

【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28年9月9日提出
【計算期間】	第18特定期間(自 平成27年12月11日至 平成28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】	投信業務部長 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】	03-6737-0522
【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－バ ル (日本を 含む)	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

る旨の記載があるものをいう。

(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

1. 国内外の株式・債券・不動産投資信託証券へ分散投資します。

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

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

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

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

<投資対象とするマザーファンド>

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

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

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。**日本株式マザーファンド「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」**

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

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

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

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

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

Jリートマザーファンド（M）「東証REIT指数（配当込み）」

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

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

外国株式マザーファンド「MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）」

「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

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

外国債券マザーファンド「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」

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

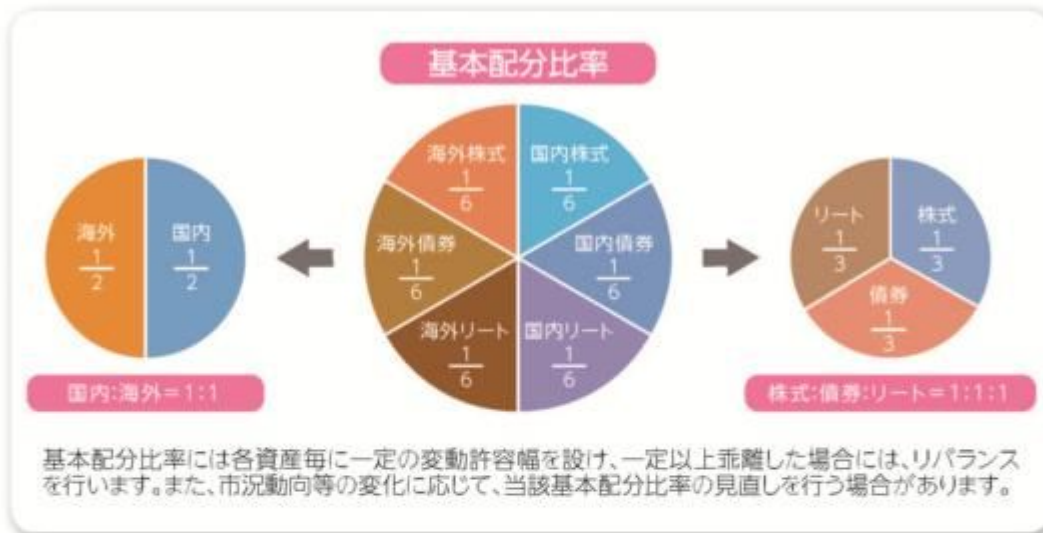
同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

海外リートマザーファンド「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）」

「S&P先進国REIT指数」（以下「当インデックス」）とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

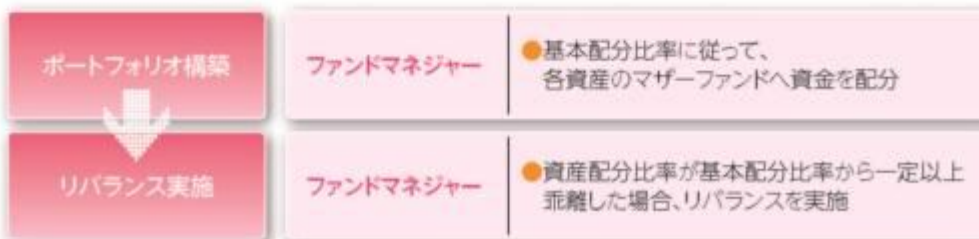
当インデックスはSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、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

2. 6つの資産への均等配分を基本配分比率とします。



ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

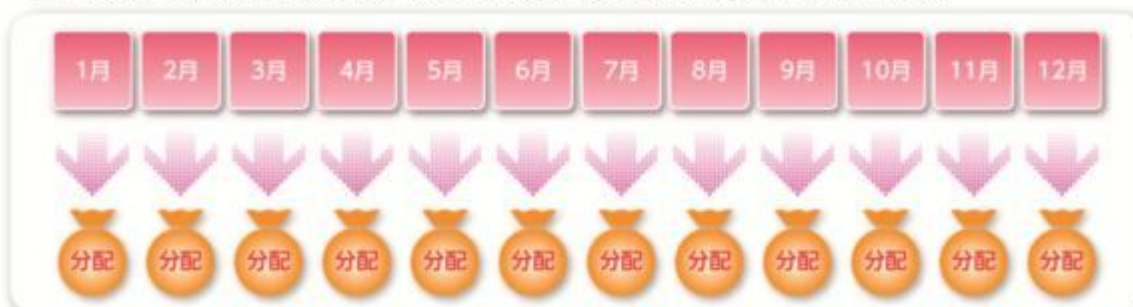
ファンドのしくみ

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



分配方針

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



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

主な投資制限

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

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

【収益分配金に関する留意事項】

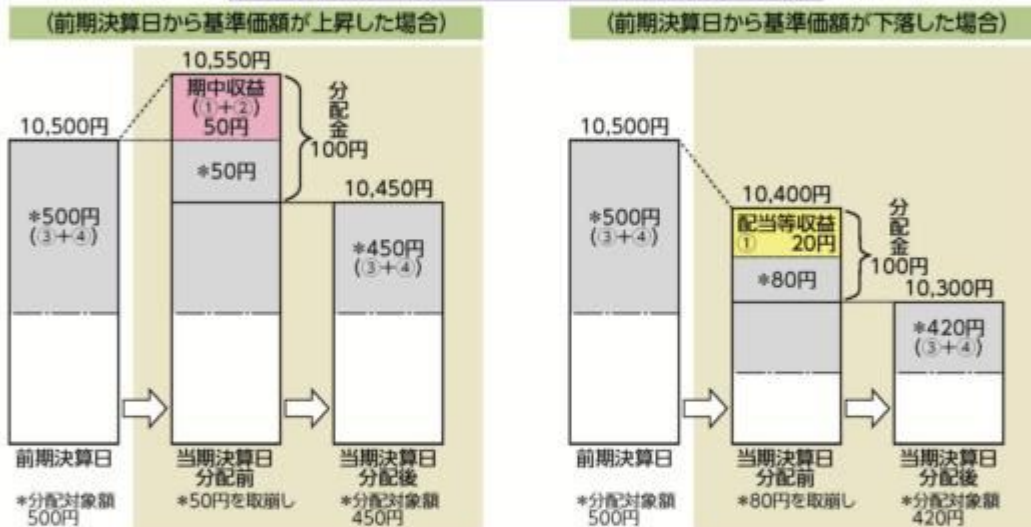
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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）



