654.00	23,321,400
新日鐵住金	4,481,000	333.80	1,495,757,800
神戸製鋼所	1,833,000	223.00	408,759,000
合同製鐵	56,000	236.00	13,216,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	270,400	2,889.50	781,320,800
日新製鋼	45,200	1,615.00	72,998,000
東京製鐵	53,900	903.00	48,671,700
共英製鋼	11,400	2,337.00	26,641,800
大和工業	24,100	3,050.00	73,505,000
東京鐵鋼	21,000	555.00	11,655,000
大阪製鐵	6,700	2,315.00	15,510,500
淀川製鋼所	73,000	556.00	40,588,000
東洋鋼鈹	25,700	610.00	15,677,000
丸一鋼管	32,500	3,080.00	100,100,000
モリ工業	17,000	401.00	6,817,000
大同特殊鋼	178,000	548.00	97,544,000

日本高周波鋼業	45,000	119.00	5,355,000	
日本冶金工業	85,800	239.00	20,506,200	
山陽特殊製鋼	63,000	607.00	38,241,000	
愛知製鋼	63,000	564.00	35,532,000	
日立金属	108,000	2,008.00	216,864,000	
日本金属	27,000	166.00	4,482,000	
大太平洋金属	68,000	406.00	27,608,000	
新日本電工	65,000	296.00	19,240,000	
栗本鐵工所	55,000	251.00	13,805,000	
虹技	15,000	211.00	3,165,000	
日本鑄鉄管	11,000	229.00	2,519,000	
三菱製鋼	70,000	282.00	19,740,000	
日亜鋼業	14,900	309.00	4,604,100	
日本精線	8,000	622.00	4,976,000	
シンニッタン	11,200	575.00	6,440,000	
新家工業	21,000	183.00	3,843,000	
大紀アルミニウム工業所	18,000	430.00	7,740,000	
日本軽金属ホールディングス	257,200	221.00	56,841,200	
三井金属鉱業	288,000	358.00	103,104,000	
東邦亜鉛	60,000	428.00	25,680,000	
三菱マテリアル	661,000	508.00	335,788,000	
住友金属鉱山	293,000	1,986.00	581,898,000	
D O W Aホールディングス	127,000	1,090.00	138,430,000	
古河機械金属	165,000	221.00	36,465,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,400	3,550.00	36,920,000	
東邦チタニウム	17,900	1,543.00	27,619,700	
U A C J	121,000	324.00	39,204,000	
古河電気工業	311,000	232.00	72,152,000	
住友電気工業	399,300	1,924.50	768,452,850	
フジクラ	148,000	701.00	103,748,000	
昭和電線ホールディングス	116,000	96.00	11,136,000	
東京特殊電線	1,500	1,330.00	1,995,000	
タツタ電線	19,900	502.00	9,989,800	
沖電線	12,000	309.00	3,708,000	
カナレ電気	1,900	2,271.00	4,314,900	
平河ヒューテック	2,800	1,303.00	3,648,400	
リョービ	59,000	496.00	29,264,000	
アーレスティ	9,600	1,126.00	10,809,600	
アサヒホールディングス	16,000	2,237.00	35,792,000	
稲葉製作所	4,600	1,469.00	6,757,400	
宮地エンジニアリンググループ	35,000	188.00	6,580,000	
トーカロ	7,000	2,797.00	19,579,000	

アルファＣο	4,300	1,365.00	5,869,500
SUMCO	83,200	1,685.00	140,192,000
川田テクノロジーズ	2,300	3,810.00	8,763,000
東洋製罐グループホールディングス	75,300	1,902.00	143,220,600
ホッカンホールディングス	30,000	305.00	9,150,000
コロナ	5,600	1,215.00	6,804,000
横河ブリッジホールディングス	20,100	1,308.00	26,290,800
駒井ハルテック	21,000	259.00	5,439,000
高田機工	10,000	253.00	2,530,000
三和ホールディングス	100,400	1,036.00	104,014,400
文化シャッター	29,900	1,004.00	30,019,600
三協立山	14,400	2,043.00	29,419,200
アルインコ	4,500	1,140.00	5,130,000
東洋シャッター	3,600	995.00	3,582,000
LIXILグループ	157,600	2,501.00	394,157,600
日本フィルコン	9,300	516.00	4,798,800
ノーリツ	20,800	2,181.00	45,364,800
長府製作所	11,300	2,979.00	33,662,700
リンナイ	19,700	9,230.00	181,831,000
ダイニチ工業	5,400	776.00	4,190,400
日東精工	15,000	354.00	5,310,000
三洋工業	14,000	219.00	3,066,000
岡部	20,900	1,012.00	21,150,800
ジーテクト	7,800	1,322.00	10,311,600
東プレ	20,500	2,211.00	45,325,500
高周波熱錬	18,300	918.00	16,799,400
サンコール	6,000	700.00	4,200,000
モリテック スチール	5,700	327.00	1,863,900
パイオラックス	5,400	5,750.00	31,050,000
日本発條	92,100	1,450.00	133,545,000
中央発條	15,000	331.00	4,965,000
アドバネクス	25,000	182.00	4,550,000
三益半導体工業	7,800	1,294.00	10,093,200
日本ドライケミカル	1,300	2,387.00	3,103,100
日本製鋼所	152,000	553.00	84,056,000
三浦工業	47,300	1,356.00	64,138,800
タクマ	34,000	784.00	26,656,000
ツガミ	31,000	731.00	22,661,000
オークマ	69,000	1,378.00	95,082,000
東芝機械	58,000	587.00	34,046,000
アマダホールディングス	158,000	1,296.00	204,768,000
アイダエンジニアリング	23,200	1,405.00	32,596,000

滝澤鉄工所	33,000	241.00	7,953,000
富士機械製造	34,600	1,251.00	43,284,600
牧野フライス製作所	53,000	1,275.00	67,575,000
オーエスジー	48,300	2,526.00	122,005,800
ダイジェット工業	16,000	217.00	3,472,000
旭ダイヤモンド工業	29,000	1,426.00	41,354,000
D M G 森精機	66,900	2,470.00	165,243,000
ソディック	21,400	1,051.00	22,491,400
ディスコ	12,400	10,540.00	130,696,000
日東工器	6,200	2,690.00	16,678,000
パンチ工業	3,000	1,280.00	3,840,000
豊和工業	6,200	753.00	4,668,600
大阪機工	47,000	186.00	8,742,000
東洋機械金属	7,300	543.00	3,963,900
津田駒工業	26,000	151.00	3,926,000
島精機製作所	15,000	2,081.00	31,215,000
日阪製作所	13,400	1,152.00	15,436,800
やまびこ	4,200	5,080.00	21,336,000
ペガサスミシン製造	10,100	591.00	5,969,100
ナプテスコ	64,500	3,255.00	209,947,500
三井海洋開発	10,700	1,907.00	20,404,900
レオン自動機	8,400	580.00	4,872,000
S M C	31,800	37,550.00	1,194,090,000
新川	8,800	1,133.00	9,970,400
ホソカワミクロン	18,000	619.00	11,142,000
ユニオンツール	5,200	4,055.00	21,086,000
オイレス工業	12,600	2,231.00	28,110,600
日精エー・エス・ビー機械	3,800	2,484.00	9,439,200
サトーホールディングス	13,200	3,255.00	42,966,000
日本エアーテック	3,900	844.00	3,291,600
日精樹脂工業	7,800	1,176.00	9,172,800
ワイエイシイ	4,500	910.00	4,095,000
小松製作所	519,400	2,564.00	1,331,741,600
住友重機械工業	290,000	773.00	224,170,000
日立建機	47,300	2,234.00	105,668,200
日工	15,000	452.00	6,780,000
巴工業	4,000	1,674.00	6,696,000
井関農機	110,000	232.00	25,520,000
T O W A	8,800	795.00	6,996,000
丸山製作所	25,000	230.00	5,750,000
北川鉄工所	49,000	328.00	16,072,000
クボタ	509,000	1,983.50	1,009,601,500

荏原実業	3,300	1,469.00	4,847,700
三菱化工機	35,000	405.00	14,175,000
月島機械	18,700	1,305.00	24,403,500
帝国電機製作所	7,100	1,062.00	7,540,200
新東工業	25,000	1,162.00	29,050,000
澁谷工業	8,900	2,323.00	20,674,700
アイチ コーポレーション	15,000	689.00	10,335,000
小森コーポレーション	25,800	1,504.00	38,803,200
鶴見製作所	7,900	1,872.00	14,788,800
住友精密工業	17,000	480.00	8,160,000
酒井重工業	20,000	277.00	5,540,000
荏原製作所	220,000	625.00	137,500,000
石井鐵工所	18,000	217.00	3,906,000
西島製作所	10,400	965.00	10,036,000
北越工業	8,400	927.00	7,786,800
ダイキン工業	147,400	9,130.00	1,345,762,000
オルガノ	20,000	550.00	11,000,000
トーヨーカネツ	61,000	232.00	14,152,000
栗田工業	59,900	2,986.00	178,861,400
椿本チエイン	54,000	1,178.00	63,612,000
大同工業	24,000	251.00	6,024,000
日本コンベヤ	33,000	201.00	6,633,000
木村化工機	11,100	513.00	5,694,300
アネスト岩田	15,900	783.00	12,449,700
ダイフク	50,000	1,911.00	95,550,000
サムコ	1,500	1,178.00	1,767,000
加藤製作所	22,000	772.00	16,984,000
油研工業	22,000	270.00	5,940,000
タダノ	49,000	1,823.00	89,327,000
フジテック	29,500	1,520.00	44,840,000
C K D	28,400	1,387.00	39,390,800
キトー	11,200	1,274.00	14,268,800
平和	22,000	2,431.00	53,482,000
理想科学工業	12,300	2,316.00	28,486,800
S A N K Y O	28,200	4,390.00	123,798,000
日本金銭機械	9,400	1,708.00	16,055,200
マースエンジニアリング	5,700	2,123.00	12,101,100
福島工業	5,600	2,351.00	13,165,600
オーイズミ	4,100	829.00	3,398,900
ダイコク電機	4,200	1,710.00	7,182,000
竹内製作所	4,300	7,030.00	30,229,000
アマノ	33,800	1,652.00	55,837,600

JUKI	75,000	357.00	26,775,000
サンデンホールディングス	63,000	628.00	39,564,000
蛇の目ミシン工業	98,000	138.00	13,524,000
マックス	16,000	1,300.00	20,800,000
グローリー	32,400	3,650.00	118,260,000
新晃工業	7,100	1,229.00	8,725,900
大和冷機工業	14,700	832.00	12,230,400
セガサミーホールディングス	108,800	1,686.00	183,436,800
日本ピストンリング	40,000	244.00	9,760,000
リケン	44,000	482.00	21,208,000
T P R	11,400	3,665.00	41,781,000
ホンザキ電機	22,200	7,190.00	159,618,000
大豊工業	8,400	1,691.00	14,204,400
日本精工	208,000	1,980.00	411,840,000
N T N	235,000	727.00	170,845,000
ジェイテクト	107,900	2,294.00	247,522,600
不二越	94,000	716.00	67,304,000
日本トムソン	35,000	741.00	25,935,000
T H K	67,300	2,888.00	194,362,400
ユーシン精機	4,500	2,697.00	12,136,500
前澤給装工業	3,900	1,680.00	6,552,000
イーグル工業	14,100	2,847.00	40,142,700
前澤工業	9,300	406.00	3,775,800
日本ピラー工業	11,100	1,121.00	12,443,100
キッツ	45,500	596.00	27,118,000
日立工機	27,100	1,039.00	28,156,900
マキタ	66,000	6,910.00	456,060,000
日立造船	79,400	701.00	55,659,400
三菱重工業	1,697,000	770.70	1,307,877,900
I H I	729,000	586.00	427,194,000
イビデン	66,400	2,159.00	143,357,600
コニカミノルタ	241,300	1,507.00	363,639,100
ブラザー工業	130,900	1,863.00	243,866,700
ミネベア	151,000	2,139.00	322,989,000
日立製作所	2,431,000	825.60	2,007,033,600
東芝	2,131,000	442.80	943,606,800
三菱電機	1,012,000	1,667.00	1,687,004,000
富士電機	282,000	562.00	158,484,000
東洋電機製造	20,000	456.00	9,120,000
安川電機	123,600	1,667.00	206,041,200
シンフォニアテクノロジー	70,000	238.00	16,660,000
明電舎	93,000	454.00	42,222,000

オリジン電気	15,000	470.00	7,050,000
山洋電気	22,000	1,020.00	22,440,000
デンヨー	8,600	2,049.00	17,621,400
東芝テック	72,000	660.00	47,520,000
芝浦メカトロニクス	16,000	288.00	4,608,000
マブチモーター	29,000	7,620.00	220,980,000
日本電産	111,200	8,829.00	981,784,800
東光高岳	5,100	1,650.00	8,415,000
ダイヘン	55,000	702.00	38,610,000
田淵電機	8,900	1,214.00	10,804,600
ヤーマン	1,300	1,578.00	2,051,400
JVCケンウッド	74,400	351.00	26,114,400
ミマキエンジニアリング	6,100	995.00	6,069,500
第一精工	3,700	2,097.00	7,758,900
日新電機	23,700	860.00	20,382,000
大崎電気工業	17,000	720.00	12,240,000
オムロン	109,300	5,590.00	610,987,000
日東工業	16,200	2,713.00	43,950,600
I D E C	12,000	1,108.00	13,296,000
不二電機工業	1,000	1,485.00	1,485,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	195,000	526.00	102,570,000
サクサホールディングス	26,000	255.00	6,630,000
メルコホールディングス	5,600	2,319.00	12,986,400
テクノメディカ	2,300	2,906.00	6,683,800
日本電気	1,310,000	389.00	509,590,000
富士通	976,000	699.50	682,712,000
沖電気工業	356,000	261.00	92,916,000
岩崎通信機	44,000	94.00	4,136,000
電気興業	29,000	592.00	17,168,000
サンケン電気	51,000	835.00	42,585,000
ナカヨ	10,000	365.00	3,650,000
アイホン	5,800	2,030.00	11,774,000
ルネサスエレクトロニクス	52,400	945.00	49,518,000
セイコーエプソン	138,200	2,241.00	309,706,200
ワコム	79,800	476.00	37,984,800
アルバック	17,100	1,956.00	33,447,600
アクセル	4,700	1,680.00	7,896,000
E I Z O	9,300	2,883.00	26,811,900
ジャパンディスプレイ	208,000	521.00	108,368,000
日本信号	27,900	1,312.00	36,604,800
京三製作所	24,000	381.00	9,144,000
能美防災	13,400	1,482.00	19,858,800

ホーチキ	7,400	876.00	6,482,400
エレコム	3,300	3,065.00	10,114,500
日本無線	22,000	424.00	9,328,000
パナソニック	1,233,700	1,714.00	2,114,561,800
シャープ	856,000	169.00	144,664,000
アンリツ	60,800	869.00	52,835,200
富士通ゼネラル	31,000	1,605.00	49,755,000
日立国際電気	26,000	1,780.00	46,280,000
ソニー	661,800	3,653.00	2,417,555,400
TDK	61,100	9,720.00	593,892,000
帝国通信工業	24,000	237.00	5,688,000
ミツミ電機	35,800	846.00	30,286,800
タムラ製作所	39,000	518.00	20,202,000
アルプス電気	79,900	3,230.00	258,077,000
池上通信機	34,000	180.00	6,120,000
パイオニア	152,100	227.00	34,526,700
日本電波工業	9,200	964.00	8,868,800
鈴木	1,300	1,502.00	1,952,600
日本トリム	2,500	3,340.00	8,350,000
ローランド ディー・ジー	4,100	3,305.00	13,550,500
フォスター電機	11,000	2,771.00	30,481,000
クラリオン	53,000	357.00	18,921,000
SMK	30,000	524.00	15,720,000
ヨコオ	7,900	712.00	5,624,800
東光	24,000	357.00	8,568,000
ホシデン	30,700	855.00	26,248,500
ヒロセ電機	17,200	17,750.00	305,300,000
日本航空電子工業	29,000	3,410.00	98,890,000
TOA	10,900	1,301.00	14,180,900
日立マクセル	20,100	2,033.00	40,863,300
古野電気	12,100	929.00	11,240,900
ユニデン	28,000	231.00	6,468,000
アルパイン	24,100	2,525.00	60,852,500
スミダコーポレーション	9,100	883.00	8,035,300
アイコム	5,600	3,030.00	16,968,000
リオン	3,000	1,670.00	5,010,000
船井電機	10,200	1,468.00	14,973,600
横河電機	101,300	1,515.00	153,469,500
新電元工業	39,000	631.00	24,609,000
アズビル	33,100	3,330.00	110,223,000
東亜ディーケーケー	4,300	626.00	2,691,800
日本光電工業	43,200	2,866.00	123,811,200

チノー	3,600	1,244.00	4,478,400
共和電業	12,300	516.00	6,346,800
日本電子材料	4,300	772.00	3,319,600
堀場製作所	18,700	4,910.00	91,817,000
アドバンテスト	69,000	1,332.00	91,908,000
小野測器	5,000	1,050.00	5,250,000
エスベック	11,200	1,408.00	15,769,600
パナソニック デバイスSUNX	8,900	824.00	7,333,600
キーエンス	22,900	65,890.00	1,508,881,000
日置電機	5,300	2,559.00	13,562,700
シスメックス	78,400	7,010.00	549,584,000
メガチップス	10,600	1,620.00	17,172,000
OBARA GROUP	6,600	7,250.00	47,850,000
澤藤電機	6,000	246.00	1,476,000
コーセル	14,700	1,452.00	21,344,400
新日本無線	7,000	775.00	5,425,000
オブテックス	7,000	2,662.00	18,634,000
千代田インテグレ	4,600	3,210.00	14,766,000
レーザーテック	10,400	1,696.00	17,638,400
スタンレー電気	72,700	2,853.00	207,413,100
岩崎電気	35,000	296.00	10,360,000
ウシオ電機	61,500	1,752.00	107,748,000
岡谷電機産業	5,500	425.00	2,337,500
ヘリオス テクノ ホールディング	9,400	453.00	4,258,200
日本セラミック	5,800	1,697.00	9,842,600
遠藤照明	4,700	1,407.00	6,612,900
日本デジタル研究所	8,500	1,710.00	14,535,000
古河電池	7,000	893.00	6,251,000
双信電機	5,000	408.00	2,040,000
山一電機	11,800	1,261.00	14,879,800
図研	7,400	1,200.00	8,880,000
日本電子	43,000	568.00	24,424,000
カシオ計算機	101,500	2,301.00	233,551,500
ファナック	105,400	26,400.00	2,782,560,000
日本シイエムケイ	25,900	313.00	8,106,700
エンプラス	4,600	4,870.00	22,402,000
大真空	19,000	313.00	5,947,000
ローム	49,900	8,190.00	408,681,000
浜松ホトニクス	79,000	3,515.00	277,685,000
三井ハイテック	13,400	886.00	11,872,400
新光電気工業	38,300	988.00	37,840,400
京セラ	166,200	6,558.00	1,089,939,600

太陽誘電	53,000	1,715.00	90,895,000	
村田製作所	106,200	18,960.00	2,013,552,000	
ユーシン	14,300	791.00	11,311,300	
双葉電子工業	17,300	2,263.00	39,149,900	
北陸電気工業	44,000	181.00	7,964,000	
ニチコン	31,900	988.00	31,517,200	
日本ケミコン	82,000	397.00	32,554,000	
K O A	14,000	1,293.00	18,102,000	
市光工業	24,000	303.00	7,272,000	
小糸製作所	60,700	4,660.00	282,862,000	
ミツバ	18,600	3,435.00	63,891,000	
スター精密	19,200	2,139.00	41,068,800	
S C R E E Nホールディングス	96,000	819.00	78,624,000	
キャノン電子	9,300	2,438.00	22,673,400	
キャノン	586,900	4,160.00	2,441,504,000	
リコー	304,400	1,250.00	380,500,000	
M U T O Hホールディングス	14,000	398.00	5,572,000	
東京エレクトロン	85,200	7,603.00	647,775,600	
トヨタ紡織	36,100	1,936.00	69,889,600	
鬼怒川ゴム工業	24,000	701.00	16,824,000	
ユニプレス	19,600	2,683.00	52,586,800	
豊田自動織機	92,400	6,960.00	643,104,000	
モリタホールディングス	17,700	1,149.00	20,337,300	
三櫻工業	13,300	871.00	11,584,300	
デンソー	250,300	6,085.00	1,523,075,500	
東海理化電機製作所	26,800	3,170.00	84,956,000	
三井造船	392,000	228.00	89,376,000	
川崎重工業	735,000	606.00	445,410,000	
名村造船所	28,700	1,046.00	30,020,200	
サノヤスホールディングス	15,200	270.00	4,104,000	
日本車輛製造	37,000	346.00	12,802,000	
ニチユ三菱フォークリフト	11,700	620.00	7,254,000	
近畿車輛	15,000	353.00	5,295,000	
日産自動車	1,420,900	1,255.50	1,783,939,950	
いすゞ自動車	320,000	1,541.00	493,120,000	
トヨタ自動車	1,396,600	8,182.00	11,426,981,200	代用有価証券 500,000株
日野自動車	144,500	1,578.00	228,021,000	
三菱自動車工業	371,000	1,102.00	408,842,000	
エフテック	5,400	1,259.00	6,798,600	
レシップホールディングス	3,300	863.00	2,847,900	
G M B	1,500	1,271.00	1,906,500	
ファルテック	1,100	1,596.00	1,755,600	

武蔵精密工業	10,800	2,441.00	26,362,800
日産車体	44,500	1,695.00	75,427,500
新明和工業	41,000	1,194.00	48,954,000
極東開発工業	18,800	1,419.00	26,677,200
日信工業	18,500	1,994.00	36,889,000
トピー工業	87,000	321.00	27,927,000
ティラド	39,000	250.00	9,750,000
曙ブレーキ工業	44,000	415.00	18,260,000
タチエス	16,100	1,762.00	28,368,200
NOK	49,300	4,160.00	205,088,000
フタバ産業	33,200	601.00	19,953,200
カヤバ工業	114,000	446.00	50,844,000
シロキ工業	23,000	399.00	9,177,000
大同メタル工業	14,500	1,261.00	18,284,500
プレス工業	51,100	543.00	27,747,300
ミクニ	12,100	588.00	7,114,800
カルソニックカンセイ	78,000	927.00	72,306,000
太平洋工業	21,000	1,152.00	24,192,000
ケーヒン	23,300	1,880.00	43,804,000
河西工業	12,900	1,284.00	16,563,600
アイシン精機	92,900	5,540.00	514,666,000
富士機工	11,800	713.00	8,413,400
マツダ	301,700	2,594.00	782,609,800
ダイハツ工業	120,800	1,740.00	210,192,000
今仙電機製作所	8,700	1,383.00	12,032,100
本田技研工業	911,000	4,132.50	3,764,707,500
スズキ	211,600	4,310.00	911,996,000
富士重工業	344,500	4,518.50	1,556,623,250
安永	3,400	593.00	2,016,200
ヤマハ発動機	154,000	2,980.00	458,920,000
ショーワ	23,900	1,324.00	31,643,600
T B K	13,100	573.00	7,506,300
エクセディ	13,800	3,205.00	44,229,000
豊田合成	32,900	3,015.00	99,193,500
愛三工業	16,200	1,143.00	18,516,600
盟和産業	8,000	153.00	1,224,000
ヨロズ	9,500	2,757.00	26,191,500
エフ・シー・シー	14,900	2,019.00	30,083,100
シマノ	43,700	16,790.00	733,723,000
テイ・エス テック	21,400	3,475.00	74,365,000
ジャムコ	4,100	3,710.00	15,211,000
テルモ	155,200	2,729.00	423,540,800

クリエートメディック	3,400	1,042.00	3,542,800
日機装	32,800	1,203.00	39,458,400
島津製作所	121,000	1,640.00	198,440,000
JMS	19,000	297.00	5,643,000
ショットモリテックス	2,200	250.00	550,000
長野計器	6,600	807.00	5,326,200
ブイ・テクノロジー	2,000	4,375.00	8,750,000
東京計器	35,000	268.00	9,380,000
愛知時計電機	13,000	341.00	4,433,000
オーバル	7,900	310.00	2,449,000
東京精密	18,300	2,645.00	48,403,500
マニー	2,900	7,960.00	23,084,000
ニコン	189,000	1,476.00	278,964,000
トプコン	30,600	2,612.00	79,927,200
オリンパス	150,800	4,100.00	618,280,000
理研計器	8,900	1,390.00	12,371,000
タムロン	7,800	2,759.00	21,520,200
HOYA	240,900	4,680.50	1,127,532,450
ノーリツ鋼機	9,100	732.00	6,661,200
エー・アンド・デイ	9,200	521.00	4,793,200
シチズンホールディングス	124,600	889.00	110,769,400
リズム時計工業	44,000	158.00	6,952,000
大研医器	7,300	1,245.00	9,088,500
松風	5,000	1,245.00	6,225,000
セイコーホールディングス	72,000	643.00	46,296,000
ニプロ	64,700	1,174.00	75,957,800
パラマウントベッドホールディングス	10,700	3,345.00	35,791,500
トランザクション	800	1,183.00	946,400
SHO-BI	3,400	410.00	1,394,000
前田工織	10,300	1,026.00	10,567,800
永大産業	14,000	462.00	6,468,000
アートネイチャー	7,300	1,099.00	8,022,700
ダンロップスポーツ	6,400	1,212.00	7,756,800
バンダイナムコホールディングス	111,600	2,415.00	269,514,000
共立印刷	18,300	303.00	5,544,900
フランスベッドホールディングス	71,000	181.00	12,851,000
パイロットコーポレーション	8,800	8,470.00	74,536,000
萩原工業	2,100	2,059.00	4,323,900
トッパン・フォームズ	18,100	1,635.00	29,593,500
フジシールインターナショナル	12,300	3,550.00	43,665,000
タカラトミー	36,300	682.00	24,756,600
廣濟堂	9,400	673.00	6,326,200

A s - m e エステール	2,700	794.00	2,143,800
アーク	31,900	135.00	4,306,500
タカノ	4,400	798.00	3,511,200
プロネクサス	10,300	774.00	7,972,200
ホクシン	8,000	152.00	1,216,000
ウッドワン	17,000	289.00	4,913,000
大建工業	41,000	312.00	12,792,000
凸版印刷	286,000	1,038.00	296,868,000
大日本印刷	308,000	1,301.00	400,708,000
図書印刷	16,000	425.00	6,800,000
共同印刷	31,000	363.00	11,253,000
日本写真印刷	17,000	2,143.00	36,431,000
光村印刷	9,000	265.00	2,385,000
宝印刷	5,300	1,164.00	6,169,200
アシックス	100,600	3,225.00	324,435,000
ツツミ	5,000	2,835.00	14,175,000
小松ウオール工業	3,100	2,497.00	7,740,700
ヤマハ	74,400	2,427.00	180,568,800
河合楽器製作所	3,500	2,543.00	8,900,500
クリナップ	9,200	890.00	8,188,000
ピジョン	57,400	3,505.00	201,187,000
兼松日産農林	13,000	166.00	2,158,000
キングジム	8,400	935.00	7,854,000
リンテック	24,100	2,796.00	67,383,600
T A S A K I	1,900	3,060.00	5,814,000
イトーキ	21,300	720.00	15,336,000
任天堂	62,300	20,160.00	1,255,968,000
三菱鉛筆	8,300	5,810.00	48,223,000
タカラスタンダード	42,000	890.00	37,380,000
コクヨ	52,600	1,072.00	56,387,200
ナカバヤシ	21,000	235.00	4,935,000
グローブライド	49,000	175.00	8,575,000
岡村製作所	38,900	1,100.00	42,790,000
美津濃	54,000	610.00	32,940,000
アデランス	11,700	1,106.00	12,940,200
東京電力	858,700	676.00	580,481,200
中部電力	309,700	1,868.50	578,674,450
関西電力	413,100	1,332.00	550,249,200
中国電力	140,000	1,847.00	258,580,000
北陸電力	99,200	1,876.00	186,099,200
東北電力	252,900	1,756.00	444,092,400
四国電力	91,200	1,881.00	171,547,200

九州電力	223,600	1,427.00	319,077,200
北海道電力	94,700	1,256.00	118,943,200
沖縄電力	9,950	3,200.00	31,840,000
電源開発	73,400	4,485.00	329,199,000
東京瓦斯	1,231,000	697.30	858,376,300
大阪瓦斯	1,048,000	524.50	549,676,000
東邦瓦斯	257,000	767.00	197,119,000
北海道瓦斯	21,000	282.00	5,922,000
広島ガス	16,000	479.00	7,664,000
西部瓦斯	114,000	280.00	31,920,000
静岡ガス	28,700	847.00	24,308,900
メタウォーター	4,900	3,180.00	15,582,000
SBSホールディングス	7,700	1,040.00	8,008,000
東武鉄道	541,000	535.00	289,435,000
相鉄ホールディングス	174,000	581.00	101,094,000
東京急行電鉄	550,000	813.00	447,150,000
京浜急行電鉄	277,000	917.00	254,009,000
小田急電鉄	324,000	1,159.00	375,516,000
京王電鉄	283,000	877.00	248,191,000
京成電鉄	152,000	1,417.00	215,384,000
富士急行	28,000	1,165.00	32,620,000
新京成電鉄	13,000	421.00	5,473,000
東日本旅客鉄道	185,500	10,930.00	2,027,515,000
西日本旅客鉄道	97,400	7,389.00	719,688,600
東海旅客鉄道	90,600	20,645.00	1,870,437,000
西武ホールディングス	80,700	2,815.00	227,170,500
鴻池運輸	12,500	1,466.00	18,325,000
西日本鉄道	131,000	535.00	70,085,000
ハマキョウレックス	3,200	4,885.00	15,632,000
サカイ引越センター	1,700	4,385.00	7,454,500
近鉄グループホールディングス	1,019,000	414.00	421,866,000
阪急阪神ホールディングス	679,000	732.00	497,028,000
南海電気鉄道	227,000	543.00	123,261,000
京阪電気鉄道	227,000	705.00	160,035,000
神戸電鉄	25,000	359.00	8,975,000
名糖運輸	4,100	746.00	3,058,600
名古屋鉄道	369,000	462.00	170,478,000
山陽電気鉄道	37,000	472.00	17,464,000
日本通運	392,000	654.00	256,368,000
ヤマトホールディングス	178,000	2,420.00	430,760,000
山九	123,000	655.00	80,565,000
丸運	5,500	270.00	1,485,000

