

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

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

### （６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース）で再投資する場合は1口単位です。

（ 7 ）【申込期間】

平成27年 3月11日から平成27年 9月10日までとします。

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

（ 8 ）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< スイッチング >

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

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
一般						
大型株	年2回	(日本を 含む)	ファンド・	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株			オブ・ファ ンズ			
債券	年4回	日本			その他 ( )	ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型
一般	年6回	北米				
公債	(隔月)					
社債						
その他債券	年12回	欧州				その他
クレジット属 性 ( )	(毎月)	アジア				( )
	日々	オセアニア				
不動産投信	その他 ( )					
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))		中南米				
		アフリカ				
		中近東 (中東)				
資産複合 ( )		エマージ ング				
資産配分 固定型						
資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

< 属性区分表定義 >

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

#### < ファンドの特色 >

## 1. 国内外の株式・債券・不動産投資信託証券へ分散投資します。

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

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

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

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

### <投資対象とするマザーファンド>

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

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

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

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

**日本株式マザーファンド「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」**

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

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

**日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」**

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

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

**Jリートマザーファンド(M)「東証REIT指数(配当込み)」**

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

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

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

**外国株式マザーファンド「MSCIコクサイ指数(円ベース)」**

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

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

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

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

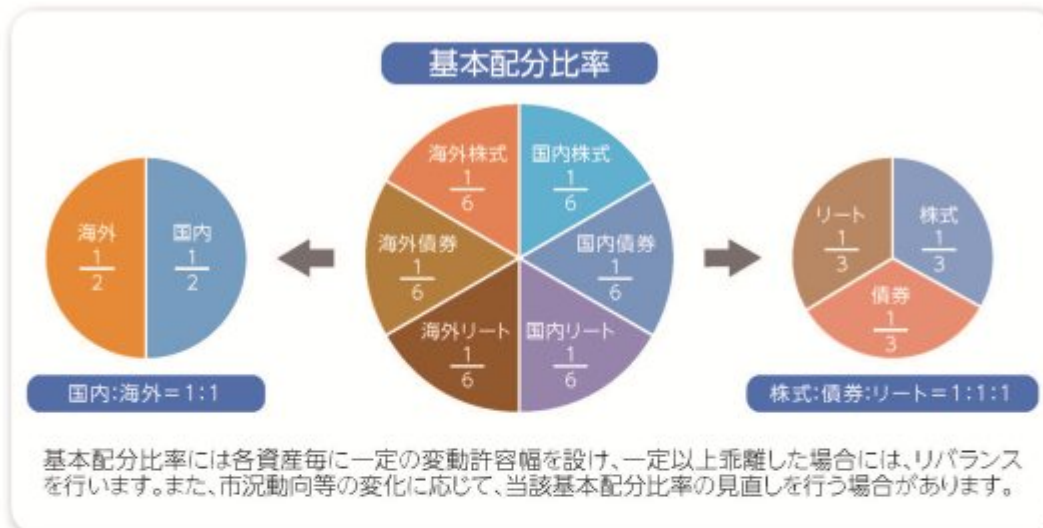
同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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

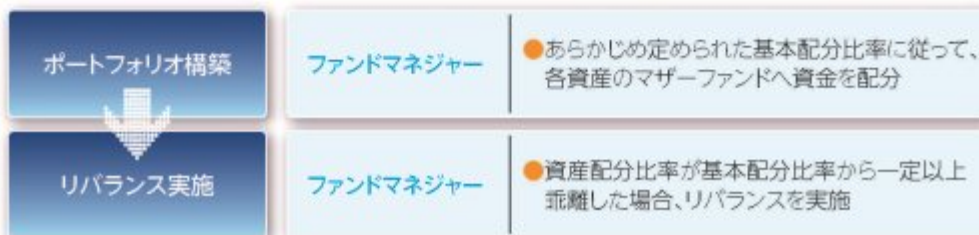
当インデックスはSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、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

## 2. 6つの資産への均等配分を基本配分比率とします。



### ポートフォリオ構築プロセス

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





## 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

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた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。



※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。

## (2) 【ファンドの沿革】

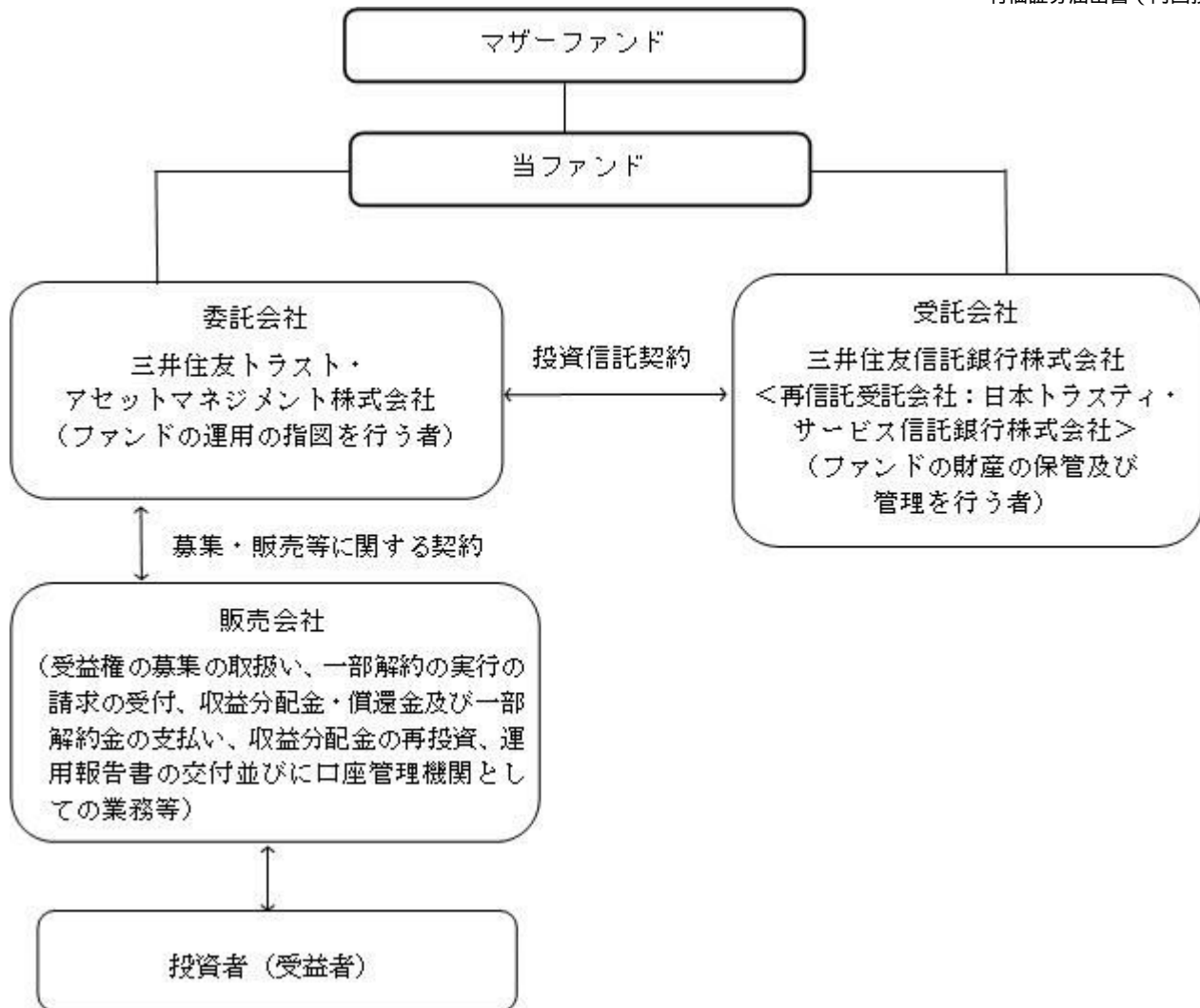
平成19年 8月31日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンド、中央三井Jリートマザーファンドの名称をJリートマザーファンド(M)に変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成26年12月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．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」、「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書で、上記1．から11．までの証券又は証書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書（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



証券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．の証券又は証券のうち上記2．から6．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13．の証券及び上記14．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「日本株式マザーファンド」の概要

#### 1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とそ

の元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「日本債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金

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

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

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

### 「外国債券マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「Jリートマザーファンド（M）」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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

### (2) 投資態度

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

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

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

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

## 3. 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## 「海外リートマザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

1：上場に準ずるものを含みます。

2：一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。

#### (2) 投資態度

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

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

R E I T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、ベンチマークにおける時価の構成割合が10%を超えるR E I T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R E I Tをベンチマークの構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