(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）

（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。

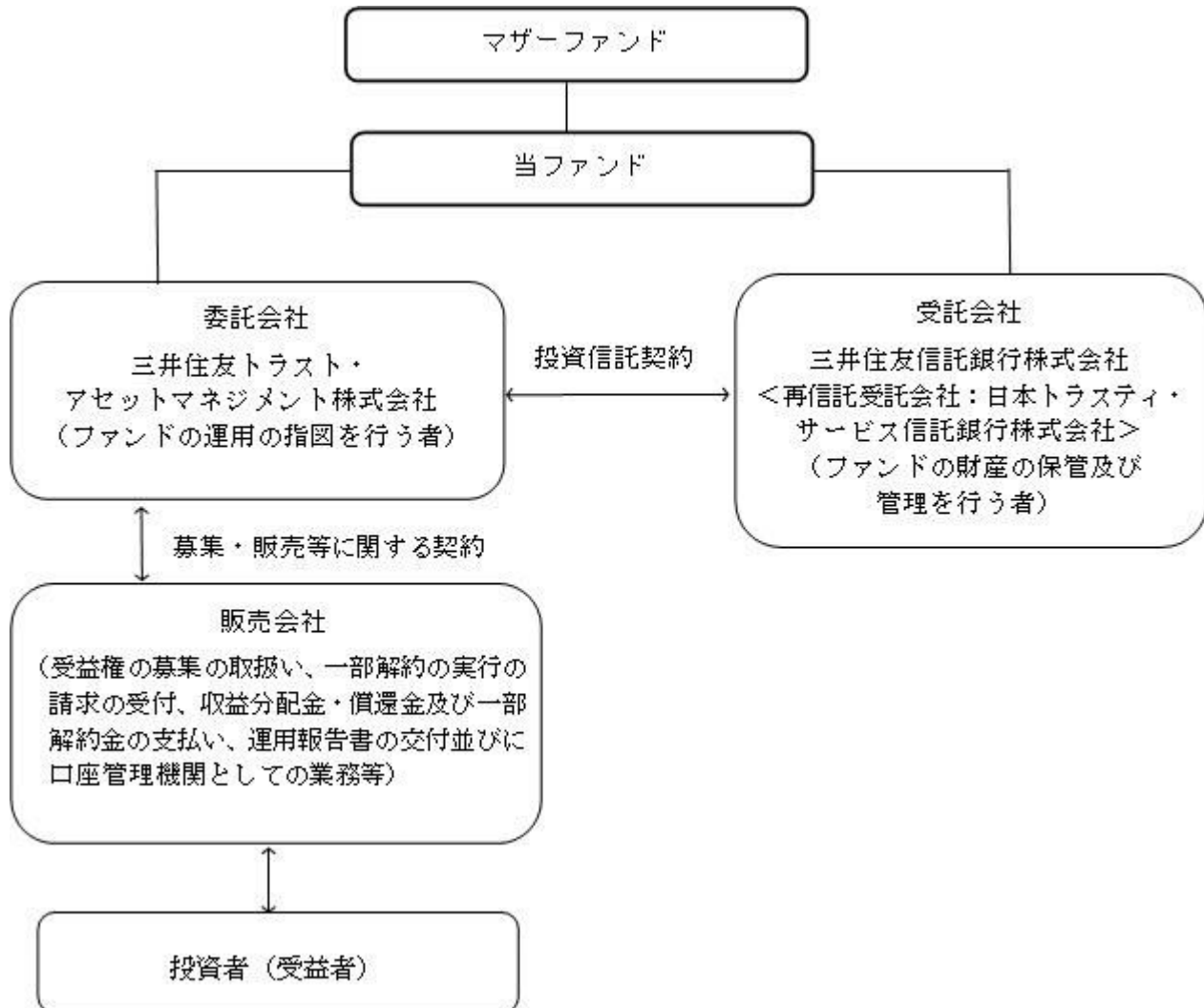
(2) 【ファンドの沿革】

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28年 6月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

八．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

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

投資対象

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

投資態度

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「Jリートマザーファンド（M）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

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

社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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

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

3. 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

「海外リートマザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

1：上場に準ずるものを含みます。

2：一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。

(2) 投資態度

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

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

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

3. 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

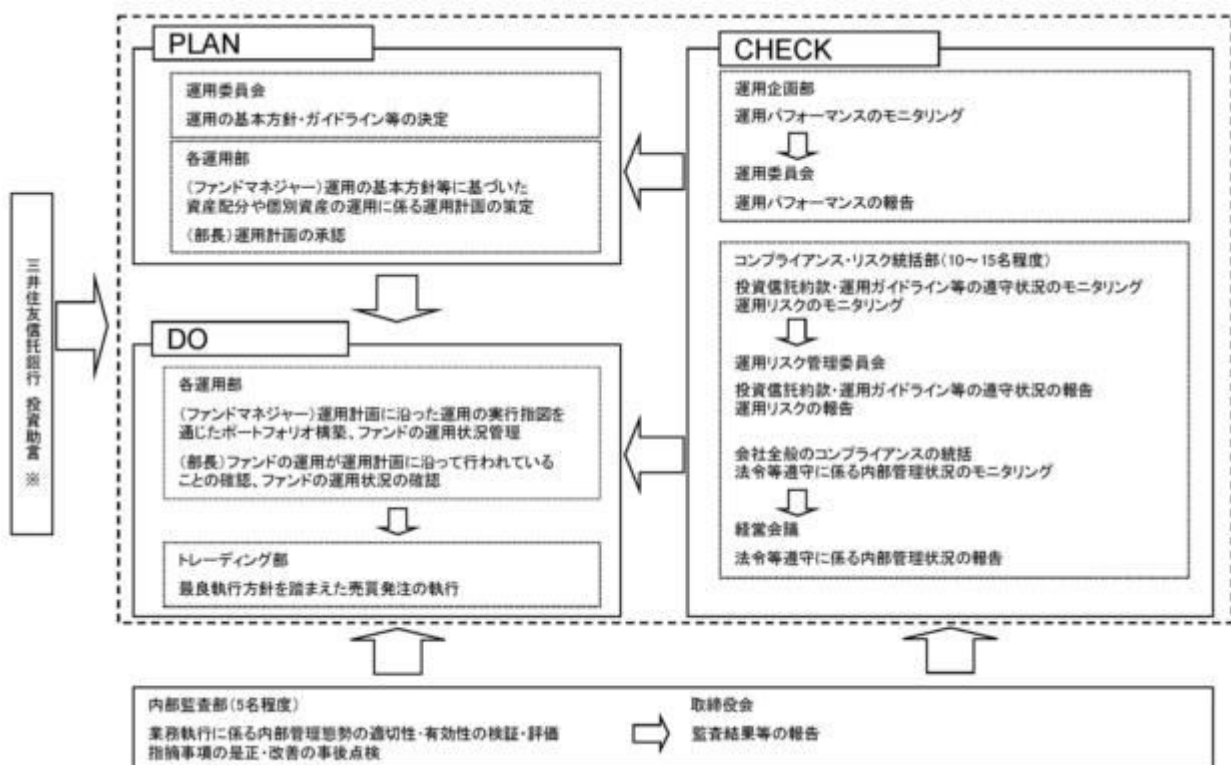
株式への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