丸全昭和運輸	34,000	439.00	14,926,000
センコー	45,000	751.00	33,795,000
トナミホールディングス	21,000	407.00	8,547,000
日本梱包運輸倉庫	33,100	2,193.00	72,588,300
日本石油輸送	11,000	247.00	2,717,000
福山通運	61,000	706.00	43,066,000
セイノーホールディングス	78,300	1,451.00	113,613,300
神奈川中央交通	12,000	581.00	6,972,000
日立物流	21,100	1,983.00	41,841,300
丸和運輸機関	900	3,410.00	3,069,000
日本郵船	856,000	347.00	297,032,000
商船三井	532,000	403.00	214,396,000
川崎汽船	446,000	298.00	132,908,000
N S ユナイテッド海運	53,000	275.00	14,575,000
飯野海運	54,900	613.00	33,653,700
共栄タンカー	19,000	220.00	4,180,000
日本航空	193,800	3,990.00	773,262,000
A N Aホールディングス	1,990,000	321.00	638,790,000
パスコ	9,000	357.00	3,213,000
ランコム	2,900	6,000.00	17,400,000
日新	38,000	381.00	14,478,000
三菱倉庫	66,000	1,669.00	110,154,000
三井倉庫ホールディングス	59,000	391.00	23,069,000
住友倉庫	74,000	725.00	53,650,000
澁澤倉庫	26,000	351.00	9,126,000
東陽倉庫	17,000	293.00	4,981,000
乾汽船	6,800	980.00	6,664,000
日本トランスシティ	23,000	433.00	9,959,000
ケイヒン	18,000	200.00	3,600,000
中央倉庫	5,800	959.00	5,562,200
安田倉庫	7,900	999.00	7,892,100
東洋埠頭	32,000	202.00	6,464,000
宇徳	8,200	540.00	4,428,000
上組	121,000	1,138.00	137,698,000
サンリツ	2,500	557.00	1,392,500
キムラユニティー	2,600	1,158.00	3,010,800
キューソー流通システム	2,800	1,859.00	5,205,200
郵船ロジスティクス	9,300	1,485.00	13,810,500
近鉄エクスプレス	9,100	5,820.00	52,962,000
東海運	5,500	286.00	1,573,000
エーアイティー	4,700	1,145.00	5,381,500
内外トランスライン	1,100	2,443.00	2,687,300

NEC ネットエスアイ	12,500	2,614.00	32,675,000
システナ	9,700	1,020.00	9,894,000
デジタルアーツ	5,300	1,396.00	7,398,800
新日鉄住金ソリューションズ	8,300	3,865.00	32,079,500
キューブシステム	4,300	659.00	2,833,700
コア	4,200	865.00	3,633,000
ソフトクリエイティブホールディングス	3,300	943.00	3,111,900
ITホールディングス	33,100	2,374.00	78,579,400
ネオス	2,700	667.00	1,800,900
電算システム	3,500	1,615.00	5,652,500
グリー	60,500	742.00	44,891,000
コーエーテクモホールディングス	22,600	2,114.00	47,776,400
三菱総合研究所	3,900	2,885.00	11,251,500
ボルテージ	1,800	2,152.00	3,873,600
電算	1,100	2,261.00	2,487,100
AGS	1,600	1,058.00	1,692,800
ファインデックス	4,400	1,546.00	6,802,400
ヒト・コミュニケーションズ	1,100	1,935.00	2,128,500
ブレインパッド	1,200	1,080.00	1,296,000
KL a b	10,600	1,475.00	15,635,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,600	1,205.00	7,953,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	1,010.00	2,323,000
ネクソン	95,400	1,598.00	152,449,200
アイスタイル	3,800	918.00	3,488,400
エムアップ	2,700	754.00	2,035,800
エイチーム	2,600	2,691.00	6,996,600
e n i s h	2,600	1,845.00	4,797,000
コロプラ	27,400	2,440.00	66,856,000
モバイルクリエイティブ	5,000	764.00	3,820,000
オルトプラス	1,900	917.00	1,742,300
ブロードリーフ	8,200	1,768.00	14,497,600
ハーツユナイテッドグループ	3,000	1,986.00	5,958,000
ベリサーブ	1,200	1,152.00	1,382,400
ティーガイア	9,900	1,689.00	16,721,100
豆蔵ホールディングス	7,800	646.00	5,038,800
テクマトリックス	4,300	861.00	3,702,300
GMOペイメントゲートウェイ	8,700	3,195.00	27,796,500
ザッパラス	5,600	605.00	3,388,000
インターネットイニシアティブ	16,100	2,014.00	32,425,400
GMOクラウド	1,700	918.00	1,560,600
ビットアイル	11,300	515.00	5,819,500
SRAホールディングス	5,300	1,952.00	10,345,600

パイブドピッツ	1,000	1,788.00	1,788,000
朝日ネット	10,200	525.00	5,355,000
コムチュア	1,700	2,000.00	3,400,000
g u m i	7,800	1,713.00	13,361,400
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,300	4,255.00	9,786,500
フェイス	3,000	1,576.00	4,728,000
ハイマックス	1,300	1,142.00	1,484,600
野村総合研究所	56,600	4,695.00	265,737,000
サイバネットシステム	8,200	463.00	3,796,600
C E ホールディングス	1,200	1,258.00	1,509,600
インタージホールディングス	5,700	1,830.00	10,431,000
東邦システムサイエンス	3,000	619.00	1,857,000
ソースネクスト	5,000	750.00	3,750,000
ティー・ワイ・オー	10,100	206.00	2,080,600
クレスコ	2,300	1,972.00	4,535,600
フジ・メディア・ホールディングス	104,000	1,625.00	169,000,000
オービック	34,400	4,965.00	170,796,000
ジャストシステム	14,000	802.00	11,228,000
T D C ソフトウェアエンジニアリング	2,200	1,300.00	2,860,000
ヤフー	716,000	512.00	366,592,000
トレンドマイクロ	52,900	4,220.00	223,238,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,900	949.00	1,803,100
日本オラクル	16,000	5,190.00	83,040,000
アルファシステムズ	3,300	1,738.00	5,735,400
フューチャーアーキテクト	10,500	763.00	8,011,500
C A C H o l d i n g s	6,800	1,099.00	7,473,200
ソフトバンク・テクノロジー	2,700	1,344.00	3,628,800
トーセ	2,500	930.00	2,325,000
オービックビジネスコンサルタント	6,300	4,250.00	26,775,000
伊藤忠テクノソリューションズ	22,600	2,946.00	66,579,600
アイティフォー	12,000	475.00	5,700,000
東計電算	1,800	1,915.00	3,447,000
エクスネット	900	1,535.00	1,381,500
大塚商会	26,900	5,910.00	158,979,000
サイボウズ	13,300	341.00	4,535,300
ソフトブレーン	13,700	188.00	2,575,600
電通国際情報サービス	6,200	1,316.00	8,159,200
E M システムズ	1,200	2,171.00	2,605,200
ウェザーニューズ	3,000	3,575.00	10,725,000
C I J	9,100	580.00	5,278,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,000	1,453.00	1,453,000
日本エンタープライズ	6,800	339.00	2,305,200

WOWOW	4,800	3,675.00	17,640,000	
フュージョンパートナー	4,400	727.00	3,198,800	
日本コロムビア	3,400	396.00	1,346,400	
イマジカ・ロボット ホールディングス	5,400	597.00	3,223,800	
ネットワンシステムズ	40,600	870.00	35,322,000	
アルゴグラフィックス	4,100	1,877.00	7,695,700	
マーベラス	16,800	1,594.00	26,779,200	
エイベックス・グループ・ホールディングス	19,800	2,160.00	42,768,000	
日本ユニシス	27,600	1,130.00	31,188,000	
兼松エレクトロニクス	6,300	2,090.00	13,167,000	
東京放送ホールディングス	59,900	1,598.00	95,720,200	
日本テレビホールディングス	91,200	2,006.00	182,947,200	
朝日放送	9,900	963.00	9,533,700	
テレビ朝日ホールディングス	27,300	2,005.00	54,736,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	75,800	677.00	51,316,600	
テレビ東京ホールディングス	8,100	1,974.00	15,989,400	
日本BS放送	1,700	1,035.00	1,759,500	
コネクシオ	7,000	1,300.00	9,100,000	
クロップス	900	516.00	464,400	
日本電信電話	391,000	8,655.00	3,384,105,000	代用有価証券 200,000株
K D D I	1,015,000	2,815.00	2,857,225,000	
光通信	9,000	8,510.00	76,590,000	
N T T ドコモ	770,500	2,287.50	1,762,518,750	
エムティーアイ	12,700	839.00	10,655,300	
G M O インターネット	33,300	1,470.00	48,951,000	
K A D O K A W A ・ D W A N G O	24,500	1,701.00	41,674,500	
学研ホールディングス	33,000	248.00	8,184,000	
ゼンリン	13,200	1,593.00	21,027,600	
昭文社	6,000	890.00	5,340,000	
インプレスホールディングス	7,100	227.00	1,611,700	
アイネット	5,100	1,013.00	5,166,300	
松竹	66,000	1,054.00	69,564,000	
東宝	71,300	3,005.00	214,256,500	
東映	37,000	898.00	33,226,000	
A O I P r o .	4,600	919.00	4,227,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	61,700	5,320.00	328,244,000	
ピー・シー・エー	1,300	1,616.00	2,100,800	
D T S	10,300	2,600.00	26,780,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	38,400	2,787.00	107,020,800	
シーイーシー	6,500	1,078.00	7,007,000	
カブコン	25,500	2,298.00	58,599,000	
アイ・エス・ビー	1,100	898.00	987,800	

ジャステック	5,800	1,049.00	6,084,200
S C S K	23,800	3,440.00	81,872,000
日本システムウエア	3,800	928.00	3,526,400
アイネス	13,600	1,228.00	16,700,800
T K C	8,700	3,300.00	28,710,000
富士ソフト	13,800	2,561.00	35,341,800
N S D	23,300	1,585.00	36,930,500
コナミ	40,600	2,234.00	90,700,400
福井コンピュータホールディングス	2,700	769.00	2,076,300
J B C Cホールディングス	8,400	808.00	6,787,200
ミロク情報サービス	6,600	782.00	5,161,200
ソフトバンク	528,300	7,208.00	3,807,986,400
ハウスイ	8,000	145.00	1,160,000
高千穂交易	3,900	1,069.00	4,169,100
伊藤忠食品	2,500	4,265.00	10,662,500
エレマテック	4,700	3,020.00	14,194,000
J A L U X	2,800	2,406.00	6,736,800
あらた	23,000	384.00	8,832,000
トーメンデバイス	1,500	2,127.00	3,190,500
東京エレクトロン デバイス	2,100	1,695.00	3,559,500
フィールズ	6,600	2,041.00	13,470,600
双日	668,700	303.00	202,616,100
アルフレッサ ホールディングス	118,200	1,881.00	222,334,200
横浜冷凍	24,800	848.00	21,030,400
神栄	15,000	192.00	2,880,000
山下医科器械	800	1,902.00	1,521,600
ラサ商事	4,800	632.00	3,033,600
アルコニックス	5,700	2,082.00	11,867,400
神戸物産	3,200	5,670.00	18,144,000
あい ホールディングス	16,000	2,070.00	33,120,000
ディーブイエックス	3,000	1,106.00	3,318,000
ダイワボウホールディングス	91,000	243.00	22,113,000
マクニカ・富士エレホールディングス	18,000	1,655.00	29,790,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,800	875.00	16,450,000
八洲電機	7,800	591.00	4,609,800
U K Cホールディングス	6,400	2,541.00	16,262,400
O C H Iホールディングス	2,600	1,353.00	3,517,800
T O K A Iホールディングス	48,900	490.00	23,961,000
三洋貿易	5,500	1,713.00	9,421,500
ウイン・パートナーズ	3,300	1,510.00	4,983,000
ミタチ産業	2,400	775.00	1,860,000
シップヘルスケアホールディングス	18,300	2,418.00	44,249,400

明治電機工業	2,900	1,329.00	3,854,100
デリカフーズ	1,800	1,030.00	1,854,000
スターティア	900	1,572.00	1,414,800
富士興産	3,900	576.00	2,246,400
協栄産業	12,000	212.00	2,544,000
小野建	8,700	1,192.00	10,370,400
佐島電機	8,000	831.00	6,648,000
エコートレーディング	2,300	680.00	1,564,000
伯東	6,900	1,477.00	10,191,300
コンドーテック	7,300	777.00	5,672,100
中山福	5,800	896.00	5,196,800
ナガイレーベン	14,400	2,284.00	32,889,600
三菱食品	11,000	2,626.00	28,886,000
松田産業	7,300	1,535.00	11,205,500
メディカルホールディングス	99,900	1,861.00	185,913,900
アドヴァン	5,100	1,630.00	8,313,000
S P K	2,200	2,365.00	5,203,000
萩原電気	2,800	2,037.00	5,703,600
アズワン	7,200	4,280.00	30,816,000
スズデン	3,300	895.00	2,953,500
尾家産業	3,300	894.00	2,950,200
シモジマ	6,100	1,037.00	6,325,700
ドウシシャ	12,900	2,100.00	27,090,000
小津産業	2,000	2,118.00	4,236,000
高速	6,000	889.00	5,334,000
たけびし	3,500	1,076.00	3,766,000
黒田電気	17,400	2,150.00	37,410,000
丸文	8,900	903.00	8,036,700
ハピネット	6,100	1,341.00	8,180,100
橋本総業	1,900	1,413.00	2,684,700
エクセル	4,600	1,464.00	6,734,400
マルカキカイ	3,200	2,010.00	6,432,000
ガリバーインターナショナル	30,300	1,020.00	30,906,000
日本エム・ディ・エム	8,400	528.00	4,435,200
進和	5,900	2,296.00	13,546,400
エスケイジャパン	2,600	233.00	605,800
ダイトエレクトロン	4,600	916.00	4,213,600
シークス	6,300	3,405.00	21,451,500
田中商事	3,100	752.00	2,331,200
オーハシテクニカ	6,200	1,721.00	10,670,200
白銅	3,300	1,564.00	5,161,200
伊藤忠商事	836,300	1,625.00	1,358,987,500

丸紅	874,000	703.30	614,684,200
高島	19,000	280.00	5,320,000
長瀬産業	56,100	1,649.00	92,508,900
蝶理	6,400	1,948.00	12,467,200
豊田通商	111,300	3,315.00	368,959,500
三共生興	17,100	493.00	8,430,300
兼松	199,000	215.00	42,785,000
ツカモトコーポレーション	18,000	142.00	2,556,000
三井物産	847,000	1,676.50	1,419,995,500
日本紙パルプ商事	52,000	346.00	17,992,000
日立ハイテクノロジーズ	34,600	3,380.00	116,948,000
カメイ	13,000	1,061.00	13,793,000
東都水産	17,000	198.00	3,366,000
OUGホールディングス	16,000	250.00	4,000,000
スターゼン	39,000	362.00	14,118,000
山善	38,400	1,107.00	42,508,800
椿本興業	11,000	353.00	3,883,000
住友商事	589,600	1,448.00	853,740,800
内田洋行	25,000	427.00	10,675,000
三菱商事	765,700	2,755.00	2,109,503,500
第一実業	24,000	631.00	15,144,000
キャノンマーケティングジャパン	28,500	2,147.00	61,189,500
西華産業	33,000	337.00	11,121,000
佐藤商事	9,000	807.00	7,263,000
菱洋エレクトロ	11,600	1,500.00	17,400,000
東京産業	10,000	497.00	4,970,000
ユアサ商事	8,800	2,854.00	25,115,200
神鋼商事	25,000	280.00	7,000,000
小林産業	7,400	248.00	1,835,200
阪和興業	100,000	558.00	55,800,000
カナデン	8,600	980.00	8,428,000
菱電商事	16,000	964.00	15,424,000
フルサト工業	5,500	1,867.00	10,268,500
岩谷産業	111,000	790.00	87,690,000
すてきナイスグループ	43,000	209.00	8,987,000
昭光通商	35,000	125.00	4,375,000
ニチモウ	16,000	198.00	3,168,000
極東貿易	12,000	341.00	4,092,000
イワキ	15,000	238.00	3,570,000
三愛石油	26,000	854.00	22,204,000
稲畑産業	24,000	1,373.00	32,952,000
G S Iクレオス	27,000	138.00	3,726,000

明和産業	8,000	430.00	3,440,000
ワキタ	21,300	1,279.00	27,242,700
東邦ホールディングス	34,500	2,657.00	91,666,500
サンゲツ	35,000	1,812.00	63,420,000
ミツウロコグループホールディングス	16,100	596.00	9,595,600
シナネン	22,000	496.00	10,912,000
伊藤忠エネクス	22,100	1,098.00	24,265,800
サンリオ	28,000	3,385.00	94,780,000
サンワテクノス	6,400	1,264.00	8,089,600
リョーサン	16,800	3,170.00	53,256,000
新光商事	11,800	1,263.00	14,903,400
トーホー	23,000	506.00	11,638,000
三信電気	13,800	1,242.00	17,139,600
東陽テクニカ	14,700	1,125.00	16,537,500
モスフードサービス	13,100	2,575.00	33,732,500
加賀電子	9,100	1,521.00	13,841,100
ソーダニッカ	10,400	550.00	5,720,000
立花エレテック	7,400	1,458.00	10,789,200
フォーバル	2,000	1,702.00	3,404,000
P a l t a c	16,000	2,037.00	32,592,000
三谷産業	10,700	474.00	5,071,800
ヤマタネ	50,000	201.00	10,050,000
丸紅建材リース	9,000	266.00	2,394,000
日鉄住金物産	66,000	457.00	30,162,000
トラスコ中山	12,500	3,995.00	49,937,500
オートバックスセブン	36,800	1,993.00	73,342,400
加藤産業	14,800	2,725.00	40,330,000
イノテック	9,300	482.00	4,482,600
イエローハット	9,400	2,391.00	22,475,400
J Kホールディングス	10,100	590.00	5,959,000
日伝	4,100	3,020.00	12,382,000
北沢産業	8,500	183.00	1,555,500
杉本商事	5,400	1,490.00	8,046,000
因幡電機産業	14,900	4,255.00	63,399,500
バイテック	3,400	1,284.00	4,365,600
ミスミグループ本社	37,400	5,250.00	196,350,000
アルテック	6,500	241.00	1,566,500
タキヒヨー	17,000	481.00	8,177,000
蔵王産業	1,400	1,416.00	1,982,400
スズケン	45,500	3,810.00	173,355,000
ジェコス	6,900	1,279.00	8,825,100
ルネサスイーストン	5,000	621.00	3,105,000

ローソン	37,900	8,320.00	315,328,000
サンエー	7,500	4,980.00	37,350,000
ダイユーエイト	2,300	813.00	1,869,900
カワチ薬品	7,800	1,859.00	14,500,200
エービーシー・マート	14,200	7,100.00	100,820,000
ハードオフコーポレーション	4,800	1,231.00	5,908,800
アスクル	10,400	3,505.00	36,452,000
ゲオホールディングス	18,900	1,458.00	27,556,200
アダストリア	8,400	4,000.00	33,600,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	13,000	119.00	1,547,000
くらコーポレーション	5,900	4,030.00	23,777,000
キャンドウ	4,800	1,532.00	7,353,600
パル	5,800	3,950.00	22,910,000
エディオン	46,000	903.00	41,538,000
サーラコーポレーション	8,600	587.00	5,048,200
ワッツ	4,000	1,000.00	4,000,000
あみやき亭	1,700	4,870.00	8,279,000
ひらまつ	13,900	779.00	10,828,100
ゲンキー	1,000	10,100.00	10,100,000
サッポロドラッグストア	1,000	1,740.00	1,740,000
大黒天物産	2,400	4,620.00	11,088,000
ハニーズ	8,800	964.00	8,483,200
ファーマライズホールディングス	2,000	595.00	1,190,000
アルペン	8,900	1,955.00	17,399,500
クオール	9,300	1,201.00	11,169,300
ジェイアイエヌ	6,800	4,940.00	33,592,000
ビックカメラ	49,300	1,334.00	65,766,200
D C Mホールディングス	48,500	1,133.00	54,950,500
Monotaro	19,500	4,365.00	85,117,500
きちり	2,100	697.00	1,463,700
アークランドサービス	1,200	5,240.00	6,288,000
J.フロント リテイリング	126,500	2,142.00	270,963,000
ドトール・日レスホールディングス	17,500	2,170.00	37,975,000
マツモトキヨシホールディングス	22,300	4,840.00	107,932,000
broncoビリー	1,800	5,310.00	9,558,000
スタートトゥデイ	31,100	3,170.00	98,587,000
トレジャー・ファクトリー	2,000	1,427.00	2,854,000
物語コーポレーション	2,800	3,980.00	11,144,000
ココカラファイン	10,400	3,760.00	39,104,000
三越伊勢丹ホールディングス	198,700	2,013.00	399,983,100
ウエルシアホールディングス	8,600	5,170.00	44,462,000
クリエイトSDホールディングス	4,900	5,440.00	26,656,000

丸善C H I ホールディングス	11,100	386.00	4,284,600
ミサワ	1,200	711.00	853,200
エー・ピーカンパニー	1,400	1,765.00	2,471,000
チムニー	1,900	3,130.00	5,947,000
ネクステージ	1,000	804.00	804,000
ジョイフル本田	7,300	4,915.00	35,879,500
キリン堂ホールディングス	3,300	1,220.00	4,026,000
すかいらーく	49,000	1,611.00	78,939,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,900	1,030.00	33,887,000
ブックオフコーポレーション	6,000	897.00	5,382,000
あさひ	6,600	1,133.00	7,477,800
日本調剤	1,300	6,010.00	7,813,000
コスモス薬品	5,000	15,700.00	78,500,000
トーエル	5,300	817.00	4,330,100
一六堂	2,500	450.00	1,125,000
セブン&アイ・ホールディングス	417,900	5,022.00	2,098,693,800
薬王堂	1,400	3,280.00	4,592,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,000	2,519.00	17,633,000
ツルハホールディングス	21,400	9,360.00	200,304,000
サンマルクホールディングス	7,200	4,085.00	29,412,000
フェリシモ	2,500	1,113.00	2,782,500
トリドール	10,800	1,602.00	17,301,600
クスリのアオキ	7,900	4,135.00	32,666,500
メディカルシステムネットワーク	9,200	478.00	4,397,600
総合メディカル	4,900	3,320.00	16,268,000
はるやま商事	4,200	760.00	3,192,000
カッパ・クリエイトホールディングス	15,600	1,161.00	18,111,600
ライトオン	7,600	1,007.00	7,653,200
良品計画	12,400	20,570.00	255,068,000
三城ホールディングス	12,400	469.00	5,815,600
アルビス	2,200	2,100.00	4,620,000
コナカ	11,800	727.00	8,578,600
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,456.00	1,601,600
G - 7ホールディングス	2,100	1,609.00	3,378,900
イオン北海道	6,900	648.00	4,471,200
コジマ	14,900	369.00	5,498,100
ヒマラヤ	2,700	1,028.00	2,775,600
コーナン商事	15,500	1,466.00	22,723,000
エコス	3,700	970.00	3,589,000
マルシェ	2,500	913.00	2,282,500
ドンキホーテホールディングス	32,200	9,170.00	295,274,000

西松屋チェーン	19,700	1,079.00	21,256,300
ゼンショーホールディングス	51,400	1,148.00	59,007,200
幸楽苑	6,400	1,539.00	9,849,600
ハークスレイ	2,900	984.00	2,853,600
サイゼリヤ	15,200	2,483.00	37,741,600
魚力	2,800	2,182.00	6,109,600
ポブラ	2,500	549.00	1,372,500
ユナイテッドアローズ	13,100	3,825.00	50,107,500
ハイデイ日高	7,600	2,987.00	22,701,200
京都きもの友禅	5,900	1,000.00	5,900,000
コロワイド	33,300	1,919.00	63,902,700
壱番屋	4,500	5,050.00	22,725,000
トップカルチャー	4,500	510.00	2,295,000
P L A N T	2,400	1,485.00	3,564,000
スギホールディングス	17,900	6,020.00	107,758,000
スクロール	13,000	294.00	3,822,000
ヨンドシーホールディングス	7,600	2,718.00	20,656,800
ファミリーマート	33,800	5,450.00	184,210,000
木曽路	12,200	2,002.00	24,424,400
サトレストランシステムズ	9,600	911.00	8,745,600
千趣会	18,000	868.00	15,624,000
タカキュー	7,100	218.00	1,547,800
ケーヨー	19,500	574.00	11,193,000
上新電機	22,000	936.00	20,592,000
日本瓦斯	16,100	3,405.00	54,820,500
ベスト電器	32,200	147.00	4,733,400
ロイヤルホールディングス	16,700	2,104.00	35,136,800
東天紅	7,000	185.00	1,295,000
いなげや	11,300	1,334.00	15,074,200
島忠	25,900	3,215.00	83,268,500
チヨダ	11,800	2,738.00	32,308,400
ライフコーポレーション	6,400	2,598.00	16,627,200
リンガーハット	9,800	2,287.00	22,412,600
Mr Max	10,900	270.00	2,943,000
テンアライド	8,400	382.00	3,208,800
A O K Iホールディングス	23,000	1,708.00	39,284,000
オークワ	16,000	1,029.00	16,464,000
コメリ	17,100	2,801.00	47,897,100
青山商事	25,100	4,680.00	117,468,000
しまむら	11,600	12,510.00	145,116,000
C F S コーポレーション	6,800	1,025.00	6,970,000
はせがわ	3,600	536.00	1,929,600

高島屋	145,000	1,131.00	163,995,000
松屋	20,200	2,207.00	44,581,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	47,300	2,226.00	105,289,800
近鉄百貨店	38,000	337.00	12,806,000
ニッセンホールディングス	21,300	262.00	5,580,600
パルコ	9,700	1,146.00	11,116,200
丸井グループ	105,200	1,548.00	162,849,600
アクシアル リテイリング	7,800	3,085.00	24,063,000
イオン	412,200	1,573.00	648,390,600
ユニーグループ・ホールディングス	96,300	710.00	68,373,000
イズミ	22,400	4,695.00	105,168,000
東武ストア	13,000	319.00	4,147,000
平和堂	20,300	2,903.00	58,930,900
フジ	11,300	2,293.00	25,910,900
ヤオコー	11,300	5,270.00	59,551,000
ゼビオ	13,600	2,380.00	32,368,000
ケーズホールディングス	23,000	4,460.00	102,580,000
Olympicグループ	6,100	819.00	4,995,900
日産東京販売ホールディングス	17,000	345.00	5,865,000
アインファーマシーズ	12,000	4,680.00	56,160,000
元気寿司	3,100	2,374.00	7,359,400
ヤマダ電機	395,400	513.00	202,840,200
アークランドサカモト	7,200	2,941.00	21,175,200
ニトリホールディングス	43,200	8,870.00	383,184,000
グルメ杵屋	7,000	970.00	6,790,000
愛眼	7,900	244.00	1,927,600
ケーユーホールディングス	5,200	744.00	3,868,800
吉野家ホールディングス	28,200	1,440.00	40,608,000
松屋フーズ	4,800	2,330.00	11,184,000
サガミチェーン	13,000	1,224.00	15,912,000
関西スーパーマーケット	7,600	805.00	6,118,000
王将フードサービス	7,300	4,150.00	30,295,000
プレナス	11,200	2,218.00	24,841,600
ミニストップ	7,500	1,934.00	14,505,000
アークス	17,400	2,583.00	44,944,200
バロー	21,600	2,712.00	58,579,200
藤久	800	1,742.00	1,393,600
ベルク	4,500	3,450.00	15,525,000
大庄	4,700	1,540.00	7,238,000
ファーストリテイリング	20,000	51,000.00	1,020,000,000
サンドラッグ	21,100	6,490.00	136,939,000
サクスパー ホールディングス	7,500	2,075.00	15,562,500

ヤマザワ	2,100	1,710.00	3,591,000
やまや	1,700	1,859.00	3,160,300
ペルーナ	25,100	600.00	15,060,000
島根銀行	2,100	1,589.00	3,336,900
じもとホールディングス	71,700	221.00	15,845,700
足利ホールディングス	62,800	516.00	32,404,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	12,900	4,110.00	53,019,000
新生銀行	951,000	247.00	234,897,000
あおぞら銀行	674,000	471.00	317,454,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,016,400	877.00	7,030,382,800
りそなホールディングス	1,168,800	687.50	803,550,000
三井住友トラスト・ホールディングス	2,207,000	536.60	1,184,276,200
三井住友フィナンシャルグループ	755,600	5,488.00	4,146,732,800
第四銀行	126,000	501.00	63,126,000
北越銀行	108,000	255.00	27,540,000
西日本シティ銀行	351,000	346.00	121,446,000
千葉銀行	385,000	951.00	366,135,000
横浜銀行	670,000	762.00	510,540,000
常陽銀行	361,000	663.00	239,343,000
群馬銀行	237,000	864.00	204,768,000
武蔵野銀行	15,900	4,660.00	74,094,000
千葉興業銀行	20,700	939.00	19,437,300
筑波銀行	41,500	408.00	16,932,000
七十七銀行	169,000	722.00	122,018,000
青森銀行	78,000	406.00	31,668,000
秋田銀行	66,000	387.00	25,542,000
山形銀行	60,000	530.00	31,800,000
岩手銀行	7,000	5,660.00	39,620,000
東邦銀行	89,000	558.00	49,662,000
東北銀行	54,000	168.00	9,072,000
みちのく銀行	50,000	216.00	10,800,000
ふくおかフィナンシャルグループ	405,000	650.00	263,250,000
静岡銀行	293,000	1,303.00	381,779,000
十六銀行	125,000	485.00	60,625,000
スルガ銀行	105,500	2,644.00	278,942,000
八十二銀行	181,000	921.00	166,701,000
山梨中央銀行	62,000	565.00	35,030,000
大垣共立銀行	125,000	443.00	55,375,000
福井銀行	85,000	268.00	22,780,000
北國銀行	111,000	434.00	48,174,000
清水銀行	3,400	3,455.00	11,747,000
滋賀銀行	100,000	655.00	65,500,000

南都銀行	96,000	440.00	42,240,000
百五銀行	96,000	590.00	56,640,000
京都銀行	191,000	1,367.00	261,097,000
紀陽銀行	39,200	1,806.00	70,795,200
三重銀行	44,000	288.00	12,672,000
ほくほくフィナンシャルグループ	680,000	284.00	193,120,000
広島銀行	295,000	723.00	213,285,000
山陰合同銀行	61,000	1,197.00	73,017,000
中国銀行	70,800	1,878.00	132,962,400
鳥取銀行	32,000	234.00	7,488,000
伊予銀行	106,900	1,489.00	159,174,100
百十四銀行	110,000	446.00	49,060,000
四国銀行	77,000	267.00	20,559,000
阿波銀行	82,000	775.00	63,550,000
鹿児島銀行	69,000	869.00	59,961,000
大分銀行	61,000	512.00	31,232,000
宮崎銀行	67,000	472.00	31,624,000
肥後銀行	82,000	780.00	63,960,000
佐賀銀行	61,000	305.00	18,605,000
十八銀行	61,000	375.00	22,875,000
沖縄銀行	7,900	5,360.00	42,344,000
琉球銀行	20,600	1,827.00	37,636,200
セブン銀行	336,900	572.00	192,706,800
みずほフィナンシャルグループ	13,933,400	256.80	3,578,097,120
高知銀行	39,000	174.00	6,786,000
山口フィナンシャルグループ	100,000	1,549.00	154,900,000
長野銀行	33,000	218.00	7,194,000
名古屋銀行	90,000	476.00	42,840,000
北洋銀行	150,500	509.00	76,604,500
愛知銀行	3,600	6,820.00	24,552,000
第三銀行	56,000	193.00	10,808,000
中京銀行	41,000	228.00	9,348,000
東日本銀行	44,000	450.00	19,800,000
大光銀行	35,000	245.00	8,575,000
愛媛銀行	59,000	268.00	15,812,000
トマト銀行	39,000	202.00	7,878,000
みなと銀行	90,000	309.00	27,810,000
京葉銀行	82,000	650.00	53,300,000
関西アーバン銀行	13,900	1,444.00	20,071,600
栃木銀行	50,000	702.00	35,100,000
北日本銀行	3,100	3,425.00	10,617,500
東和銀行	140,000	119.00	16,660,000