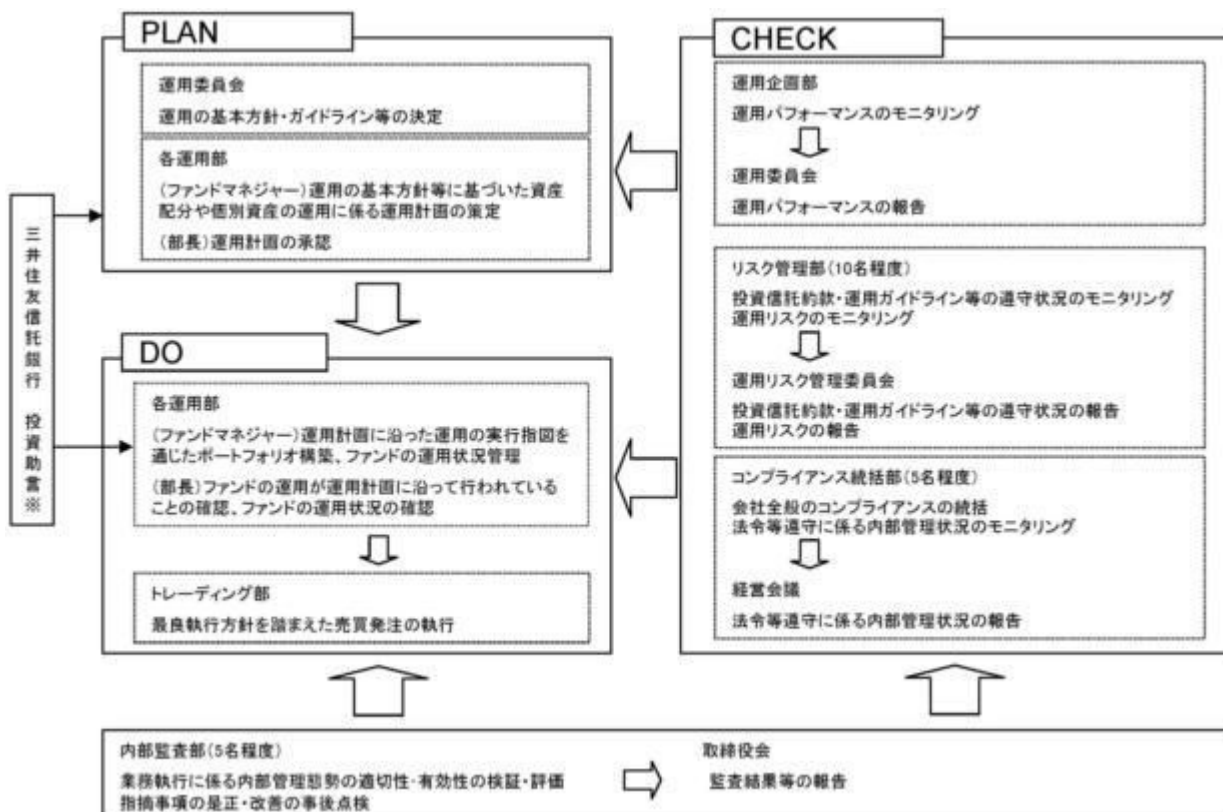
株式への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

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

#### (3) 【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

#### （４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた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。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

##### A．株式への投資割合

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

##### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

##### C．新株引受権証券等への投資割合

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

##### D．同一銘柄の株式への投資割合

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

##### E．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

##### F．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

##### G．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で金融商品取引所が有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場）で金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及



び当該市場を開設するものをいいます。)をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、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るものとします。

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、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、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．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

T．受託会社による資金の立替え

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

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

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

U．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

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

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

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

W．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）につい

て、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### A．デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

##### B．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### （1）ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の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、全て投資者の皆様に帰属します。

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。

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

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

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。

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

#### （２）リスクの管理体制

##### 委託会社におけるリスク管理体制

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

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

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

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

\*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

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

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

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

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

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

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

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している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、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、ファンドの認定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

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

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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、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、ファンドの認定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

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

当ファンドは「分配金再投資コース」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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

## （４）【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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



にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

## 5【運用状況】

以下は、平成26年12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【バスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）】

#### （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	437,405,615	100.13

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		569,117	0.13
合計(純資産総額)		436,836,498	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートマザーファンド	64,577,178	0.9447	61,006,061	1.1960	77,234,304	17.68
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	34,632,406	1.8494	64,049,172	2.1929	75,945,403	17.39
日本	親投資信託受益証券	Jリートマザーファンド(M)	31,261,142	1.9749	61,737,630	2.4250	75,808,269	17.35
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	51,577,097	1.1783	60,773,294	1.3608	70,186,113	16.07
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	27,700,269	2.1763	60,284,096	2.5104	69,538,755	15.92
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	52,934,246	1.2601	66,702,444	1.2977	68,692,771	15.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.13
合計	100.13

(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期計算期間末（平成20年 6月10日）	1,748,361,193	1,748,361,193	8,956	8,956
第2期計算期間末（平成21年 6月10日）	1,231,812,016	1,231,812,016	6,571	6,571
第3期計算期間末（平成22年 6月10日）	1,088,521,423	1,088,521,423	6,741	6,741
第4期計算期間末（平成23年 6月10日）	954,233,557	954,233,557	7,246	7,246
第5期計算期間末（平成24年 6月11日）	700,232,110	700,232,110	6,983	6,983
第6期計算期間末（平成25年 6月10日）	700,503,208	700,503,208	9,619	9,619
第7期計算期間末（平成26年 6月10日）	481,438,047	482,311,991	11,018	11,038
平成25年12月末日	562,290,422		10,766	
平成26年 1月末日	518,809,392		10,504	
2月末日	508,006,878		10,647	
3月末日	486,649,047		10,668	
4月末日	479,822,913		10,744	
5月末日	481,792,906		10,929	
6月末日	472,446,223		11,098	
7月末日	460,982,500		11,241	
8月末日	453,406,985		11,356	
9月末日	447,674,014		11,555	
10月末日	451,850,122		11,731	
11月末日	449,180,606		12,596	
12月末日	436,836,498		12,834	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	平成19年 8月31日～平成20年 6月10日	0
第2期計算期間	平成20年 6月11日～平成21年 6月10日	0
第3期計算期間	平成21年 6月11日～平成22年 6月10日	0
第4期計算期間	平成22年 6月11日～平成23年 6月10日	0
第5期計算期間	平成23年 6月11日～平成24年 6月11日	0
第6期計算期間	平成24年 6月12日～平成25年 6月10日	0
第7期計算期間	平成25年 6月11日～平成26年 6月10日	20

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成19年 8月31日～平成20年 6月10日	10.4
第2期計算期間	平成20年 6月11日～平成21年 6月10日	26.6
第3期計算期間	平成21年 6月11日～平成22年 6月10日	2.6
第4期計算期間	平成22年 6月11日～平成23年 6月10日	7.5

第5期計算期間	平成23年 6月11日～平成24年 6月11日	3.6
第6期計算期間	平成24年 6月12日～平成25年 6月10日	37.7
第7期計算期間	平成25年 6月11日～平成26年 6月10日	14.8
第8期中間計算期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	14.8

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(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期計算期間	平成19年 8月31日～平成20年 6月10日	2,008,670,402	56,611,304	1,952,059,098
第2期計算期間	平成20年 6月11日～平成21年 6月10日	84,070,583	161,421,487	1,874,708,194
第3期計算期間	平成21年 6月11日～平成22年 6月10日	73,705,982	333,646,809	1,614,767,367
第4期計算期間	平成22年 6月11日～平成23年 6月10日	54,091,605	352,017,560	1,316,841,412
第5期計算期間	平成23年 6月11日～平成24年 6月11日	34,182,666	348,188,308	1,002,835,770
第6期計算期間	平成24年 6月12日～平成25年 6月10日	29,020,948	303,600,978	728,255,740
第7期計算期間	平成25年 6月11日～平成26年 6月10日	15,668,706	306,952,201	436,972,245
第8期中間計算期間	平成26年 6月11日～平成26年12月10日	11,339,847	95,241,310	353,070,782

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	245,630,493,000	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,857,494,509	1.15
合計(純資産総額)		248,487,987,509	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

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

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,649,300	6,329.40	10,439,079,420	7,558.00	12,465,409,400	5.02
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,466,700	673.89	6,379,514,463	664.50	6,290,622,150	2.53
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	623,900	8,754.40	5,461,870,160	7,210.00	4,498,319,000	1.81
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	892,300	5,315.81	4,743,297,263	4,375.00	3,903,812,500	1.57
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,075,800	4,108.22	4,419,623,076	3,526.00	3,793,270,800	1.53
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	16,330,600	231.46	3,779,880,676	202.50	3,306,946,500	1.33
日本	株式	KDDI	情報・通信業	399,500	6,381.58	2,549,441,210	7,637.00	3,050,981,500	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	461,700	5,799.11	2,677,449,087	6,211.00	2,867,618,700	1.15
日本	株式	キヤノン	電気機器	693,100	3,239.35	2,245,193,485	3,840.50	2,661,850,550	1.07
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,871,000	856.76	2,459,757,960	900.70	2,585,909,700	1.04
日本	株式	ファナック	電気機器	124,500	17,898.54	2,228,368,230	19,945.00	2,483,152,500	1.00
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	742,400	3,238.92	2,404,574,208	3,328.00	2,470,707,200	0.99
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,426,000	1,263.51	1,801,765,260	1,686.50	2,404,949,000	0.97
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	469,000	4,862.00	2,280,278,000	4,996.50	2,343,358,500	0.94
日本	株式	三菱地所	不動産業	877,000	2,845.46	2,495,468,420	2,555.50	2,241,173,500	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	493,600	4,235.64	2,090,711,904	4,358.50	2,151,355,600	0.87
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,456,900	1,255.30	1,828,846,570	1,427.00	2,078,996,300	0.84
日本	株式	三井不動産	不動産業	626,000	3,589.08	2,246,764,080	3,255.00	2,037,630,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	904,200	2,010.21	1,817,631,882	2,217.00	2,004,611,400	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	219,100	8,073.64	1,768,934,524	9,123.00	1,998,849,300	0.80
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	107,100	12,233.91	1,310,251,761	18,140.00	1,942,794,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	485,600	3,296.91	1,600,979,496	3,933.50	1,910,107,600	0.77
日本	株式	ソニー	電気機器	769,000	1,792.45	1,378,394,050	2,472.50	1,901,352,500	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,678,000	957.16	1,606,114,480	1,057.00	1,773,646,000	0.71
日本	株式	信越化学工業	化学	224,600	5,858.38	1,315,792,148	7,866.00	1,766,703,600	0.71
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	406,800	2,988.24	1,215,616,032	4,300.00	1,749,240,000	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,196,000	1,314.24	1,571,831,040	1,446.00	1,729,416,000	0.70
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	972,100	1,732.74	1,684,396,554	1,768.00	1,718,672,800	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	295,600	5,584.55	1,650,792,980	5,652.00	1,670,731,200	0.67