（3）【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

（４）【配分方針】

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

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

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

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

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．同一銘柄の株式への投資割合

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

E．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

F．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

G．投資する株式等の範囲

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

証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

H．信用取引の運用指図

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

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

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

I．先物取引等の運用指図

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

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

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

J．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

K．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

M．公社債の空売りの指図及び範囲

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

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

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

N．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

O．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

P．外国為替予約取引の指図

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

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

りません。

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

Q．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図

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

R．再投資の指図

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

S．資金の借入れ

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

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

ハ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

T．受託会社による資金の立替え

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

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

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

U．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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

ます。

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

A．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2011年7月～2016年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{*1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{*3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{*5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(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買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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

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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び
譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離
課税を選択したものに限りま
す。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

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

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成28年 6月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成28年 6月30日現在の状況について記載してあります。

【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
-------	------	---------	---------

親投資信託受益証券	日本	504,772,393	98.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,716,707	1.12
合計(純資産総額)		510,489,100	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	Jリートマザーファンド(M)	35,319,801	2.5460	89,924,214	2.5139	88,790,447	17.39
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	61,614,674	1.3835	85,243,902	1.3952	85,964,793	16.84
日本	親投資信託受益証券	海外リートマザーファンド	75,975,359	1.1401	86,619,507	1.1132	84,575,769	16.57
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	45,230,142	1.9604	88,669,171	1.8264	82,608,331	16.18
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	66,317,090	1.3260	87,936,462	1.2433	82,452,037	16.15
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	37,050,480	2.2580	83,659,984	2.1695	80,381,016	15.75

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.88
合計	98.88

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（平成19年12月10日）	3,586,283,463	3,589,844,188	9,957	9,967
第2特定期間末（平成20年 6月10日）	3,192,838,387	3,196,433,746	8,877	8,887
第3特定期間末（平成20年12月10日）	2,013,785,577	2,017,176,994	5,938	5,948
第4特定期間末（平成21年 6月10日）	2,100,580,982	2,103,869,774	6,387	6,397
第5特定期間末（平成21年12月10日）	2,016,006,579	2,022,240,837	6,467	6,487
第6特定期間末（平成22年 6月10日）	1,808,286,497	1,813,977,919	6,354	6,374
第7特定期間末（平成22年12月10日）	1,702,409,568	1,710,097,724	6,643	6,673
第8特定期間末（平成23年 6月10日）	1,531,647,646	1,538,702,069	6,514	6,544
第9特定期間末（平成23年12月12日）	1,212,675,791	1,218,975,235	5,775	5,805
第10特定期間末（平成24年 6月11日）	1,107,710,596	1,113,337,628	5,906	5,936
第11特定期間末（平成24年12月10日）	1,042,705,830	1,044,316,718	6,473	6,483
第12特定期間末（平成25年 6月10日）	1,113,727,390	1,115,120,751	7,993	8,003
第13特定期間末（平成25年12月10日）	1,045,420,431	1,046,628,716	8,652	8,662
第14特定期間末（平成26年 6月10日）	954,452,290	955,507,504	9,045	9,055
第15特定期間末（平成26年12月10日）	831,378,464	832,184,479	10,315	10,325
第16特定期間末（平成27年 6月10日）	702,772,093	703,432,466	10,642	10,652
第17特定期間末（平成27年12月10日）	580,433,326	580,999,534	10,251	10,261
第18特定期間末（平成28年 6月10日）	533,798,664	534,339,635	9,867	9,877
平成27年 6月末日	683,588,064		10,506	
7月末日	667,355,433		10,643	
8月末日	613,541,047		10,089	
9月末日	585,317,141		9,850	
10月末日	607,702,099		10,363	
11月末日	592,074,992		10,412	
12月末日	579,087,384		10,309	
平成28年 1月末日	559,098,791		9,992	
2月末日	542,971,015		9,724	
3月末日	560,226,680		10,059	
4月末日	542,541,990		9,982	
5月末日	545,334,680		10,057	
6月末日	510,489,100		9,539	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1特定期間	平成19年 8月31日～平成19年12月10日	20
第2特定期間	平成19年12月11日～平成20年 6月10日	60
第3特定期間	平成20年 6月11日～平成20年12月10日	60

第4特定期間	平成20年12月11日～平成21年 6月10日	60
第5特定期間	平成21年 6月11日～平成21年12月10日	90
第6特定期間	平成21年12月11日～平成22年 6月10日	120
第7特定期間	平成22年 6月11日～平成22年12月10日	140
第8特定期間	平成22年12月11日～平成23年 6月10日	180
第9特定期間	平成23年 6月11日～平成23年12月12日	180
第10特定期間	平成23年12月13日～平成24年 6月11日	180
第11特定期間	平成24年 6月12日～平成24年12月10日	60
第12特定期間	平成24年12月11日～平成25年 6月10日	60
第13特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	60
第14特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	60
第15特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	60
第16特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	60
第17特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	60
第18特定期間	平成27年12月11日～平成28年 6月10日	60