福島銀行	123,000	101.00	12,423,000
大東銀行	64,000	174.00	11,136,000
トモニホールディングス	76,700	558.00	42,798,600
フィデアホールディングス	59,200	272.00	16,102,400
池田泉州ホールディングス	95,200	573.00	54,549,600
F P G	26,700	914.00	24,403,800
S B Iホールディングス	120,200	1,739.00	209,027,800
ジャフコ	13,700	4,730.00	64,801,000
大和証券グループ本社	935,000	937.20	876,282,000
野村ホールディングス	2,042,900	819.50	1,674,156,550
岡三証券グループ	85,000	884.00	75,140,000
丸三証券	32,000	1,210.00	38,720,000
東洋証券	39,000	393.00	15,327,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	114,900	884.00	101,571,600
光世証券	25,000	232.00	5,800,000
水戸証券	31,600	442.00	13,967,200
いちよし証券	21,200	1,202.00	25,482,400
松井証券	51,000	1,061.00	54,111,000
だいこう証券ビジネス	5,100	983.00	5,013,300
マネックスグループ	118,300	348.00	41,168,400
カブドットコム証券	44,600	827.00	36,884,200
極東証券	13,500	1,808.00	24,408,000
岩井コスモホールディングス	10,400	1,586.00	16,494,400
藍澤証券	14,200	821.00	11,658,200
マネースクウェアHD	3,400	1,415.00	4,811,000
マネーパートナーズグループ	11,000	385.00	4,235,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	221,900	4,315.00	957,498,500
アニコムホールディングス	4,300	2,200.00	9,460,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	318,500	3,773.00	1,201,700,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	95,700	2,088.00	199,821,600
第一生命保険	640,200	2,283.50	1,461,896,700
東京海上ホールディングス	404,800	4,905.00	1,985,544,000
T & Dホールディングス	364,100	1,837.50	669,033,750
全国保証	26,000	4,100.00	106,600,000
クレディセゾン	81,600	2,479.00	202,286,400
アクリーティブ	6,800	571.00	3,882,800
芙蓉総合リース	10,500	5,100.00	53,550,000
興銀リース	18,800	2,698.00	50,722,400
東京センチュリーリース	23,500	3,750.00	88,125,000
日本証券金融	44,000	743.00	32,692,000
アイフル	167,200	389.00	65,040,800
ポケットカード	7,500	532.00	3,990,000

リコーリース	7,900	3,645.00	28,795,500
イオンフィナンシャルサービス	65,500	2,868.00	187,854,000
アコム	200,700	436.00	87,505,200
ジャックス	55,000	607.00	33,385,000
オリエントコーポレーション	230,900	219.00	50,567,100
日立キャピタル	19,600	3,120.00	61,152,000
アプラスフィナンシャル	47,900	137.00	6,562,300
オリックス	707,300	1,886.50	1,334,321,450
三菱UFJリース	253,400	645.00	163,443,000
日本取引所グループ	146,700	3,695.00	542,056,500
イー・ギャランティ	2,900	2,163.00	6,272,700
アサックス	1,700	1,588.00	2,699,600
NECキャピタルソリューション	4,100	1,836.00	7,527,600
日本駐車場開発	108,900	187.00	20,364,300
ヒューリック	185,600	1,198.00	222,348,800
東京建物不動産販売	5,300	545.00	2,888,500
三栄建築設計	4,100	1,011.00	4,145,100
野村不動産ホールディングス	60,100	2,530.00	152,053,000
三重交通グループホールディングス	17,800	476.00	8,472,800
日本商業開発	3,200	1,853.00	5,929,600
プレサンスコーポレーション	3,100	4,150.00	12,865,000
常和ホールディングス	5,500	4,560.00	25,080,000
日本管理センター	5,000	1,626.00	8,130,000
サンセイランディック	1,200	825.00	990,000
エストラスト	1,100	624.00	686,400
フージャースホールディングス	15,000	508.00	7,620,000
オープンハウス	6,500	3,645.00	23,692,500
東急不動産ホールディングス	261,900	913.00	239,114,700
飯田グループホールディングス	64,800	1,906.00	123,508,800
パーク24	50,300	2,126.00	106,937,800
パラカ	3,500	1,321.00	4,623,500
三井不動産	530,000	3,533.50	1,872,755,000
三菱地所	743,000	2,677.00	1,989,011,000
平和不動産	18,900	1,692.00	31,978,800
東京建物	218,000	893.00	194,674,000
ダイビル	25,800	1,146.00	29,566,800
京阪神ビルディング	16,600	726.00	12,051,600
住友不動産	239,000	4,525.50	1,081,594,500
大京	159,000	185.00	29,415,000
テーオーシー	34,500	915.00	31,567,500
東京楽天地	16,000	502.00	8,032,000
レオパレス21	109,400	693.00	75,814,200

スタートコーポレーション	11,500	1,883.00	21,654,500
フジ住宅	12,800	690.00	8,832,000
空港施設	12,200	675.00	8,235,000
明和地所	5,800	621.00	3,601,800
住友不動産販売	7,200	3,020.00	21,744,000
ゴールドクレスト	9,000	2,300.00	20,700,000
日本エスリード	3,900	1,278.00	4,984,200
日神不動産	13,400	453.00	6,070,200
タカラレーベン	44,300	749.00	33,180,700
サンヨーハウジング名古屋	5,700	1,242.00	7,079,400
イオンモール	64,500	2,176.00	140,352,000
ファースト住建	3,800	1,463.00	5,559,400
トーセイ	13,700	877.00	12,014,900
穴吹興産	9,000	262.00	2,358,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	62,100	1,237.00	76,817,700
サンフロンティア不動産	10,800	1,028.00	11,102,400
エフ・ジェー・ネクスト	6,900	594.00	4,098,600
ランドビジネス	5,200	400.00	2,080,000
グランディハウス	8,900	356.00	3,168,400
日本空港ビルデング	34,500	6,860.00	236,670,000
日本工営	35,000	501.00	17,535,000
ネクスト	25,000	808.00	20,200,000
日本M&Aセンター	16,300	4,730.00	77,099,000
ノバレーゼ	3,000	923.00	2,769,000
アコーディア・ゴルフ	40,400	1,158.00	46,783,200
タケエイ	9,300	1,182.00	10,992,600
トラスト・テック	1,900	2,212.00	4,202,800
パソナグループ	8,000	964.00	7,712,000
CDS	2,400	1,021.00	2,450,400
リンクアンドモチベーション	15,700	167.00	2,621,900
GCAサヴィアン	8,400	1,368.00	11,491,200
エス・エム・エス	11,900	1,554.00	18,492,600
テンプホールディングス	20,800	4,255.00	88,504,000
リニカル	2,900	1,174.00	3,404,600
クックパッド	6,700	5,340.00	35,778,000
エスクリ	4,300	1,108.00	4,764,400
アイ・ケイ・ケイ	6,400	620.00	3,968,000
学情	4,000	1,314.00	5,256,000
スタジオアリス	4,900	2,218.00	10,868,200
シミックホールディングス	4,400	1,638.00	7,207,200
NJS	2,400	1,570.00	3,768,000
総合警備保障	35,300	4,480.00	158,144,000

カカクコム	69,700	1,852.00	129,084,400
アイロムホールディングス	2,700	2,108.00	5,691,600
ルネサンス	5,700	1,277.00	7,278,900
ディップ	2,300	10,320.00	23,736,000
オプトホールディング	4,800	708.00	3,398,400
ツクイ	13,100	900.00	11,790,000
総合臨床ホールディングス	5,000	498.00	2,490,000
キャリアデザインセンター	3,100	1,279.00	3,964,900
エムスリー	91,500	2,285.00	209,077,500
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	799.00	6,631,700
アウトソーシング	4,200	1,894.00	7,954,800
ウェルネット	2,900	2,850.00	8,265,000
ディー・エヌ・エー	52,100	2,427.00	126,446,700
博報堂D Yホールディングス	146,600	1,268.00	185,888,800
ぐるなび	12,200	1,972.00	24,058,400
エスアールジータカミヤ	9,200	726.00	6,679,200
一休	8,300	2,496.00	20,716,800
ファンコミュニケーションズ	24,400	997.00	24,326,800
ジェイコムホールディングス	2,600	936.00	2,433,600
P G Mホールディングス	15,400	1,306.00	20,112,400
W D Bホールディングス	3,200	1,217.00	3,894,400
ティア	3,400	635.00	2,159,000
バリューコマース	8,800	583.00	5,130,400
J Pホールディングス	27,700	344.00	9,528,800
E P Sホールディングス	9,700	1,434.00	13,909,800
プレステージ・インターナショナル	8,100	905.00	7,330,500
アミューズ	3,200	4,095.00	13,104,000
ドリームインキュベータ	3,700	2,597.00	9,608,900
クイック	4,000	1,025.00	4,100,000
T A C	7,500	217.00	1,627,500
ケネディクス	151,300	514.00	77,768,200
電通	117,800	5,920.00	697,376,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,700	802.00	3,769,400
ぴあ	3,100	2,303.00	7,139,300
イオンファンタジー	3,500	2,136.00	7,476,000
ネクシィーズ	4,000	649.00	2,596,000
みらかホールディングス	27,000	5,930.00	160,110,000
アルプス技研	4,300	2,365.00	10,169,500
ダイオーズ	2,300	1,078.00	2,479,400
日本空調サービス	5,300	938.00	4,971,400
オリエンタルランド	114,300	7,907.00	903,770,100
ダスキン	29,900	2,155.00	64,434,500

明光ネットワークジャパン	10,800	1,415.00	15,282,000
ファルコホールディングス	4,600	1,469.00	6,757,400
田谷	1,800	787.00	1,416,600
ラウンドワン	30,500	590.00	17,995,000
リゾートトラスト	40,200	3,015.00	121,203,000
ビー・エム・エル	6,200	3,580.00	22,196,000
ワタベウェディング	4,000	485.00	1,940,000
もしもしホットライン	19,700	1,465.00	28,860,500
早稲田アカデミー	1,700	855.00	1,453,500
ユー・エス・エス	128,000	2,210.00	282,880,000
東京個別指導学院	5,500	625.00	3,437,500
サイバーエージェント	25,800	5,410.00	139,578,000
楽天	459,900	1,883.50	866,221,650
テー・オー・ダブリュー	3,200	1,052.00	3,366,400
セントラルスポーツ	3,800	2,286.00	8,686,800
フルキャストホールディングス	10,900	705.00	7,684,500
リゾートソリューション	12,000	277.00	3,324,000
テクノプロ・ホールディングス	15,200	3,105.00	47,196,000
リブセンス	6,600	603.00	3,979,800
ジャパンマテリアル	4,400	1,825.00	8,030,000
ベクトル	1,900	1,804.00	3,427,600
ウチヤマホールディングス	5,300	538.00	2,851,400
サクセスホールディングス	1,300	1,476.00	1,918,800
キャリアリンク	1,400	1,792.00	2,508,800
アサンテ	2,800	1,545.00	4,326,000
N・フィールド	2,700	1,886.00	5,092,200
M&Aキャピタルパートナーズ	300	2,897.00	869,100
E R Iホールディングス	2,900	991.00	2,873,900
アビスト	1,300	1,423.00	1,849,900
ウィルグループ	1,100	1,604.00	1,764,400
リクルートホールディングス	159,900	3,895.00	622,810,500
リロ・ホールディング	3,600	10,860.00	39,096,000
東祥	2,300	2,545.00	5,853,500
エイチ・アイ・エス	17,200	4,045.00	69,574,000
共立メンテナンス	6,300	7,160.00	45,108,000
イチネンホールディングス	11,700	1,160.00	13,572,000
建設技術研究所	6,300	1,241.00	7,818,300
スペース	5,700	1,260.00	7,182,000
燦ホールディングス	2,100	1,771.00	3,719,100
スバル興業	8,000	433.00	3,464,000
東京テアトル	40,000	142.00	5,680,000
よみうりランド	22,000	446.00	9,812,000

東京都競馬	72,000	290.00	20,880,000
カナモト	14,800	3,205.00	47,434,000
東京ドーム	74,000	540.00	39,960,000
西尾レントオール	8,600	3,125.00	26,875,000
トランス・コスモス	13,800	3,005.00	41,469,000
乃村工藝社	20,700	1,384.00	28,648,800
藤田観光	38,000	412.00	15,656,000
KNT-CTホールディングス	46,000	167.00	7,682,000
日本管財	5,200	2,742.00	14,258,400
トーカイ	4,700	4,485.00	21,079,500
白洋舎	13,000	266.00	3,458,000
セコム	102,700	8,127.00	834,642,900
セントラル警備保障	4,800	1,391.00	6,676,800
丹青社	12,200	1,059.00	12,919,800
メイテック	14,200	4,470.00	63,474,000
アサツー ディ・ケイ	19,900	3,030.00	60,297,000
応用地質	11,100	1,695.00	18,814,500
船井総研ホールディングス	11,400	1,370.00	15,618,000
進学会	4,700	600.00	2,820,000
ベネッセホールディングス	38,600	3,255.00	125,643,000
イオンディライト	10,200	3,405.00	34,731,000
ナック	6,700	1,013.00	6,787,100
ニチイ学館	21,100	1,019.00	21,500,900
ダイセキ	17,000	2,432.00	41,344,000
ステップ	3,500	989.00	3,461,500
合計	168,426,150		241,220,667,440

(注)代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,770,409,058
国債証券	259,498,201,550
地方債証券	19,727,081,895
特殊債券	26,917,546,667
社債券	17,424,535,310
未収入金	995,858,500
未収利息	1,154,348,475
前払費用	23,733,489
流動資産合計	327,511,714,944
資産合計	327,511,714,944
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,153,240
未払金	140,282,800
未払解約金	405,344,854
流動負債合計	548,780,894
負債合計	548,780,894
純資産の部	
元本等	
元本	254,586,079,485
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,376,854,565
元本等合計	326,962,934,050
純資産合計	326,962,934,050
負債純資産合計	327,511,714,944

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 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>

平成27年 6月10日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	254,586,079,485口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 105,751,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2843円 (1万口当たり純資産額) (12,843円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27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27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27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26年12月11日
期首元本額	280,376,950,176円
期中追加設定元本額	9,200,782,402円

区分	平成27年 6月10日現在
期中一部解約元本額	34,991,653,093円
期末元本額	254,586,079,485円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	2,356,695,786円
D C日本債券インデックスファンド	2,657,500,040円
D C日本債券インデックスファンドL	29,496,228,007円
D Cバランスファンド30	4,744,504,152円
D Cバランスファンド50	3,351,831,656円
D Cバランスファンド70	926,491,332円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	85,834,521円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	48,197,521円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	339,281,271円
新生・4分散ファンド	104,791,111円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	20,809,188円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	75,940,546円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	123,950,528円
日本債券インデックスe	2,046,999,994円
インデックスコレクション（国内債券）	5,576,725,198円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,231,680,606円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,553,274,591円
インデックスコレクション（バランス株式70）	735,134,124円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	39,705,133,514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）	5,186,244,170円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	2,690,554,131円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	10,551,960,032円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	3,495,078,617円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	630,891,918円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	3,137,964,941円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	9,417,685,232円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,063,240,340円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	23,687,060,164円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	217,665,460円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	16,972,083,660円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	5,142,229,954円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	419,897,750円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	1,801,267,441円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	215,286,058円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	5,402,824,301円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	693,953,042円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	1,374,618,063円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	325,214,731円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,194,778,771円

区分	平成27年 6月10日現在
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	6,410,348,378円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	415,986,047円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,954,183,594円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	47,625,444,604円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	974,339,085円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	254,459,323円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	86,653,148円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,048,270,804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）	9,395,211円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	5,496,829円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 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	3,641,389,000
地方債証券	216,206,692
特殊債証券	271,026,522
社債証券	118,785,250
合計	4,247,407,464

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成27年 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	1,466,753,240	-	1,463,600,000	3,153,240
合計		1,466,753,240	-	1,463,600,000	3,153,240

(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342回利付国債(2年)	780,000,000	780,928,200	
	第343回利付国債(2年)	2,050,000,000	2,052,644,500	
	第344回利付国債(2年)	1,470,000,000	1,472,028,600	
	第345回利付国債(2年)	3,090,000,000	3,094,542,300	
	第349回利付国債(2年)	870,000,000	871,600,800	
	第350回利付国債(2年)	690,000,000	691,331,700	
	第353回利付国債(2年)	140,000,000	140,294,000	
	第99回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,889,813,600	
	第100回利付国債(5年)	1,150,000,000	1,154,531,000	
	第101回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,267,862,400	
	第102回利付国債(5年)	2,535,000,000	2,546,965,200	
	第103回利付国債(5年)	2,730,000,000	2,744,714,700	
	第104回利付国債(5年)	200,000,000	200,724,000	
	第105回利付国債(5年)	3,522,000,000	3,535,876,680	
	第106回利付国債(5年)	5,280,000,000	5,303,390,400	
	第107回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,718,396,100	
	第108回利付国債(5年)	880,000,000	882,103,200	
	第109回利付国債(5年)	1,380,000,000	1,383,243,000	
	第110回利付国債(5年)	370,000,000	372,919,300	
	第111回利付国債(5年)	1,230,000,000	1,243,099,500	
	第112回利付国債(5年)	660,000,000	667,669,200	
	第113回利付国債(5年)	2,030,000,000	2,047,458,000	
	第114回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,311,908,000	
	第115回利付国債(5年)	1,970,000,000	1,981,583,600	
	第116回利付国債(5年)	3,490,000,000	3,509,613,800	
	第117回利付国債(5年)	3,070,000,000	3,087,314,800	
	第118回利付国債(5年)	1,720,000,000	1,729,305,200	
	第119回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,502,100,000	
	第120回利付国債(5年)	1,340,000,000	1,346,847,400	
	第121回利付国債(5年)	1,830,000,000	1,831,555,500	
	第122回利付国債(5年)	3,330,000,000	3,330,000,000	
	第123回利付国債(5年)	3,805,000,000	3,802,260,400	
	第1回利付国債(40年)	230,000,000	280,091,700	
第2回利付国債(40年)	500,000,000	583,685,000		

第3回利付国債（40年）	510,000,000	595,659,600	
第4回利付国債（40年）	675,000,000	788,663,250	
第5回利付国債（40年）	630,000,000	701,322,300	
第6回利付国債（40年）	670,000,000	725,864,600	
第7回利付国債（40年）	570,000,000	583,634,400	
第8回利付国債（40年）	60,000,000	56,061,000	
第282回利付国債（10年）	1,900,000,000	1,941,382,000	
第283回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,329,978,000	
第284回利付国債（10年）	2,400,000,000	2,462,520,000	
第285回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,565,123,300	
第286回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,450,792,000	
第287回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,339,419,900	
第288回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,142,383,000	
第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	2,127,305,500	
第290回利付国債（10年）	900,000,000	934,641,000	
第291回利付国債（10年）	820,000,000	849,290,400	
第292回利付国債（10年）	550,000,000	575,734,500	
第293回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,159,301,000	
第294回利付国債（10年）	900,000,000	945,801,000	
第295回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,138,886,500	
第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	2,253,737,500	
第297回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,205,234,500	
第298回利付国債（10年）	1,360,000,000	1,420,533,600	
第299回利付国債（10年）	1,140,000,000	1,193,614,200	
第300回利付国債（10年）	550,000,000	580,008,000	
第301回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,798,209,000	
第302回利付国債（10年）	870,000,000	916,771,200	
第303回利付国債（10年）	1,640,000,000	1,732,200,800	
第304回利付国債（10年）	740,000,000	778,450,400	
第305回利付国債（10年）	2,200,000,000	2,319,394,000	
第306回利付国債（10年）	1,370,000,000	1,453,857,700	
第307回利付国債（10年）	970,000,000	1,024,766,200	
第308回利付国債（10年）	970,000,000	1,026,871,100	
第309回利付国債（10年）	1,040,000,000	1,090,596,000	
第310回利付国債（10年）	1,670,000,000	1,745,634,300	
第311回利付国債（10年）	840,000,000	869,248,800	
第312回利付国債（10年）	2,427,000,000	2,566,576,770	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,533,844,800	
第314回利付国債（10年）	620,000,000	653,318,800	
第315回利付国債（10年）	1,130,000,000	1,198,658,800	
第316回利付国債（10年）	570,000,000	601,236,000	
第317回利付国債（10年）	680,000,000	718,141,200	

第318回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,249,761,800	
第319回利付国債(10年)	740,000,000	782,379,800	
第320回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,796,919,300	
第321回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,734,100,500	
第322回利付国債(10年)	810,000,000	845,891,100	
第323回利付国債(10年)	840,000,000	877,674,000	
第324回利付国債(10年)	1,450,000,000	1,504,505,500	
第325回利付国債(10年)	2,735,000,000	2,834,362,550	
第326回利付国債(10年)	560,000,000	575,842,400	
第327回利付国債(10年)	870,000,000	901,006,800	
第328回利付国債(10年)	2,395,000,000	2,443,043,700	
第329回利付国債(10年)	2,735,000,000	2,831,025,850	
第330回利付国債(10年)	2,080,000,000	2,151,801,600	
第331回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,598,982,200	
第332回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,418,195,200	
第333回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,130,850,800	
第334回利付国債(10年)	3,630,000,000	3,686,773,200	
第335回利付国債(10年)	3,345,000,000	3,362,862,300	
第336回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,334,841,200	
第337回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,276,274,000	
第338回利付国債(10年)	3,540,000,000	3,515,184,600	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	63,297,500	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	121,355,000	
第3回利付国債(30年)	200,000,000	240,026,000	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	244,499,600	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	213,208,200	
第6回利付国債(30年)	270,000,000	327,534,300	
第7回利付国債(30年)	390,000,000	466,810,500	
第8回利付国債(30年)	270,000,000	301,635,900	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	189,603,000	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	170,379,100	
第11回利付国債(30年)	280,000,000	307,115,200	
第12回利付国債(30年)	370,000,000	429,562,600	
第13回利付国債(30年)	350,000,000	400,008,000	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	422,429,000	
第15回利付国債(30年)	500,000,000	612,035,000	
第16回利付国債(30年)	250,000,000	305,657,500	
第17回利付国債(30年)	420,000,000	505,314,600	
第18回利付国債(30年)	540,000,000	640,024,200	
第19回利付国債(30年)	300,000,000	354,990,000	
第20回利付国債(30年)	290,000,000	353,202,600	
第21回利付国債(30年)	410,000,000	484,665,100	

第22回利付国債(30年)	410,000,000	499,031,500
第23回利付国債(30年)	370,000,000	450,367,700
第24回利付国債(30年)	330,000,000	401,682,600
第25回利付国債(30年)	400,000,000	472,032,000
第26回利付国債(30年)	700,000,000	839,195,000
第27回利付国債(30年)	600,000,000	730,668,000
第28回利付国債(30年)	790,000,000	963,326,000
第29回利付国債(30年)	570,000,000	685,088,700
第30回利付国債(30年)	890,000,000	1,053,519,700
第31回利付国債(30年)	880,000,000	1,024,240,800
第32回利付国債(30年)	980,000,000	1,161,437,200
第33回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,391,875,200
第34回利付国債(30年)	910,000,000	1,059,904,300
第35回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,402,137,500
第36回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,301,856,400
第37回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,396,707,900
第38回利付国債(30年)	885,000,000	952,923,750
第39回利付国債(30年)	540,000,000	593,146,800
第40回利付国債(30年)	880,000,000	945,551,200
第41回利付国債(30年)	685,000,000	719,551,400
第42回利付国債(30年)	820,000,000	860,737,600
第43回利付国債(30年)	925,000,000	970,251,000
第44回利付国債(30年)	980,000,000	1,027,177,200
第45回利付国債(30年)	720,000,000	720,000,000
第46回利付国債(30年)	1,180,000,000	1,180,000,000
第33回利付国債(20年)	430,000,000	450,872,200
第34回利付国債(20年)	70,000,000	74,342,100
第35回利付国債(20年)	270,000,000	285,743,700
第37回利付国債(20年)	410,000,000	438,851,700
第39回利付国債(20年)	640,000,000	685,894,400
第40回利付国債(20年)	450,000,000	483,489,000
第41回利付国債(20年)	620,000,000	653,945,000
第42回利付国債(20年)	380,000,000	416,461,000
第43回利付国債(20年)	340,000,000	380,837,400
第44回利付国債(20年)	370,000,000	412,054,200
第45回利付国債(20年)	270,000,000	299,335,500
第46回利付国債(20年)	290,000,000	319,983,100
第47回利付国債(20年)	470,000,000	520,985,600
第48回利付国債(20年)	230,000,000	259,693,000
第49回利付国債(20年)	280,000,000	311,172,400
第50回利付国債(20年)	590,000,000	648,929,200
第51回利付国債(20年)	240,000,000	266,191,200
第52回利付国債(20年)	430,000,000	480,942,100

第53回利付国債(20年)	350,000,000	392,693,000	
第54回利付国債(20年)	280,000,000	315,854,000	
第55回利付国債(20年)	490,000,000	548,016,000	
第56回利付国債(20年)	410,000,000	459,671,500	
第57回利付国債(20年)	360,000,000	401,126,400	
第58回利付国債(20年)	250,000,000	278,870,000	
第59回利付国債(20年)	440,000,000	485,320,000	
第60回利付国債(20年)	570,000,000	615,902,100	
第61回利付国債(20年)	390,000,000	409,792,500	
第62回利付国債(20年)	250,000,000	258,877,500	
第63回利付国債(20年)	570,000,000	635,230,800	
第64回利付国債(20年)	410,000,000	460,913,800	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	416,945,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	369,141,300	
第67回利付国債(20年)	310,000,000	349,841,200	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	265,638,500	
第69回利付国債(20年)	530,000,000	607,364,100	
第70回利付国債(20年)	490,000,000	575,583,400	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	462,896,000	
第72回利付国債(20年)	710,000,000	816,833,700	
第73回利付国債(20年)	540,000,000	617,279,400	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	357,361,800	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	415,782,000	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	386,134,600	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	332,221,100	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	22,748,200	
第79回利付国債(20年)	570,000,000	654,092,100	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	289,140,000	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	206,787,600	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	562,202,300	
第83回利付国債(20年)	420,000,000	487,422,600	
第84回利付国債(20年)	690,000,000	793,865,700	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	418,222,800	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	283,857,600	
第87回利付国債(20年)	360,000,000	421,894,800	
第88回利付国債(20年)	530,000,000	628,012,900	
第89回利付国債(20年)	480,000,000	563,472,000	
第90回利付国債(20年)	620,000,000	728,983,600	
第91回利付国債(20年)	510,000,000	605,385,300	
第92回利付国債(20年)	640,000,000	746,284,800	
第93回利付国債(20年)	500,000,000	577,905,000	
第94回利付国債(20年)	870,000,000	1,015,690,200	

第95回利付国債(20年)	510,000,000	607,894,500
第96回利付国債(20年)	300,000,000	350,457,000
第97回利付国債(20年)	620,000,000	732,567,200
第98回利付国債(20年)	450,000,000	526,261,500
第99回利付国債(20年)	880,000,000	1,030,154,400
第100回利付国債(20年)	800,000,000	946,768,000
第101回利付国債(20年)	360,000,000	434,793,600
第102回利付国債(20年)	500,000,000	604,320,000
第103回利付国債(20年)	300,000,000	358,782,000
第104回利付国債(20年)	360,000,000	421,657,200
第105回利付国債(20年)	650,000,000	761,910,500
第106回利付国債(20年)	310,000,000	367,142,300
第107回利付国債(20年)	430,000,000	504,054,600
第108回利付国債(20年)	810,000,000	928,357,200
第109回利付国債(20年)	500,000,000	573,195,000
第110回利付国債(20年)	565,000,000	662,259,100
第111回利付国債(20年)	320,000,000	379,350,400
第112回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,207,180,600
第113回利付国債(20年)	880,000,000	1,031,844,000
第114回利付国債(20年)	700,000,000	820,540,000
第115回利付国債(20年)	450,000,000	533,704,500
第116回利付国債(20年)	520,000,000	616,974,800
第117回利付国債(20年)	770,000,000	902,817,300
第118回利付国債(20年)	500,000,000	578,905,000
第119回利付国債(20年)	480,000,000	542,548,800
第120回利付国債(20年)	500,000,000	551,050,000
第121回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,143,490,000
第122回利付国債(20年)	610,000,000	688,805,900
第123回利付国債(20年)	880,000,000	1,030,849,600
第124回利付国債(20年)	400,000,000	462,764,000
第125回利付国債(20年)	300,000,000	355,821,000
第126回利付国債(20年)	530,000,000	613,051,000
第127回利付国債(20年)	650,000,000	742,326,000
第128回利付国債(20年)	640,000,000	730,124,800
第129回利付国債(20年)	450,000,000	506,709,000
第130回利付国債(20年)	840,000,000	944,630,400
第131回利付国債(20年)	500,000,000	554,810,000
第133回利付国債(20年)	890,000,000	999,461,100
第134回利付国債(20年)	350,000,000	392,465,500
第135回利付国債(20年)	880,000,000	973,359,200
第136回利付国債(20年)	290,000,000	316,349,400
第137回利付国債(20年)	500,000,000	552,515,000
第138回利付国債(20年)	540,000,000	579,695,400

	第139回利付国債(20年)	350,000,000	381,377,500	
	第140回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,323,720,000	
	第141回利付国債(20年)	800,000,000	880,864,000	
	第142回利付国債(20年)	600,000,000	670,068,000	
	第143回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,158,991,900	
	第144回利付国債(20年)	440,000,000	469,299,600	
	第145回利付国債(20年)	1,460,000,000	1,601,386,400	
	第146回利付国債(20年)	1,440,000,000	1,576,252,800	
	第147回利付国債(20年)	1,460,000,000	1,571,120,600	
	第148回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,626,963,800	
	第149回利付国債(20年)	1,400,000,000	1,475,320,000	
	第150回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,726,329,100	
	第151回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,792,908,000	
	第152回利付国債(20年)	1,700,000,000	1,687,862,000	
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,931,000	
	国債証券合計	244,239,000,000	259,498,201,550	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,395,000	
	第4回東京都公募公債(7年)	100,000,000	101,519,000	
	第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	238,104,000	
	第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,598,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,174,000	
	第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	235,678,000	
	第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,083,000	
	第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,434,000	
	第645回東京都公募公債	100,000,000	103,020,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	103,929,000	
	第647回東京都公募公債	100,000,000	103,888,000	
	第657回東京都公募公債	100,000,000	104,834,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	105,673,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	104,736,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	104,653,000	
	第714回東京都公募公債	200,000,000	205,406,000	
	第722回東京都公募公債	200,000,000	206,142,000	
	平成19年度第14回北海道公募公債(10年)	100,000,000	104,247,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,857,000	
	平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	105,920,000	
	平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	106,020,000	
	平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	103,761,000	
	平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,473,000	
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,744,000	
	第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,636,000	