日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,413,600	791.45	1,910,243,720	690.20	1,665,866,720	0.67
----	----	------------	------------	-----------	--------	---------------	--------	---------------	------

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.44
		建設業	2.69
		食料品	3.93
		繊維製品	0.77
		パルプ・紙	0.22
		化学	5.96
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.91
		ガラス・土石製品	0.93
		鉄鋼	1.58
		非鉄金属	0.96
		金属製品	0.65
		機械	5.21
		電気機器	12.90
		輸送用機器	11.85
		精密機器	1.44
		その他製品	1.36
		電気・ガス業	2.07
		陸運業	3.98
		海運業	0.33
		空運業	0.62
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	6.65
		卸売業	4.13
		小売業	4.11
		銀行業	8.95
証券、商品先物取引業	1.40		
保険業	2.42		
その他金融業	1.23		
不動産業	3.03		
サービス業	2.93		

	小計	98.85
合計		98.85

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

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

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

#### 日本債券マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	286,741,762,750	79.26
	メキシコ	100,828,000	0.03
	小計	286,842,590,750	79.29
地方債証券	日本	21,700,802,782	6.00
特殊債券	日本	30,132,457,410	8.33
	韓国	102,693,000	0.03
	小計	30,235,150,410	8.36
社債券	日本	17,806,254,950	4.92
	オーストラリア	609,523,000	0.17
	アメリカ	308,553,000	0.09
	オランダ	302,579,000	0.08
	スウェーデン	302,215,000	0.08
	フランス	300,942,000	0.08
	ノルウェー	100,919,000	0.03
	韓国	100,343,000	0.03
小計	19,831,328,950	5.48	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,143,628,658	0.87
合計(純資産総額)		361,753,501,550	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

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

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	5,910,000,000	100.26	5,925,889,800	100.59	5,945,164,500	0.200	2017/9/20	1.64
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,930,000,000	99.87	3,924,891,000	103.15	4,053,991,500	0.600	2023/12/20	1.12
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,975,000,000	100.32	3,987,808,900	101.88	4,049,928,750	0.500	2024/9/20	1.12
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,710,000,000	100.05	3,711,855,000	100.81	3,740,051,000	0.200	2018/12/20	1.03
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	3,630,000,000	100.66	3,654,010,600	102.94	3,736,939,800	0.600	2024/6/20	1.03
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,660,000,000	100.08	3,662,928,000	100.84	3,690,744,000	0.200	2019/3/20	1.02
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	3,580,000,000	99.89	3,576,062,000	103.05	3,689,333,200	0.600	2024/3/20	1.02
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,522,000,000	100.21	3,529,433,100	100.55	3,541,441,440	0.200	2017/6/20	0.98
日本	国債証券	第121回利付国債(5年)	3,400,000,000	99.95	3,398,464,000	100.37	3,412,750,000	0.100	2019/9/20	0.94
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	3,105,000,000	99.87	3,100,963,500	103.31	3,207,775,500	0.600	2023/3/20	0.89
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	3,080,000,000	104.97	3,233,076,000	103.83	3,197,994,800	1.700	2017/3/20	0.88
日本	国債証券	第345回利付国債(2年)	3,190,000,000	100.16	3,195,344,000	100.23	3,197,624,100	0.100	2016/10/15	0.88
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,827,000,000	105.78	2,990,680,800	106.95	3,023,561,310	1.200	2020/12/20	0.84
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,735,000,000	102.04	2,790,794,000	104.95	2,870,382,500	0.800	2022/9/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,735,000,000	101.50	2,776,025,000	104.94	2,870,191,050	0.800	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,830,000,000	100.56	2,845,848,000	100.73	2,850,857,100	0.300	2017/3/20	0.79
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	2,640,000,000	100.50	2,653,200,000	101.07	2,668,248,000	0.300	2018/6/20	0.74
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,510,000,000	101.36	2,544,136,000	104.95	2,634,320,300	0.800	2023/9/20	0.73



日本	国債証券	第102回利付国債（5年）	2,535,000,000	100.52	2,548,237,000	100.65	2,551,578,900	0.300	2016/12/20	0.71
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	2,400,000,000	104.60	2,510,400,000	103.39	2,481,384,000	1.700	2016/12/20	0.69
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,300,000,000	106.00	2,438,156,000	106.30	2,445,061,000	1.300	2019/12/20	0.68
日本	国債証券	第119回利付国債（5年）	2,380,000,000	99.73	2,373,574,000	100.40	2,389,520,000	0.100	2019/6/20	0.66
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	2,100,000,000	102.03	2,142,696,400	108.31	2,274,678,000	1.500	2034/6/20	0.63
日本	国債証券	第97回利付国債（5年）	2,260,000,000	100.73	2,276,498,000	100.63	2,274,260,600	0.400	2016/6/20	0.63
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	106.04	2,279,946,000	105.59	2,270,292,500	1.500	2018/9/20	0.63
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	2,060,000,000	102.29	2,107,196,000	106.23	2,188,420,400	1.400	2034/9/20	0.60
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	2,070,000,000	104.62	2,165,774,000	105.55	2,184,947,100	1.000	2020/9/20	0.60
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	105.21	2,156,805,000	104.49	2,142,065,500	1.500	2017/12/20	0.59
日本	国債証券	第343回利付国債（2年）	2,050,000,000	100.05	2,051,107,000	100.21	2,054,428,000	0.100	2016/8/15	0.57
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	1,890,000,000	103.71	1,960,119,000	106.31	2,009,429,100	1.000	2022/3/20	0.56

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

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

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

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

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

## 外国株式マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	138,968,942,330	56.07
	イギリス	19,260,786,465	7.77
	カナダ	9,964,588,932	4.02
	スイス	9,465,771,891	3.82
	ドイツ	8,763,131,931	3.54
	フランス	8,608,750,535	3.47
	オーストラリア	6,455,336,130	2.60
	オランダ	3,510,595,544	1.42
	スペイン	3,379,196,735	1.36
	アイルランド	3,095,981,792	1.25
	スウェーデン	2,906,803,498	1.17
	香港	2,505,545,134	1.01
	イタリア	1,968,291,926	0.79
	シンガポール	1,500,457,370	0.61
	デンマーク	1,451,422,893	0.59
	ベルギー	1,265,328,242	0.51
	ジャージー	1,248,357,159	0.50
	バミューダ	877,075,993	0.35
	フィンランド	870,396,215	0.35
	キュラソー	856,703,198	0.35
	ノルウェー	564,379,930	0.23
	イスラエル	543,031,176	0.22
	ルクセンブルク	389,996,545	0.16
	オーストリア	212,095,309	0.09
	ケイマン	205,616,851	0.08
	ニュージーランド	166,813,153	0.07
	ポルトガル	143,826,198	0.06
パナマ	129,109,363	0.05	
リベリア	114,682,904	0.05	
英ヴァージン諸島	114,653,476	0.05	

	ガーンジー	59,723,295	0.02
	マン島	40,983,227	0.02
	モーリシャス	19,964,038	0.01
	小計	229,628,339,378	92.64
投資信託受益証券	オーストラリア	126,894,462	0.05
	香港	33,166,400	0.01
	シンガポール	24,690,448	0.01
	小計	184,751,310	0.07
投資証券	アメリカ	3,938,577,170	1.59
	オーストラリア	551,296,815	0.22
	イギリス	325,753,341	0.13
	フランス	299,748,834	0.12
	香港	119,083,020	0.05
	シンガポール	94,879,584	0.04
	カナダ	32,504,082	0.01
	オランダ	28,731,541	0.01
	小計	5,390,574,387	2.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,657,833,577	5.11
合計(純資産総額)		247,861,498,652	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

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

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

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

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

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	378,834	8,825.46	3,343,386,397	13,731.85	5,202,091,852	2.10
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	269,905	10,825.39	2,921,826,888	11,219.58	3,028,223,034	1.22
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	495,211	4,361.49	2,159,862,281	5,720.09	2,832,655,203	1.14
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	178,351	10,698.81	1,908,143,909	12,697.53	2,264,617,441	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	313,424	5,398.22	1,691,934,526	6,715.84	2,104,905,593	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	634,480	3,007.72	1,908,339,772	3,098.13	1,965,704,695	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	171,235	9,270.29	1,587,398,965	11,167.75	1,912,310,014	0.77
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	203,745	8,099.69	1,650,273,376	8,921.84	1,817,782,328	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	237,643	6,808.66	1,618,031,339	7,589.82	1,803,669,495	0.73
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	145,098	8,696.52	1,261,847,659	11,321.30	1,642,699,438	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	120,007	13,413.59	1,609,725,715	13,660.72	1,639,382,745	0.66
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	400,891	3,717.76	1,490,417,325	3,784.06	1,516,997,401	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	262,409	5,717.68	1,500,372,396	5,732.15	1,504,168,405	0.61