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1特定期間	平成19年 8月31日～平成19年12月10日	0.2
第2特定期間	平成19年12月11日～平成20年 6月10日	10.2
第3特定期間	平成20年 6月11日～平成20年12月10日	32.4
第4特定期間	平成20年12月11日～平成21年 6月10日	8.6
第5特定期間	平成21年 6月11日～平成21年12月10日	2.7
第6特定期間	平成21年12月11日～平成22年 6月10日	0.1
第7特定期間	平成22年 6月11日～平成22年12月10日	6.8
第8特定期間	平成22年12月11日～平成23年 6月10日	0.8
第9特定期間	平成23年 6月11日～平成23年12月12日	8.6
第10特定期間	平成23年12月13日～平成24年 6月11日	5.4
第11特定期間	平成24年 6月12日～平成24年12月10日	10.6
第12特定期間	平成24年12月11日～平成25年 6月10日	24.4
第13特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	9.0
第14特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	5.2
第15特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	14.7
第16特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	3.8
第17特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	3.1
第18特定期間	平成27年12月11日～平成28年 6月10日	3.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1特定期間	平成19年 8月31日～平成19年12月10日	3,613,938,221	12,188,903	3,601,749,318
第2特定期間	平成19年12月11日～平成20年 6月10日	137,066,455	141,987,767	3,596,828,006
第3特定期間	平成20年 6月11日～平成20年12月10日	20,837,684	226,248,338	3,391,417,352
第4特定期間	平成20年12月11日～平成21年 6月10日	1,444,362	103,953,055	3,288,908,659
第5特定期間	平成21年 6月11日～平成21年12月10日	7,833,268	179,383,448	3,117,358,479
第6特定期間	平成21年12月11日～平成22年 6月10日	7,973,109	279,620,527	2,845,711,061
第7特定期間	平成22年 6月11日～平成22年12月10日	154,462	283,146,803	2,562,718,720
第8特定期間	平成22年12月11日～平成23年 6月10日	1,801,557	213,045,766	2,351,474,511
第9特定期間	平成23年 6月11日～平成23年12月12日	1,457,958	253,117,712	2,099,814,757
第10特定期間	平成23年12月13日～平成24年 6月11日	196,582	224,333,874	1,875,677,465
第11特定期間	平成24年 6月12日～平成24年12月10日	273,173	265,062,129	1,610,888,509
第12特定期間	平成24年12月11日～平成25年 6月10日	2,293,905	219,820,949	1,393,361,465
第13特定期間	平成25年 6月11日～平成25年12月10日	2,597,165	187,672,755	1,208,285,875
第14特定期間	平成25年12月11日～平成26年 6月10日	470,072	153,541,180	1,055,214,767
第15特定期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	124,890	249,324,474	806,015,183
第16特定期間	平成26年12月11日～平成27年 6月10日	479,267	146,121,136	660,373,314
第17特定期間	平成27年 6月11日～平成27年12月10日	95,536	94,260,179	566,208,671
第18特定期間	平成27年12月11日～平成28年 6月10日	107,758	25,344,751	540,971,678

(注1)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該特定期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	193,493,559,910	98.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,852,794,564	1.45
合計（純資産総額）		196,346,354,474	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,864,650,000	1.46

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

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

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

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	265,581,953,960	81.74
	メキシコ	100,911,000	0.03
	小計	265,682,864,960	81.77
地方債証券	日本	18,342,939,237	5.65
特殊債券	日本	24,463,639,341	7.53
社債券	日本	12,819,004,000	3.95
	フランス	403,166,000	0.12
	オーストラリア	303,133,000	0.09
	オランダ	202,236,000	0.06
	スウェーデン	201,975,000	0.06
	ノルウェー	101,216,000	0.03
	カナダ	100,872,000	0.03
	スイス	99,823,000	0.03
	小計	14,231,425,000	4.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,186,719,039	0.67
合計(純資産総額)		324,907,587,577	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	1,070,440,000	0.33

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	81.77
地方債証券	5.65
特殊債券	7.53
社債券	4.38
合計	99.33

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

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

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

外国株式マザーファンド

投資状況

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

	香港	36,984,792	0.02
	シンガポール	13,384,989	0.01
	小計	195,673,950	0.09
投資証券	アメリカ	4,156,225,614	2.02
	オーストラリア	529,657,759	0.26
	フランス	313,429,224	0.15
	イギリス	207,184,904	0.10
	香港	99,437,403	0.05
	シンガポール	82,736,060	0.04
	カナダ	56,778,545	0.03
	小計	5,445,449,509	2.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,993,699,704	5.82
合計(純資産総額)		205,989,954,634	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,688,902,126	3.73
	買建	カナダ	607,715,875	0.30
	買建	ドイツ	1,996,364,743	0.97
	買建	イギリス	1,226,080,763	0.60
	買建	オーストラリア	469,004,184	0.23

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,773,664,450	1.83

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	723	アメリカドル	74,331,746	7,649,479,981	74,714,820	7,688,902,126	3.73
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	47	カナダドル	7,594,215.5	604,271,727	7,637,500	607,715,875	0.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	57	スイスフラン	4,363,329	458,454,978	4,514,400	474,328,008	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	472	ユーロ	13,079,554	1,496,170,182	13,305,680	1,522,036,735	0.74
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	48	オーストラリアドル	6,159,386	472,671,282	6,111,600	469,004,184	0.23
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	141	イギリスポンド	8,361,398.75	1,157,301,201	8,858,325	1,226,080,763	0.60

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	27,239,000.00	2,818,299,167	2,802,530,250	1.36
	ユーロ	買建	4,319,000.00	496,597,978	494,050,410	0.24

イギリスポンド	買建	1,417,000.00	202,010,811	196,076,800	0.10
スイスフラン	買建	1,070,000.00	111,754,010	112,424,900	0.05
スウェーデンクローナ	買建	1,587,000.00	19,104,782	19,297,920	0.01
デンマーククローネ	買建	1,673,000.00	25,476,778	25,730,740	0.01
オーストラリアドル	買建	1,211,000.00	91,675,243	92,920,030	0.05
シンガポールドル	買建	401,000.00	30,457,369	30,633,400	0.01