第162回神奈川県公募公債	100,000,000	105,992,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	105,393,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	105,524,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	104,877,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	104,478,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	104,601,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	103,845,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	102,095,000	
第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,435,000	
第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,937,000	
第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,059,000	
第324回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,628,000	
第331回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,318,000	
第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,833,000	
第335回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,952,000	
第339回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,719,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	136,250,400	
第363回大阪府公募公債（10年）	114,000,000	117,082,560	
第371回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	202,046,000	
第376回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,794,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	105,147,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	105,361,000	
第4回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,339,000	
平成18年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	102,409,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,653,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	105,790,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	105,596,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	104,152,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,301,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	105,864,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	106,662,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,442,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,096,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	101,298,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,570,000	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,154,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,765,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,995,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,347,000	

平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	115,759,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,585,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,074,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,545,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,750,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	105,127,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	119,200,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	287,066,080	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	103,475,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	104,305,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	104,275,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	105,635,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	105,697,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,953,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,594,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,049,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,131,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	120,704,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	105,331,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	200,000,000	228,844,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	105,302,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,798,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	118,292,000	
第8回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	117,235,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	102,944,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	106,093,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	104,942,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,245,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,507,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	105,160,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	142,063,883	
平成18年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	102,392,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債(10年)	139,630,000	144,149,823	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,910,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,744,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,048,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,739,000	

第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,732,000	
第72回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,072,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,706,000	
第76回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,188,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,849,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,310,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,162,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,735,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,938,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,725,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,086,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,492,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,942,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,672,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,951,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,083,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,507,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,507,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,779,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,845,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,746,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	185,530,242	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,105,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,763,000	
第111回共同発行市場公募地方債	400,000,000	415,680,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,080,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,230,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,690,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,113,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,184,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	103,086,000	
平成18年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,693,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,892,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	204,512,000	
平成21年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	210,794,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	105,853,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	112,575,000	
第464回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	104,988,000	
第482回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,800,000	
第2回京都市公募公債(20年)	100,000,000	115,102,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	104,246,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	105,960,000	

	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,605,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	105,137,000	
	平成22年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,771,000	
	平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	105,051,000	
	平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	103,939,000	
	平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,558,000	
	第25回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,631,000	
	第26回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	110,148,000	
	平成23年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	104,569,000	
	平成24年度第7回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,767,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	104,085,000	
	平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	104,263,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,935,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	104,953,000	
	平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	158,967,907	
	平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	106,544,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	103,086,000	
	平成24年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	103,089,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	104,692,000	
	地方債証券合計	18,618,830,000	19,727,081,895	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	207,680,000	
	第36回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	102,295,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	233,719,500	
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,017,000	
	第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	201,256,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,672,000	
	第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,707,000	
	第41回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,128,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,852,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	177,448,500	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,239,000	
	第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,579,000	
	第21回道路債券	100,000,000	124,198,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	238,334,000	
	第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	128,588,750	
	第27回道路債券	100,000,000	116,066,000	

第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,120,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	193,000,000	198,741,750	
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,669,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,150,000	
第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,107,000	
第33回道路債券	100,000,000	126,518,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,254,000	
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,261,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,394,000	
第38回道路債券	100,000,000	115,170,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,767,000	
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	208,250,000	
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	118,782,000	
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	208,180,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,216,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,704,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,115,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,095,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,856,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,541,000	
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	104,893,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,042,000	
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	104,726,000	
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	105,281,000	
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	104,482,000	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,546,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,108,000	

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	105,540,000	
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	115,163,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,030,000	
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	232,920,000	
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	104,683,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,625,000	
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	104,788,000	
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	210,654,000	
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	235,726,000	
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	105,860,000	
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	117,071,000	
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	105,451,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,015,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,950,000	
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	105,592,000	
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	115,019,000	
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	105,689,000	
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	115,115,000	
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	176,551,800	
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	112,923,000	
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	106,344,000	
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	105,258,000	
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	104,756,000	
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	130,977,500	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,516,000	
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	104,689,000	
	100,000,000	104,181,000	

第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,691,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,426,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,050,000	
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	206,930,000	
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	109,655,000	
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	213,616,810	
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	202,380,000	
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	101,660,000	
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	104,030,000	
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	103,098,000	
第2回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	110,972,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,252,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	117,803,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,767,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,402,000	
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	115,500,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,649,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,044,000	
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	233,778,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,591,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,620,000	
第9回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,911,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,433,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,997,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,305,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	114,920,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,635,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,703,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,908,000	
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	341,538,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,301,000	
第17回公営企業債券(20年)	200,000,000	235,310,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,484,000	

第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,583,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,258,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	324,120,000	
第24回政府保証地方公共団体金融機構債券	181,000,000	190,397,520	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,728,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,260,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,678,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,368,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	225,949,080	
第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,980,000	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,115,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,209,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,859,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,079,000	
第877回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,814,000	
第879回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,528,000	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,857,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	207,492,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	108,026,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	106,901,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	103,775,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	105,138,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,440,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	105,468,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,214,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,685,000	22,741,926	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,265,000	173,338,910	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	51,724,000	55,624,506	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,669,000	28,940,132	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,000,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	66,990,000	71,180,224	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,944,000	24,319,951	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,904,000	25,869,386	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,388,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,831,000	16,496,693	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	95,800,000	103,592,372	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,905,000	26,862,782	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,338,000	73,095,691	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,559,000	26,523,720	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,216,000	37,546,938	

第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	25,316,000	27,309,888	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,032,000	20,469,498	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,935,000	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,278,000	21,228,835	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,202,000	37,765,057	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,842,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	122,154,000	128,485,241	
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,068,000	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,014,000	23,287,069	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,954,000	42,850,170	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,836,000	50,020,379	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,533,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,703,000	48,679,331	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,688,000	27,100,069	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,017,000	48,871,805	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,392,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,056,000	93,929,941	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,862,000	30,566,301	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	88,791,000	94,296,042	
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,591,000	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,521,000	34,417,624	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	105,606,000	111,682,569	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,306,000	38,634,666	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,179,000	61,904,783	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,070,000	67,146,214	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,078,000	34,222,093	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,356,000	68,425,229	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,585,000	35,835,866	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	95,046,000	101,202,129	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,854,000	145,566,202	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,510,000	72,291,733	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,969,000	36,601,937	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,856,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,334,000	34,144,033	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,435,000	79,897,505	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,380,000	81,684,649	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,637,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,025,000	248,556,116	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,860,000	316,672,436	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,323,000	32,882,867	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,851,000	77,526,577	

第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,954,000	77,237,858	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	94,446,000	102,506,966	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,278,000	81,720,712	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,332,000	34,897,867	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,079,000	83,913,182	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,164,000	85,020,101	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,163,000	86,797,223	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,665,000	86,436,177	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,337,000	90,195,610	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,129,000	92,188,798	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	263,553,000	272,218,622	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,306,000	89,063,469	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,982,000	89,769,794	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,009,000	93,248,423	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,665,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,972,000	
第19回政府保証国民生活債券	125,000,000	128,146,250	
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,965,000	
い第734号商工債	200,000,000	200,914,000	
い第740号商工債	200,000,000	200,986,000	
い第741号商工債	200,000,000	201,044,000	
い第758号商工債	100,000,000	100,756,000	
い第773号商工債	100,000,000	99,858,000	
い第736号農林債	100,000,000	100,422,000	
い第745号農林債	120,000,000	120,451,200	
い第749号農林債	100,000,000	100,308,000	
い第751号農林債	100,000,000	100,328,000	
い第765号農林債	100,000,000	100,291,000	
い第766号農林債	300,000,000	300,834,000	
い第769号農林債	100,000,000	100,260,000	
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,558,000	
第266回信金中金債（5年）	100,000,000	100,510,000	
第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,539,000	
第275回信金中金債（5年）	100,000,000	100,403,000	
第278回信金中金債（5年）	100,000,000	100,426,000	
第280回信金中金債（5年）	100,000,000	100,166,000	
第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,469,000	
第299回信金中金債（5年）	100,000,000	99,901,000	
第167号商工債（3年）	200,000,000	200,158,000	
第168号商工債（3年）	100,000,000	100,086,000	
第182号商工債（3年）	100,000,000	99,958,000	
第21回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,387,000	

	第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,650,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,566,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	172,000,000	176,336,120	
	第20回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	103,727,000	
	第3回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,569,000	
	第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,309,000	
	第21回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,451,000	
	特殊債券合計	25,280,418,000	26,917,546,667	
社債券	第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ円貨社債	100,000,000	100,832,000	
	第5回ノルデアバンク・アクツィエポラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,409,000	
	第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,616,000	
	第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	99,984,000	
	第12回株式会社ポスコ円貨社債(2013)	100,000,000	100,416,000	
	第13回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	100,293,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	107,341,000	
	第25回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,482,000	
	第4回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,396,000	
	第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,071,000	
	第6回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,950,000	
	第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	203,684,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	201,488,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,815,000	
	第21回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,364,000	
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	102,881,000	
	第20回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,255,000	
	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	100,486,000	
	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	104,227,000	
	第8回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,508,000	
	第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	101,806,000	
	第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,461,000	
	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	101,787,000	
第29回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,479,000		
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,683,000		

第9回宇部興産株式会社無担保社債	100,000,000	100,930,000	
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	102,559,000	
第1回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,490,000	
第2回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,298,000	
第3回出光興産株式会社無担保社債	100,000,000	101,101,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,242,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	103,595,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,057,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,526,000	
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,091,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,869,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	102,760,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,398,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,801,000	
第1回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	100,534,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	101,370,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,649,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	101,024,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,301,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,387,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	300,000,000	304,062,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,936,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,269,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	106,282,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,169,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,789,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,471,000	
第92回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,562,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,983,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,247,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,405,000	
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	112,930,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,816,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,312,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,935,000	
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	106,552,000	
	200,000,000	225,400,000	

第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債			
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,208,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,573,000	
第140回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,243,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	99,655,000	
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	108,065,000	
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	105,355,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	212,956,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	213,656,000	
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	113,678,000	
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	108,004,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,199,000	
第6回興リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,899,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,599,000	
第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,278,000	
第63回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	101,338,000	
第9回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,997,000	
第42回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,675,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,537,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,195,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,788,000	
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	100,411,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	103,835,000	
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	106,682,000	
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	101,631,000	
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	101,570,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,990,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	109,208,000	
第78回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	102,705,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	102,975,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	117,633,000	

第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,556,000	
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,744,000	
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	103,767,000	
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,896,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,884,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,291,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,054,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,476,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,570,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,005,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,246,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,211,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,383,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,946,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,395,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,002,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,798,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,590,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	102,294,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	117,737,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	116,802,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	108,198,000	
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	101,905,000	
第19回株式会社商船三井無担保社債	100,000,000	98,412,000	
第12回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	101,307,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,023,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,947,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,632,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,912,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	105,455,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,597,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,116,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,486,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,315,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,646,000	

第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,871,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,952,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,184,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	108,929,000	
第478回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,224,000	
第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	107,489,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,638,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,294,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,375,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,656,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,372,000	
第354回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,857,000	
第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,630,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	103,586,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,739,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,858,000	
第416回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,719,000	
第459回東北電力株式会社社債	173,000,000	174,984,310	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,668,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,804,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,439,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,516,000	
第396回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,685,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,817,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,395,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,339,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	102,102,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,127,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,735,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,313,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,192,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	104,094,000	
社債券合計	16,773,000,000	17,424,535,310	
合計		323,567,365,422	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,423,934,650
コール・ローン	1,139,027,274
株式	211,429,906,747
投資信託受益証券	168,639,008
投資証券	4,923,548,621
派生商品評価勘定	38,573,288
未収入金	82,652,886
未収配当金	454,888,351
未収利息	1,689
前払金	174,289,180
差入委託証拠金	857,926,273
流動資産合計	223,693,387,967
資産合計	223,693,387,967
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	174,596,101
未払解約金	541,185,710
流動負債合計	715,781,811
負債合計	715,781,811
純資産の部	
元本等	
元本	96,857,370,344
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	126,120,235,812
元本等合計	222,977,606,156
純資産合計	222,977,606,156
負債純資産合計	223,693,387,967

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 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</p> <p>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</p>

	平成27年 6月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)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>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成27年 6月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成27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	96,857,370,344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 2.3021円 (1万口当たり純資産額) (23,021円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成27年 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株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 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27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26年12月11日
期首元本額	114,877,145,982円
期中追加設定元本額	3,399,205,738円
期中一部解約元本額	21,418,981,376円

区分	平成27年 6月10日現在
期末元本額	96,857,370,344円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,388,655,845円
DC外国株式インデックスファンド	4,503,869,821円
DC外国株式インデックスファンドL	17,173,999,895円
DCバランスファンド30	459,634,098円
DCバランスファンド50	981,357,043円
DCバランスファンド70	627,732,529円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	53,191,077円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	29,540,468円
新生・4分散ファンド	61,491,667円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	457,603,620円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	11,930,423円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	46,505,727円
外国株式インデックスe	6,780,066,415円
インデックスコレクション（外国株式）	3,097,976,537円
インデックスコレクション（バランス株式30）	315,599,900円
インデックスコレクション（バランス株式50）	446,965,630円
インデックスコレクション（バランス株式70）	512,483,821円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,983,117,684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）	1,254,849,358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）	2,946,202,565円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	664,579,109円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	6,092,929,360円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	1,687,387,154円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	929,216,827円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	189,506,895円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	5,853,091,952円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,340,171,113円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	701,465,554円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	13,694,685,658円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	1,210,306,586円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	11,397,496,701円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,918,716,907円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	58,763,814円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	700,845,683円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	125,763,378円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	291,337,611円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	769,473,107円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	47,293,947円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	1,173,932,259円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	34,092,310円

区分	平成27年 6月10日現在
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	234,032,299円
V Aバランス2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	586,725,758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）	22,782,239円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	3,115,167,962	
投資信託受益証券	8,020,204	
投資証券	488,946,394	
合計	2,618,201,364	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 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	6,300,791,359	-	6,126,502,179	174,289,180
合計		6,300,791,359	-	6,126,502,179	174,289,180

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 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	1,000,249,299	-	1,038,379,750	38,130,451
	アメリカドル	736,965,847	-	765,989,750	29,023,903
	ユーロ	150,656,912	-	157,472,000	6,815,088

イギリスポンド	112,626,540	-	114,918,000	2,291,460
売建	684,833,846	-	684,697,930	135,916
アメリカドル	412,525,814	-	412,178,400	347,414
カナダドル	28,208,466	-	28,327,610	119,144
ユーロ	95,877,795	-	95,889,200	11,405
イギリスポンド	59,113,841	-	59,188,950	75,109
スイスフラン	14,907,943	-	14,856,240	51,703
スウェーデンク ローナ	12,616,968	-	12,616,800	168
ノルウェークロー ネ	14,302,011	-	14,401,980	99,969
デンマーククロー ネ	14,816,650	-	14,816,100	550
オーストラリアド ル	16,189,963	-	16,158,090	31,873
香港ドル	16,274,395	-	16,264,560	9,835
合計	1,685,083,145	-	1,723,077,680	38,266,367

(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	28,491	83.22	2,371,021.02	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,927	38.13	111,606.51	
	APACHE CORP	21,089	58.57	1,235,182.73	
	BAKER HUGHES	24,406	64.03	1,562,716.18	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,017	33.89	780,046.13	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	11,693	52.56	614,584.08	
	CHENIERE ENERGY INC	12,675	70.03	887,630.25	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	31,007	13.22	409,912.54	
	CHEVRON CORP	104,954	100.42	10,539,480.68	
	CIMAREX ENERGY CO	5,042	118.86	599,292.12	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	21,037	10.54	221,729.98	
	CONCHO RESOURCES INC	6,706	122.55	821,820.30	
	CONOCOPHILLIPS	68,688	63.06	4,331,465.28	

CONSOL ENERGY INC	12,533	27.79	348,292.07
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,454	46.03	205,017.62
CORE LABORATORIES N.V.	2,361	120.53	284,571.33
DEVON ENERGY CORPORATION	21,941	62.12	1,362,974.92
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,327	29.56	127,906.12
ENERGEN CORP	3,692	73.03	269,626.76
ENSCO PLC-CL A	14,447	23.89	345,138.83
EOG RESOURCES INC	30,653	89.09	2,730,875.77
EQT CORPORATION	8,880	86.07	764,301.60
EXXON MOBIL	234,550	84.58	19,838,239.00
FMC TECHNOLOGIES INC	13,591	42.49	577,481.59
HALLIBURTON CO	47,475	45.28	2,149,668.00
HELMERICH & PAYNE	5,887	72.69	427,926.03
HESS CORP	14,440	65.57	946,830.80
HOLLYFRONTIER CORP	10,931	40.72	445,110.32
KINDER MORGAN INC	101,650	40.24	4,090,396.00
MARATHON OIL CORP	39,619	26.73	1,059,015.87
MARATHON PETROLEUM CORP	15,317	99.33	1,521,437.61
MURPHY OIL CORP	9,351	43.26	404,524.26
NABORS INDUSTRIES LTD	18,183	14.63	266,017.29
NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,824	47.90	1,093,269.60
NOBLE ENERGY INC	21,297	45.75	974,337.75
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,048	77.48	3,335,359.04
OCEANEERING INTL INC	5,399	49.64	268,006.36
ONEOK INC	12,311	39.44	485,545.84
PHILLIPS 66	30,457	76.79	2,338,793.03
PIONEER NATURAL RESOURCES	8,360	148.77	1,243,717.20
RANGE RESOURCES CORP	8,808	54.37	478,890.96
SCHLUMBERGER	71,709	89.86	6,443,770.74
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,593	24.56	505,764.08
SPECTRA ENERGY CORP	37,461	33.83	1,267,305.63
TESORO CORP	7,570	83.02	628,461.40
VALERO ENERGY CORP	28,949	57.15	1,654,435.35
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	45,274	13.72	621,159.28
WHITING PETROLEUM CORP	8,824	33.12	292,250.88
WILLIAMS COS	39,808	48.17	1,917,551.36
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	11,426	144.43	1,650,257.18
AIRGAS INC	3,841	103.52	397,620.32
ALBEMARLE CORP	5,066	60.60	306,999.60
ALCOA	71,180	12.19	867,684.20
ASHLAND INC	3,922	126.81	497,348.82
AVERY DENNISON CORP	5,057	61.23	309,640.11

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,771	35.18	167,843.78
BALL CORP	7,616	71.30	543,020.80
CELANESE CORP-SERIES A	9,207	70.20	646,331.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,662	315.59	840,100.58
CROWN HOLDINGS INC	8,563	55.55	475,674.65
DOW CHEMICAL CO	64,846	51.52	3,340,865.92
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	50,721	69.21	3,510,400.41
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,014	77.84	701,649.76
ECOLAB INC	14,940	113.66	1,698,080.40
FMC CORP	7,713	55.13	425,217.69
FREEMONT-MCMORAN INC	57,316	20.02	1,147,466.32
INT'L PAPER CO	22,079	50.36	1,111,898.44
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,824	109.76	529,482.24
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,702	101.83	2,311,744.66
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,929	148.61	435,278.69
MEADWESTVACO CORP	9,842	49.13	483,537.46
MONSANTO CO	26,989	113.54	3,064,331.06
MOSAIC CO/THE	18,201	43.93	799,569.93
NEWMONT MINING CORP	26,633	24.41	650,111.53
NUCOR CORP	17,441	48.31	842,574.71
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,695	67.12	315,128.40
PPG INDUSTRIES INC	7,600	229.25	1,742,300.00
PRAXAIR INC	16,000	121.96	1,951,360.00
ROCK-TENN COMPANY -CL A	7,608	63.05	479,684.40
SEALED AIR CORP	10,470	49.56	518,893.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,514	278.17	1,255,659.38
SIGMA-ALDRICH	6,560	138.24	906,854.40
VULCAN MATERIALS CO	7,244	88.08	638,051.52
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,689	70.71	190,139.19
3 M COMPANY	35,370	156.98	5,552,382.60
ACUITY BRANDS INC	2,121	179.12	379,913.52
AGCO CORP	5,330	51.19	272,842.70
AMETEK INC	13,550	53.74	728,177.00
B/E AEROSPACE INC	5,411	55.21	298,741.31
BOEING CO	37,550	140.10	5,260,755.00
CATERPILLAR	32,053	86.73	2,779,956.69
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,184	53.17	328,803.28
CUMMINS INC	9,541	135.91	1,296,717.31
DANAHER CORP	35,514	85.20	3,025,792.80
DEERE&CO	17,960	91.85	1,649,626.00
DOVER CORP	9,759	72.41	706,649.19
EATON CORP	26,073	71.49	1,863,958.77

EMERSON ELECTRIC CO	37,992	59.18	2,248,366.56
FASTENAL CO	16,518	41.68	688,470.24
FLOWSERVE CORP	7,966	53.95	429,765.70
FLUOR CORP	9,184	55.09	505,946.56
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	7,657	45.62	349,312.34
GENERAL DYNAMICS CORP	15,801	138.68	2,191,282.68
GENERAL ELECTRIC CO	562,472	27.33	15,372,359.76
GRAINGER (WW) INC	3,262	241.51	787,805.62
HONEYWELL INTL INC	41,674	103.56	4,315,759.44
ILLINOIS TOOL WORKS	19,064	92.73	1,767,804.72
INGERSOLL-RAND PLC	14,595	68.61	1,001,362.95
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,309	42.94	356,788.46
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,512	114.11	514,864.32
LOCKHEED MARTIN CORP	14,936	189.35	2,828,131.60
MASCO CORP	19,054	27.28	519,793.12
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,885	157.22	1,711,339.70
PACCAR INC	19,658	63.76	1,253,394.08
PALL CORP	6,359	124.99	794,811.41
PARKER HANNIFIN CORP	7,833	119.16	933,380.28
PENTAIR PLC	11,048	61.22	676,358.56
PRECISION CASTPARTS CORP	8,076	207.54	1,676,093.04
QUANTA SERVICES INC	10,395	28.90	300,415.50
RAYTHEON COMPANY	17,191	99.90	1,717,380.90
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,423	125.12	928,765.76
ROCKWELL COLLIN	7,145	93.35	666,985.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,521	175.07	966,561.47
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,324	55.13	569,162.12
SNAP-ON INC	3,400	154.73	526,082.00
STANLEY BLACK&DECKER	8,892	103.97	924,501.24
TEXTRON	16,537	44.55	736,723.35
TRANSDIGM GROUP INC	2,987	225.82	674,524.34
UNITED RENTALS INC	5,768	88.88	512,659.84
UNITED TECHNOLOGIES CORP	45,770	116.30	5,323,051.00
WABCO HOLDINGS INC	2,679	124.20	332,731.80
WABTEC CORP	5,705	98.89	564,167.45
XYLEM INC	9,576	36.10	345,693.60
ADT CORPORATION	9,976	36.49	364,024.24
CINTAS CORP	5,126	85.51	438,324.26
DUN & BRADSTREET CORP	2,153	128.28	276,186.84
EQUIFAX INC	7,037	98.13	690,540.81
IHS INC-CLASS A	3,877	124.58	482,996.66
MANPOWER GROUP	4,737	86.10	407,855.70

NIELSEN NV	19,199	44.51	854,547.49
REPUBLIC SERVICES INC	13,687	40.03	547,890.61
ROBERT HALF INTL INC	7,911	56.24	444,914.64
STERICYCLE INC	4,563	135.34	617,556.42
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,877	136.12	527,737.24
TYCO INTERNATIONAL PLC	23,181	40.23	932,571.63
VERISK ANALYTICS INC	8,588	73.70	632,935.60
WASTE MANAGEMENT INC	25,574	48.32	1,235,735.68
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,742	40.32	392,846.15
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,773	63.77	559,454.21
CSX CORP	55,460	33.76	1,872,329.60
DELTA AIR LINES INC	11,444	40.72	465,999.68
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,441	46.79	488,534.39
FEDEX CORP	15,085	180.37	2,720,881.45
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	21,373	20.34	434,726.82
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,521	84.85	468,456.85
KANSAS CITY SOUTHERN	6,642	93.16	618,768.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,803	90.44	1,610,103.32
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,790	34.59	304,046.10
UNION PACIFIC CORP	49,419	99.70	4,927,074.30
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,600	52.58	294,448.00
UNITED PARCEL SERVICE B	39,370	99.62	3,922,039.40
AUTOLIV INC	5,289	120.86	639,228.54
BORGWARNER INC	13,409	59.99	804,405.91
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,158	86.57	1,398,798.06
FORD MOTOR COMPANY	207,535	14.88	3,088,120.80
GENERAL MOTORS CO	79,613	35.26	2,807,154.38
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	13,263	31.50	417,784.50
HARLEY-DAVIDSON	11,418	54.02	616,800.36
JOHNSON CONTROLS INC	37,876	51.56	1,952,886.56
LEAR CORP	3,826	114.46	437,923.96
TESLA MOTORS INC	5,309	256.00	1,359,104.00
COACH INC	16,231	35.28	572,629.68
DR HORTON INC	18,907	25.79	487,611.53
GARMIN LTD	6,761	45.72	309,112.92
HANESBRANDS INC	22,043	32.29	711,768.47
HARMAN INTL INDS INC	3,390	119.96	406,664.40
HASBRO INC	5,937	72.05	427,760.85
JARDEN CORP	10,738	52.40	562,671.20
LEGGETT & PLATT INC	8,421	48.00	404,208.00
LENNAR CORP-CL A	10,875	46.33	503,838.75
LULULEMON ATHLETICA INC	6,418	68.27	438,156.86

MATTEL INC	17,948	26.01	466,827.48
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	10,787	48.57	523,924.59
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,631	186.95	678,815.45
NEWELL RUBBERMAID	16,103	40.43	651,044.29
NIKE B	38,281	101.35	3,879,779.35
POLARIS INDUSTRIES INC	3,815	142.60	544,019.00
PULTE GROUP INC	17,706	18.85	333,758.10
PVH CORP	4,835	115.52	558,539.20
RALPH LAUREN CORPORATION	3,612	136.31	492,351.72
TOLL BROTHERS INC	10,714	36.21	387,953.94
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,078	80.67	812,992.26
VF CORP	19,475	69.43	1,352,149.25
WHIRLPOOL CORP	4,305	182.99	787,771.95
ARAMARK	7,505	31.34	235,206.70
BLOCK H & R INC	16,471	31.96	526,413.16
CARNIVAL CORPORATION	23,308	47.20	1,100,137.60
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,711	605.79	1,036,506.69
DARDEN RESTAURANTS INC	6,050	65.01	393,310.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,734	29.18	750,918.12
LAS VEGAS SANDS CORP	22,072	51.93	1,146,198.96
MARRIOTT INTL A	12,266	77.32	948,407.12
MCDONALD'S CORP	53,669	94.73	5,084,064.37
MGM RESORTS INTERNATIONAL	20,308	19.35	392,959.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	5,297	54.82	290,408.02
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,042	77.62	779,460.04
STARBUCKS CORP	83,898	51.54	4,324,102.92
STARWOOD HOTELS & RESORTS	9,396	82.17	772,069.32
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,199	84.58	608,891.42
WYNN RESORTS LTD	4,917	102.28	502,910.76
YUM BRANDS INC	24,124	90.59	2,185,393.16
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	11,519	23.81	274,267.39
CBS CORP-CL B	25,662	59.85	1,535,870.70
CHARTER COMMUNICATION-A	4,557	173.00	788,361.00
COMCAST CORP-CL A	118,738	57.85	6,868,993.30
COMCAST CORP-SPECIAL A	21,711	57.61	1,250,770.71
DIRECTV	27,283	91.90	2,507,307.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,429	33.44	248,425.76
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	14,891	30.93	460,578.63
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,402	73.02	978,614.04
GANNETT CO	10,526	35.31	371,673.06
INTERPUBLIC GROUP OF COS	22,934	19.87	455,698.58
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,326	55.02	788,216.52

LIBERTY GLOBAL PLC-C	35,169	52.06	1,830,898.14
LIBERTY MEDIA CORP	6,970	38.39	267,613.15
LIBERTY MEDIA CORP-C	10,578	37.94	401,329.32
NEWS CORP-CLASS A	24,731	14.56	360,083.36
OMNICOM GROUP	13,797	72.81	1,004,559.57
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,333	67.28	291,524.24
SIRIUS XM HOLDINGS INC	150,956	3.78	570,613.68
THE WALT DISNEY CO	90,139	108.52	9,781,884.28
TIME WARNER CABLE-A	15,787	179.07	2,826,978.09
TIME WARNER INC	46,641	85.53	3,989,204.73
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	73,071	32.80	2,397,094.15
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	26,029	32.72	851,668.88
VIACOM INC-CLASS B	19,713	66.74	1,315,645.62
ADVANCE AUTO PARTS	4,362	157.42	686,666.04
AMAZON.COM	22,110	425.48	9,407,362.80
AUTONATION INC	4,738	63.96	303,042.48
AUTOZONE INC	1,752	676.04	1,184,422.08
BED BATH & BEYOND INC	10,981	68.85	756,041.85
BEST BUY COMPANY INC	17,110	33.83	578,831.30
CARMAX INC	11,643	72.59	845,165.37
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,631	53.51	301,314.81
DOLLAR GENERAL CORP	16,683	75.92	1,266,573.36
DOLLAR TREE INC	12,138	77.09	935,718.42
EXPEDIA INC	6,117	105.02	642,407.34
FAMILY DOLLAR STORES	5,147	78.26	402,804.22
FOOT LOCKER INC	8,427	62.00	522,474.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,469	42.90	234,620.10
GAP	14,100	37.52	529,032.00
GENUINE PARTS CO	8,061	90.23	727,344.03
HOME DEPOT	73,770	109.53	8,080,028.10
KOHL'S CORP	11,099	62.05	688,692.95
L BRANDS INC	13,886	83.93	1,165,451.98
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	26,563	27.93	741,904.59
LKQ CORP	17,698	29.12	515,365.76
LOWES COMPANIES	54,407	68.53	3,728,511.71
MACY'S INC	18,668	69.13	1,290,518.84
NETFLIX INC	3,210	647.15	2,077,351.50
NORDSTROM INC	8,334	73.16	609,715.44
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,624	222.93	1,253,758.32
PRICELINE GROUP INC/THE	2,894	1,163.27	3,366,503.38
ROSS STORES INC	11,408	97.50	1,112,280.00
SIGNET JEWELERS LTD	4,556	130.49	594,512.44