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	44,292	30,303.83	1,342,217,681	32,886.00	1,456,586,712	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	663,543	2,011.97	1,335,034,914	2,183.16	1,448,620,868	0.58
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,210,854	1,174.54	1,422,206,628	1,159.39	1,403,862,879	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	313,197	2,891.99	905,764,002	4,482.04	1,403,764,301	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	328,206	3,857.60	1,266,087,466	4,111.96	1,349,570,108	0.54
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	72,495	13,279.78	962,718,231	18,329.62	1,328,806,346	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	249,545	4,584.51	1,144,043,170	5,166.77	1,289,342,368	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	182,073	6,481.97	1,180,192,361	6,959.35	1,267,110,006	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	191,773	5,816.53	1,115,454,846	6,597.70	1,265,261,010	0.51
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	225,291	4,429.00	997,815,416	5,498.28	1,238,714,239	0.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	124,805	7,563.30	943,938,530	9,646.41	1,203,920,325	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	102,644	9,108.75	934,959,356	11,512.52	1,181,691,616	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,925	70,023.87	1,255,178,022	64,772.72	1,161,051,015	0.47
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	59,935	21,056.46	1,262,019,440	19,349.48	1,159,711,114	0.47
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	18,082	69,808.09	1,262,269,956	63,931.28	1,156,005,432	0.47
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	95,611	9,222.07	881,731,813	11,729.51	1,121,470,659	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	95,029	9,570.46	909,471,671	11,660.80	1,108,114,306	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.15
		素材	4.76
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	0.83
		運輸	2.03
		自動車・自動車部品	1.59
		耐久消費財・アパレル	1.58
		消費者サービス	1.57

	メディア	2.98
	小売	3.17
	食品・生活必需品小売り	2.12
	食品・飲料・タバコ	5.83
	家庭用品・パーソナル用品	1.74
	ヘルスケア機器・サービス	3.26
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.28
	銀行	9.13
	各種金融	3.89
	保険	4.08
	不動産	0.65
	ソフトウェア・サービス	6.80
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.36
	電気通信サービス	2.99
	公益事業	3.33
	半導体・半導体製造装置	1.75
	小計	92.64
投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.17
合計		94.89

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,075,000.00	714,433,972	732,159,000	0.29
	ユーロ	買建	1,120,000.00	164,505,376	164,113,600	0.06
	イギリスポンド	買建	600,000.00	111,125,820	112,182,000	0.04
	アメリカドル	売建	5,067,000.00	610,667,239	610,776,180	0.24
	カナダドル	売建	361,000.00	37,396,170	37,399,600	0.01
	ユーロ	売建	910,000.00	133,326,830	133,342,300	0.05
	イギリスポンド	売建	538,000.00	100,595,024	100,606,000	0.04
	スイスフラン	売建	300,000.00	36,540,660	36,540,000	0.01
	スウェーデンクローナ	売建	782,000.00	12,047,648	12,050,620	0.00
	オーストラリアドル	売建	321,000.00	31,461,980	31,461,210	0.01
	香港ドル	売建	1,081,000.00	16,794,091	16,787,930	0.00

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

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

## 外国債券マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	102,832,337,589	38.48
	イタリア	26,066,908,281	9.75
	フランス	26,014,347,991	9.73
	イギリス	21,757,094,704	8.14
	ドイツ	21,678,209,845	8.11
	スペイン	14,137,796,143	5.29
	ベルギー	7,004,373,148	2.62
	オランダ	6,954,501,106	2.60
	カナダ	6,017,613,447	2.25
	オーストリア	4,335,228,736	1.62
	オーストラリア	4,286,137,924	1.60
	メキシコ	2,761,305,599	1.03
	アイルランド	2,180,060,927	0.82
	デンマーク	1,938,232,961	0.73
	フィンランド	1,708,905,518	0.64

	ポーランド	1,622,015,784	0.61
	南アフリカ	1,360,505,146	0.51
	マレーシア	1,282,525,329	0.48
	スウェーデン	1,266,235,835	0.47
	シンガポール	994,468,303	0.37
	スイス	871,594,167	0.33
	ノルウェー	708,671,667	0.27
	小計	257,779,070,150	96.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,482,916,747	3.55
合計(純資産総額)		267,261,986,897	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

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

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

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

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

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/16	15,000,000	12,057.35	1,808,603,170	12,054.52	1,808,179,370	0.375	2016/3/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	13,000,000	12,468.91	1,620,959,568	12,546.85	1,631,090,942	2.625	2020/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/29/16	12,850,000	12,618.19	1,621,437,996	12,370.26	1,589,579,239	2.625	2016/2/29	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	9,800,000	13,282.19	1,301,655,502	13,183.03	1,291,937,647	3.625	2020/2/15	0.48



アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	9,000,000	12,156.26	1,094,063,580	12,644.09	1,137,968,458	2.750	2024/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 03/31/16	9,150,000	12,536.72	1,147,110,716	12,334.94	1,128,647,848	2.250	2016/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/16	9,050,000	12,087.02	1,093,875,408	12,065.59	1,091,936,370	0.625	2016/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 10/15/16	9,000,000	12,069.59	1,086,263,809	12,051.70	1,084,653,331	0.625	2016/10/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	9,000,000	12,050.99	1,084,589,764	12,040.87	1,083,678,580	0.625	2016/12/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 07/31/16	8,500,000	12,351.43	1,049,871,595	12,233.70	1,039,865,008	1.500	2016/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	7,900,000	13,180.93	1,041,294,023	13,115.69	1,036,140,198	3.500	2020/5/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 5.75% 10/25/32	4,250,000	20,634.29	876,957,640	24,367.33	1,035,611,552	5.750	2032/10/25	0.39
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	4,550,000	19,618.77	892,654,272	22,719.26	1,033,726,718	5.500	2029/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	8,550,000	12,063.07	1,031,393,070	12,035.92	1,029,071,897	1.500	2019/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.375% 09/30/18	8,520,000	12,033.10	1,025,220,390	12,023.68	1,024,417,979	1.375	2018/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/15/16	8,500,000	12,061.12	1,025,195,340	12,046.52	1,023,954,531	0.625	2016/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	5,950,000	16,559.02	985,261,690	17,188.92	1,022,740,870	3.500	2020/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 04/25/16	6,600,000	15,615.30	1,030,609,958	15,290.13	1,009,148,589	3.250	2016/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	7,950,000	12,134.39	964,684,029	12,647.39	1,005,467,527	2.750	2023/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/44	7,700,000	11,880.75	914,818,509	12,919.80	994,824,982	3.125	2044/8/15	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000	15,984.87	951,100,139	16,623.27	989,085,029	4.250	2019/2/1	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.375% 03/31/16	7,900,000	12,569.92	993,024,264	12,352.84	975,874,616	2.375	2016/3/31	0.37
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	5,550,000	16,300.15	904,658,718	17,469.10	969,535,420	3.250	2021/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	5,000,000	17,369.38	868,469,310	19,188.82	959,441,342	4.250	2023/10/25	0.36
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 03/07/19	4,500,000	21,181.05	953,147,429	21,309.54	958,929,462	4.500	2019/3/7	0.36
イタリア	国債証券	BTPS 6% 05/01/31	4,450,000	17,846.88	794,186,425	21,108.64	939,334,808	6.000	2031/5/1	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	7,950,000	11,160.51	887,261,261	11,698.29	930,014,411	1.750	2023/5/15	0.35
イタリア	国債証券	BTPS 5% 03/01/25	4,950,000	16,145.77	799,215,971	18,642.37	922,797,769	5.000	2025/3/1	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 10/25/19	5,350,000	16,729.00	895,001,842	17,180.56	919,160,463	3.750	2019/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	6,500,000	12,273.39	797,770,485	14,136.37	918,864,120	3.625	2044/2/15	0.34

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.45
合計	96.45

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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

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

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

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

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

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

## Jリートマザーファンド(M)

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	101,289,064,000	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		971,019,765	0.95
合計(純資産総額)		102,260,083,765	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	14,882	567,216.53	8,441,316,399	604,000	8,988,728,000	8.79
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	13,475	572,926.68	7,720,187,013	580,000	7,815,500,000	7.64
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	23,317	223,914.37	5,221,011,365	254,000	5,922,518,000	5.79
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,449	168,245.31	4,281,674,894	188,900	4,807,316,100	4.70
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	14,846	252,900.97	3,754,567,800	321,000	4,765,566,000	4.66
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,920	240,738.09	4,073,288,482	260,600	4,409,352,000	4.31
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	15,334	186,513.42	2,859,996,782	241,000	3,695,494,000	3.61
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,229	142,475.08	3,024,603,473	168,800	3,583,455,200	3.50
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	3,225	949,226.61	3,061,255,817	1,046,000	3,373,350,000	3.30
日本	投資証券	GLP投資法人	23,174	114,736.86	2,658,911,993	133,600	3,096,046,400	3.03
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	19,640	130,958.14	2,572,017,869	155,600	3,055,984,000	2.99
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	17,479	153,963.33	2,691,125,045	172,400	3,013,379,600	2.95
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	4,451	561,179.55	2,497,810,177	673,000	2,995,523,000	2.93
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	5,157	561,639.19	2,896,373,302	550,000	2,836,350,000	2.77
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,708	363,757.83	2,440,087,523	418,000	2,803,944,000	2.74
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,201	60,642.13	2,134,663,618	77,000	2,710,477,000	2.65
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	9,846	240,311.6	2,366,108,013	269,500	2,653,497,000	2.59
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,668	391,982.7	1,829,775,243	474,500	2,214,966,000	2.17
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,720	449,477.37	1,672,055,835	555,000	2,064,600,000	2.02
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,744	142,163.39	1,669,566,852	170,400	2,001,177,600	1.96
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,287	453,330.23	1,490,096,466	600,000	1,972,200,000	1.93
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	3,262	482,851.21	1,575,060,647	580,000	1,891,960,000	1.85
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	11,724	139,409.21	1,634,433,578	160,500	1,881,702,000	1.84
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,648	174,345.16	1,682,082,103	182,100	1,756,900,800	1.72
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	2,718	496,859.17	1,350,463,244	595,000	1,617,210,000	1.58
日本	投資証券	プレミアム投資法人	2,681	465,666.92	1,248,453,012	590,000	1,581,790,000	1.55
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,115	574,323.85	1,214,694,942	677,000	1,431,855,000	1.40
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	3,502	253,108.02	886,384,286	360,500	1,262,471,000	1.23
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,126	142,806.55	1,017,639,475	163,600	1,165,813,600	1.14
日本	投資証券	積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	8,499	105,733.91	898,632,501	136,200	1,157,563,800	1.13