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

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

外国債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	67,850,896,710	41.68
	フランス	15,711,719,761	9.65
	イタリア	15,252,154,096	9.37
	イギリス	12,414,509,847	7.63
	ドイツ	11,858,890,099	7.28
	スペイン	8,541,702,434	5.25
	ベルギー	4,188,853,604	2.57
	オランダ	3,807,308,967	2.34
	カナダ	3,294,985,321	2.02
	オーストラリア	2,993,615,881	1.84
	オーストリア	2,450,326,925	1.51
	メキシコ	1,438,368,973	0.88
	アイルランド	1,279,838,713	0.79
	デンマーク	1,092,925,738	0.67
	フィンランド	972,503,271	0.60
	ポーランド	920,483,439	0.57
	スウェーデン	793,758,733	0.49
	マレーシア	756,746,203	0.46
	南アフリカ	718,775,574	0.44
	シンガポール	588,422,280	0.36
スイス	449,296,462	0.28	
ノルウェー	404,918,598	0.25	
	小計	157,781,001,629	96.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,007,740,648	3.08
合計(純資産総額)		162,788,742,277	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	953,502,966	0.59
	買建	ドイツ	1,444,109,691	0.89

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		3,208,816,800	1.97

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.92
合計	96.92

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	36	アメリカドル	4,366,605.01	449,367,322	4,395,093.84	452,299,107	0.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	21	アメリカドル	2,762,755.9	284,315,209	2,794,312.5	287,562,699	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	12	アメリカドル	2,025,954.25	208,490,952	2,076,000	213,641,160	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	20	ユーロ	2,238,800	256,096,332	2,241,200	256,370,868	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	24	ユーロ	3,191,756	365,104,969	3,205,680	366,697,735	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	43	ユーロ	7,085,612	810,523,156	7,177,560	821,041,088	0.50

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	14,380,000.00	1,491,126,576	1,478,983,000	0.91
	カナダドル	買建	1,570,000.00	126,968,878	124,846,400	0.08
	ユーロ	買建	11,600,000.00	1,356,168,471	1,326,924,000	0.82
	イギリスポンド	買建	2,010,000.00	298,435,894	278,063,400	0.17

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

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

Jリートマザーファンド(M)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	85,536,268,900	98.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,247,803,987	1.44
合計(純資産総額)		86,784,072,887	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

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

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.56
合計	98.56

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.53
合計	96.53

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2007年8月31日
作成基準日：2016年6月30日

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:1,570円 直近1年間分配金合計額:120円

決算期	2016年2月	2016年3月	2016年4月	2016年5月	2016年6月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位購入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期間	売却投資比率
リートマザーファンド(M)	17.4%	日本ビルファンド投資法人 ジャパニアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.6%
日本債券マザーファンド	16.8%	第342回利付国債(10年) 第106回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100% 0.200%	2026/03/20 2017/09/20	0.2%
海外リートマザーファンド	16.6%	SIMON PROPERTY GROUP PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
外国株式マザーファンド	16.2%	APPLE INC EXXON MOBIL	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア機器 エネルギー	-	-	0.3%
日本株式マザーファンド	16.2%	トヨタ自動車 日本電信電話	日本	株式	輸送用機器 情報・通信業	-	-	0.5%
外国債券マザーファンド	15.7%	T 2% 08/15/25 T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債	-	2.000% 3.625%	2025/08/15 2020/02/15	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※2007年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2016年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

<申込手続>

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

<申込コース>

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< スイッチング >

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

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

< 問い合わせ先 >

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

2 【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（http://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

イ．国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

ハ．公社債等

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

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

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成19年 8月31日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎月11日から翌月10日までとします。

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

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

えるときは、当該約款変更を行いません。

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18特定期間(平成27年12月11日から平成28年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

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

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日	第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日
営業収益		
受取利息	719	202
有価証券売買等損益	17,711,412	15,148,173
営業収益合計	17,710,693	15,147,971
営業費用		
支払利息	-	743
受託者報酬	135,875	118,977
委託者報酬	3,057,129	2,676,776
その他費用	16,923	15,125
営業費用合計	3,209,927	2,811,621
営業利益又は営業損失（ ）	20,920,620	17,959,592
経常利益又は経常損失（ ）	20,920,620	17,959,592
当期純利益又は当期純損失（ ）	20,920,620	17,959,592
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	374,721	355,677
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	42,398,779	14,224,655
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,350	236,133
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	236,133
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,350	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,029,310	83
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,029,310	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	83
分配金	3,601,265	3,318,450
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,224,655	7,173,014

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日	第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日																																																						
分配金の計算過程 第94期 自 平成27年 6月11日 至 平成27年 7月10日	分配金の計算過程 第100期 自 平成27年12月11日 至 平成28年 1月12日																																																						
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>895,898円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>10,482,312円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>46,070,845円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>57,449,055円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>641,942,774口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>894円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	895,898円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	10,482,312円	分配準備積立金額	D	46,070,845円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,449,055円	当ファンドの期末残存口数	F	641,942,774口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	894円	1万口当たり分配金額	H	10円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>900,402円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>9,136,409円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>42,017,512円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>52,054,323円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>559,518,923口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>930円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	900,402円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	9,136,409円	分配準備積立金額	D	42,017,512円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,054,323円	当ファンドの期末残存口数	F	559,518,923口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	930円	1万口当たり分配金額	H	10円
項目																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	895,898円																																																					
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																					
収益調整金額	C	10,482,312円																																																					
分配準備積立金額	D	46,070,845円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	57,449,055円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	641,942,774口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	894円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					
項目																																																							
費用控除後の配当等収益額	A	900,402円																																																					
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																					
収益調整金額	C	9,136,409円																																																					
分配準備積立金額	D	42,017,512円																																																					
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,054,323円																																																					
当ファンドの期末残存口数	F	559,518,923口																																																					
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	930円																																																					
1万口当たり分配金額	H	10円																																																					

第17特定期間

自 平成27年 6月11日

至 平成27年12月10日

収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	641,942円
---------	-------------------------	----------

第95期

自 平成27年 7月11日

至 平成27年 8月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	923,603円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	10,219,534円
分配準備積立金額	D	45,163,505円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	56,306,642円
当ファンドの期末残存口数	F	625,849,909口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	899円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	625,849円