STAPLES INC	38,552	16.22	625,313.44
TARGET (DAYTON HUDSON)	33,830	78.90	2,669,187.00
TIFFANY & CO	7,196	92.07	662,535.72
TJX COMPANIES INC	37,819	64.70	2,446,889.30
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,118	87.30	708,701.40
TRIPADVISOR INC	7,127	75.21	536,021.67
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,657	153.77	562,336.89
URBAN OUTFITTERS INC	6,908	36.08	249,240.64
COSTCO WHOLESALE CORP	24,660	138.04	3,404,066.40
CVS HEALTH CORP	62,820	99.98	6,280,743.60
KROGER CO	26,845	70.70	1,897,941.50
RITE AID CORP	48,475	8.45	409,613.75
SYSCO CORP	32,462	37.10	1,204,340.20
WAL-MART STORES	90,393	72.47	6,550,780.71
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	48,932	84.17	4,118,606.44
WHOLE FOODS MKT INC	20,226	40.28	814,703.28
ALTRIA GROUP INC	109,731	48.56	5,328,537.36
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	35,333	51.01	1,802,336.33
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,299	97.16	709,170.84
BUNGE LIMITED	8,579	89.71	769,622.09
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,082	46.57	469,518.74
COCA-COLA CO	231,086	40.20	9,289,657.20
COCA-COLA ENTERPRISES	13,609	42.93	584,234.37
CONAGRA	23,542	37.96	893,654.32
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,530	120.31	1,146,554.30
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	10,701	73.27	784,062.27
GENERAL MILLS INC	33,545	54.45	1,826,525.25
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,275	91.07	753,604.25
HORMEL FOODS CORP	7,482	56.22	420,638.04
JM SMUCKER CO	5,577	111.60	622,393.20
KELLOGG CO	14,654	61.51	901,367.54
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	7,153	84.84	606,860.52
KRAFT FOODS GROUP INC	32,981	84.01	2,770,733.81
LORILLARD INC	20,122	71.37	1,436,107.14
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,188	76.53	473,567.64
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	11,195	92.71	1,037,888.45
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,248	72.46	670,110.08
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	92,188	40.22	3,707,801.36
MONSTER BEVERAGE CORP	8,094	124.88	1,010,778.72
PEPSICO INC	83,104	93.07	7,734,489.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	86,683	80.75	6,999,652.25
REYNOLDS AMERICAN INC	17,864	72.13	1,288,530.32

TYSON FOODS INC	16,811	41.16	691,940.76
WHITEWAVE FOODS CO	8,597	47.64	409,561.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,913	83.08	657,412.04
CLOROX COMPANY	7,682	105.53	810,681.46
COLGATE-PALMOLIVE CO	48,091	66.03	3,175,448.73
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,372	135.99	458,558.28
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,654	87.95	1,112,919.30
KIMBERLY-CLARK CORP	20,331	105.85	2,152,036.35
PROCTER & GAMBLE CO	151,248	78.90	11,933,467.20
ABBOTT LABORATORIES	84,305	48.18	4,061,814.90
AETNA INC	20,065	117.24	2,352,420.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,681	109.12	1,274,630.72
ANTHEM INC	14,980	162.59	2,435,598.20
BARD C R INC	4,028	168.25	677,711.00
BAXTER INTERNATIONAL	29,952	64.08	1,919,324.16
BECTON DICKINSON & CO	11,636	137.93	1,604,953.48
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,600	17.39	1,297,294.00
CARDINAL HEALTH	18,386	87.66	1,611,716.76
CENTENE CORP	5,486	72.93	400,093.98
CERNER CORP	16,971	65.77	1,116,182.67
CIGNA CORP	14,481	138.50	2,005,618.50
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	9,518	81.49	775,621.82
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,185	51.88	372,757.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,484	133.30	864,317.20
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	8,741	36.54	319,396.14
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	40,637	86.93	3,532,574.41
HCA HOLDINGS INC	18,145	81.32	1,475,551.40
HENRY SCHEIN INC	5,080	139.32	707,745.60
HOLOGIC INC	13,090	36.55	478,439.50
HUMANA INC	8,389	212.47	1,782,410.83
INTUITIVE SURGICAL INC	2,026	497.22	1,007,367.72
LABORATORY CRP OF AMER	5,429	119.91	650,991.39
MCKESSON CORP	13,039	234.00	3,051,126.00
MEDTRONIC PLC	79,453	74.92	5,952,618.76
OMNICARE INC	4,986	94.87	473,021.82
PATTERSON COMPANIES INC	3,878	47.82	185,445.96
QUEST DIAGNOSTICS	8,654	73.71	637,886.34
RESMED INC	8,274	58.70	485,683.80
ST JUDE MEDICAL INC	15,537	73.39	1,140,260.43
STRYKER CORP	18,905	94.16	1,780,094.80
THE COOPER COS INC	2,821	171.43	483,604.03
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,054	116.99	6,206,787.46

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,528	127.44	704,488.32
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,075	85.94	522,085.50
ZIMMER HOLDINGS INC	9,985	112.64	1,124,710.40
ABBVIE INC	95,249	67.67	6,445,499.83
ACTAVIS PLC	21,129	296.87	6,272,566.23
AGILENT TECHNOLOGIES	18,324	40.12	735,158.88
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,451	159.04	1,821,167.04
ALKERMES PLC	7,800	58.25	454,350.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,759	127.58	479,573.22
AMGEN	42,272	154.80	6,543,705.60
BIOGEN INC	13,064	382.00	4,990,448.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,657	120.66	1,044,553.62
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	93,204	65.08	6,065,716.32
CELGENE CORP	44,518	110.72	4,929,032.96
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,127	82.40	834,464.80
GILEAD SCIENCES INC	83,238	114.75	9,551,560.50
HOSPIRA INC	9,617	88.26	848,796.42
ILLUMINA INC	8,033	215.59	1,731,834.47
INCYTE CORP	9,207	106.25	978,243.75
ISIS PHARMACEUTICALS INC	6,000	65.79	394,740.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,645	174.86	637,364.70
JOHNSON & JOHNSON	155,774	98.21	15,298,564.54
LILLY (ELI) & CO	56,006	82.77	4,635,616.62
MALLINCKRODT PLC	6,349	122.97	780,736.53
MEDIVATION INC	4,520	111.84	505,516.80
MERCK & CO	158,999	58.84	9,355,501.16
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,687	332.66	561,197.42
MYLAN NV	23,435	73.80	1,729,503.00
PERRIGO CO PLC	7,854	188.17	1,477,887.18
PFIZER	343,653	34.01	11,687,638.53
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	1,286	130.80	168,208.80
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	3,098	69.43	215,094.14
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,182	526.09	2,200,108.38
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,177	128.57	2,851,296.89
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,284	178.12	406,826.08
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,639	124.08	1,692,327.12
WATERS CORP	4,970	133.43	663,147.10
ZOETIS INC	26,532	49.24	1,306,435.68
BANK OF AMERICA CORP	589,521	17.31	10,204,608.51
BB&T CORP	39,851	40.60	1,617,950.60
CIT GROUP INC	9,325	46.62	434,731.50
CITIGROUP	169,877	56.00	9,513,112.00

CITIZENS FINANCIAL GROUP	16,194	28.08	454,727.52
COMERICA INC	9,338	51.48	480,720.24
FIFTH THIRD BANCORP	45,228	20.99	949,335.72
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,475	63.54	538,501.50
HUDSON CITY BANCORP INC	29,661	9.86	292,457.46
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,106	11.39	547,927.34
JPMORGAN CHASE & CO	208,418	67.18	14,001,521.24
KEY CORP	50,926	15.34	781,204.84
M & T BANK CORP	7,081	124.84	883,992.04
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	25,154	18.20	457,802.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	19,983	15.93	318,329.19
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,096	97.57	2,838,896.72
REGIONS FINL CORP	72,015	10.55	759,758.25
SUNTRUST BANKS	29,152	43.41	1,265,488.32
US BANCORP	99,643	44.07	4,391,267.01
WELLS FARGO & CO	273,922	56.70	15,531,377.40
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,288	218.48	718,362.24
ALLY FINANCIAL INC	22,000	22.61	497,420.00
AMERICAN EXPRESS	51,292	79.17	4,060,787.64
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,152	126.33	1,282,502.16
BANK NEW YORK CO	62,317	43.40	2,704,557.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,780	139.63	9,045,231.40
BLACKROCK INC	6,943	352.73	2,449,004.39
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,820	85.57	2,637,267.40
CME GROUP INC	18,471	96.30	1,778,757.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	24,819	57.67	1,431,311.73
E*TRADE FINANCIAL CORP	14,271	30.77	439,118.67
EATON VANCE CORP	6,907	39.21	270,823.47
FRANKLIN RESOURCES INC	22,579	49.66	1,121,273.14
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,790	209.02	4,554,545.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,234	236.88	1,476,709.92
INVESCO LTD	23,409	39.00	912,951.00
LEGG MASON INC	6,654	53.77	357,785.58
LEUCADIA NATIONAL CORP	19,913	24.35	484,881.55
MCGRAW-HILL FINANCIAL	15,303	101.91	1,559,528.73
MOODY'S CORP	10,179	106.01	1,079,075.79
MORGAN STANLEY	82,526	39.13	3,229,242.38
NASDAQ OMX GROUP	6,939	50.14	347,921.46
NAVIENT CORP	24,651	18.90	465,903.90
NORTHERN TRUST CORP	12,076	75.88	916,326.88
PRICE T ROWE GROUP INC	14,101	78.10	1,101,288.10
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,527	59.31	446,426.37

SCHWAB (CHARLES) CORP	67,390	33.02	2,225,217.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,570	48.29	365,555.30
STATE STREET CORP	23,677	79.15	1,874,034.55
SYNCHRONY FINANCIAL	8,888	32.86	292,059.68
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,625	38.40	638,400.00
VOYA FINANCIAL INC	11,960	46.38	554,704.80
ACE LTD	18,217	103.52	1,885,823.84
AFLAC	24,343	61.67	1,501,232.81
ALLEGHANY CORP	944	473.31	446,804.64
ALLSTATE CORP	23,763	65.71	1,561,466.73
AMERICAN INT'L GROUP	76,942	59.99	4,615,750.58
AON PLC	15,587	100.61	1,568,208.07
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,212	63.98	461,423.76
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,040	47.50	381,900.00
ASSURANT INC	4,557	65.82	299,941.74
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,257	53.13	332,434.41
CHUBB CORPORATION	12,710	94.85	1,205,543.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,273	50.17	465,272.77
EVEREST RE GROUP LTD	2,730	179.28	489,434.40
FNF GROUP	15,202	36.16	549,704.32
HARTFORD FINANCIAL SVCS	23,906	41.01	980,385.06
LINCOLN NATIONAL CORP	14,192	59.79	848,539.68
LOEWS CORP	15,907	39.66	630,871.62
MARSH & MCLENNAN COS	30,666	57.94	1,776,788.04
METLIFE INC	53,087	54.66	2,901,735.42
PARTNERRE LTD	2,636	130.12	342,996.32
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,989	51.67	826,151.63
PROGRESSIVE CORP	33,266	26.98	897,516.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,997	87.97	2,286,956.09
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,185	101.89	222,629.65
TORCHMARK CORP	6,447	57.54	370,960.38
TRAVELERS COS INC/THE	17,904	97.80	1,751,011.20
UNUM GROUP	13,270	36.07	478,648.90
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,356	47.20	441,603.20
WR BERKLEY CORP	6,317	48.75	307,953.75
XL GROUP PLC	15,549	36.89	573,602.61
CBRE GROUP INC-A	16,064	36.60	587,942.40
JONES LANG LASALLE INC	2,171	167.73	364,141.83
REALOGY HOLDINGS CORP	7,960	45.15	359,394.00
WEYERHAEUSER CO	28,957	31.24	904,616.68
ACCENTURE PLC-CL A	35,161	94.94	3,338,185.34
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,006	25.52	765,753.12

ADOBE SYSTEMS INC	27,226	77.90	2,120,905.40
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	10,733	72.90	782,435.70
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,681	293.53	1,080,483.93
ANSYS INC	5,078	88.80	450,926.40
AUTODESK INC	13,573	53.92	731,856.16
AUTOMATIC DATA PROCESS	26,561	83.16	2,208,812.76
CA INC	18,266	29.43	537,568.38
CDK GLOBAL INC	6,602	52.49	346,538.98
CITRIX SYSTEMS INC	9,467	64.45	610,148.15
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	34,165	63.71	2,176,652.15
COMPUTER SCIENCES CORP	8,337	66.43	553,826.91
EBAY	61,174	60.41	3,695,521.34
ELECTRONIC ARTS INC	17,441	61.78	1,077,504.98
FACEBOOK INC-A	112,438	80.67	9,070,373.46
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,884	61.79	981,472.36
FIREEYE INC	4,721	50.64	239,095.04
FISERV INC	13,567	79.24	1,075,049.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,664	151.28	705,569.92
GARTNER INC	4,250	85.87	364,947.50
GOOGLE INC-CL A	16,025	542.16	8,688,114.00
GOOGLE INC-CL C	17,110	526.69	9,011,665.90
INTL BUSINESS MACHINES CORP	52,618	165.68	8,717,750.24
INTUIT INC	14,640	104.64	1,531,929.60
LINKEDIN CORP - A	6,141	216.83	1,331,553.03
MASTERCARD INC-CLASS A	56,089	92.09	5,165,236.01
MICROSOFT CORP	436,381	45.65	19,920,792.65
NETSUITE INC	2,299	91.11	209,461.89
NUANCE COMMUNICATIONS INC	13,610	17.46	237,630.60
ORACLE CORP	196,132	43.07	8,447,405.24
PAYCHEX INC	19,175	47.69	914,455.75
RACKSPACE HOSTING INC	7,326	38.75	283,882.50
RED HAT INC	10,220	77.37	790,721.40
SALESFORCE.COM INC	33,538	71.76	2,406,686.88
SERVICENOW INC	7,352	75.66	556,252.32
SPLUNK INC	6,192	67.39	417,278.88
SYMANTEC CORP	37,977	23.44	890,180.88
SYNOPSYS INC	8,122	49.48	401,876.56
TERADATA CORP	7,871	38.77	305,158.67
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,091	40.88	371,640.08
TWITTER INC	25,693	35.88	921,864.84
VANTIV INC - CL A	8,790	40.11	352,566.90
VERISIGN INC	6,144	61.54	378,101.76

VISA INC-CLASS A SHARES	110,174	67.95	7,486,323.30
VMWARE INC-CLASS A	4,467	87.94	392,827.98
WESTERN UNION CO	27,853	21.57	600,789.21
WORKDAY INC-CLASS A	5,634	78.13	440,184.42
XEROX CORP	58,604	11.03	646,402.12
YAHOO	50,080	41.63	2,084,830.40
ZILLOW GROUP INC - CL A	2,600	87.47	227,422.00
AMPHENOL CORPORATION	17,522	56.69	993,322.18
APPLE INC	326,034	127.42	41,543,252.28
ARROW ELECTRONICS INC	5,053	58.10	293,579.30
AVNET INC	8,497	42.83	363,926.51
CISCO SYSTEMS	286,406	28.24	8,088,105.44
CORNING	72,506	20.63	1,495,798.78
EMC CORP	110,641	26.71	2,955,221.11
F5 NETWORKS INC	4,312	124.69	537,663.28
FLEXTRONICS INTL LTD	31,468	12.01	377,930.68
FLIR SYSTEMS INC	8,767	30.87	270,637.29
HARRIS CORP	5,936	78.01	463,067.36
HEWLETT-PACKARD CO	102,323	32.58	3,333,683.34
JUNIPER NETWORKS INC	19,985	27.40	547,589.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,179	57.90	647,264.10
NETAPP INC	16,604	33.10	549,592.40
PALO ALTO NETWORKS INC	3,926	171.98	675,193.48
QUALCOMM	92,262	66.84	6,166,792.08
SANDISK CORP	11,748	66.81	784,883.88
SEAGATE TECHNOLOGY	18,069	52.62	950,790.78
TE CONNECTIVITY LTD	22,647	68.21	1,544,751.87
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,617	23.01	382,357.17
WESTERN DIGITAL CORP	12,303	92.04	1,132,368.12
AT&T INC	289,808	34.51	10,001,274.08
CENTURYLINK INC	31,922	32.07	1,023,738.54
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	51,399	4.96	254,939.04
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	17,624	54.59	962,094.16
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,271	115.99	843,363.29
SPRINT CORP	49,920	4.53	226,137.60
T-MOBILE US INC	14,642	38.79	567,963.18
VERIZON COMMUNICATIONS	232,267	47.34	10,995,519.78
AES CORP	40,128	13.51	542,129.28
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,132	57.81	354,490.92
AMEREN CORPORATION	12,847	37.87	486,515.89
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,638	53.46	1,477,527.48
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,665	51.00	492,915.00

CALPINE CORP	21,631	19.46	420,939.26
CENTERPOINT ENERGY INC	21,130	19.29	407,597.70
CMS ENERGY CORP	15,476	31.79	491,982.04
CONSOLIDATED EDISON INC	16,210	58.44	947,312.40
DOMINION RESOURCES	33,774	66.83	2,257,116.42
DTE ENERGY COMPANY	9,885	74.52	736,630.20
DUKE ENERGY CORP	39,446	72.13	2,845,239.98
EDISON INTL	18,365	57.26	1,051,579.90
ENTERGY CORP	10,157	70.90	720,131.30
EVERSOURCE ENERGY	19,070	46.33	883,513.10
EXELON CORP	48,619	33.11	1,609,775.09
FIRSTENERGY CORP	23,582	33.92	799,901.44
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,841	68.88	333,448.08
MDU RESOURCES GROUP INC	12,955	20.26	262,468.30
NEXTERA ENERGY INC	25,259	98.19	2,480,181.21
NISOURCE INC	19,032	45.06	857,581.92
NRG ENERGY INC	18,649	23.86	444,965.14
OGE ENERGY CORP	11,648	29.15	339,539.20
PEPCO HOLDINGS INC	13,913	26.76	372,311.88
PG&E CORP	26,871	50.33	1,352,417.43
PINNACLE WEST CAPITAL	5,679	56.90	323,135.10
PPL CORPORATION	37,522	30.10	1,129,412.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	28,248	40.14	1,133,874.72
SCANA CORP	7,611	50.06	381,006.66
SEMPRA ENERGY	13,178	103.05	1,357,992.90
SOUTHERN CO	51,080	42.44	2,167,835.20
WISCONSIN ENERGY CORP	13,404	45.20	605,860.80
XCEL ENERGY INC	28,494	32.36	922,065.84
ALTERA CORPORATION	16,516	51.50	850,574.00
ANALOG DEVICES	18,386	65.69	1,207,776.34
APPLIED MATERIALS	68,783	19.91	1,369,469.53
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	14,493	140.21	2,032,063.53
BROADCOM CORP-CL A	32,072	53.55	1,717,455.60
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	4,647	42.02	195,266.94
INTEL CORP	265,707	31.25	8,303,343.75
KLA-TENCOR CORP	8,895	55.65	495,006.75
LAM RESEARCH CORP	9,370	81.98	768,152.60
LINEAR TECHNOLOGY CORP	13,921	45.99	640,296.39
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	19,484	14.13	275,308.92
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,914	33.63	501,557.82
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,557	46.83	541,272.09
MICRON TECHNOLOGY	60,384	25.19	1,521,072.96

	NVIDIA CORP	32,225	21.86	704,438.50
	QORVO INC	8,400	80.05	672,420.00
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,802	102.24	1,104,396.48
	SUNEDISON INC	13,376	29.35	392,585.60
	TEXAS INSTRUMENTS	58,871	52.91	3,115,158.96
	XILINX INC	14,388	46.45	668,322.60
	アメリカドル 小計	17,559,610		1,067,136,896.13 (132,815,858,092)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,879	38.21	339,266.59
	ARC RESOURCES LTD	20,535	22.13	454,439.55
	BAYTEX ENERGY CORP	10,495	21.41	224,697.95
	CAMECO CORP	21,278	18.88	401,728.64
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	61,119	37.00	2,261,403.00
	CANADIAN OIL SANDS LTD	30,774	10.50	323,127.00
	CENOVUS ENERGY INC	44,951	19.97	897,671.47
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	24,569	27.13	666,556.97
	ENBRIDGE	47,687	56.70	2,703,852.90
	ENCANA CORP	42,944	14.89	639,436.16
	ENERPLUS CORP	14,416	11.09	159,873.44
	HUSKY ENERGY INC	18,451	23.85	440,056.35
	IMPERIAL OIL	17,504	48.90	855,945.60
	INTER PIPELINE LTD	18,978	29.81	565,734.18
	KEYERA CORP	9,280	40.40	374,912.00
	MEG ENERGY CORP	9,886	18.87	186,548.82
	PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	2,200	30.72	67,584.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,896	39.77	711,723.92
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	7,989	32.72	261,400.08
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,500	32.09	208,585.00
	SUNCOR ENERGY	80,555	35.88	2,890,313.40
	TOURMALINE OIL CORP	9,307	38.91	362,135.37
	TRANSCANADA CORP	40,201	50.72	2,038,994.72
	VERESEN INC	12,406	16.90	209,661.40
	VERMILION ENERGY INC	7,014	54.10	379,457.40
	AGNICO EAGLE MINES	13,647	38.18	521,042.46
	AGRIUM INC	7,555	126.98	959,333.90
	BARRICK GOLD CORP	68,942	14.24	981,734.08
	ELDORADO GOLD CORP	38,874	5.60	217,694.40
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,303	17.87	541,514.61
	FRANCO-NEVADA CORP	8,810	59.58	524,899.80
	GOLDCORP INC	45,450	21.20	963,540.00
	KINROSS GOLD CORP	58,315	3.09	180,193.35
	METHANEX CORP	4,891	67.49	330,093.59

POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	46,153	37.56	1,733,506.68
SILVER WHEATON CORP	19,655	22.77	447,544.35
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,598	14.45	514,391.10
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	5.30	257,277.90
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,900	66.42	192,618.00
YAMANA GOLD INC	62,705	4.15	260,225.75
BOMBARDIER B	104,404	2.50	261,010.00
CAE INC	14,339	15.04	215,658.56
FINNING INTERNATIONAL INC	10,642	24.72	263,070.24
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,775	45.57	399,876.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	45,124	72.60	3,276,002.40
CP RAILWAY LIMITED	8,701	203.65	1,771,958.65
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,217	71.87	1,668,605.79
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,580	40.06	544,014.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,824	46.71	458,879.04
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	23,181	26.89	623,337.09
THOMSON REUTERS CORP	21,558	47.92	1,033,059.36
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,876	132.43	513,298.68
DOLLARAMA INC	7,774	70.89	551,098.86
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	24,595	50.71	1,247,212.45
EMPIRE CO LTD 'A'	2,792	88.67	247,566.64
JEAN COUTU GROUP INC A	1,800	22.73	40,914.00
LOBLAW COMPANIES LTD	12,146	63.79	774,793.34
METRO INC	13,502	34.35	463,793.70
WESTON (GEORGE) LTD	3,406	100.46	342,166.76
SAPUTO INC	13,399	31.56	422,872.44
CATAMARAN CORPORATION	12,176	74.65	908,938.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	17,923	286.35	5,132,251.05
BANK MONTREAL	36,894	74.79	2,759,302.26
BANK NOVA SCOTIA	67,189	66.08	4,439,849.12
CANADIAN IMPERIAL BANK	21,590	93.45	2,017,585.50
NATIONAL BANK OF CANADA	19,421	48.58	943,472.18
ROYAL BANK OF CANADA	80,190	77.92	6,248,404.80
TORONTO-DOMINION BANK	102,819	54.44	5,597,466.36
CI FINANCIAL CORP	14,619	33.89	495,437.91
IGM FINANCIAL INC	6,544	42.26	276,549.44
ONEX CORP	4,444	70.48	313,213.12
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,155	631.97	729,925.35
GREAT-WEST LIFECO INC	17,342	36.75	637,318.50
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,595	43.16	284,640.20
INTACT FINANCIAL CORP	7,048	88.05	620,576.40
MANULIFE FINANCIAL CORP	109,094	23.63	2,577,891.22

	POWER CORP OF CANADA	19,529	32.49	634,497.21
	POWER FINANCIAL CORP	13,740	36.51	501,647.40
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,525	41.60	1,394,640.00
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	47,754	43.37	2,071,090.98
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	18.45	129,150.00
	CGI GROUP INC - CL A	13,234	51.80	685,521.20
	CONSTELLATION SOFTWARE -RTS	980	0.25	245.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	980	523.53	513,059.40
	OPEN TEXT CORP	7,676	52.35	401,838.60
	BLACKBERRY LIMITED	24,879	11.79	293,323.41
	BCE INC	7,138	54.37	388,093.06
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,800	42.28	921,704.00
	TELUS CORP	11,560	41.56	480,433.60
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	41.27	180,432.44
	CANADIAN UTILITIES LTD A	8,412	35.75	300,729.00
	FORTIS INC	15,900	36.06	573,354.00
	TRANSALTA CORP	15,728	9.87	155,235.36
	カナダドル 小計	2,224,040		85,977,721.90 (8,668,273,921)
ユーロ	ENI	141,778	15.78	2,237,256.84
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	17,326	10.45	181,056.70
	NESTE OIL OYJ	8,021	22.66	181,755.86
	OMV AG	8,029	25.02	200,925.72
	REPSOL SA	57,098	16.85	962,101.30
	SAIPEM	14,052	9.78	137,498.82
	TECHNIP S.A.	5,700	59.21	337,497.00
	TENARIS SA	25,356	12.81	324,810.36
	TOTAL SA	120,174	44.08	5,297,269.92
	VOPAK	3,661	45.15	165,312.45
	AIR LIQUIDE	19,401	113.20	2,196,193.20
	AKZO NOBEL	13,777	67.75	933,391.75
	ARCELORMITTAL	54,801	9.90	542,803.90
	ARKEMA	4,246	66.30	281,509.80
	BASF SE	51,435	80.85	4,158,519.75
	CRH	48,499	24.47	1,186,770.53
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,600	33.25	119,700.00
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,446	38.31	170,348.49
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,537	70.55	531,735.35
	IMERYS SA	2,111	67.95	143,442.45
	K+S AG	11,391	27.96	318,492.36
	KONINKLIJKE DSM NV	10,335	53.58	553,749.30
	LAFARGE (FRANCE)	10,303	60.32	621,476.96

LANXESS	4,650	49.40	229,733.25
LINDE AG	10,343	166.50	1,722,109.50
OCI NV	5,100	24.78	126,403.50
SOLVAY SA	3,145	123.10	387,149.50
STORA ENSO OYJ R	27,359	8.95	244,863.05
SYMRISE AG	7,200	55.70	401,040.00
THYSSEN KRUPP	20,122	23.41	471,156.63
UMICORE	4,723	42.88	202,522.24
UPM KYMMENE CORP	29,265	15.55	455,070.75
VOESTALPINE AG	7,378	40.62	299,731.25
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,854	28.40	308,307.87
AIRBUS GROUP SE	33,016	58.95	1,946,293.20
ALSTOM RGPT	11,927	27.13	323,579.51
ANDRITZ AG	3,976	53.64	213,272.64
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,606	44.09	203,078.54
BOUYGUES ORD	10,612	34.22	363,195.70
BRENTAG AG	9,493	51.50	488,889.50
CNH INDUSTRIAL NV	59,096	7.81	461,539.76
FERROVIAL SA	24,350	19.34	471,050.75
FINMECCANICA SPA	22,011	11.71	257,748.81
GEA GROUP AG	9,883	41.43	409,502.10
KONE OYJ-B	17,372	36.90	641,026.80
KONINKLIJKE PHILIPS	51,934	24.06	1,249,532.04
LEGRAND SA	14,730	50.60	745,338.00
MAN SE	1,673	92.81	155,271.13
METSO OYJ	8,009	25.28	202,467.52
OSRAM LICHT AG	5,181	45.24	234,414.34
PRYSMIAN SPA	11,275	19.89	224,259.75
REXEL SA	17,749	15.13	268,631.11
SAFRAN SA	16,669	61.05	1,017,642.45
SAINT-GOBAIN	26,538	41.92	1,112,605.65
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,183	66.02	1,992,681.66
SIEMENS	44,323	93.77	4,156,167.71
THALES SA	5,995	55.25	331,223.75
VALLOUREC	6,620	20.93	138,589.70
VINCI S.A.	26,544	52.25	1,386,924.00
WARTSILA OYJ	8,281	40.70	337,036.70
ZARDOYA OTIS SA	8,907	11.30	100,649.10
ZODIAC AEROSPACE	11,896	31.89	379,363.44
BUREAU VERITAS SA	12,914	20.19	260,733.66
EDENRED	13,096	22.96	300,684.16
RANDSTAD HOLDING NV	7,024	52.83	371,077.92

SOCIETE BIC SA	1,751	142.80	250,042.80
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	24,969	15.43	385,396.51
ADP	1,532	108.10	165,609.20
AENA SA	3,230	95.02	306,914.60
ATLANTIA SPA	23,519	22.24	523,062.56
BOLLORE	27,000	4.90	132,300.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	11,333	12.32	139,679.22
DEUTSCHE POST AG-REG	54,029	25.85	1,396,919.79
FRAPORT AG	2,688	57.40	154,291.20
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	26,998	13.17	355,698.65
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	50,952	7.06	360,128.73
TNT EXPRESS	30,460	7.64	232,714.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,528	98.04	1,816,485.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,141	75.48	237,082.68
CONTINENTAL AG	6,147	205.30	1,261,979.10
DAIMLER AG	54,040	80.85	4,369,134.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	49,216	13.62	670,321.92
MICHELIN	10,315	97.80	1,008,807.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,716	29.10	166,335.60
PEUGEOT SA	23,234	17.86	414,959.24
PIRELLI & CO	13,734	15.34	210,679.56
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,384	76.50	641,376.00
RENAULT SA	10,781	92.66	998,967.46
VALEO SA	4,526	142.95	646,991.70
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,957	212.65	1,904,706.05
VOLKSWAGEN STAMM	1,734	208.55	361,625.70
ADIDAS AG	11,542	69.25	799,283.50
CHRISTIAN DIOR	2,987	179.30	535,569.10
HERMES INTERNATIONAL	1,352	345.85	467,589.20
HUGO BOSS AG	2,797	101.15	282,916.55
KERING	4,135	153.90	636,376.50
LUXOTTICA GROUP SPA	9,131	58.80	536,902.80
LVMH	15,618	155.15	2,423,132.70
ACCOR	10,207	48.30	493,049.13
SODEXO	5,595	90.25	504,948.75
ALTICE SA	5,165	111.95	578,221.75
AXEL SPRINGER SE	1,620	47.62	77,152.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,009	30.17	271,801.53
JC DECAUX SA	3,750	37.24	139,650.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,209	120.00	145,080.00
LAGADERE S.C.A	6,893	26.26	181,044.64
NUMERICABLE-SFR	5,697	47.98	273,342.06

PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	12,898	42.38	546,681.73
PUBLICIS GROUPE	10,265	68.77	705,924.05
REED ELSEVIER NV	37,592	21.31	801,273.48
RTL GROUP	2,176	80.51	175,189.76
SES	16,209	31.38	508,638.42
TELENET GROUP HOLDING NV	2,299	48.66	111,880.83
VIVENDI	64,989	23.84	1,549,337.76
WOLTERS KLUWER	15,946	27.47	438,036.62
INDITEX	62,200	29.99	1,865,689.00
CARREFOUR	31,988	29.80	953,402.34
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	73.11	241,116.78
COLRUYT SA	2,738	41.19	112,778.22
DELHAIZE GROUP	5,476	83.11	455,110.36
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	32,188	6.91	222,644.39
JERONIMO MARTINS	10,371	11.90	123,466.75
KONINKLIJKE AHOLD NV	50,520	18.22	920,474.40
METRO STAMM	9,401	30.66	288,281.66
ANHEUSER-BUSCH INBEV	44,806	107.20	4,803,203.20
DANONE (GROUPE)	32,372	60.47	1,957,534.84
HEINEKEN HOLDING NV	5,100	61.29	312,579.00
HEINEKEN NV	12,975	67.43	874,904.25
KERRY GROUP PLC-A	9,623	66.40	638,967.20
PERNOD-RICARD	11,868	105.45	1,251,480.60
REMY COINTREAU	1,720	63.58	109,357.60
UNILEVER NV-CVA	91,461	36.86	3,371,252.46
BEIERSDORF AG	5,153	77.85	401,161.05
HENKEL AG & CO KGAA	5,713	89.33	510,342.29
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,954	104.80	1,043,179.20
LOREAL	14,507	164.70	2,389,302.90
ESSILOR INTERNATIONAL	11,395	106.25	1,210,718.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,053	75.07	904,818.71
FRESENIUS SE&CO KGAA	21,266	54.58	1,160,698.28
BAYER	46,328	124.25	5,756,254.00
GRIFOLS SA	8,770	35.22	308,923.25
MERCK KGAA	7,744	91.53	708,808.32
ORION OYJ-CLASS B	6,539	30.44	199,047.16
QIAGEN N.V.	11,549	21.40	247,148.60
SANOFI	66,537	87.85	5,845,275.45
UCB (GROUPE)	7,393	64.49	476,774.57
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	15,125	1.82	27,527.50
BANCO BILBAO VIZCAYA	352,174	8.84	3,115,331.20
BANCO DE SABADELL SA	257,172	2.28	586,352.16

BANCO POPOLARE SPA	20,969	14.89	312,228.41
BANCO POPULAR ESPANOL	91,462	4.54	415,237.48
BANCO SANTANDER SA	805,262	6.44	5,188,303.06
BANK OF IRELAND	1,841,000	0.33	624,099.00
BANKIA SA	269,344	1.15	311,631.00
BANKINTER SA	36,000	6.71	241,560.00
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,340,000	0.08	197,964.00
BNP PARIBAS	59,434	54.39	3,232,615.26
CAIXABANK	136,820	4.33	593,661.98
COMMERZBANK AG	60,211	11.80	710,790.85
CREDIT AGRICOLE SA	58,906	13.23	779,326.38
ERSTE GROUP BANK AG	16,259	25.43	413,547.66
ING GROEP NV-CVA	217,100	14.41	3,129,496.50
INTESA SANPAOLO	730,011	3.15	2,303,914.71
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	2.78	123,940.78
KBC GROEP NV	14,552	58.14	846,053.28
NATIXIS	60,710	6.49	394,129.32
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	13.17	103,634.55
SOCIETE GENERALE	40,557	42.19	1,711,302.61
UNICREDIT SPA	259,423	6.20	1,608,422.60
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,872	7.12	390,963.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	77,064	27.88	2,148,544.32
DEUTSCHE BOERSE	11,418	71.65	818,099.70
EURAZEO	2,985	59.64	178,025.40
EXOR SPA	5,390	43.21	232,901.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,086	72.66	369,548.76
MEDIOBANCA	30,850	8.82	272,251.25
WENDEL	1,767	110.50	195,253.50
AEGON	101,474	6.55	665,567.96
AGEAS	12,758	33.71	430,135.97
ALLIANZ SE-REG	25,599	139.75	3,577,460.25
ASSICURAZIONI GENERALI	68,047	16.63	1,131,621.61
AXA	106,711	22.15	2,364,182.20
CNP ASSURANCES	11,327	14.71	166,620.17
DELTA LLOYD NV	13,451	15.09	202,975.59
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,749	85.41	320,202.09
MAPFRE SA	46,919	3.12	146,434.19
MUENCHENER RUECKVERSICH.	9,610	161.80	1,554,898.00
NN GROUP NV	6,900	24.75	170,809.50
SAMPO OYJ-A SHS	25,077	41.75	1,046,964.75
SCOR SE	9,111	31.01	282,577.66
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	38,251	2.39	91,725.89

DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	18,900	27.24	514,836.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	17,557	21.59	379,055.63
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	25,073	35.30	885,076.90
ATOS	5,308	67.52	358,396.16
CAP GEMINI SA	8,532	77.73	663,192.36
DASSAULT SYSTEMES SA	7,760	68.27	529,775.20
GEMALTO	4,337	78.10	338,719.70
SAP SE	54,017	64.83	3,501,922.11
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,983	39.63	316,366.29
ALCATEL-LUCENT	168,671	3.43	579,384.88
NOKIA CORP	211,886	6.36	1,347,594.96
BELGACOM	8,202	31.04	254,631.09
DEUTSCHE TELEKOM	179,491	15.01	2,695,057.36
ELISA A	7,731	27.15	209,896.65
ILIAD SA	1,579	206.30	325,747.70
KPN (KON.)	171,672	3.25	558,449.01
ORANGE	105,318	13.55	1,427,585.49
TELECOM ITALIA ORD	563,235	1.11	625,754.08
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.89	310,510.99
TELEFONICA	251,445	12.56	3,158,149.20
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,607	5.13	151,943.12
E.ON SE	111,530	12.68	1,414,200.40
ELECTRICITE DE FRANCE	15,750	20.68	325,710.00
ENAGAS	11,715	25.12	294,339.37
ENDESA	15,100	16.46	248,546.00
ENEL	388,654	4.16	1,616,800.64
ENEL GREEN POWER SPA	82,675	1.73	143,358.45
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	131,710	3.35	441,755.34
FORTUM OYJ	24,361	16.51	402,200.11
GAS NATURAL SDG SA	19,754	21.56	425,896.24
GDF SUEZ	81,941	17.26	1,414,711.36
IBERDROLA SA	310,346	6.05	1,878,834.68
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,495	73.36	476,473.20
RWE STAMM	26,985	19.83	535,247.47
SNAM SPA	126,456	4.25	537,690.91
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	15,575	16.89	263,061.75
TERNA SPA	92,159	4.13	381,353.94
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,294	18.19	460,097.86
ASML HOLDING NV	20,107	96.38	1,937,912.66
INFINEON TECHNOLOGIES	65,344	11.30	738,387.20
STMICROELECTRONICS	36,899	7.49	276,594.90
	14,903,718		196,410,156.49

ユーロ 小計				(27,615,268,002)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	22,875	8.82	201,757.50
	BG GROUP	191,292	10.93	2,090,821.56
	BP PLC	1,025,072	4.41	4,524,155.27
	PETROFAC LTD	16,540	8.92	147,619.50
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	219,121	18.83	4,126,048.43
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	135,685	18.97	2,573,944.45
	TULLOW OIL PLC	45,784	3.71	169,995.99
	ANGLO AMERICAN PLC	76,832	9.85	757,102.52
	ANTOFAGASTA PLC	21,571	7.26	156,713.31
	BHP BILLITON PLC	117,584	13.15	1,546,229.60
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,430	28.39	210,937.70
	FRESNILLO PLC	14,610	7.15	104,461.50
	GLENCORE PLC	619,751	2.75	1,706,174.50
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,443	32.33	402,282.19
	LONMIN PLC	7,062	1.39	9,830.30
	MONDI PLC	16,400	13.95	228,780.00
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,875	46.52	273,305.00
	REXAM PLC	38,985	5.57	217,341.37
	RIO TINTO PLC REG	70,883	27.81	1,971,256.23
	ASHTREAD GROUP PLC	29,500	11.34	334,530.00
	BAE SYSTEMS PLC	177,341	4.89	867,374.83
	BUNZL PLC	19,262	18.64	359,043.68
	COBHAM PLC	73,053	2.89	211,707.59
	IMI PLC	14,582	12.07	176,004.74
	MEGGITT PLC	43,669	4.89	213,759.75
	MELROSE INDUSTRIES PLC	52,939	2.69	142,617.66
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	103,583	9.62	996,468.46
	SMITHS GROUP PLC	23,298	11.74	273,518.52
	TRAVIS PERKINS PLC	14,871	21.45	318,982.95
	WEIR GROUP PLC/THE	12,587	19.22	241,922.14
	WOLSELEY LTD	15,382	40.41	621,586.62
	AGGREKO PLC	15,294	15.12	231,245.28
	BABCOCK INTL GROUP PLC	14,809	11.39	168,674.51
CAPITA GROUP PLC	36,666	12.21	447,691.86	
EXPERIAN PLC	55,289	12.18	673,420.02	
G4S PLC	93,926	2.90	272,667.17	
INTERTEK GROUP PLC	9,459	25.40	240,258.60	
EASYJET PLC	9,909	15.63	154,877.67	
ROYAL MAIL PLC	30,000	5.11	153,450.00	
NEW GKN	93,977	3.62	340,384.69	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	45,000	5.89	265,050.00	

BURBERRY GROUP PLC	26,566	16.36	434,619.76
PERSIMMON PLC	15,558	18.95	294,824.10
TAYLOR WIMPAY PLC	150,000	1.83	274,800.00
CARNIVAL PLC	9,605	31.64	303,902.20
COMPASS GROUP PLC	94,413	11.18	1,055,537.34
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,698	26.64	364,914.72
MERLIN ENTERTAINME	22,600	4.40	99,530.40
TUI AG-DI	23,176	11.94	276,721.44
WHITBREAD PLC	10,052	49.97	502,298.44
WILLIAM HILL	55,124	4.23	233,450.14
ITV PLC	231,335	2.62	607,948.38
PEARSON	46,083	12.73	586,636.59
REED ELSEVIER PLC	63,380	10.77	682,602.60
SKY PLC	58,491	10.15	593,683.65
WPP PLC	74,039	14.72	1,089,854.08
DIXONS CARPHONE PLC	53,052	4.59	243,986.14
KINGFISHER PLC	127,494	3.74	477,465.03
MARKS & SPENCER GROUP PLC	90,768	5.55	503,762.40
NEXT PLC	7,933	72.20	572,762.60
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	12,900	6.56	84,624.00
MORRISON SUPERMARKETS	123,161	1.71	211,097.95
SAINSBURY (J) PLC	73,619	2.49	183,311.31
TESCO	466,810	2.02	943,423.01
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,870	29.14	579,011.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	104,569	34.23	3,579,396.87
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,138	14.03	184,326.14
DIAGEO	140,870	18.87	2,658,921.25
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	53,817	31.88	1,715,685.96
SABMILLER PLC	54,319	33.44	1,816,427.36
TATE & LYLE	29,097	5.47	159,306.07
UNILEVER PLC	71,831	27.92	2,005,521.52
RECKITT BENCKISER PLC	36,132	56.62	2,045,793.84
SMITH & NEPHEW PLC	49,408	11.00	543,488.00
ASTRAZENECA	70,835	42.46	3,007,654.10
GLAXOSMITHKLINE	272,770	13.76	3,753,315.20
SHIRE PLC	33,091	52.50	1,737,277.50
BARCLAYS	925,723	2.61	2,421,228.50
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,077,962	6.13	6,615,452.79
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,206,955	0.86	2,773,374.68
ROYAL BANK OF SCOTLAND	153,644	3.52	541,748.74
STANDARD CHARTERED PLC	138,297	10.34	1,429,990.98
3I GROUP PLC	54,307	5.46	296,516.22

	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,195	4.21	232,702.12
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,622	12.22	166,460.84
	ICAP PLC	30,718	5.38	165,416.43
	INVESTEC PLC	35,539	5.71	202,927.69
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	15,143	23.46	355,254.78
	SCHRODERS PLC	7,525	32.20	242,305.00
	ADMIRAL GROUP PLC	12,465	14.36	178,997.40
	AVIVA PIC	229,387	5.06	1,161,845.15
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	93,600	3.44	322,171.20
	LEGAL & GENERAL GROUP	334,018	2.60	868,446.80
	OLD MUTUAL PLC	275,393	2.07	570,614.29
	PRUDENTIAL	144,442	15.58	2,250,406.36
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	53,389	4.26	227,864.25
	STANDARD LIFE PLC	108,016	4.68	505,946.94
	SAGE GROUP PLC	59,665	5.41	322,787.65
	BT GROUP PLC	473,661	4.40	2,087,424.02
	INMARSAT PLC	23,413	9.80	229,447.40
	VODAFONE GROUP PLC	1,493,284	2.41	3,610,014.07
	CENTRICA PLC	277,189	2.64	732,887.71
	NATIONAL GRID PLC	211,301	8.48	1,792,043.78
	SEVERN TRENT PLC	13,547	21.40	289,905.80
	SSE PLC	55,522	15.77	875,581.94
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	39,385	9.57	376,914.45
	ARM HOLDINGS PLC	78,919	11.12	877,579.28
	イギリスポンド 小計	16,141,021		96,256,132.81 (18,438,824,801)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	16,064	17.99	288,991.36
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	396	393.00	155,628.00
	GIVAUDAN-REG	516	1,674.00	863,784.00
	HOLCIM LTD	12,497	70.50	881,038.50
	SIKA AG-BR	114	3,133.00	357,162.00
	SYNGENTA AG	5,170	402.00	2,078,340.00
	ABB LTD	122,522	21.17	2,593,790.74
	GEBERIT AG-REG	2,189	333.50	730,031.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	914	163.40	149,347.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,822	163.70	461,961.40
	SULZER AG-REG	1,409	103.30	145,549.70
	ADECCO	9,518	75.00	713,850.00
	SGS SA	297	1,826.00	542,322.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,417	131.70	450,018.90
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	28,906	76.80	2,219,980.80
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,593	367.70	585,746.10

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	72.60	218,090.40	
	ARYZTA AG	5,627	51.45	289,509.15	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,075.00	138,675.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	47	5,010.00	235,470.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	60,050.00	360,300.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	180,877	69.30	12,534,776.10	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,226	135.40	436,800.40	
	ACTELION LTD-REG	5,618	139.60	784,272.80	
	LONZA GROUP AG-REG	3,212	125.60	403,427.20	
	NOVARTIS	129,084	93.60	12,082,262.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	39,387	266.70	10,504,512.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	85,480	25.48	2,178,030.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,980	50.55	605,589.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	63.70	145,809.30	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	859	288.25	247,606.75	
	UBS GROUP AG	204,739	20.06	4,107,064.34	
	BALOISE HOLDING AG	3,051	114.50	349,339.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,853	215.80	399,877.40	
	SWISS RE LTD	19,937	85.00	1,694,645.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,407	289.10	2,430,463.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,788	76.25	212,585.00	
	SWISSCOM	1,398	525.50	734,649.00	
	スイスフラン 小計	921,342		64,311,298.34 (8,607,424,169)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,036	132.20	1,458,959.20	
	BOLIDEN AB	15,596	166.50	2,596,734.00	
	ALFA LAVAL AB	17,624	156.50	2,758,156.00	
	ASSA ABLOY AB-B	54,672	159.50	8,720,184.00	
	ATLAS COPCO A	38,928	247.60	9,638,572.80	
	ATLAS COPCO B	20,917	219.80	4,597,556.60	
	SANDVIK AB	60,966	99.20	6,047,827.20	
	SKANSKA B	19,294	171.70	3,312,779.80	
	SKF AB-B	22,705	202.20	4,590,951.00	
	VOLVO B	84,959	109.00	9,260,531.00	
	SECURITAS B	18,644	111.30	2,075,077.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	14,061	253.50	3,564,463.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	61.90	1,351,957.90	
	HENNES & MAURITZ B	54,238	324.70	17,611,078.60	
	ICA GRUPPEN AB	3,500	290.10	1,015,350.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,713	240.10	3,052,391.30	
	SCA SV CELLULOSA B	34,444	215.20	7,412,348.80	
	ELEKTA AB-B SHS	20,086	52.35	1,051,502.10	

	GETINGE AB-B SHS	12,973	203.00	2,633,519.00	
	NORDEA BANK AB	168,034	106.10	17,828,407.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	81,888	102.40	8,385,331.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	84,906	122.00	10,358,532.00	
	SWEDBANK AB-A	49,107	192.20	9,438,365.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	160.60	1,386,138.60	
	INVESTOR AB-B SHS	26,580	314.40	8,356,752.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,657	270.90	3,699,681.30	
	ERICSSON (LM) B	167,922	93.60	15,717,499.20	
	HEXAGON AB-B SHS	15,175	303.10	4,599,542.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,878	644.50	2,499,371.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,919	101.20	1,914,602.80	
	TELIASONERA AB	142,890	49.05	7,008,754.50	
	スウェーデンクローナ 小計	1,320,784		183,942,917.90 (2,762,822,626)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	17,906	98.15	1,757,473.90	
	STATOIL ASA	62,308	143.80	8,959,890.40	
	SUBSEA 7 SA	13,940	82.00	1,143,080.00	
	NORSK HYDRO	71,518	37.43	2,676,918.74	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,504	374.30	3,931,647.20	
	ORKLA	46,184	62.50	2,886,500.00	
	DNB ASA	54,416	135.30	7,362,484.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,316	121.10	1,249,267.60	
	TELENOR ASA	42,313	176.90	7,485,169.70	
	ノルウェークローネ 小計	329,405		37,452,432.34 (600,362,490)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S	14,320	317.40	4,545,168.00	
	VESTAS WIND SYSSEMS	12,116	318.90	3,863,792.40	
	ISS A/S	6,669	227.50	1,517,197.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	232	12,180.00	2,825,760.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	420	12,530.00	5,262,600.00	
	DSV A/S	10,940	227.90	2,493,226.00	
	PANDORA A/S	6,920	669.00	4,629,480.00	
	CARLSBERG AS-B	6,285	599.00	3,764,715.00	
	COLOPLAST-B	6,576	493.10	3,242,625.60	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	956	561.00	536,316.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	106,550	369.60	39,380,880.00	
	DANSKE BANK A/S	39,243	194.50	7,632,763.50	
	TRYG A/S	4,445	131.20	583,184.00	
TDC A/S	43,672	50.80	2,218,537.60		
	デンマーククローネ 小計	259,344		82,496,245.60 (1,555,054,229)	

オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,922	31.77	410,531.94
	ORIGIN ENERGY LIMITED	65,596	12.56	823,885.76
	SANTOS	56,325	8.00	450,600.00
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,674	35.60	1,483,594.40
	WORLEYPARSONS LTD	10,691	10.19	108,941.29
	ALUMINA LIMITED	135,453	1.59	215,370.27
	AMCOR	70,421	14.08	991,527.68
	BHP BILLITON LTD	178,797	27.60	4,934,797.20
	BORAL LIMITED	48,785	5.92	288,807.20
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	81,907	2.39	195,757.73
	ILUKA RESOURCES LTD	28,163	8.21	231,218.23
	INCITEC PIVOT LTD	108,462	3.85	417,578.70
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	23,392	16.25	380,120.00
	NEWCREST MINING LIMITED	46,131	13.44	620,000.64
	ORICA LTD	19,570	21.60	422,712.00
	RIO TINTO LTD	23,753	56.37	1,338,956.61
	SOUTH32 LTD	307,797	2.09	643,295.73
	CIMIC GROUP LIMITED	6,260	23.07	144,418.20
	BRAMBLES LTD	86,573	10.89	942,779.97
	SEEK LTD	17,113	16.31	279,113.03
	ASCIANO GROUP	62,700	6.48	406,296.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	114,077	5.21	594,341.17
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	35,104	3.24	113,736.96
	TRANSURBAN GROUP	105,407	9.96	1,049,853.72
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	21,411	7.65	163,794.15
	CROWN RESORTS LTD	22,372	12.78	285,914.16
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,988	43.47	129,888.36
	TABCORP HOLDINGS	46,982	4.63	217,526.66
	TATTS GROUP LTD	87,232	3.85	335,843.20
	REA GROUP LTD	3,000	38.35	115,050.00
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,021	4.70	173,998.70
	WESFARMERS LTD	62,330	41.28	2,572,982.40
	WOOLWORTHS LTD	69,567	27.11	1,885,961.37
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	35,080	9.41	330,102.80
TREASURY WINE ESTATES LTD	40,720	5.04	205,228.80	
COCHLEAR LIMITED	3,095	82.70	255,956.50	
HEALTHSCOPE LTD	45,805	2.72	124,589.60	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,039	59.70	479,928.30	
SONIC HEALTHCARE LTD	19,678	19.69	387,459.82	
CSL LIMITED	26,922	90.41	2,434,018.02	
AUST AND NZ BANKING GROUP	155,322	31.16	4,839,833.52	
BANK OF QUEENSLAND LTD	19,098	12.45	237,770.10	

	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	22,032	11.75	258,876.00
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	91,175	79.82	7,277,588.50
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	144,535	31.60	4,567,306.00
	WESTPAC BANKING	175,455	31.35	5,500,514.25
	ASX LTD	10,073	40.08	403,725.84
	MACQUARIE GROUP LIMITED	16,982	78.70	1,336,483.40
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	4,900	7.34	35,966.00
	AMP LTD	166,300	6.06	1,007,778.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	128,938	5.34	688,528.92
	MEDIBANK PRIVATE LTD	157,000	2.04	320,280.00
	QBE INSURANCE GROUP	77,967	13.59	1,059,571.53
	SUNCORP GROUP LIMITED	76,099	13.15	1,000,701.85
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,680	12.38	355,058.40
	TELSTRA CORP	251,278	6.02	1,512,693.56
	TPG TELECOM LTD	8,100	8.62	69,822.00
	AGL ENERGY LTD	40,729	15.53	632,521.37
	AUSNET SERVICES	117,666	1.39	164,144.07
	オーストラリアドル 小計	3,911,644		58,855,640.58 (5,627,776,352)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,101	8.38	336,046.38
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,261	5.06	229,020.66
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	8.30	182,600.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	105,967	2.88	305,184.96
	CONTACT ENERGY LTD	14,237	5.45	77,591.65
	MERIDIAN ENERGY LTD	35,277	2.22	78,314.94
	MIGHTY RIVER POWER	19,544	2.73	53,355.12
	ニュージーランドドル 小計	282,387		1,262,113.71 (112,277,635)
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	73,500	12.26	901,110.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	43,000	18.92	813,560.00
	MTR CORP	80,500	35.85	2,885,925.00
	LI & FUNG	377,400	6.21	2,343,654.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,000	25.65	2,154,600.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	47,000	24.95	1,172,650.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	139,000	33.85	4,705,150.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,400	13.78	832,312.00
	SANDS CHINA LTD	145,000	29.45	4,270,250.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	90,000	11.22	1,009,800.00
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	9.71	1,359,400.00
	WYNN MACAU LTD	107,200	14.32	1,535,104.00
	WH GROUP LTD	249,000	5.52	1,374,480.00
	BANK EAST ASIA	52,964	34.50	1,827,258.00
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	216,000	32.15	6,944,400.00	

	HANG SENG BANK	45,400	151.60	6,882,640.00	
	FIRST PACIFIC CO	112,000	6.75	756,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	63,600	289.20	18,393,120.00	
	AIA GROUP LTD	671,200	50.15	33,660,680.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	160,448	63.85	10,244,604.80	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	160,448	112.00	17,970,176.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	117,000	23.85	2,790,450.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	62,839	53.05	3,333,608.95	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	31,000	33.85	1,049,350.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	30.75	1,137,750.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	10.24	3,123,200.00	
	SINO LAND CO	186,600	13.02	2,429,532.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	94,000	127.30	11,966,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	31,000	100.40	3,112,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	24.85	1,664,950.00	
	WHARF HOLDINGS	73,000	52.10	3,803,300.00	
	WHEELOCK & CO LTD	49,000	40.65	1,991,850.00	
	PCCW LTD	183,000	4.76	871,080.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	62.90	2,138,600.00	
	CLP HOLDINGS	103,000	65.65	6,761,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	376,933	16.12	6,076,159.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	81,500	69.55	5,668,325.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	77.05	901,485.00	
	香港ドル 小計	4,961,632		180,857,064.71 (2,902,755,888)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	77,000	8.39	646,030.00	
	NOBLE GROUP LTD	292,145	0.66	192,815.70	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	3.90	241,800.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	49,400	2.77	136,838.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	75,500	3.30	249,150.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	152,000	1.42	215,840.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	114,000	3.04	346,560.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,500	10.64	345,800.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	295,300	0.91	268,723.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	82,150	4.07	334,350.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,300	36.02	190,906.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.40	194,688.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	102,400	3.28	335,872.00	
	DBS GROUP	98,000	20.42	2,001,160.00	
	OCBC BANK	167,350	9.95	1,665,132.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	72,300	22.92	1,657,116.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	40,100	7.90	316,790.00	

	CAPITALAND LTD	149,000	3.39	505,110.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	9.74	214,280.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	177,000	2.69	476,130.00	
	UOL GROUP LIMITED	19,400	7.19	139,486.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	449,180	4.12	1,850,621.60	
	STARHUB LTD	21,000	4.02	84,420.00	
	シンガポールドル 小計	3,041,745		12,609,619.30	(1,160,841,552)
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	310	1,151.00	356,810.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	27.79	791,570.36	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	256	1,410.00	360,960.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	48,017	230.20	11,053,513.40	
	BANK HAPOALIM BM	64,237	20.85	1,339,341.45	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,035	15.33	1,257,596.55	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,694	47.14	551,255.16	
	AZRIELI GROUP	700	161.50	113,050.00	
	NICE SYSTEMS LTD	2,614	256.40	670,229.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,181	6.77	793,315.37	
	イスラエルシェケル 小計	355,528		17,287,641.89	(562,366,990)
	合 計	66,212,200		211,429,906,747	(211,429,906,747)

(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	188,370.00	
		アメリカドル 小計	299,000	188,370.00	(23,444,530)
	オーストラリアドル	APA GROUP	58,103	503,171.98	
		LEND LEASE GROUP	30,349	473,444.40	
		SYDNEY AIRPORT	51,840	277,344.00	
	オーストラリアドル 小計	140,292	1,253,960.38	(119,903,691)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	165,000	1,575,750.00	
香港ドル 小計	165,000	1,575,750.00	(25,290,787)		
	投資信託受益証券合計	604,292	168,639,008	(168,639,008)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	21,733	422,706.85	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	53,870	463,820.70	

	AMERICAN TOWER CORPORATION	23,827	2,193,751.89	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,911	560,004.24	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,403	1,189,291.95	
	BOSTON PROPERTIES	8,556	1,068,558.84	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,722	182,316.42	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,153	376,323.59	
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7,063	180,035.87	
	CROWN CASTLE INTL CORP	18,453	1,512,776.94	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,151	520,441.35	
	DUKE REALTY CORP	19,266	362,393.46	
	EQUINIX INC	3,172	817,773.32	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,429	1,374,407.46	
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,779	799,296.29	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,404	355,745.32	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,213	545,246.46	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	32,369	857,454.81	
	HCP INC	25,591	951,729.29	
	HEALTH CARE REIT INC	19,315	1,309,750.15	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	41,545	807,219.35	
	IRON MOUNTAIN INC	9,882	315,729.90	
	KIMCO REALTY CORP	24,313	560,657.78	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,727	259,240.85	
	MACERICH CO/THE	7,483	596,320.27	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,719	439,157.43	
	PROLOGIS INC	27,933	1,091,342.31	
	PUBLIC STORAGE	8,504	1,581,233.76	
	REALTY INCOME CORP	13,146	591,701.46	
	REGENCY CENTERS CORP	5,012	305,982.60	
	SIMON PROPERTY GROUP	17,516	3,057,943.28	
	SL GREEN REALTY CORP	5,753	659,121.21	
	UDR INC	15,851	501,208.62	
	VENTAS INC	19,109	1,208,262.07	
	VORNADO REALTY TRUST	10,082	980,978.60	
	アメリカドル 小計	575,955	28,999,924.69 (3,609,330,626)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	5,050	111,504.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,532	201,556.32	
	カナダドル 小計	12,582	313,060.32 (31,562,741)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	FONCIERE DES REGIONS	1,902	144,932.40	

	GECINA SA	1,357	155,647.90	
	ICADE	1,843	125,029.12	
	KLEPIERRE	9,049	353,318.20	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,523	1,244,884.20	
	ユーロ 小計	1,625,258	2,023,811.82 (284,547,941)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	54,123	445,973.52	
	HAMMERSON PLC	43,137	277,155.22	
	INTU PROPERTIES PLC	53,831	172,151.53	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,230	553,759.60	
	SEGRO PLC	45,745	189,841.75	
	イギリスポンド 小計	241,066	1,638,881.62 (313,944,163)	
オーストラ リアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	45,152	337,736.96	
	FEDERATION CENTRES	198,963	594,899.37	
	GOODMAN GROUP	95,320	581,452.00	
	GPT GROUP	106,799	461,371.68	
	MIRVAC GROUP	229,116	433,029.24	
	SCENTRE GROUP	315,785	1,225,245.80	
	STOCKLAND	142,485	595,587.30	
	WESTFIELD CORP	113,674	1,025,339.48	
	オーストラリアドル 小計	1,247,294	5,254,661.83 (502,450,764)	
香港ドル	LINK REIT	124,000	5,629,600.00	
	香港ドル 小計	124,000	5,629,600.00 (90,355,080)	
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,000	329,820.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	168,300.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	144,600	299,322.00	
	SUNTEC REIT	113,000	194,925.00	
	シンガポールドル 小計	505,600	992,367.00 (91,357,306)	
	投資証券合計	4,331,755	4,923,548,621 (4,923,548,621)	
	合計		5,092,187,629 (5,092,187,629)	

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 607銘柄	97.3%			61.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			2.6%	1.7%
カナダドル	株式 93銘柄	99.6%			4.0%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	99.0%			12.8%
	投資証券 6銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 107銘柄	98.3%			8.5%
	投資証券 5銘柄			1.7%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			4.0%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.3%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.0%			2.6%
	投資信託受 益証券 3銘柄		1.9%		0.1%
	投資証券 8銘柄			8.0%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	96.2%			1.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 23銘柄	92.7%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%			0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 6月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	198,451,402
コール・ローン	3,414,292,763
国債証券	218,795,812,983
派生商品評価勘定	36,453,272
未収入金	119,768,605
未収利息	2,009,913,080
前払金	26,064,481
前払費用	21,051,984
差入委託証拠金	46,721,659
流動資産合計	224,668,530,229
資産合計	224,668,530,229
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,064,481
未払金	5,553,528
未払解約金	879,536,651
流動負債合計	911,154,660
負債合計	911,154,660
純資産の部	
元本等	
元本	90,258,230,807
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	133,499,144,762
元本等合計	223,757,375,569
純資産合計	223,757,375,569
負債純資産合計	224,668,530,229