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.05
合計	99.05

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 海外リートマザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	476,271,545	69.04
	オーストラリア	55,591,530	8.06
	イギリス	42,611,146	6.18
	フランス	29,280,604	4.24
	シンガポール	22,668,942	3.29
	カナダ	15,153,492	2.20
	香港	12,039,304	1.75
	オランダ	6,989,687	1.01
	ベルギー	3,352,057	0.49
	ニュージーランド	2,119,432	0.31
	スペイン	1,657,704	0.24
	アイルランド	1,383,430	0.20
	ドイツ	915,207	0.13
	イタリア	506,901	0.07
	ガーンジー	481,602	0.07
	マン島	476,440	0.07
	イスラエル	243,170	0.04
	小計	671,742,193	97.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,140,949	2.63
合計(純資産総額)		689,883,142	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	1,737	20,787.64	36,108,134	22,483.78	39,054,327	5.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	808	21,123.97	17,068,173	22,826.14	18,443,523	2.67
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	2,019	8,094.93	16,343,669	8,889.35	17,947,612	2.60
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	547	30,304.47	16,576,546	31,550.06	17,257,884	2.50
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	1,806	8,103.37	14,634,688	9,236.54	16,681,193	2.42
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	729	18,785.30	13,694,488	20,184.89	14,714,786	2.13
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	2,786	4,984.74	13,887,493	5,245.13	14,612,934	2.12
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1,641	7,805.61	12,809,011	8,770.01	14,391,591	2.09
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	971	12,883.17	12,509,566	14,357.50	13,941,137	2.02
アメリカ	投資証券	HCP INC	2,557	5,204.14	13,306,995	5,374.11	13,741,622	1.99
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	852	14,634.76	12,468,824	15,761.91	13,429,149	1.95
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	4,201	2,723.22	11,440,266	2,910.07	12,225,233	1.77
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	3,478	2,992.05	10,406,353	3,454.96	12,016,361	1.74
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	29,623	347.16	10,284,152	356.97	10,574,665	1.53
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	10,669	753.17	8,035,652	919.89	9,814,377	1.42
香港	投資証券	LINK REIT	13,000	728.82	9,474,738	753.69	9,797,970	1.42
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,334	1,993.73	8,640,868	2,163.93	9,378,503	1.36
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	352	23,436.12	8,249,516	25,496.32	8,974,706	1.30
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	5,685	1,344.74	7,644,879	1,461.63	8,309,419	1.20
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	782	7,970.76	6,233,139	10,126.19	7,918,688	1.15
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	529	13,167.67	6,965,700	14,655.26	7,752,634	1.12
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	1,227	5,380.14	6,601,440	5,975.66	7,332,139	1.06
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	2,283	2,805.19	6,404,268	3,122.24	7,128,085	1.03
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	376	15,096.47	5,676,275	16,537.04	6,217,930	0.90
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	753	8,121.45	6,115,455	8,100.96	6,100,023	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	1,398	3,635.78	5,082,832	3,806.96	5,322,143	0.77
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	12,755	408.95	5,216,182	412.87	5,266,217	0.76
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	5,044	1,584.02	7,989,833	1,022.26	5,156,300	0.75
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	8,507	538.40	4,580,205	591.36	5,030,717	0.73
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	4,357	1,122.17	4,889,338	1,139.01	4,962,678	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

投資証券	97.37
合計	97.37

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

#### 投資不動産物件


該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

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

**基準価額・純資産の推移**


基準価額	12,834円
純資産総額	4.37億円

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

**分配の推移（1万口当たり、税引前）**

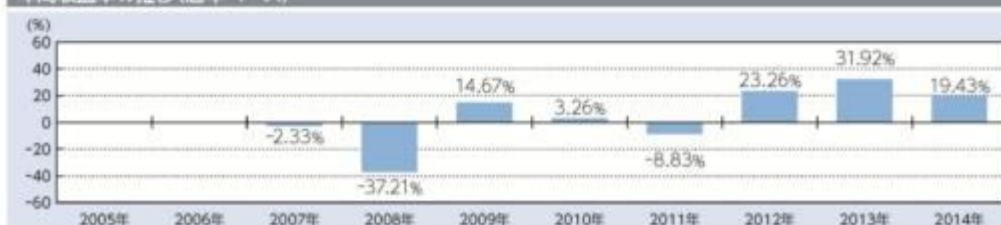
設定来分配金合計額：20円

決算期	2010年6月	2011年6月	2012年6月	2013年6月	2014年6月
分配金	0円	0円	0円	0円	20円

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

**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
海外リート	17.7%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
マザーファンド		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.5%
外国株式	17.4%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	0.4%
マザーファンド		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.2%
リートマザー	17.4%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.5%
ファンド(M)		ジャパニアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.3%
日本株式	16.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.8%
マザーファンド		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
外国債券	15.9%	T 0.375% 03/15/16	アメリカ	国債証券	-	0.375%	2016/03/15	0.1%
マザーファンド		T 2.625% 11/15/20	アメリカ	国債証券	-	2.625%	2020/11/15	0.1%
日本債券	15.7%	第106回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.200%	2017/09/20	0.3%
マザーファンド		第335回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	0.500%	2024/09/20	0.2%

**年間収益率の推移（暦年ベース）**


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

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 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（受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。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。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了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 >

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

#### < その他 >

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

#### < スイッチング >

当ファンドはベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）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、委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部

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

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、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。

#### 八．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、毎年6月11日から翌年6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20年6月10日までとします。

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意の

うえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

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

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

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

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

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

## < 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

### (1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(平成25年 6月11日から平成26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（1年決算型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （平成25年 6月10日現在）	第7期 （平成26年 6月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,798,376	1,207,778
親投資信託受益証券	694,632,872	479,680,898
未収入金	6,068,055	3,970,750
未収利息	7	1
流動資産合計	705,499,310	484,859,427
資産合計	705,499,310	484,859,427
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	-	873,944
未払解約金	1,375,660	-
未払受託者報酬	153,256	107,830
未払委託者報酬	3,448,090	2,426,185
その他未払費用	19,096	13,421
流動負債合計	4,996,102	3,421,380
負債合計	4,996,102	3,421,380
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	728,255,740	436,972,245
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,752,532	44,465,802
（分配準備積立金）	71,254,390	64,110,700
元本等合計	700,503,208	481,438,047
純資産合計	700,503,208	481,438,047
負債純資産合計	705,499,310	484,859,427



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	平成24年 6月12日 至 平成25年 6月10日	自	平成25年 6月11日 至 平成26年 6月10日
営業収益				
受取利息		1,882		1,467
有価証券売買等損益		236,141,126		88,754,949
営業収益合計		236,143,008		88,756,416
営業費用				
受託者報酬		299,632		249,076
委託者報酬		6,741,409		5,604,197
その他費用		37,324		31,014
営業費用合計		7,078,365		5,884,287
営業利益又は営業損失（ ）		229,064,643		82,872,129
経常利益又は経常損失（ ）		229,064,643		82,872,129
当期純利益又は当期純損失（ ）		229,064,643		82,872,129
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（ ）		41,214,893		21,648,334
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		302,603,660		27,752,532
剰余金増加額又は欠損金減少額		91,189,017		11,868,483
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		91,189,017		11,558,921
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		309,562
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,187,639		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,187,639		-
分配金		-		873,944
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,752,532		44,465,802

## (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6期 (平成25年 6月10日現在)	第7期 (平成26年 6月10日現在)
1. 期首元本額	1,002,835,770円	728,255,740円
期中追加設定元本額	29,020,948円	15,668,706円
期中一部解約元本額	303,600,978円	306,952,201円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	728,255,740口	436,972,245口
3. 「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 27,752,532円	
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9619円 (9,619円)	1.1018円 (11,018円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第6期 自 平成24年 6月12日 至 平成25年 6月10日	第7期 自 平成25年 6月11日 至 平成26年 6月10日
費用控除後の配当等収益額	A	16,692,267円 (17,319,856円)	10,669,950円 (11,694,341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	12,705,834円
収益調整金額	C	7,091,012円	5,418,644円
分配準備積立金額	D	54,562,123円	41,608,860円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	78,345,402円	70,403,288円
当ファンドの期末残存口数	F	728,255,740口	436,972,245口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,075.79円	1,611.16円
1万口当たり分配金額	H	- 円	20円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円	873,944円

(注)( )内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)親投資信託受益証券 「(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。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第6期 (平成25年 6月10日現在)	第7期 (平成26年 6月10日現在)
	計算期間(自 平成24年6月12日 至 平成25年 6月10日)の損益に 含まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成25年 6月11日 至 平成26年 6月10日)の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	173,387,642	65,248,179

合計	173,387,642	65,248,179
----	-------------	------------

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	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	66,379,594	78,088,954	
	日本債券マザーファンド	59,131,580	74,505,790	
	外国株式マザーファンド	45,198,824	83,495,787	
	外国債券マザーファンド	35,896,985	78,011,327	
	Jリートマザーファンド(M)	41,670,513	82,115,912	
	海外リートマザーファンド	88,479,941	83,463,128	
親投資信託受益証券 小計		336,757,437	479,680,898	
合計		336,757,437	479,680,898	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 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。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等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。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

## (参考)

「ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)」は、「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファン

ド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド(M)」、「海外リートマザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成26年6月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 日本株式マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成26年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,816,765,469
株式	243,241,754,160
派生商品評価勘定	99,866,760
未収入金	1,583,191,750
未収配当金	2,040,287,115
未収利息	2,496
流動資産合計	248,781,867,750
資産合計	248,781,867,750
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,512,000
前受金	85,531,000
未払金	22,320,258
未払解約金	829,205,514
流動負債合計	946,568,772
負債合計	946,568,772
純資産の部	
元本等	
元本	210,678,487,456
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,156,811,522
元本等合計	247,835,298,978
純資産合計	247,835,298,978
負債純資産合計	248,781,867,750

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
--	---------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	283,920,465,158円
計算期間中の追加設定元本額	18,559,412,197円
計算期間中の一部解約元本額	91,801,389,899円
計算日の元本額	210,678,487,456円
<p>計算日の元本額の内訳</p> <p>日本株式インデックスファンド</p> <p>DC日本株式インデックスファンド</p> <p>DC日本株式インデックスファンドL</p> <p>DC日本株式インデックスファンドA</p> <p>DCバランスファンド30</p> <p>DCバランスファンド50</p> <p>DCバランスファンド70</p> <p>ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)</p> <p>ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)</p> <p>新生・4分散ファンド</p> <p>グローバル・インデックス・バランス・ファンド</p> <p>4資産インデックスバランスオープン(分配型)</p> <p>4資産インデックスバランスオープン(成長型)</p> <p>日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)</p> <p>日本株式インデックスe</p> <p>インデックスコレクション(国内株式)</p> <p>インデックスコレクション(バランス株式30)</p> <p>インデックスコレクション(バランス株式50)</p> <p>インデックスコレクション(バランス株式70)</p> <p>私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)</p>	<p>1,514,384,785円</p> <p>357,294,557円</p> <p>49,261,466,831円</p> <p>1,436,566,827円</p> <p>913,309,818円</p> <p>1,415,064,273円</p> <p>866,011,639円</p> <p>129,565,842円</p> <p>66,379,594円</p> <p>125,145,098円</p> <p>698,155,065円</p> <p>24,535,447円</p> <p>92,822,627円</p> <p>23,474,511円</p> <p>1,721,844,375円</p> <p>4,862,008,557円</p> <p>755,969,972円</p> <p>1,042,771,732円</p> <p>985,962,430円</p> <p>9,853,372,584円</p>

日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	10,344,068,508円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	2,175,970,198円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	19,208,931,106円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	10,790,350,136円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	2,576,014,644円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	729,850,088円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	3,778,834,748円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	4,405,688,355円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,692,256,245円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	28,259,973,231円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,035,529,184円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	11,876,512,613円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	4,059,764,969円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	129,344,312円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,869,098,541円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,152,691,903円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	6,020,993,083円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	225,859,976円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	190,040,582円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	318,910,196円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	2,356,111,045円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,155,981,015円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	70,653,227円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,082,885,492円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	16,060,685,231円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	367,960,573円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	122,322,376円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	39,423,950円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	423,161,202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)	10,399,418円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,114,745円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 株式 4,114,200,000円
3. 計算日における受益権総数	210,678,487,456口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1764円 (11,764円)

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

株式 4,114,200,000円

なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式 「(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。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 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。



4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。
--------------------	------------------------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26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	13,486,654,108	
合計	13,486,654,108	

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成26年1月23日から平成26年6月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成26年 6月10日現在			
		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	4,283,740,240	-	4,374,095,000	90,354,760
	合計	4,283,740,240	-	4,374,095,000	90,354,760

(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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

附属明細表

(平成26年6月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	61,000	259.00	15,799,000	
日本水産	191,000	321.00	61,311,000	
マルハニチロ	29,900	1,602.00	47,899,800	
サカタのタネ	22,900	1,362.00	31,189,800	
ホクト	17,200	1,941.00	33,385,200	
住石ホールディングス	43,100	120.00	5,172,000	
日鉄鉱業	40,000	412.00	16,480,000	
三井松島産業	102,000	133.00	13,566,000	

国際石油開発帝石	755,700	1,508.00	1,139,595,600	
日本海洋掘削	3,900	4,670.00	18,213,000	
石油資源開発	22,200	4,200.00	93,240,000	
K & O エナジーグループ	7,600	1,396.00	10,609,600	
ショーボンドホールディングス	13,800	4,530.00	62,514,000	
ミライト・ホールディングス	44,200	974.00	43,050,800	
タマホーム	10,400	734.00	7,633,600	
サンヨーホームズ	2,900	750.00	2,175,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,605.00	2,247,000	
安藤・間	103,700	505.00	52,368,500	
東急建設	64,200	438.00	28,119,600	
コムシスホールディングス	75,500	1,861.00	140,505,500	
ミサワホーム	18,800	1,265.00	23,782,000	
高松コンストラクショングループ	11,800	1,645.00	19,411,000	
東建コーポレーション	5,800	4,660.00	27,028,000	
ヤマウラ	11,500	305.00	3,507,500	
大成建設	786,000	536.00	421,296,000	
大林組	466,000	695.00	323,870,000	
清水建設	475,000	680.00	323,000,000	
長谷工コーポレーション	207,300	783.00	162,315,900	
松井建設	21,000	396.00	8,316,000	
鹿島建設	683,000	430.00	293,690,000	
不動テトラ	109,700	190.00	20,843,000	
鉄建建設	94,000	303.00	28,482,000	
日鉄住金テックスエンジ	29,000	496.00	14,384,000	
西松建設	209,000	415.00	86,735,000	
三井住友建設	417,700	105.00	43,858,500	
前田建設工業	97,000	764.00	74,108,000	
佐田建設	53,000	113.00	5,989,000	
ナカノフドー建設	25,900	289.00	7,485,100	
奥村組	138,000	458.00	63,204,000	
大和小田急建設	8,400	336.00	2,822,400	
東鉄工業	18,700	2,223.00	41,570,100	
イチケン	32,000	168.00	5,376,000	
戸田建設	181,000	339.00	61,359,000	
熊谷組	168,000	247.00	41,496,000	
青木あすなろ建設	9,500	595.00	5,652,500	
北野建設	33,000	250.00	8,250,000	
植木組	37,000	210.00	7,770,000	
三井ホーム	20,000	466.00	9,320,000	
矢作建設工業	23,300	829.00	19,315,700	
ピーエス三菱	12,300	494.00	6,076,200	
東日本ハウス	21,000	509.00	10,689,000	
大東建託	59,000	11,210.00	661,390,000	
新日本建設	26,600	311.00	8,272,600	
N I P P O	36,000	1,644.00	59,184,000	
東亜道路工業	32,000	431.00	13,792,000	
前田道路	49,000	1,681.00	82,369,000	
日本道路	42,000	550.00	23,100,000	

東亜建設工業	144,000	179.00	25,776,000	
若築建設	84,000	136.00	11,424,000	
東洋建設	51,400	361.00	18,555,400	
五洋建設	186,100	325.00	60,482,500	
大林道路	20,000	536.00	10,720,000	
福田組	33,000	531.00	17,523,000	
住友林業	107,000	1,147.00	122,729,000	
日本基礎技術	17,400	343.00	5,968,200	
日成ビルド工業	54,000	282.00	15,228,000	
巴コーポレーション	19,300	418.00	8,067,400	
パナホーム	58,000	768.00	44,544,000	
大和ハウス工業	427,000	1,986.00	848,022,000	
ライト工業	32,600	717.00	23,374,200	
積水ハウス	414,200	1,332.00	551,714,400	
日特建設	20,100	359.00	7,215,900	
北陸電気工事	7,000	483.00	3,381,000	
ユアテック	24,000	607.00	14,568,000	
西部電気工業	13,000	465.00	6,045,000	
四電工	13,000	388.00	5,044,000	
中電工	22,500	1,506.00	33,885,000	
関電工	71,000	588.00	41,748,000	
きんでん	103,000	952.00	98,056,000	
東京エネシス	16,000	530.00	8,480,000	
トーエネック	23,000	551.00	12,673,000	
住友電設	10,900	1,129.00	12,306,100	
日本電設工業	25,400	1,522.00	38,658,800	
協和エクシオ	60,900	1,411.00	85,929,900	
新日本空調	13,200	627.00	8,276,400	
NDS	24,000	287.00	6,888,000	
九電工	29,000	995.00	28,855,000	
三機工業	33,000	664.00	21,912,000	
日揮	156,000	3,114.00	485,784,000	
中外炉工業	41,000	207.00	8,487,000	
ヤマト	14,000	334.00	4,676,000	
太平電業	23,000	724.00	16,652,000	
高砂熱学工業	43,300	1,101.00	47,673,300	
三晃金属工業	28,000	230.00	6,440,000	
朝日工業社	18,000	386.00	6,948,000	
明星工業	30,000	540.00	16,200,000	
大気社	20,600	2,297.00	47,318,200	
ダイダン	21,000	564.00	11,844,000	
日比谷総合設備	17,600	1,467.00	25,819,200	
東芝プラントシステム	25,300	1,540.00	38,962,000	
東洋エンジニアリング	83,000	484.00	40,172,000	
千代田化工建設	123,000	1,218.00	149,814,000	
新興プランテック	32,000	796.00	25,472,000	
日本製粉	95,000	540.00	51,300,000	
日清製粉グループ本社	155,000	1,175.00	182,125,000	
日東富士製粉	12,000	309.00	3,708,000	