第96期

自 平成27年 8月11日

至 平成27年 9月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	737,682円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,750,608円
分配準備積立金額	D	43,375,268円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	53,863,558円
当ファンドの期末残存口数	F	597,133,005口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	902円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	597,133円

第97期

自 平成27年 9月11日

至 平成27年10月13日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,839,500円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,655,089円
分配準備積立金額	D	43,089,530円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	54,584,119円
当ファンドの期末残存口数	F	591,283,368口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	923円

第18特定期間

自 平成27年12月11日

至 平成28年 6月10日

収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	559,518円
---------	-------------------------	----------

第101期

自 平成28年 1月13日

至 平成28年 2月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	340,795円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,137,668円
分配準備積立金額	D	42,322,335円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	51,800,798円
当ファンドの期末残存口数	F	559,140,383口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	926円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	559,140円

第102期

自 平成28年 2月11日

至 平成28年 3月10日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,351,697円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,126,071円
分配準備積立金額	D	42,046,339円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	52,524,107円
当ファンドの期末残存口数	F	558,384,681口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	940円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	$I=F \times H / 10,000$	558,384円

第103期

自 平成28年 3月11日

至 平成28年 4月11日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,488,237円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,102,060円
分配準備積立金額	D	42,726,942円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	53,317,239円
当ファンドの期末残存口数	F	556,915,533口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	957円

第17特定期間 自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日			第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日		
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	591,283円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	556,915円
第98期 自 平成27年10月14日 至 平成27年11月10日			第104期 自 平成28年 4月12日 至 平成28年 5月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	776,754円	費用控除後の配当等収益額	A	775,065円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,452,068円	収益調整金額	C	8,883,173円
分配準備積立金額	D	43,405,442円	分配準備積立金額	D	42,608,368円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	53,634,264円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	52,266,606円
当ファンドの期末残存口数	F	578,850,144口	当ファンドの期末残存口数	F	543,522,495口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	926円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	961円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	578,850円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	543,522円
第99期 自 平成27年11月11日 至 平成27年12月10日			第105期 自 平成28年 5月11日 至 平成28年 6月10日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	434,993円	費用控除後の配当等収益額	A	556,159円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	9,245,647円	収益調整金額	C	8,841,485円
分配準備積立金額	D	42,651,102円	分配準備積立金額	D	42,638,863円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	52,331,742円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	52,036,507円
当ファンドの期末残存口数	F	566,208,671口	当ファンドの期末残存口数	F	540,971,678口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	924円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	961円
1万口当たり分配金額	H	10円	1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	566,208円	収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	540,971円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第18特定期間 自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第18特定期間 (平成28年 6月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17特定期間	第18特定期間
	自 平成27年 6月11日 至 平成27年12月10日	自 平成27年12月11日 至 平成28年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	660,373,314円	566,208,671円
期中追加設定元本額	95,536円	107,758円
期中一部解約元本額	94,260,179円	25,344,751円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第17特定期間 （平成27年12月10日現在）	第18特定期間 （平成28年 6月10日現在）
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	3,164,176	3,630,740
合計	3,164,176	3,630,740

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	67,097,056	88,970,696	
	日本債券マザーファンド	62,301,413	86,194,004	
	外国株式マザーファンド	45,754,208	89,696,549	
	外国債券マザーファンド	37,411,173	84,474,428	
	Jリートマザーファンド(M)	35,719,542	90,941,953	
	海外リートマザーファンド	76,858,490	87,626,364	
合計		325,141,882	527,903,994	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	156,957,655,657口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3260円 (1万口当たり純資産額) (13,260円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	平成28年 6月10日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 6月10日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

平成28年 6月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成28年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年12月11日
期首元本額	147,024,582,880円
期中追加設定元本額	19,066,035,057円
期中一部解約元本額	9,132,962,280円
期末元本額	156,957,655,657円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	987,582,812円
D C 日本株式インデックスファンド	343,087,122円
D C 日本株式インデックスファンド L	51,820,944,842円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,363,078,854円
D C バランスファンド 3 0	1,945,961,462円
D C バランスファンド 5 0	2,908,253,002円
D C バランスファンド 7 0	1,390,602,521円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	67,097,056円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	38,104,395円
新生・4分散ファンド	87,877,896円

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成28年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,706,151,540	-	3,670,250,000	35,901,540
合計		3,706,151,540	-	3,670,250,000	35,901,540

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ミロク情報サービス	7,600	1,522.00	11,567,200
ソフトバンクグループ	580,000	5,996.00	3,477,680,000
ハウスイ	8,000	116.00	928,000
高千穂交易	4,000	892.00	3,568,000
伊藤忠食品	2,500	4,120.00	10,300,000
エレマテック	4,800	2,131.00	10,228,800
JALUX	3,300	1,806.00	5,959,800
あらた	4,600	2,380.00	10,948,000
トーメンデバイス	1,500	1,976.00	2,964,000
東京エレクトロン デバイス	3,700	1,523.00	5,635,100
フィールズ	9,000	1,434.00	12,906,000
双日	644,800	258.00	166,358,400
アルフレッサ ホールディングス	128,700	2,370.00	305,019,000
横浜冷凍	25,400	1,018.00	25,857,200
神栄	14,000	124.00	1,736,000
山下医科器械	800	1,722.00	1,377,600
ラサ商事	4,800	474.00	2,275,200
ラクーン	4,400	610.00	2,684,000
アルコニックス	5,800	1,540.00	8,932,000
神戸物産	6,600	2,206.00	14,559,600
あい ホールディングス	18,200	2,703.00	49,194,600
ディーブイエックス	3,700	1,082.00	4,003,400
ダイワボウホールディングス	93,000	227.00	21,111,000
マクニカ・富士エレホールディングス	18,400	1,174.00	21,601,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,800	1,048.00	18,654,400
八洲電機	7,900	524.00	4,139,600
UKCホールディングス	6,600	1,879.00	12,401,400
OCHIホールディングス	3,000	1,015.00	3,045,000
TOKAIホールディングス	45,000	682.00	30,690,000
三洋貿易	5,600	1,257.00	7,039,200
ウイン・パートナーズ	3,700	1,517.00	5,612,900
ミタチ産業	2,600	593.00	1,541,800
シップヘルスケアホールディングス	20,800	3,185.00	66,248,000
明治電機工業	3,200	1,007.00	3,222,400
デリカフーズ	2,200	954.00	2,098,800
スターティア	2,000	600.00	1,200,000
富士興産	4,000	420.00	1,680,000
協栄産業	14,000	137.00	1,918,000
小野建	8,900	1,239.00	11,027,100
佐島電機	8,100	658.00	5,329,800
エコトレーディング	2,400	588.00	1,411,200
伯東	7,800	908.00	7,082,400