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 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> <p>(2)為替予約取引</p>

平成27年 6月10日現在	
	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。
	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。
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) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (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27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	90,258,230,807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 2.4791円 (1万口当たり純資産額) (24,791円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27年 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27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27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27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26年12月11日
期首元本額	109,005,662,924円
期中追加設定元本額	3,403,938,028円
期中一部解約元本額	22,151,370,145円
期末元本額	90,258,230,807円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	3,140,162,720円
D C 外国債券インデックスファンド	1,825,891,334円
D C 外国債券インデックスファンド L	9,914,509,579円
物価連動債組入世界債券ファンド	38,041,586円
D C バランスファンド 3 0	399,476,029円
D C バランスファンド 5 0	423,860,967円
D C バランスファンド 7 0	85,188,944円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	46,212,455円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	25,294,722円
新生・4分散ファンド	54,015,496円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	421,231,442円
4 資産インデックスバランスオープン（分配型）	10,743,785円
4 資産インデックスバランスオープン（成長型）	40,341,461円
外国債券インデックス e	1,657,335,938円
インデックスコレクション（外国債券）	1,639,325,262円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	273,642,741円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	193,326,156円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	64,603,836円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	2,505,825,383円

区分	平成27年 6月10日現在
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,059,866,894円
外国債券インデックスファンドF（一般投資家私募）	183,540,358円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,731,543,657円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,394,266,308円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	5,448,619,294円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	7,599,707,984円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	1,395,128,539円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	85,581,898円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,746,167,467円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	4,288,559,664円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,165,921,381円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,430,674,426円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	533,940,867円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	12,477,371,693円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,700,627,072円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	220,561,264円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	939,065,412円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	225,848,276円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	182,251,311円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	80,226,914円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	168,361,590円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,406,299,618円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	20,072,387円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	452,395,334円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	145,193,033円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	2,385,848,772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）	31,258,526円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	301,032円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 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	8,408,060,122
合計	8,408,060,122

(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

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	1,648,245,897	-	1,622,181,416	26,064,481
	合計	1,648,245,897	-	1,622,181,416	26,064,481

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 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	2,190,247,316	-	2,226,698,200	36,450,884
	アメリカドル	1,014,963,185	-	1,016,756,500	1,793,315
	カナダドル	65,734,482	-	66,528,000	793,518
	ユーロ	940,667,432	-	972,952,000	32,284,568
	イギリスポンド 売建	168,882,217	-	170,461,700	1,579,483
	イギリスポンド 売建	97,333,731	-	97,331,343	2,388
	イギリスポンド 売建	97,333,731	-	97,331,343	2,388
	合計	2,287,581,047	-	2,324,029,543	36,453,272

(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% 06/15/16	1,050,000.00	1,051,476.56	
		T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,967,693.52	
		T 0.5% 11/30/16	4,000,000.00	3,997,578.12	
		T 0.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,000,097.65	
		T 0.625% 04/30/18	2,850,000.00	2,812,371.10	
		T 0.625% 05/31/17	3,000,000.00	2,994,785.16	
		T 0.625% 07/15/16	7,000,000.00	7,016,816.38	
		T 0.625% 08/15/16	4,700,000.00	4,710,281.25	
		T 0.625% 08/31/17	2,500,000.00	2,489,013.67	
		T 0.625% 09/30/17	3,250,000.00	3,232,607.43	
		T 0.625% 10/15/16	4,000,000.00	4,006,484.36	
		T 0.625% 11/15/16	8,500,000.00	8,511,787.12	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,964,453.15	
		T 0.625% 12/15/16	9,000,000.00	9,007,910.19	
		T 0.75% 02/28/18	4,500,000.00	4,466,777.35	
		T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,957,714.85	
		T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,999,453.12	
		T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,594,656.25	
		T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,975,000.00	
		T 0.875% 01/31/17	2,000,000.00	2,008,789.06	
		T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,994,257.82	
		T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,024,843.78	
		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,018,359.40	
		T 0.875% 04/30/17	3,350,000.00	3,361,711.90	
		T 0.875% 05/15/17	6,000,000.00	6,020,039.04	
		T 0.875% 06/15/17	4,550,000.00	4,562,885.73	
		T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	4,008,671.88	
		T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,866,601.55	
		T 0.875% 09/15/16	5,000,000.00	5,025,683.60	
		T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,009,531.26	
		T 0.875% 12/31/16	5,000,000.00	5,024,414.05	
		T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,943,632.82	
		T 1.125% 05/31/19	4,800,000.00	4,735,125.02	
		T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,074,671.88	
T 1.25% 01/31/19	4,800,000.00	4,778,906.25			
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,985,507.82			
T 1.375% 02/28/19	5,500,000.00	5,494,628.92			
T 1.375% 04/30/20	8,250,000.00	8,105,625.00			

T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,908,789.05	
T 1.375% 06/30/18	3,500,000.00	3,524,814.44	
T 1.375% 07/31/18	3,000,000.00	3,018,281.25	
T 1.375% 09/30/18	2,520,000.00	2,530,680.46	
T 1.375% 11/30/18	3,000,000.00	3,008,261.73	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,704,119.13	
T 1.5% 01/31/19	5,550,000.00	5,575,365.22	
T 1.5% 01/31/22	5,000,000.00	4,799,902.35	
T 1.5% 02/28/19	6,100,000.00	6,122,636.73	
T 1.5% 05/31/19	1,350,000.00	1,350,500.97	
T 1.5% 06/30/16	3,450,000.00	3,490,429.68	
T 1.5% 07/31/16	2,500,000.00	2,530,761.72	
T 1.5% 08/31/18	2,500,000.00	2,522,558.60	
T 1.5% 10/31/19	3,200,000.00	3,182,250.01	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	4,969,726.55	
T 1.5% 12/31/18	2,500,000.00	2,513,867.20	
T 1.625% 03/31/19	4,400,000.00	4,431,367.20	
T 1.625% 04/30/19	4,000,000.00	4,024,531.24	
T 1.625% 06/30/19	4,000,000.00	4,017,343.76	
T 1.625% 07/31/19	6,500,000.00	6,520,312.50	
T 1.625% 08/15/22	5,700,000.00	5,483,244.16	
T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	3,834,921.88	
T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,557,181.63	
T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,476,105.48	
T 1.75% 05/15/23	7,950,000.00	7,631,534.20	
T 1.75% 05/31/16	4,600,000.00	4,662,890.64	
T 1.75% 10/31/18	1,800,000.00	1,829,109.38	
T 1.875% 06/30/20	3,200,000.00	3,216,624.99	
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,046,562.50	
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,238,217.57	
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,014,269.51	
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,449,755.85	
T 1% 03/31/17	5,000,000.00	5,030,957.05	
T 1% 05/31/18	1,000,000.00	996,640.63	
T 1% 06/30/19	1,200,000.00	1,176,140.62	
T 1% 08/31/16	4,850,000.00	4,882,491.21	
T 1% 08/31/19	2,800,000.00	2,734,046.86	
T 1% 09/15/17	4,100,000.00	4,114,093.75	
T 1% 09/30/16	3,000,000.00	3,021,035.16	
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,875,390.65	
T 1% 10/31/16	6,200,000.00	6,241,292.99	
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,928,556.63	

T 1% 12/15/17	6,000,000.00	6,008,437.50	
T 2.125% 01/31/21	5,000,000.00	5,049,316.40	
T 2.125% 05/15/25	2,500,000.00	2,432,958.97	
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,015,585.93	
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,910,535.14	
T 2.125% 08/31/20	6,000,000.00	6,091,171.86	
T 2.25% 03/31/21	3,000,000.00	3,044,179.68	
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,764,992.21	
T 2.25% 07/31/18	4,500,000.00	4,648,798.84	
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,551,416.01	
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	4,925,000.00	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,065,468.76	
T 2.375% 05/31/18	3,800,000.00	3,940,199.21	
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,592,578.12	
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,067,656.26	
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	6,680,501.92	
T 2.375% 12/31/20	7,200,000.00	7,374,937.53	
T 2.5% 02/15/45	900,000.00	783,298.82	
T 2.5% 05/15/24	5,800,000.00	5,852,562.50	
T 2.5% 06/30/17	3,200,000.00	3,314,624.99	
T 2.5% 08/15/23	7,000,000.00	7,100,625.00	
T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,483,001.93	
T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,758,203.11	
T 2.625% 08/15/20	5,000,000.00	5,199,121.10	
T 2.625% 11/15/20	7,750,000.00	8,046,982.40	
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,097,890.62	
T 2.75% 02/15/24	9,000,000.00	9,276,328.17	
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	303,463.47	
T 2.75% 05/31/17	4,900,000.00	5,096,095.69	
T 2.75% 08/15/42	3,150,000.00	2,900,953.12	
T 2.75% 11/15/23	7,950,000.00	8,204,337.91	
T 2.75% 11/15/42	2,900,000.00	2,667,546.87	
T 2.75% 11/30/16	3,000,000.00	3,097,089.84	
T 2.75% 12/31/17	5,300,000.00	5,539,431.63	
T 2.875% 03/31/18	2,550,000.00	2,678,396.47	
T 2.875% 05/15/43	7,300,000.00	6,880,535.13	
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,074,812.50	
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,385,361.32	
T 2% 02/15/25	1,500,000.00	1,443,808.59	
T 2% 02/28/21	1,550,000.00	1,553,693.35	
T 2% 05/31/21	3,000,000.00	2,996,953.14	
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,041,406.24	
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,182,199.22	

T 2% 11/15/21	4,300,000.00	4,273,125.00	
T 2% 11/30/20	6,000,000.00	6,034,687.50	
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,165,000.00	
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	3,781,519.53	
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,574,609.38	
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,124,519.51	
T 3.125% 05/15/19	3,620,000.00	3,847,027.72	
T 3.125% 05/15/21	4,190,000.00	4,454,166.42	
T 3.125% 08/15/44	7,700,000.00	7,632,474.61	
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,450,449.22	
T 3.125% 11/15/41	3,200,000.00	3,189,687.48	
T 3.25% 03/31/17	5,000,000.00	5,232,910.15	
T 3.25% 05/31/16	3,250,000.00	3,341,660.17	
T 3.25% 06/30/16	2,500,000.00	2,575,634.77	
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,675,352.33	
T 3.25% 12/31/16	2,800,000.00	2,915,992.18	
T 3.375% 05/15/44	1,500,000.00	1,558,066.41	
T 3.375% 11/15/19	5,900,000.00	6,339,619.14	
T 3.5% 02/15/18	3,650,000.00	3,890,529.30	
T 3.5% 02/15/39	1,600,000.00	1,706,093.74	
T 3.5% 05/15/20	4,050,000.00	4,382,305.65	
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	10,654,246.10	
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	5,706,113.88	
T 3.625% 02/15/44	6,500,000.00	7,064,814.44	
T 3.625% 08/15/19	5,500,000.00	5,961,162.13	
T 3.625% 08/15/43	3,200,000.00	3,480,562.49	
T 3.75% 08/15/41	4,800,000.00	5,337,656.25	
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,458,654.70	
T 3.75% 11/15/43	1,400,000.00	1,556,871.09	
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,242,404.29	
T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	5,552,327.72	
T 3% 02/28/17	4,600,000.00	4,786,425.76	
T 3% 05/15/42	3,400,000.00	3,296,937.50	
T 3% 05/15/45	1,000,000.00	969,121.09	
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,062,127.15	
T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,131,796.88	
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	1,983,094.72	
T 4.0% 08/15/18	4,000,000.00	4,356,015.64	
T 4.25% 05/15/39	1,750,000.00	2,090,327.15	
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,458,290.03	
T 4.25% 11/15/40	2,000,000.00	2,396,445.32	
T 4.375% 02/15/38	700,000.00	852,318.36	

	T 4.375% 05/15/40	1,600,000.00	1,950,093.74
	T 4.375% 05/15/41	1,350,000.00	1,653,117.18
	T 4.375% 11/15/39	3,100,000.00	3,774,068.37
	T 4.5% 02/15/36	1,500,000.00	1,865,009.75
	T 4.5% 05/15/17	3,500,000.00	3,754,365.23
	T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,237,910.16
	T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,548,608.40
	T 4.625% 02/15/17	5,500,000.00	5,868,242.21
	T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	1,893,457.03
	T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,592,645.51
	T 4.75% 02/15/41	2,300,000.00	2,968,482.41
	T 4.75% 08/15/17	3,000,000.00	3,256,171.89
	T 4.875% 08/15/16	750,000.00	789,492.18
	T 5.0% 05/15/37	1,150,000.00	1,524,738.28
	T 5.25% 02/15/29	500,000.00	648,300.78
	T 5.25% 11/15/28	1,350,000.00	1,748,698.24
	T 5.375% 02/15/31	1,900,000.00	2,534,978.51
	T 5.5% 08/15/28	1,250,000.00	1,650,830.07
	T 6.0% 02/15/26	1,350,000.00	1,799,982.41
	T 6.125% 11/15/27	1,300,000.00	1,791,562.50
	T 6.25% 05/15/30	1,200,000.00	1,719,609.37
	T 6.25% 08/15/23	2,500,000.00	3,246,435.55
	T 6.5% 11/15/26	450,000.00	628,382.81
	T 7.5% 11/15/16	3,250,000.00	3,572,651.35
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,533,511.72
	T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,116,232.43
	T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,421,105.46
	アメリカドル 小計	718,610,000.00	738,742,691.05 (91,943,915,328)
カナダドル	CAN 0.25% 05/01/17	350,000.00	347,326.00
	CAN 1.25% 02/01/18	700,000.00	710,363.50
	CAN 1.25% 03/01/18	1,700,000.00	1,727,293.50
	CAN 1.25% 08/01/17	400,000.00	404,836.00
	CAN 1.25% 09/01/18	1,050,000.00	1,069,010.25
	CAN 1.5% 02/01/17	1,300,000.00	1,317,901.00
	CAN 1.5% 03/01/17	600,000.00	608,802.00
	CAN 1.5% 03/01/20	250,000.00	255,011.25
	CAN 1.5% 06/01/23	2,100,000.00	2,072,668.50
	CAN 1.5% 09/01/17	1,400,000.00	1,426,082.00
	CAN 1.75% 03/01/19	1,150,000.00	1,189,956.75
	CAN 1.75% 09/01/19	700,000.00	724,094.00
	CAN 1% 08/01/16	1,050,000.00	1,053,874.50
	CAN 1% 11/01/16	550,000.00	552,598.75

	CAN 2.25% 06/01/25	900,000.00	930,429.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,950,000.00	2,064,484.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,000,000.00	1,082,395.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,150,000.00	3,229,679.25	
	CAN 2.75% 12/01/48	400,000.00	427,336.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	400,000.00	438,000.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,900,000.00	1,924,082.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,550,000.00	1,724,778.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,700,000.00	1,895,304.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,100,000.00	2,578,422.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,100,000.00	3,446,998.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,050,000.00	2,656,338.75	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,100,000.00	1,214,944.50	
	CAN 4% 06/01/16	2,550,000.00	2,631,625.50	
	CAN 4% 06/01/17	1,750,000.00	1,864,878.75	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,218,181.75	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,750,000.00	2,630,136.25	
	CAN 5% 06/01/37	1,600,000.00	2,303,768.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	650,000.00	1,061,833.50	
	カナダドル 小計	44,450,000.00	49,783,434.25	(5,019,165,841)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,850,000.00	9,313,465.50	
	MBONO 10% 12/05/24	21,500,000.00	27,272,212.50	
	MBONO 4.75% 06/14/18	25,400,000.00	25,395,301.00	
	MBONO 5% 06/15/17	11,700,000.00	11,876,202.00	
	MBONO 5% 12/11/19	3,050,000.00	3,003,274.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	17,700,000.00	18,171,616.50	
	MBONO 6.5% 06/09/22	15,850,000.00	16,308,302.75	
	MBONO 6.5% 06/10/21	17,700,000.00	18,355,696.50	
	MBONO 7.25% 12/15/16	18,300,000.00	19,180,962.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	11,700,000.00	12,685,023.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	21,000,000.00	23,223,165.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	14,550,000.00	16,071,129.75	
	MBONO 7.75% 11/23/34	1,900,000.00	2,101,485.50	
	MBONO 7.75% 12/14/17	19,750,000.00	21,262,257.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	11,900,000.00	13,983,987.50	
	MBONO 8.5% 11/18/38	13,150,000.00	15,607,603.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	11,450,000.00	12,749,632.25	
	MBONO 8% 06/11/20	11,600,000.00	12,861,152.00	
	MBONO 8% 12/07/23	12,350,000.00	13,808,967.25	
	メキシコペソ 小計	267,400,000.00	293,231,436.00	(2,342,919,173)

ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	250,000.00	238,586.25
	BGB 1.25% 06/22/18	850,000.00	881,705.00
	BGB 2.25% 06/22/23	2,300,000.00	2,526,561.50
	BGB 2.6% 06/22/24	1,350,000.00	1,519,229.25
	BGB 3.25% 09/28/16	1,650,000.00	1,723,062.00
	BGB 3.5% 06/28/17	1,650,000.00	1,772,479.50
	BGB 3.75% 06/22/45	800,000.00	1,096,788.00
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,939,112.50
	BGB 3% 06/22/34	650,000.00	771,998.50
	BGB 3% 09/28/19	1,450,000.00	1,621,491.50
	BGB 4.0% 03/28/17	650,000.00	698,597.25
	BGB 4.0% 03/28/19	1,800,000.00	2,062,728.00
	BGB 4.25% 03/28/41	1,800,000.00	2,624,742.00
	BGB 4.25% 09/28/21	2,050,000.00	2,510,922.00
	BGB 4.25% 09/28/22	1,900,000.00	2,361,120.50
	BGB 4.5% 03/28/26	1,450,000.00	1,911,281.25
	BGB 4% 03/28/18	1,150,000.00	1,279,996.00
	BGB 4% 03/28/22	1,250,000.00	1,521,725.00
	BGB 4% 03/28/32	1,200,000.00	1,592,334.00
	BGB 5.5% 03/28/28	2,250,000.00	3,292,256.25
	BGB 5.5% 09/28/17	1,500,000.00	1,693,387.50
	BGB 5% 03/28/35	2,400,000.00	3,649,800.00
	BKO 0% 12/16/16	400,000.00	401,154.00
	BTNS 1.75% 02/25/17	3,150,000.00	3,251,981.25
	BTNS 1% 07/25/17	2,800,000.00	2,866,332.00
	BTNS 2.5% 07/25/16	3,800,000.00	3,914,019.00
	BTPS 1.5% 08/01/19	850,000.00	870,727.25
	BTPS 1.5% 12/15/16	100,000.00	102,090.00
	BTPS 2.15% 12/15/21	700,000.00	721,042.00
	BTPS 2.5% 05/01/19	1,000,000.00	1,064,270.00
	BTPS 3.25% 09/01/46	800,000.00	795,284.00
	BTPS 3.5% 03/01/30	1,300,000.00	1,407,672.50
	BTPS 3.5% 06/01/18	150,000.00	163,234.50
	BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	3,118,877.50
	BTPS 3.5% 12/01/18	1,600,000.00	1,756,640.00
	BTPS 3.75% 03/01/21	2,000,000.00	2,259,400.00
	BTPS 3.75% 05/01/21	1,350,000.00	1,523,603.25
	BTPS 3.75% 08/01/16	450,000.00	469,068.75
	BTPS 3.75% 08/01/21	4,800,000.00	5,417,016.00
	BTPS 3.75% 09/01/24	3,900,000.00	4,375,683.00
	BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000.00	6,702,050.25
	BTPS 4.25% 03/01/20	3,200,000.00	3,669,152.00
	BTPS 4.25% 09/01/19	3,150,000.00	3,583,660.50

BTPS 4.5% 02/01/18	4,400,000.00	4,870,800.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	2,600,000.00	3,007,927.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,650,000.00	5,289,700.50	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,900,000.00	3,424,943.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	3,224,394.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	100,000.00	118,137.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	4,950,000.00	5,559,345.00	
BTPS 4.75% 05/01/17	2,160,000.00	2,345,954.40	
BTPS 4.75% 06/01/17	4,700,000.00	5,117,806.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,850,000.00	4,618,402.25	
BTPS 4.75% 09/01/21	3,550,000.00	4,213,069.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,550,000.00	3,115,526.25	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,000,000.00	2,531,520.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	3,400,000.00	3,600,345.00	
BTPS 4% 02/01/17	4,950,000.00	5,263,557.75	
BTPS 4% 02/01/37	3,200,000.00	3,583,072.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,850,000.00	4,390,925.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,150,000.00	2,765,340.75	
BTPS 5.25% 08/01/17	1,750,000.00	1,937,985.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,950,000.00	5,086,415.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,200,000.00	3,979,440.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,350,000.00	4,168,388.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	1,700,000.00	2,346,816.00	
BTPS 5% 03/01/22	3,900,000.00	4,714,612.50	
BTPS 5% 03/01/25	2,600,000.00	3,198,975.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,150,000.00	4,026,660.75	
BTPS 5% 09/01/40	2,550,000.00	3,285,343.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	2,850,000.00	4,006,002.75	
BTPS 6% 05/01/31	3,900,000.00	5,459,220.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,550,000.00	2,273,563.25	
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,747,025.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,850,000.00	3,029,165.25	
DBR 1.5% 05/15/23	4,050,000.00	4,299,763.50	
DBR 1.5% 05/15/24	2,750,000.00	2,902,418.75	
DBR 1.5% 09/04/22	2,550,000.00	2,714,679.00	
DBR 1.75% 02/15/24	1,800,000.00	1,941,498.00	
DBR 1.75% 07/04/22	2,800,000.00	3,031,630.00	
DBR 1% 08/15/24	1,800,000.00	1,816,065.00	
DBR 2.25% 09/04/20	1,400,000.00	1,543,185.00	
DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,167,152.00	
DBR 2.5% 01/04/21	2,650,000.00	2,966,502.75	
DBR 2.5% 07/04/44	2,000,000.00	2,403,270.00	

DBR 2.5% 08/15/46	700,000.00	843,090.50
DBR 2% 01/04/22	2,200,000.00	2,416,414.00
DBR 2% 08/15/23	1,800,000.00	1,980,981.00
DBR 3.25% 01/04/20	2,050,000.00	2,336,948.75
DBR 3.25% 07/04/21	1,050,000.00	1,228,977.75
DBR 3.25% 07/04/42	2,050,000.00	2,782,834.00
DBR 3.5% 07/04/19	4,810,000.00	5,477,531.80
DBR 3.75% 01/04/17	1,000,000.00	1,061,870.00
DBR 3.75% 01/04/19	5,300,000.00	6,008,133.00
DBR 3% 07/04/20	3,920,000.00	4,460,744.40
DBR 4.0% 01/04/18	2,550,000.00	2,820,147.00
DBR 4.0% 01/04/37	2,700,000.00	3,910,747.50
DBR 4.25% 07/04/17	2,750,000.00	3,000,428.75
DBR 4.25% 07/04/18	2,300,000.00	2,604,278.50
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,528,336.25
DBR 4.75% 07/04/28	1,400,000.00	1,996,673.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,450,000.00	3,771,138.00
DBR 4.75% 07/04/40	1,850,000.00	3,053,258.50
DBR 4% 07/04/16	3,550,000.00	3,709,004.50
DBR 5.5% 01/04/31	2,050,000.00	3,232,409.25
DBR 5.625% 01/04/28	1,800,000.00	2,733,669.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,100,000.00	1,600,384.50
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,074,312.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,100,000.00	1,765,153.50
DBR 6% 06/20/16	900,000.00	957,357.00
FRTR 0.5% 05/25/25	2,150,000.00	1,995,146.25
FRTR 0.5% 11/25/19	1,500,000.00	1,514,280.00
FRTR 1.75% 05/25/23	2,500,000.00	2,653,262.50
FRTR 1.75% 11/25/24	3,150,000.00	3,304,413.00
FRTR 1% 05/25/18	2,400,000.00	2,470,692.00
FRTR 1% 05/25/19	3,100,000.00	3,198,781.50
FRTR 1% 11/25/18	2,900,000.00	2,991,582.00
FRTR 2.25% 05/25/24	3,900,000.00	4,275,082.50
FRTR 2.25% 10/25/22	2,650,000.00	2,917,014.00
FRTR 2.5% 05/25/30	1,850,000.00	2,044,712.50
FRTR 2.5% 10/25/20	3,600,000.00	3,989,268.00
FRTR 2.75% 10/25/27	4,850,000.00	5,518,960.50
FRTR 3.25% 05/25/45	1,500,000.00	1,872,360.00
FRTR 3.25% 10/25/21	4,250,000.00	4,936,502.50
FRTR 3.5% 04/25/20	4,950,000.00	5,698,662.75
FRTR 3.5% 04/25/26	3,000,000.00	3,651,975.00
FRTR 3.75% 04/25/17	4,400,000.00	4,719,902.00
FRTR 3.75% 04/25/21	4,700,000.00	5,569,077.00

FRTR 3.75% 10/25/19	4,900,000.00	5,644,996.00	
FRTR 3% 04/25/22	4,650,000.00	5,350,592.25	
FRTR 4.25% 04/25/19	3,400,000.00	3,936,775.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,550,000.00	5,019,241.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,000,000.00	4,564,160.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,000,000.00	6,304,050.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,250,000.00	4,875,000.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,750,000.00	4,068,075.00	
FRTR 4% 04/25/18	3,450,000.00	3,847,560.75	
FRTR 4% 04/25/55	1,800,000.00	2,646,891.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,300,000.00	1,936,161.50	
FRTR 4% 10/25/38	2,850,000.00	3,930,378.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,350,000.00	6,452,094.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,000,000.00	4,791,105.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,410,000.00	5,794,407.55	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,250,000.00	3,285,337.50	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,800,000.00	2,844,900.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,834,393.50	
IRISH 0.8% 03/15/22	300,000.00	294,789.00	
IRISH 2.4% 05/15/30	600,000.00	616,677.00	
IRISH 2% 02/18/45	600,000.00	523,086.00	
IRISH 3.4% 03/18/24	1,000,000.00	1,150,900.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	650,000.00	771,845.75	
IRISH 4.4% 06/18/19	850,000.00	987,874.25	
IRISH 4.5% 04/18/20	1,600,000.00	1,889,648.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,400,000.00	1,599,759.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,300,000.00	1,722,448.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	400,000.00	450,882.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	800,000.00	984,676.00	
IRISH 5% 10/18/20	1,100,000.00	1,340,922.00	
NETHER 0.25% 07/15/25	500,000.00	457,425.00	
NETHER 0.5% 04/15/17	1,850,000.00	1,871,848.50	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,900,000.00	1,964,771.00	
NETHER 1.25% 01/15/19	1,700,000.00	1,770,431.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,135,860.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,150,000.00	1,273,872.25	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,050,000.00	2,137,176.25	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,250,000.00	1,437,393.75	
NETHER 2.75% 01/15/47	500,000.00	620,165.00	
NETHER 2% 07/15/24	1,600,000.00	1,736,912.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	1,700,000.00	1,978,281.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,260,069.50	

NETHER 3.75% 01/15/23	1,920,000.00	2,340,528.00
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	3,194,048.00
NETHER 4.0% 07/15/18	2,100,000.00	2,359,077.00
NETHER 4.5% 07/15/17	2,000,000.00	2,193,860.00
NETHER 4% 01/15/37	1,750,000.00	2,522,397.50
NETHER 4% 07/15/16	1,500,000.00	1,568,655.00
NETHER 4% 07/15/19	2,300,000.00	2,658,420.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,700,000.00	2,527,177.50
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,047,067.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,250,000.00	2,271,847.50
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,100,431.75
OBL 0.5% 04/07/17	3,950,000.00	3,998,703.50
OBL 0.5% 04/12/19	850,000.00	864,794.25
OBL 0.5% 10/13/17	1,700,000.00	1,725,746.50
OBL 0.75% 02/24/17	2,900,000.00	2,946,313.00
OBL 0% 04/17/20	950,000.00	939,493.00
OBL 1.25% 10/14/16	2,200,000.00	2,242,713.00
OBL 1% 02/22/19	1,500,000.00	1,553,587.50
OBL 1% 10/12/18	2,750,000.00	2,843,857.50
RAGB 1.15% 10/19/18	800,000.00	828,932.00
RAGB 1.65% 10/21/24	400,000.00	419,480.00
RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	744,751.00
RAGB 1.95% 06/18/19	1,150,000.00	1,231,092.25
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	561,545.00
RAGB 3.15% 06/20/44	750,000.00	976,016.25
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,109,388.00
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,781,715.00
RAGB 3.5% 09/15/21	1,850,000.00	2,183,536.50
RAGB 3.65% 04/20/22	1,600,000.00	1,918,064.00
RAGB 3.8% 01/26/62	400,000.00	629,992.00
RAGB 3.9% 07/15/20	1,350,000.00	1,590,516.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,500,000.00	2,167,860.00
RAGB 4.3% 09/15/17	1,050,000.00	1,154,128.50
RAGB 4.35% 03/15/19	1,800,000.00	2,084,679.00
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,514,693.25
RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,435,329.00
RAGB 4% 09/15/16	1,250,000.00	1,315,856.25
RAGB 6.25% 07/15/27	850,000.00	1,317,143.00
RFGB 0.75% 04/15/31	250,000.00	222,197.50
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	569,354.50
RFGB 1.5% 04/15/23	600,000.00	628,680.00
RFGB 1.625% 09/15/22	650,000.00	689,455.00
RFGB 1.875% 04/15/17	650,000.00	674,183.25

RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	545,004.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	600,000.00	697,170.00	
RFGB 2% 04/15/24	650,000.00	704,418.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	900,000.00	1,032,678.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	800,000.00	938,772.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	700,000.00	763,143.50	
RFGB 4.375% 07/04/19	700,000.00	818,720.00	
RFGB 4% 07/04/25	750,000.00	956,336.25	
SPGB 1.4% 01/31/20	1,050,000.00	1,067,356.50	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,050,000.00	988,191.75	
SPGB 1.95% 07/30/30	650,000.00	577,034.25	
SPGB 2.1% 04/30/17	2,300,000.00	2,382,719.50	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,700,000.00	2,906,658.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	2,700,000.00	2,810,686.50	
SPGB 3.3% 07/30/16	2,300,000.00	2,384,479.00	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,750,000.00	1,935,666.25	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,440,000.00	4,709,730.00	
SPGB 3.8% 04/30/24	3,700,000.00	4,179,242.50	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,300,000.00	3,668,082.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,150,000.00	2,480,756.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	2,350,000.00	2,486,605.50	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,746,896.00	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,250,000.00	2,647,698.75	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,450,000.00	2,713,987.50	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,300,000.00	3,802,342.50	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,450,000.00	2,958,558.75	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,650,000.00	2,050,389.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,400,000.00	1,694,588.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	1,850,000.00	2,194,257.25	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,650,000.00	2,104,814.25	
SPGB 4% 04/30/20	2,050,000.00	2,329,896.75	
SPGB 5.15% 10/31/28	950,000.00	1,199,845.25	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,100,000.00	1,470,381.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	1,900,000.00	2,367,409.50	
SPGB 5.5% 04/30/21	2,800,000.00	3,441,424.00	
SPGB 5.5% 07/30/17	2,750,000.00	3,057,518.75	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,100,000.00	2,876,895.00	
SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,742,431.60	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,550,000.00	2,063,662.25	
SPGB 6.0% 01/31/29	3,120,000.00	4,244,541.60	
□ 小計	537,690,000.00	631,978,024.35	(88,856,110,223)