昭和産業	64,000	343.00	21,952,000
鳥越製粉	12,400	700.00	8,680,000
協同飼料	54,000	102.00	5,508,000
中部飼料	14,900	624.00	9,297,600
日本配合飼料	48,000	115.00	5,520,000
東洋精糖	24,000	98.00	2,352,000
日本甜菜製糖	79,000	184.00	14,536,000
三井製糖	61,000	376.00	22,936,000
塩水港精糖	12,300	280.00	3,444,000
森永製菓	152,000	218.00	33,136,000
中村屋	36,000	402.00	14,472,000
江崎グリコ	54,000	1,489.00	80,406,000
名糖産業	6,900	1,097.00	7,569,300
不二家	89,000	192.00	17,088,000
山崎製パン	114,000	1,203.00	137,142,000
第一屋製パン	21,000	120.00	2,520,000
モロゾフ	24,000	331.00	7,944,000
亀田製菓	8,700	3,225.00	28,057,500
寿スピリッツ	3,400	2,234.00	7,595,600
カルビー	57,500	2,877.00	165,427,500
森永乳業	131,000	376.00	49,256,000
六甲バター	7,000	871.00	6,097,000
ヤクルト本社	90,900	5,140.00	467,226,000
明治ホールディングス	46,000	6,650.00	305,900,000
雪印メグミルク	33,600	1,313.00	44,116,800
プリマハム	78,000	234.00	18,252,000
日本ハム	108,000	1,965.00	212,220,000
伊藤ハム	85,000	437.00	37,145,000
丸大食品	74,000	318.00	23,532,000
米久	5,000	880.00	4,400,000
S Foods	9,800	1,421.00	13,925,800
サッポロホールディングス	255,000	427.00	108,885,000
アサヒグループホールディングス	312,400	3,069.00	958,755,600
キリンホールディングス	665,000	1,490.00	990,850,000
宝ホールディングス	122,000	746.00	91,012,000
オエノンホールディングス	37,000	243.00	8,991,000
養命酒製造	12,000	953.00	11,436,000
コカ・コーラウエスト	47,900	1,749.00	83,777,100
コカ・コーライーストジャパン	32,200	2,505.00	80,661,000
サントリー食品インターナショナル	106,500	3,835.00	408,427,500
ダイドードリンコ	7,100	4,385.00	31,133,500
伊藤園	42,300	2,390.00	101,097,000
キーコーヒー	14,700	1,600.00	23,520,000
ユニカフェ	4,300	633.00	2,721,900
ジャパンフーズ	2,000	1,184.00	2,368,000
日清オイリオグループ	67,000	355.00	23,785,000
不二製油	37,800	1,329.00	50,236,200
かどや製油	1,500	2,622.00	3,933,000
J - オイルミルズ	65,000	317.00	20,605,000

キッコーマン	127,000	2,121.00	269,367,000
味の素	370,000	1,623.00	600,510,000
キューピー	79,100	1,582.00	125,136,200
ハウス食品グループ本社	54,700	1,860.00	101,742,000
カゴメ	60,100	1,733.00	104,153,300
焼津水産化学工業	6,800	940.00	6,392,000
アリアケジャパン	14,200	2,654.00	37,686,800
ニチレイ	166,000	495.00	82,170,000
東洋水産	76,000	3,025.00	229,900,000
イトアンド	1,300	1,514.00	1,968,200
日清食品ホールディングス	60,700	4,980.00	302,286,000
永谷園	15,000	997.00	14,955,000
フジッコ	15,000	1,258.00	18,870,000
ロック・フィールド	8,100	1,891.00	15,317,100
日本たばこ産業	861,300	3,520.00	3,031,776,000
ケンコーマヨネーズ	5,100	922.00	4,702,200
わらべや日洋	9,100	1,965.00	17,881,500
なとり	7,200	1,107.00	7,970,400
ミヨシ油脂	54,000	138.00	7,452,000
片倉工業	16,800	1,295.00	21,756,000
グンゼ	118,000	287.00	33,866,000
東洋紡	614,000	167.00	102,538,000
ユニチカ	398,000	43.00	17,114,000
富士紡ホールディングス	76,000	272.00	20,672,000
日清紡ホールディングス	93,000	1,009.00	93,837,000
倉敷紡績	149,000	178.00	26,522,000
シキボウ	83,000	114.00	9,462,000
日本毛織	46,000	764.00	35,144,000
トーア紡コーポレーション	62,000	71.00	4,402,000
ダイドーリミテッド	16,400	531.00	8,708,400
帝国繊維	15,200	1,986.00	30,187,200
帝人	594,000	231.00	137,214,000
東レ	1,054,000	651.00	686,154,000
サカイオーベックス	39,000	180.00	7,020,000
住江織物	45,000	306.00	13,770,000
日本フェルト	8,300	455.00	3,776,500
イチカワ	10,000	259.00	2,590,000
日本バイリーン	17,000	558.00	9,486,000
芦森工業	42,000	141.00	5,922,000
アツギ	123,000	108.00	13,284,000
ダイニック	27,000	156.00	4,212,000
セーレン	39,100	826.00	32,296,600
東海染工	20,000	115.00	2,300,000
小松精練	26,000	587.00	15,262,000
ワコールホールディングス	87,000	1,040.00	90,480,000
ホギメディカル	9,200	5,380.00	49,496,000
レナウン	34,900	117.00	4,083,300
クラウドシア	3,000	1,173.00	3,519,000
T S Iホールディングス	70,100	685.00	48,018,500

三陽商会	78,000	225.00	17,550,000
オンワードホールディングス	97,000	695.00	67,415,000
ルック	31,000	275.00	8,525,000
ゴールドウイン	36,000	450.00	16,200,000
デサント	33,000	872.00	28,776,000
キング	7,400	407.00	3,011,800
ヤマトインターナショナル	9,600	441.00	4,233,600
特種東海製紙	84,000	216.00	18,144,000
王子ホールディングス	642,000	425.00	272,850,000
日本製紙	75,100	2,033.00	152,678,300
三菱製紙	207,000	89.00	18,423,000
北越紀州製紙	99,100	490.00	48,559,000
中越パルプ工業	55,000	175.00	9,625,000
巴川製紙所	22,000	183.00	4,026,000
大王製紙	50,000	975.00	48,750,000
レンゴー	117,000	468.00	54,756,000
トモク	46,000	281.00	12,926,000
ザ・パック	10,300	1,982.00	20,414,600
クラレ	230,800	1,241.00	286,422,800
旭化成	906,000	756.00	684,936,000
共和レザー	9,800	465.00	4,557,000
コープケミカル	22,000	114.00	2,508,000
昭和電工	967,000	133.00	128,611,000
住友化学	1,069,000	375.00	400,875,000
日本化成	27,000	136.00	3,672,000
住友精化	30,000	706.00	21,180,000
日産化学工業	97,100	1,512.00	146,815,200
ラサ工業	55,000	142.00	7,810,000
クレハ	102,000	523.00	53,346,000
多木化学	9,000	693.00	6,237,000
テイカ	24,000	298.00	7,152,000
石原産業	261,000	80.00	20,880,000
片倉チッカリン	9,000	254.00	2,286,000
日本曹達	93,000	517.00	48,081,000
東ソー	388,000	483.00	187,404,000
トクヤマ	226,000	298.00	67,348,000
セントラル硝子	139,000	350.00	48,650,000
東亜合成	171,000	454.00	77,634,000
ダイソー	58,000	361.00	20,938,000
関東電化工業	35,000	241.00	8,435,000
電気化学工業	291,000	366.00	106,506,000
信越化学工業	260,500	6,056.00	1,577,588,000
日本カーバイド工業	42,000	267.00	11,214,000
堺化学工業	59,000	291.00	17,169,000
エア・ウォーター	120,000	1,590.00	190,800,000
大陽日酸	187,000	887.00	165,869,000
日本化学工業	54,000	130.00	7,020,000
日本パーカライジング	34,300	2,277.00	78,101,100
高圧ガス工業	22,000	575.00	12,650,000

チタン工業	17,000	231.00	3,927,000	
四国化成工業	21,000	746.00	15,666,000	
戸田工業	26,000	310.00	8,060,000	
ステラ ケミファ	7,400	1,318.00	9,753,200	
保土谷化学工業	43,000	180.00	7,740,000	
日本触媒	123,000	1,305.00	160,515,000	
大日精化工業	56,000	470.00	26,320,000	
カネカ	181,000	615.00	111,315,000	
三菱瓦斯化学	229,000	571.00	130,759,000	
三井化学	660,000	251.00	165,660,000	
J S R	133,200	1,730.00	230,436,000	
東京応化工業	28,100	2,298.00	64,573,800	
大阪有機化学工業	9,900	440.00	4,356,000	
三菱ケミカルホールディングス	908,500	421.00	382,478,500	
日本合成化学工業	30,000	779.00	23,370,000	
ダイセル	189,000	915.00	172,935,000	
住友ベークライト	113,000	377.00	42,601,000	
積水化学工業	298,000	1,128.00	336,144,000	
日本ゼオン	115,000	931.00	107,065,000	
アイカ工業	40,800	2,163.00	88,250,400	
宇部興産	732,000	171.00	125,172,000	
積水樹脂	20,400	1,427.00	29,110,800	
タキロン	34,000	523.00	17,782,000	
旭有機材工業	51,000	218.00	11,118,000	
日立化成	62,800	1,560.00	97,968,000	
ニチバン	15,000	351.00	5,265,000	
リケンテクノス	23,000	509.00	11,707,000	
大倉工業	35,000	316.00	11,060,000	
積水化成品工業	41,000	271.00	11,111,000	
群栄化学工業	39,000	378.00	14,742,000	
タイガースポリマー	7,400	468.00	3,463,200	
ミライアル	4,900	1,722.00	8,437,800	
ダイキョーニシカワ	3,600	1,872.00	6,739,200	
日本化薬	102,000	1,308.00	133,416,000	
カーリットホールディングス	11,800	479.00	5,652,200	
日本精化	12,000	657.00	7,884,000	
A D E K A	62,500	1,277.00	79,812,500	
日油	121,000	757.00	91,597,000	
ハリマ化成グループ	12,600	449.00	5,657,400	
花王	377,800	3,976.00	1,502,132,800	
第一工業製薬	27,000	341.00	9,207,000	
三洋化成工業	46,000	686.00	31,556,000	
大日本塗料	83,000	155.00	12,865,000	
日本ペイント	126,000	1,720.00	216,720,000	
関西ペイント	176,000	1,598.00	281,248,000	
神東塗料	11,000	205.00	2,255,000	
中国塗料	42,000	711.00	29,862,000	
日本特殊塗料	11,200	583.00	6,529,600	
藤倉化成	18,300	509.00	9,314,700	