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券マザーファンド

貸借対照表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成28年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	236,814,693,161口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 106,698,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3835円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,835円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成28年 6月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

平成28年 6月10日現在	
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成28年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年12月11日
期首元本額	243,643,993,202円
期中追加設定元本額	19,525,271,189円
期中一部解約元本額	26,354,571,230円
期末元本額	236,814,693,161円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	1,096,428,620円
D C日本債券インデックスファンド	2,910,454,780円
D C日本債券インデックスファンドL	32,817,634,911円
D Cバランスファンド30	5,702,026,516円
D Cバランスファンド50	3,766,243,578円
D Cバランスファンド70	848,597,329円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	62,301,413円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	35,781,583円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	330,534,371円
新生・4分散ファンド	81,656,404円

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	13,046,995,310
地方債証券	229,350,247
特殊債券	488,978,926
社債券	125,982,000
合計	13,891,306,483

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成28年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,520,603,240	-	1,523,100,000	2,496,760
	合計	1,520,603,240	-	1,523,100,000	2,496,760

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,423,000	
第21回道路債券	100,000,000	140,364,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	312,762,000	
第27回道路債券	100,000,000	118,670,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,960,000	
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,401,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,875,000	
第33回道路債券	100,000,000	144,608,000	
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,946,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,049,000	
第38回道路債券	100,000,000	118,360,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,926,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,938,000	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,550,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,344,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,058,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,548,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,436,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,558,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,659,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,008,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,399,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,990,000	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,484,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,988,000	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,584,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,096,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,521,000	

第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,815,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,388,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	252,686,000	
第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,139,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,930,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,330,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,624,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	257,246,000	
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,311,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	144,132,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,024,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,555,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,883,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,240,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	142,189,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,352,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,411,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	177,077,100	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	140,597,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,453,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,825,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,560,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	132,063,750	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,331,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,930,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,561,000	
	100,000,000	105,270,000	

第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,350,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,407,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,364,000	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,295,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	218,735,220	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,728,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,367,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,681,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,039,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	110,284,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,926,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	126,889,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,841,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,443,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	125,679,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,095,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,377,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	254,330,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,887,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	127,213,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	118,962,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,994,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,501,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	117,961,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	126,472,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,291,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,646,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	119,299,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	379,392,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,354,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	244,832,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	124,338,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,688,000	

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

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

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

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

第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	105,083,000	
第1回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	100,427,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	101,652,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,747,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,542,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	102,102,000	
第22回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,507,000	
第24回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,744,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,394,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,687,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	105,301,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,548,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,055,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,585,000	
第92回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,968,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	124,628,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,124,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,950,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	117,777,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,147,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,511,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,371,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,440,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	113,759,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,884,000	
第140回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,382,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	103,493,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,836,000	
第5回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,637,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,480,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,591,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,205,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	118,383,000	

第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,575,000	
第6回興銀リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,184,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,519,000	
第9回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	102,200,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	105,496,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,779,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,648,000	
第6回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,462,000	
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,169,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	104,367,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,790,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,298,000	
第41回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,406,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,859,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	121,468,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	122,525,000	
第104回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,411,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,879,000	
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,056,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	106,094,000	
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,087,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,404,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,008,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,465,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,268,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,529,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,956,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	127,409,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,153,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,046,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	116,904,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,835,000	

第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	126,990,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	124,417,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	127,139,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	121,642,000	
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,180,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,050,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,350,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,311,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	103,956,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,143,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,072,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,414,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,244,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,359,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,337,000	
第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,372,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,282,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,454,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,105,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,852,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,796,000	
第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,266,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,813,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,082,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	107,303,000	
第479回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,240,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,847,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	107,690,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,090,000	
第436回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,005,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,299,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	104,032,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	101,535,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,243,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,683,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,700,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,696,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,857,000	
社債券合計	13,800,000,000	14,509,322,000	
合計		324,583,402,991	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p>

	平成28年 6月10日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成28年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	111,407,571,420口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9604円 (1万口当たり純資産額) (19,604円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成28年 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	平成28年 6月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成28年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年12月11日
期首元本額	104,088,914,553円
期中追加設定元本額	14,059,231,895円
期中一部解約元本額	6,740,575,028円
期末元本額	111,407,571,420円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,323,840,055円
DC外国株式インデックスファンド	4,601,889,901円
DC外国株式インデックスファンドL	17,985,748,028円
DCバランスファンド30	673,649,068円
DCバランスファンド50	1,333,990,578円
DCバランスファンド70	724,317,527円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	45,754,208円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	26,200,532円
新生・4分散ファンド	60,114,620円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	496,334,796円
外国株式インデックスe	6,919,900,945円
インデックスコレクション(外国株式)	4,205,922,263円
インデックスコレクション(バランス株式30)	1,269,428,297円
インデックスコレクション(バランス株式50)	585,518,383円
インデックスコレクション(バランス株式70)	542,274,370円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	24,517,160,369円
外国株式パッシブファンド私募A(適格機関投資家専用)	1,212,340,456円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	2,033,474,367円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	422,228,393円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	3,863,104,331円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	220,977,490円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	790,044,905円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	56,031,352円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	5,207,816,501円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,193,698,764円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	661,088,038円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	12,478,054,440円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	1,166,718,070円

区分	平成28年 6月10日現在
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	9,952,303,118円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,858,110,810円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	57,896,450円
バランスV A 40（適格機関投資家専用）	616,354,008円
V Aバランス株式40（適格機関投資家専用）	115,402,877円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	276,652,465円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	781,601,381円
バランスV A 20（適格機関投資家専用）	46,836,725円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	1,200,056,380円
バランスV A 20 L（適格機関投資家専用）	32,430,044円
バランスV A 25 L（適格機関投資家専用）	218,820,971円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	618,836,933円
私募外国株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	14,648,211円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成28年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引	9,413,867,709	9,747,694,556	333,826,847
	買建			
合計		9,413,867,709	9,747,694,556	333,826,847