イギリスボ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,700,000.00	3,727,232.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	1,700,000.00	1,732,164.00	
	UKT 1.75% 07/22/19	2,600,000.00	2,647,931.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,200,000.00	3,176,768.00	
	UKT 1% 09/07/17	3,650,000.00	3,672,484.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	3,200,000.00	3,261,824.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	2,350,000.00	2,474,890.75	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,900,000.00	3,153,648.50	
	UKT 3.5% 01/22/45	900,000.00	1,024,636.50	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,750,000.00	2,149,516.25	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,700,000.00	2,094,714.50	
	UKT 3.75% 09/07/19	1,500,000.00	1,654,132.50	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,750,000.00	4,177,575.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,500,000.00	3,932,757.50	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,450,000.00	3,051,769.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,350,000.00	2,887,774.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,550,000.00	1,959,982.75	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,050,000.00	2,473,991.25	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,050,000.00	2,605,334.75	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,350,000.00	3,079,440.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,500,000.00	2,003,992.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,950,000.00	2,694,451.50	
	UKT 4.5% 03/07/19	2,650,000.00	2,976,360.75	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,830,000.00	3,613,287.40	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,900,000.00	3,867,556.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,750,000.00	3,172,950.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,000,000.00	2,577,620.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,950,000.00	2,633,445.75	
	UKT 4% 01/22/60	1,500,000.00	2,008,350.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,345,610.00	
	UKT 4% 09/07/16	3,000,000.00	3,130,695.00	
UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,282,316.25		
UKT 5% 03/07/25	2,350,000.00	2,946,594.50		
UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,921,016.25		
UKT 8.75% 08/25/17	1,070,000.00	1,263,225.95		
UKT 8% 06/07/21	1,300,000.00	1,772,972.50		
イギリスボンド 小計		82,400,000.00	96,149,010.60	(18,418,304,470)
スイスフラ ン	SWISS 2.25% 07/06/20	500,000.00	568,440.00	
	SWISS 2% 04/28/21	250,000.00	283,843.75	
	SWISS 3% 01/08/18	1,000,000.00	1,100,550.00	
	SWISS 3% 05/12/19	750,000.00	857,917.50	
	SWISS 4.25% 06/05/17	600,000.00	662,181.00	

	SWISS 4% 02/11/23	550,000.00	720,918.00	
	SWISS 4% 04/08/28	720,000.00	1,044,360.00	
	スイスフラン 小計	4,370,000.00	5,238,210.25 (701,082,059)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,300,000.00	9,737,937.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	6,300,000.00	7,167,667.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,450,000.00	7,224,983.25	
	SGB 3.5% 06/01/22	6,950,000.00	8,263,167.75	
	SGB 3.75% 08/12/17	8,750,000.00	9,500,356.25	
	SGB 3% 07/12/16	6,300,000.00	6,529,225.50	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,400,000.00	13,177,488.00	
	SGB 5% 12/01/20	8,400,000.00	10,474,002.00	
	スウェーデンクローナ 小計	62,850,000.00	72,074,827.25 (1,082,563,905)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.75% 03/13/25	1,950,000.00	1,952,847.00	
	NGB 2% 05/24/23	5,350,000.00	5,532,675.75	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,900,000.00	10,121,836.50	
	NGB 3% 03/14/24	6,000,000.00	6,668,790.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	7,750,000.00	8,268,397.50	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,050,000.00	8,007,777.75	
	ノルウェークローネ 小計	37,000,000.00	40,552,324.50 (650,053,761)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,750,000.00	10,272,063.75	
	DGB 1.75% 11/15/25	3,950,000.00	4,203,748.00	
	DGB 2.5% 11/15/16	5,850,000.00	6,094,647.00	
	DGB 3% 11/15/21	11,200,000.00	12,939,080.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,550,000.00	22,833,460.50	
	DGB 4% 11/15/17	6,650,000.00	7,333,586.75	
	DGB 4% 11/15/19	11,600,000.00	13,559,066.00	
	DGB 7% 11/10/24	2,650,000.00	4,120,352.50	
	デンマーククローネ 小計	66,200,000.00	81,356,004.50 (1,533,560,684)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0% 07/25/16	1,350,000.00	1,324,876.50	
	POLGB 1.5% 04/25/20	400,000.00	379,000.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,800,000.00	3,828,139.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	3,250,000.00	3,344,591.25	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,050,000.00	2,061,859.25	
	POLGB 3.75% 04/25/18	2,200,000.00	2,296,129.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,150,000.00	2,264,777.75	
	POLGB 4.75% 10/25/16	3,150,000.00	3,278,094.75	
	POLGB 4% 10/25/23	3,300,000.00	3,517,965.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	3,000,000.00	3,229,605.00	

	POLGB 5.25% 10/25/20	2,550,000.00	2,876,208.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,200,000.00	2,470,017.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,776,649.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,700,000.00	3,184,839.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,850,000.00	2,159,366.25	
	ポーランドズロチ 小計	35,350,000.00	37,992,117.50 (1,279,574,517)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	2,600,000.00	2,550,925.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	450,000.00	392,706.00	
	ACGB 2.75% 10/21/19	300,000.00	306,018.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,100,000.00	2,130,670.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,100,000.00	1,085,727.50	
	ACGB 3.25% 10/21/18	1,400,000.00	1,450,029.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,000,000.00	1,009,770.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,750,000.00	1,925,236.25	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,850,000.00	1,932,658.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,900,000.00	3,184,461.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,200,000.00	1,354,986.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,750,000.00	2,014,582.50	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,050,000.00	2,106,006.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,100,000.00	3,443,139.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,200,000.00	3,475,648.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,700,000.00	3,197,920.50	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,650,000.00	3,112,716.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,383,860.00	
ACGB 6% 02/15/17	3,100,000.00	3,301,438.00		
	オーストラリアドル 小計	37,200,000.00	40,358,497.75 (3,859,079,554)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	700,000.00	684,271.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	520,000.00	519,077.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	400,000.00	409,386.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	850,000.00	874,152.75	
	SIGB 2.75% 04/01/42	500,000.00	469,777.50	
	SIGB 2.75% 07/01/23	400,000.00	405,776.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	199,169.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	250,000.00	246,968.75	
	SIGB 3.125% 09/01/22	600,000.00	626,316.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	800,000.00	843,300.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	450,000.00	470,324.25	
	SIGB 3.5% 03/01/27	550,000.00	590,026.25	
	SIGB 3.75% 09/01/16	880,000.00	909,242.40	
	SIGB 3% 09/01/24	800,000.00	823,340.00	
SIGB 4% 09/01/18	700,000.00	754,229.00		

	シンガポールドル 小計	8,600,000.00	8,825,355.90 (812,462,264)
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	950,000.00	952,550.75
	MGS 3.26% 03/01/18	1,200,000.00	1,192,332.00
	MGS 3.418% 08/15/22	1,950,000.00	1,875,597.75
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,537,944.00
	MGS 3.492% 03/31/20	1,600,000.00	1,579,832.00
	MGS 3.502% 05/31/27	950,000.00	886,416.50
	MGS 3.58% 09/28/18	1,800,000.00	1,800,144.00
	MGS 3.814% 02/15/17	1,600,000.00	1,618,616.00
	MGS 3.844% 04/15/33	850,000.00	793,713.00
	MGS 3.889% 07/31/20	1,050,000.00	1,052,777.25
	MGS 3.892% 03/15/27	640,000.00	620,678.40
	MGS 4.127% 04/15/32	850,000.00	828,223.00
	MGS 4.16% 07/15/21	2,900,000.00	2,939,034.00
	MGS 4.181% 07/15/24	900,000.00	907,425.00
	MGS 4.24% 02/07/18	3,800,000.00	3,870,585.00
	MGS 4.262% 09/15/16	4,900,000.00	4,982,320.00
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,873,038.00
	MGS 4.392% 04/15/26	1,600,000.00	1,630,120.00
	MGS 4.498% 04/15/30	950,000.00	972,505.50
	MGS 4.935% 09/30/43	600,000.00	619,803.00
MGS 5.248% 09/15/28	1,050,000.00	1,150,511.25	
	マレーシアリンギット 小計	34,540,000.00	34,684,166.40 (1,151,514,324)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,750,000.00	24,037,526.25
	SAGB 6.25% 03/31/36	12,350,000.00	9,319,001.25
	SAGB 6.5% 02/28/41	10,100,000.00	7,660,850.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	8,100,000.00	7,648,911.00
	SAGB 7.25% 01/15/20	8,150,000.00	7,973,552.50
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,750,000.00	6,590,160.00
	SAGB 7% 02/28/31	12,450,000.00	10,594,514.25
	SAGB 8.25% 03/31/32	4,950,000.00	4,708,068.75
	SAGB 8.25% 09/15/17	7,750,000.00	7,906,666.25
	SAGB 8.5% 01/31/37	4,600,000.00	4,425,315.00
	SAGB 8.75% 01/31/44	3,200,000.00	3,122,064.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	9,450,000.00	9,213,277.50
	SAGB 8% 01/31/30	3,150,000.00	2,964,307.50
	SAGB 8% 12/21/18	8,050,000.00	8,157,829.75
	南アフリカランド 小計	119,800,000.00	114,322,044.00 (1,145,506,880)
			218,795,812,983

合計	(218,795,812,983)
----	-------------------

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 192銘柄	100.0%	42.0%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 253銘柄	100.0%	40.6%
イギリスポンド	国債証券 36銘柄	100.0%	8.4%
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 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 19銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 21銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Jリートマザーファンド(M)

貸借対照表

	平成27年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	327,177,537
投資証券	88,451,508,200

項目	平成27年 6月10日現在	
	金額（円）	
未収入金	799,739,453	
未収配当金	510,141,405	
未収利息	485	
流動資産合計	90,088,567,080	
資産合計	90,088,567,080	
負債の部		
流動負債		
未払金	593,664,505	
未払解約金	12,284,147	
流動負債合計	605,948,652	
負債合計	605,948,652	
純資産の部		
元本等		
元本	37,570,151,761	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	51,912,466,667	
元本等合計	89,482,618,428	
純資産合計	89,482,618,428	
負債純資産合計	90,088,567,080	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 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27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	37,570,151,761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	2.3817円
	(1万口当たり純資産額)	(23,817円)

(金融商品に関する注記)

1．金融商品の状況に関する事項

	平成27年 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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 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27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26年12月11日
期首元本額	43,522,331,161円
期中追加設定元本額	1,636,131,665円
期中一部解約元本額	7,588,311,065円
期末元本額	37,570,151,761円
期末元本額の内訳	
Ｊリートファンド	35,264,977,560円
３資産バランスオープン	755,092,408円
３資産バランスオープンアルファ	127,529,933円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	49,256,153円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	26,623,938円
Ｊリートアクティブファンド（１年決算型）	1,346,671,769円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 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	8,299,331,197
合計	8,299,331,197

(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	4,368	2,079,168,000	
	M I Dリート投資法人	3,085	1,198,522,500	
	森ヒルズリート投資法人	15,284	2,474,479,600	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	850	597,550,000	
	産業ファンド投資法人	3,491	1,940,996,000	
	大和ハウスリート投資法人	3,796	2,023,268,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,525	3,788,812,500	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	3,782	1,361,520,000	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	2,843	3,033,481,000	
	G L P投資法人	16,942	2,049,982,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,238	1,096,794,400	
	日本プロロジスリート投資法人	14,532	3,407,754,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	16,369	2,591,212,700	
	星野リゾート・リート投資法人	637	859,950,000	
	イオンリート投資法人	10,108	1,632,442,000	
	ヒューリックリート投資法人	8,421	1,490,517,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	8,168	862,540,800	
	積水ハウス・リート投資法人	6,792	931,183,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,151	890,472,600	
	日本ビルファンド投資法人	13,002	7,437,144,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,914	7,244,754,000	
	日本リテールファンド投資法人	18,892	4,639,875,200	
	オリックス不動産投資法人	19,495	3,438,918,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	6,218	2,493,418,000	
	プレミア投資法人	3,091	2,064,788,000	
	東急リアル・エステート投資法人	3,065	475,994,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,184	965,328,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	2,990	1,710,280,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,824	3,798,297,600	
	森トラスト総合リート投資法人	13,392	3,052,036,800	
フロンティア不動産投資法人	4,467	2,550,657,000		

日本ロジスティクスファンド投資法人	8,361	2,126,202,300	
福岡リート投資法人	3,232	692,940,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,607	1,026,873,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	7,567	985,980,100	
大和証券オフィス投資法人	3,762	2,272,248,000	
阪急リート投資法人	3,728	533,104,000	
トップリート投資法人	1,442	745,514,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	6,420	1,736,610,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,088	2,468,387,200	
ジャパンエクセレント投資法人	10,926	1,681,511,400	
合計	338,049	88,451,508,200	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートマザーファンド

貸借対照表

項目	平成27年 6月10日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金	29,756,315	
コール・ローン	1,184,137	
投資証券	523,201,414	
未収入金	6,331	
未収配当金	582,443	
未収利息	1	
流動資産合計	554,730,641	
資産合計	554,730,641	
負債の部		
流動負債		
未払解約金	695,658	
流動負債合計	695,658	
負債合計	695,658	
純資産の部		
元本等		
元本	468,693,421	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	85,341,562	
元本等合計	554,034,983	
純資産合計	554,034,983	

	平成27年 6月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	554,730,641

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 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>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	468,693,421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 1,182円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (11,821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27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。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 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。

平成27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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年12月11日
期首元本額	582,563,897円
期中追加設定元本額	13,813,109円
期中一部解約元本額	127,683,585円
期末元本額	468,693,421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	318,212,248円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	95,013,986円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	55,467,187円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 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	6,876,312
合計	6,876,312

(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	309	9,288.54	
		AGREE REALTY CORP	86	2,555.92	
		ALEXANDER'S INC	15	6,097.35	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	316	28,408.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	166	6,507.20	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	497	19,069.89	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	617	10,458.15	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	3,983	34,293.63	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	141	2,657.85	
		APARTMENT INVEST & MGMT	702	25,833.60	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	110	1,147.30	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	98	1,520.96	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	378	3,141.18	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	259	7,417.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	571	91,731.15	
		BIOMED REALTY TRUST INC	899	17,827.17	
		BOSTON PROPERTIES	662	82,677.18	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	778	10,720.84	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	639	15,086.79	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	385	28,116.55	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	284	1,536.44	
		CARETRUST REIT INC	123	1,517.82	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	747	12,616.83	
CEDAR REALTY TRUST INC	363	2,363.13			

CHAMBERS STREET PROPERTIES	1,034	7,910.10
CHATHAM LODGING TRUST	166	4,442.16
CHESAPEAKE LODGING TRUST	245	7,541.10
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	544	13,736.00
CORESITE REALTY CORP	86	3,957.72
CORPORATE OFFICE PPTYS	400	9,924.00
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	512	17,469.44
COUSINS PROPERTIES INC	873	9,149.04
CUBESMART	714	16,236.36
CYRUSONE INC	180	5,585.40
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	387	12,345.30
DDR CORPORATION	1,348	22,012.84
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	874	11,178.46
DIGITAL REALTY TRUST INC	594	37,926.90
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	597	16,817.49
DUKE REALTY CORP	1,545	29,061.45
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	282	8,713.80
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	30	463.80
EASTGROUP PROPERTIES, INC	141	7,860.75
EDUCATION REALTY TRUST INC	211	6,699.25
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	483	8,549.10
EPR PROPERTIES	250	13,985.00
EQUITY COMMONWEALTH	569	14,708.65
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	351	18,318.69
EQUITY ONE INC	334	8,009.32
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	1,574	111,344.76
ESSEX PROPERTY TRUST	281	59,434.31
EXCEL TRUST INC	268	4,271.92
EXTRA SPACE STORAGE INC	485	31,927.55
FEDERAL REALTY INVS TRUST	301	38,955.42
FELCOR LODGING TRUST INC	462	4,749.36
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	509	9,788.07
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	310	3,143.40
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	340	3,903.20
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	399	14,208.39
GENERAL GROWTH PROPERTIES	2,718	71,999.82
GEO GROUP INC/THE	324	11,608.92
GETTY REALTY CORP	114	1,917.48
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	89	1,517.45
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	319	6,025.91
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	165	4,191.00
HCP INC	1,997	74,268.43

HEALTH CARE REIT INC	1,511	102,460.91
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	450	10,485.00
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	564	13,654.44
HERSHA HOSPITALITY TRUST	842	5,355.12
HIGHWOODS PROPERTIES INC	408	16,687.20
HOME PROPERTIES INC	254	18,420.08
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	662	19,264.20
HOST HOTELS AND RESORTS INC	3,271	63,555.53
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	305	8,942.60
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	120	999.60
INLAND REAL ESTATE CORP	388	3,779.12
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	528	3,743.52
IRON MOUNTAIN INC	820	26,199.00
KILROY REALTY CORPORATION	379	25,627.98
KIMCO REALTY CORP	1,810	41,738.60
KITE REALTY GROUP TRUST	380	9,990.20
LASALLE HOTEL PROPERTIES	499	17,824.28
LEXINGTON CORP PROPERTIES	906	8,126.82
LIBERTY PROPERTY TRUST	663	22,243.65
LTC PROPERTIES INC	147	5,997.60
MACERICH CO/THE	607	48,371.83
MACK-CALI REALTY CORP	336	5,896.80
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	963	12,567.15
MID-AMERICA APARTMENT COMM	338	24,731.46
MONMOUTH REIT -CL A	286	2,691.26
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	650	6,227.00
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	585	21,089.25
NATL HEALTH INVESTORS INC	147	9,371.25
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	291	4,551.24
NEW YORK REIT INC	700	6,384.00
NORTHSTAR REALTY FINANCE	1,000	16,990.00
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	693	24,386.67
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	82	1,808.92
PARKWAY PROPERTIES INC	369	6,129.09
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	315	13,267.80
PENN REAL ESTATE INVEST TST	315	7,002.45
PHYSICIANS REALTY TRUST	290	4,640.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	677	11,434.53
POST PROPERTIES	239	13,278.84
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	110	1,163.80
PROLOGIS INC	2,216	86,579.12
PS BUSINESS PARKS INC	78	5,644.86

PUBLIC STORAGE	628	116,770.32
QTS REALTY TRUST INC	72	2,730.24
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	342	5,666.94
REALTY INCOME CORP	977	43,974.77
REGENCY CENTERS CORP	423	25,824.15
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	398	6,332.18
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	1,036	15,042.72
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	250	3,662.50
RLJ LODGING TRUST	579	17,132.61
ROUSE PROPERTIES INC	152	2,511.04
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	223	11,977.33
SABRA HEALTH CARE REIT INC	260	6,559.80
SAUL CENTERS INC	49	2,441.67
SELECT INCOME REIT	167	3,812.61
SENIOR HOUSING PROP TRUST	982	17,823.30
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	164	2,548.56
SIMON PROPERTY GROUP	1,348	235,333.84
SL GREEN REALTY CORP	424	48,577.68
SOVRAN SELF STORAGE INC	161	13,961.92
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1,766	18,348.74
STAG INDUSTRIAL INC	283	5,945.83
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	150	3,750.00
STORE CAPITAL CORP	100	2,035.00
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	1,254	14,910.06
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	348	4,426.56
SUN COMMUNITIES INC	208	12,804.48
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	915	13,798.20
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	414	13,488.12
TAUBMAN CENTERS INC	278	20,138.32
TERRENO REALTY CORP	204	4,114.68
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	90	639.00
UDR INC	1,135	35,888.70
UMH PROPERTIES INC	100	959.00
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	58	2,711.50
URBAN EDGE PROPERTIES	395	8,603.10
URSTADT BIDDLE - CL A	123	2,361.60
VENTAS INC	1,431	90,482.13
VORNADO REALTY TRUST	756	73,558.80
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	315	7,859.25
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	494	15,956.20
WHITESTONE REIT	136	1,886.32

	WP CAREY INC	430	26,354.70	
	WP GLIMCHER INC	812	10,742.76	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	500	11,530.00	
	アメリカドル 小計	84,057	2,933,729.14 (365,131,928)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	150	5,230.50	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	234	3,201.12	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	105	6,064.80	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	63	1,668.24	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	279	7,906.86	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	229	6,217.35	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	144	6,128.64	
	CHOICE PROPERTIES REIT	271	3,016.23	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	369	6,564.51	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	350	4,336.50	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	120	1,436.40	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	328	3,125.84	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	160	1,304.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	222	5,541.12	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	89	3,576.91	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	611	13,490.88	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	91	494.13	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	141	874.20	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	180	2,232.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	150	1,486.50	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	160	2,619.20	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	75	1,755.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	90	739.80	
	PLAZA RETAIL REIT	400	1,708.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	260	1,211.60	
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	283	1,018.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	675	18,063.00	
	カナダドル 小計	6,229	111,012.13 (11,192,242)	
ユーロ	AEDIFICA	47	2,700.15	

	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	316	3,692.46
	ALTAREA	14	2,300.20
	ANF IMMOBILIER	57	1,325.25
	AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	120	1,360.80
	BEFIMMO S.C.A.	75	4,257.75
	BENI STABILI SPA	5,310	3,393.09
	BGP HOLDINGS PLC	900,544	-
	COFINIMMO	76	6,988.20
	EUROCOMMERCIAL	198	7,518.06
	FONCIERE DES REGIONS	213	16,230.60
	GECINA SA	153	17,549.10
	GREEN REIT PLC	3,053	4,628.34
	HAMBORNER REIT AG	230	2,143.60
	HIBERNIA REIT PLC	3,100	3,968.00
	ICADE	151	10,243.84
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	584	478.58
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	800	895.20
	KLEPIERRE	898	35,062.41
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	250	2,655.00
	MERCIALYS	223	4,594.91
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	580	6,693.20
	NSI NV	329	1,214.33
	UNIBAIL-RODAMCO SE	424	95,569.60
	VASTNED RETAIL	86	3,455.48
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	70	4,612.30
	WERELDHAVE NV	155	8,091.00
	ユーロ 小計	918,056	251,621.45 (35,377,975)
イギリスポ ンド	ASSURA PLC	3,988	2,352.92
	BIG YELLOW GROUP PLC	631	4,079.41
	BRITISH LAND CO PLC	4,455	36,709.20
	DERWENT LONDON PLC	472	16,302.88
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	1,531	12,278.62
	HAMMERSON PLC	3,440	22,102.00
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	2,883	3,485.54
	INTU PROPERTIES PLC	4,086	13,067.02
	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,494	43,744.88
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,470	4,154.54
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	390	976.95
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	261	1,278.90
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	511	2,000.56
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	4,700	2,448.70
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	908	2,469.76

	SEGRO PLC	3,322	13,786.30
	SHAFTESBURY PLC	1,224	10,599.84
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,000	2,292.00
	WORKSPACE GROUP PLC	488	4,562.80
	イギリスポンド 小計	41,254	198,692.82 (38,061,596)
オーストラ リアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	1,200	1,296.00
	360 CAPITAL OFFICE FUND	256	532.48
	ABACUS PROPERTY GROUP	1,107	3,154.95
	ALE PROPERTY GROUP	764	2,865.00
	ARENA REIT	1,000	1,610.00
	ASPEN GROUP	520	676.00
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	165	823.35
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	366	856.44
	BWP TRUST	1,954	6,135.56
	CHARTER HALL GROUP	1,204	5,490.24
	CHARTER HALL RETAIL REIT	1,207	5,117.68
	CROMWELL PROPERTY GROUP	5,265	5,501.92
	DEXUS PROPERTY GROUP	4,030	30,144.40
	FEDERATION CENTRES	14,904	44,562.96
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	1,000	2,090.00
	GALILEO JAPAN TRUST	500	900.00
	GDI PROPERTY GROUP	2,400	2,148.00
	GOODMAN GROUP	6,845	41,754.50
	GPT GROUP	7,740	33,436.80
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	754	2,329.86
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	700	1,715.00
	INDUSTRIA REIT	466	969.28
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,832	1,666.92
	INVESTA OFFICE FUND	2,662	10,195.46
	MIRVAC GROUP	16,020	30,277.80
	NATIONAL STORAGE REIT	1,335	2,082.60
SCENTRE GROUP	23,356	90,621.28	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	2,498	5,470.62	
STOCKLAND	10,303	43,066.54	
WESTFIELD CORP	8,386	75,641.72	
	オーストラリアドル 小計	122,739	453,133.36 (43,328,611)
ニュージ ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	3,500	3,972.50
	DNZ PROPERTY FUND LTD	1,208	2,476.40
	GOODMAN PROPERTY TRUST	4,259	5,004.32
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	4,006	5,027.53

	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	4,700	5,311.00
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	2,131	3,324.36
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	1,309	2,159.85
	ニュージーランドドル 小計	21,113	27,275.96 (2,426,469)
香港ドル	CHAMPION REIT	11,000	47,300.00
	FORTUNE REIT	6,000	47,100.00
	LINK REIT	10,000	454,000.00
	NEW CENTURY REIT	2,000	6,240.00
	PROSPERITY REIT	5,000	13,900.00
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,000	9,040.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	10,470.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,000	11,790.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	5,000	21,500.00
	香港ドル 小計	49,000	621,340.00 (9,972,507)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	2,400	3,576.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	4,000	2,820.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	8,900	21,271.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	4,000	5,000.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	4,000	4,580.00
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	6,000	4,110.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	9,100	13,923.00
	CAPITALAND MALL TRUST	11,400	23,598.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	3,000	5,055.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	2,400	3,948.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	4,000	3,140.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,500	3,537.50
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	2,600	5,304.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	2,400	3,576.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	2,000	1,720.00
	KEPPEL DC REIT	2,500	2,625.00
	KEPPEL REIT	7,000	8,050.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	8,000	2,960.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	5,700	8,379.00
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	7,400	7,659.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	4,700	7,214.50
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	6,000	6,780.00
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	2,000	1,630.00	
QUE HOSPITALITY TRUST	4,000	3,760.00	

	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	1,600	3,664.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	3,000	2,550.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	2,000	1,700.00	
	SPH REIT	3,300	3,432.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	6,000	5,130.00	
	SUNTEC REIT	11,000	18,975.00	
	シンガポールドル 小計	142,900	189,667.00 (17,460,744)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	700	7,665.00	
	イスラエルシェケル 小計	700	7,665.00 (249,342)	
	合計	1,386,048	523,201,414 (523,201,414)	

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 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 152銘柄	100.0%	69.8%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.1%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.8%
イギリスポンド	投資証券 19銘柄	100.0%	7.3%
オーストラリアドル	投資証券 30銘柄	100.0%	8.3%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 9銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	684,588,670円
負債総額	1,000,606円
純資産総額（ - ）	683,588,064円
発行済口数	650,662,126口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0506円
（1万口当たり純資産額）	（10,506円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	244,274,332,919円
負債総額	1,007,939,512円
純資産総額（ - ）	243,266,393,407円
発行済口数	152,736,610,380口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5927円
（1万口当たり純資産額）	（15,927円）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	332,898,127,381円
負債総額	5,285,823,983円
純資産総額（ - ）	327,612,303,398円
発行済口数	254,073,928,527口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2894円
（1万口当たり純資産額）	（12,894円）

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	215,055,766,585円
負債総額	311,769,303円
純資産総額（ - ）	214,743,997,282円
発行済口数	95,633,095,558口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2455円
（1万口当たり純資産額）	（22,455円）

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	217,580,727,418円
負債総額	322,994,681円
純資産総額（ - ）	217,257,732,737円
発行済口数	88,831,218,657口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4457円
（1万口当たり純資産額）	（24,457円）

Jリートマザーファンド（M）

純資産額計算書

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	88,110,226,068円
負債総額	129,649,322円
純資産総額（ - ）	87,980,576,746円
発行済口数	37,502,828,459口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3460円
（1万口当たり純資産額）	（23,460円）

海外リートマザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 6月30日現在）

資産総額	537,477,362円
負債総額	760,910円
純資産総額（ - ）	536,716,452円
発行済口数	466,353,063口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1509円
（1万口当たり純資産額）	（11,509円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成27年 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27年 9月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年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	424	6,984,968
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	21	96,399
単位型公社債投資信託	0	0
合計	445	7,081,367

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26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、有限責任 不審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26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		10,457,599		12,314,170
前払費用		114,325		125,306
未収委託者報酬		2,735,763		4,518,944
未収運用受託報酬		15,268		-
繰延税金資産		144,183		116,728
その他		3,448		8,789
流動資産合計		13,470,589		17,083,939
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67,359	1	57,461
器具備品	1	87,378	1	116,879
有形固定資産合計		154,737		174,341
無形固定資産				
ソフトウェア		203,360		197,641
その他		4,686		7,648
無形固定資産合計		208,046		205,290
投資その他の資産				
投資有価証券		69,583		60,277
長期前払費用		34,773		5,425
長期貸付金		28,838		25,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		117,743		114,415
その他		553		463
貸倒引当金		28,838		25,838
投資その他の資産合計		247,653		205,581
固定資産合計		610,437		585,213
資産合計		14,081,027		17,669,152

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
預り金		13,353		13,868

未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
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	62,500	65,500
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	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	22,773,831	28,159,652
運用受託報酬	55,511	8,732
営業収益合計	22,829,342	28,168,384

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

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	1,775	1,936
営業外収益合計	16,027	18,203
営業外費用		

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	

当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	"	27,866	"

2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成27年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
----	-------	------------	--------	-------------	-----	-------

平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日
----------------------	------	--------	-------	--------	------------	------------

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	10,457,599	10,457,599	-
（2）未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	-
（4）未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
（5）未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1) 現金及び預金	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(平成27年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日) (単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

当事業年度(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) (単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位:千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)

(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

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

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・レアルコース)	3,172,592千円

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内 容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	----------------	-----	-----------------------	---------------	-------------------------------	-------------------	-----------	--------------	----	--------------

親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員兼任	経営指導料の支払	73,276	-	-
-----	----------------------	---------	---------	------	----------	------	----------	--------	---	---

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 経営指導料
 取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用の支払	2,631,233	その他未払金	239,120

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 投信販売代行手数料
 ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
 投資助言費用
 各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員兼任	投信販売代行手数料等の支払	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 投信販売代行手数料
 ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
 投資助言費用
 各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

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27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年 9月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円(平成27年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27年3月末日現在)	事業の内容
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562	
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社岩手銀行	12,089	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社四国銀行	25,000	
株式会社荘内銀行	7,000	
株式会社千葉興業銀行	57,941	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社北越銀行	24,538	

株式会社横浜銀行	215,628	
浜銀ＴＴ証券株式会社	3,307	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成27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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成27年 1月 5日	臨時報告書
平成27年 3月10日	有価証券届出書
平成27年 3月10日	有価証券報告書
平成27年 3月30日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月 5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27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26年12月11日から平成27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27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。