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成28年 6月10日現在）

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

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

有価証券明細表注記

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 597銘柄	96.9%			63.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			3.1%	2.0%
カナダドル	株式 91銘柄	99.3%			3.9%
	投資証券 3銘柄			0.7%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	98.6%			12.1%
	投資証券 6銘柄			1.4%	0.2%
イギリスポンド	株式 109銘柄	98.4%			7.7%
	投資証券 5銘柄			1.6%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.7%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	88.3%			2.5%
	投資信託受 益証券 4銘柄		2.6%		0.1%
	投資証券 8銘柄			9.2%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	94.8%			1.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式 23銘柄	92.5%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.5%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

平成28年 6月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	74,640,797,505口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2580円 (1万口当たり純資産額) (22,580円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成28年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2.金融商品の時価等に関する事項

平成28年 6月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成28年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年12月11日
期首元本額	78,266,297,921円
期中追加設定元本額	5,327,064,924円
期中一部解約元本額	8,952,565,340円
期末元本額	74,640,797,505円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,811,770,692円
D C 外国債券インデックスファンド	1,828,578,165円
D C 外国債券インデックスファンド L	10,320,696,389円
物価連動債組入世界債券ファンド	29,559,948円
D C バランスファンド 3 0	539,745,474円
D C バランスファンド 5 0	541,243,200円
D C バランスファンド 7 0	94,338,613円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（毎月決算型）	37,411,173円
ベスタ・世界 6 資産ファンド（1年決算型）	21,223,916円
新生・4分散ファンド	48,267,007円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	422,007,687円
外国債券インデックス e	1,698,229,015円
インデックスコレクション（外国債券）	2,494,278,826円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	1,068,189,952円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	244,091,775円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	73,569,595円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	2,901,765,672円
外国債券パッシブファンド私募 A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,766,235,402円
外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,875,842,070円

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,917,283,884
合計	1,917,283,884

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成28年 6月10日現在）

--	--	--	--

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

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成28年 6月10日現在)

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

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,995,624.03	
		T 0.625% 04/30/18	2,850,000.00	2,842,708.01	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 174銘柄	100.0%	42.5%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 18銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 262銘柄	100.0%	40.8%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	8.2%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%

ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	21銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券	17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	19銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Jリートマザーファンド(M)

貸借対照表

	平成28年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	60,524,163
コール・ローン	369,786,956
投資証券	86,480,093,100
未収配当金	533,997,890
流動資産合計	87,444,402,109
資産合計	87,444,402,109
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,817,532
未払利息	928
その他未払費用	10,772
流動負債合計	14,829,232
負債合計	14,829,232
純資産の部	
元本等	
元本	34,340,374,106
剰余金	
剰余金又は欠損金()	53,089,198,771
元本等合計	87,429,572,877
純資産合計	87,429,572,877
負債純資産合計	87,444,402,109

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成28年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年12月11日
期首元本額	40,443,614,087円
期中追加設定元本額	1,685,347,207円
期中一部解約元本額	7,788,587,188円
期末元本額	34,340,374,106円

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,330	1,959,325,000	
	MCUBS MidCity投資法人	3,332	1,237,838,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,983	2,304,398,400	
	産業ファンド投資法人	2,674	1,524,180,000	
	大和ハウスリート投資法人	4,588	2,775,740,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,284	3,523,051,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	2,727	816,463,800	

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

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートマザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

平成28年 6月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	382,705,012口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 1.1401円 (1万口当たり純資産額) (11,401円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成28年 6月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	平成28年 6月10日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成28年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年12月11日
期首元本額	407,762,566円
期中追加設定元本額	450,001円
期中一部解約元本額	25,507,555円
期末元本額	382,705,012円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	259,773,769円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	76,858,490円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	46,072,753円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	50,963,612
合計	50,963,612

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	234	8,005.14	
		AGREE REALTY CORP	86	3,831.30	
		ALEXANDER'S INC	15	5,503.05	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 155銘柄	100.0%	71.3%
カナダドル	投資証券 29銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 33銘柄	100.0%	6.8%
イギリスポンド	投資証券 21銘柄	100.0%	6.1%
オーストラリアドル	投資証券 29銘柄	100.0%	8.5%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 9銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	2.9%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）】

【純資産額計算書】

（平成28年 6月30日現在）

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

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

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

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

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

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

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

外国債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

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

Jリートマザーファンド（M）

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

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

海外リートマザーファンド

純資産額計算書

（平成28年 6月30日現在）

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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28年 6月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成28年 9月 9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	458	7,883,500
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	36	153,379
単位型公社債投資信託	0	0
合計	494	8,036,878

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）の財務諸表について、有限責任 必ず監査法人により監査を受けておりま

す。

(1)【貸借対照表】

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

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

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

長期前払費用償却	1	27,866	1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
特別損失				
外国税関連費用	2	56,222		-
特別損失合計		56,222		-
税引前当期純利益		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

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

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

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

未適用の会計基準等

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

(1) 概要

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

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

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

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

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

(2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

表示方法の変更

(損益計算書関係)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2外国税関連費用

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

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

平成28年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

(*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

(*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

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

(単位:千円)

区分	平成27年3月31日	平成28年3月31日
非上場株式	3	3

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日現在)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成28年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330

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

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) (単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) (単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
20,015	350	365

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位:千円)

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

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位:千円)

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

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

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で14,089千円、当事業年度で14,434千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が15,263千円、その他有価証券評価差額金が27千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が15,236千円増加しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	4,412,908円85銭	5,848,968円06銭
1株当たり当期純利益金額	1,000,232円56銭	1,447,521円33銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常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

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

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成28年 9月 9日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円(平成28年3月末日現在)

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

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (平成28年3月末日現在)	事業の内容
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562	
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社岩手銀行	12,089	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社四国銀行	25,000	
株式会社荘内銀行	8,500	
株式会社千葉興業銀行	62,120	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社北越銀行	24,538	

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

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成28年3月末日現在）

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

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

第3【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12月28日	臨時報告書
平成28年 3月10日	有価証券届出書
平成28年 3月10日	有価証券報告書
平成28年 3月28日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成28年 6月 3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成27年12月11日から平成28年6月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成28年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。