太陽ホールディングス	11,800	3,070.00	36,226,000
D I C	515,000	253.00	130,295,000
サカタインクス	29,700	933.00	27,710,100
東洋インキ S C ホールディングス	131,000	448.00	58,688,000
T & K T O K A	5,300	2,023.00	10,721,900
富士フイルムホールディングス	332,500	2,698.00	897,085,000
資生堂	258,500	1,819.00	470,211,500
ライオン	168,000	592.00	99,456,000
高砂香料工業	52,000	466.00	24,232,000
マンダム	14,600	3,405.00	49,713,000
ミルボン	9,300	3,430.00	31,899,000
ファンケル	33,800	1,205.00	40,729,000
コーセー	23,500	3,740.00	87,890,000
コタ	4,200	1,263.00	5,304,600
ドクターシーラボ	9,900	3,435.00	34,006,500
シーボン	1,300	2,237.00	2,908,100
ポーラ・オルビスホールディングス	14,800	4,100.00	60,680,000
ノエビアホールディングス	9,700	1,931.00	18,730,700
アジュバンコスメジャパン	2,500	873.00	2,182,500
エステー	9,000	984.00	8,856,000
コニシ	10,500	2,033.00	21,346,500
長谷川香料	18,400	1,548.00	28,483,200
星光 P M C	8,000	1,184.00	9,472,000
小林製薬	23,800	6,370.00	151,606,000
荒川化学工業	12,100	1,031.00	12,475,100
メック	11,400	854.00	9,735,600
日本高純度化学	4,100	2,162.00	8,864,200
J C U	2,100	6,460.00	13,566,000
新田ゼラチン	8,800	906.00	7,972,800
アース製薬	10,500	3,750.00	39,375,000
イハラケミカル工業	22,500	843.00	18,967,500
北興化学工業	14,000	366.00	5,124,000
大成ラミック	3,800	2,584.00	9,819,200
クミアイ化学工業	30,000	654.00	19,620,000
日本農薬	33,200	1,182.00	39,242,400
アキレス	116,000	138.00	16,008,000
有沢製作所	24,200	679.00	16,431,800
日東電工	119,700	4,718.00	564,744,600
レック	4,600	1,067.00	4,908,200
きもと	21,600	360.00	7,776,000
藤森工業	12,500	3,220.00	40,250,000
前澤化成工業	10,200	1,025.00	10,455,000
J S P	9,500	1,699.00	16,140,500
エフピコ	14,300	3,130.00	44,759,000
天馬	11,600	1,519.00	17,620,400
信越ポリマー	28,500	420.00	11,970,000
東リ	38,000	212.00	8,056,000
ニフコ	32,400	3,100.00	100,440,000
日本バルカー工業	60,000	280.00	16,800,000



ユニ・チャーム	89,100	6,242.00	556,162,200
協和発酵キリン	174,000	1,302.00	226,548,000
武田薬品工業	544,100	4,686.00	2,549,652,600
アステラス製薬	1,672,800	1,313.00	2,196,386,400
大日本住友製薬	102,800	1,131.00	116,266,800
塩野義製薬	226,800	2,060.00	467,208,000
田辺三菱製薬	120,900	1,478.00	178,690,200
わかもと製薬	17,000	241.00	4,097,000
あすか製薬	17,100	999.00	17,082,900
日本新薬	33,000	1,970.00	65,010,000
ビオフェルミン製薬	2,400	2,424.00	5,817,600
中外製薬	144,600	2,778.00	401,698,800
科研製薬	53,000	2,084.00	110,452,000
エーザイ	178,800	4,134.00	739,159,200
ロート製薬	60,900	1,572.00	95,734,800
小野薬品工業	66,000	7,880.00	520,080,000
久光製薬	45,100	4,245.00	191,449,500
有機合成薬品工業	9,000	249.00	2,241,000
持田製薬	10,400	6,960.00	72,384,000
参天製薬	53,300	5,600.00	298,480,000
扶桑薬品工業	49,000	317.00	15,533,000
日本ケミファ	20,000	465.00	9,300,000
ツムラ	42,700	2,262.00	96,587,400
日医工	34,000	1,483.00	50,422,000
キッセイ薬品工業	27,000	2,331.00	62,937,000
生化学工業	30,300	1,130.00	34,239,000
栄研化学	11,300	1,657.00	18,724,100
日水製薬	5,800	1,149.00	6,664,200
鳥居薬品	9,900	2,948.00	29,185,200
JCRファーマ	11,200	2,436.00	27,283,200
東和薬品	7,400	3,995.00	29,563,000
富士製薬工業	4,100	1,884.00	7,724,400
沢井製薬	23,000	5,910.00	135,930,000
ゼリア新薬工業	22,900	2,202.00	50,425,800
第一三共	458,000	1,735.00	794,630,000
キョーリン製薬ホールディングス	38,700	1,936.00	74,923,200
大幸薬品	6,900	1,465.00	10,108,500
ダイト	4,800	1,620.00	7,776,000
大塚ホールディングス	288,300	2,993.00	862,881,900
大正製薬ホールディングス	34,900	7,310.00	255,119,000
日本コークス工業	117,200	115.00	13,478,000
昭和シェル石油	129,800	1,187.00	154,072,600
コスモ石油	402,000	212.00	85,224,000
ニチレキ	18,000	1,059.00	19,062,000
東燃ゼネラル石油	219,000	982.00	215,058,000
ユシロ化学工業	7,900	1,278.00	10,096,200
ビーピー・カストロール	5,900	619.00	3,652,100
富士石油	37,000	302.00	11,174,000
MORESCO	4,600	1,655.00	7,613,000

出光興産	68,900	2,111.00	145,447,900
J Xホールディングス	1,612,100	540.00	870,534,000
横浜ゴム	162,000	917.00	148,554,000
東洋ゴム工業	120,000	915.00	109,800,000
ブリヂストン	455,200	3,679.00	1,674,680,800
住友ゴム工業	113,300	1,543.00	174,821,900
藤倉ゴム工業	9,100	869.00	7,907,900
オカモト	51,000	335.00	17,085,000
フコク	6,100	929.00	5,666,900
ニッタ	14,300	2,256.00	32,260,800
東海ゴム工業	26,900	1,001.00	26,926,900
三ツ星ベルト	37,000	597.00	22,089,000
バンドー化学	53,000	399.00	21,147,000
日東紡績	108,000	412.00	44,496,000
旭硝子	716,000	570.00	408,120,000
日本板硝子	700,000	124.00	86,800,000
石塚硝子	19,000	196.00	3,724,000
日本山村硝子	59,000	159.00	9,381,000
日本電気硝子	300,000	515.00	154,500,000
オハラ	5,600	594.00	3,326,400
住友大阪セメント	270,000	383.00	103,410,000
太平洋セメント	853,000	406.00	346,318,000
デイ・シイ	15,800	498.00	7,868,400
日本ヒューム	14,000	637.00	8,918,000
日本コンクリート工業	29,000	430.00	12,470,000
三谷セキサン	7,300	1,534.00	11,198,200
ジャパンパイル	17,500	842.00	14,735,000
東海カーボン	136,000	289.00	39,304,000
日本カーボン	77,000	175.00	13,475,000
東洋炭素	9,000	2,123.00	19,107,000
ノリタケカンパニーリミテド	82,000	252.00	20,664,000
TOTO	213,000	1,305.00	277,965,000
日本碍子	183,000	2,173.00	397,659,000
日本特殊陶業	125,000	2,833.00	354,125,000
MARUWA	3,700	4,065.00	15,040,500
品川リフラクトリーズ	37,000	211.00	7,807,000
黒崎播磨	34,000	223.00	7,582,000
ヨータイ	9,000	303.00	2,727,000
イソライト工業	9,600	173.00	1,660,800
東京窯業	18,000	199.00	3,582,000
ニッカトー	5,300	400.00	2,120,000
フジインコーポレーテッド	13,300	1,158.00	15,401,400
ニチアス	70,000	697.00	48,790,000
ニチハ	17,900	1,123.00	20,101,700
新日鐵住金	6,139,000	304.00	1,866,256,000
神戸製鋼所	2,317,000	146.00	338,282,000
合同製鐵	77,000	149.00	11,473,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	370,500	2,033.00	753,226,500
日新製鋼	62,000	1,134.00	70,308,000

東京製鐵	80,300	536.00	43,040,800
共英製鋼	13,600	1,788.00	24,316,800
大和工業	30,100	2,837.00	85,393,700
東京鐵鋼	31,000	497.00	15,407,000
大阪製鐵	7,300	1,703.00	12,431,900
淀川製鋼所	103,000	423.00	43,569,000
東洋鋼鈹	35,000	582.00	20,370,000
丸一鋼管	48,600	2,618.00	127,234,800
モリ工業	22,000	383.00	8,426,000
大同特殊鋼	243,000	520.00	126,360,000
日本高周波鋼業	62,000	97.00	6,014,000
日本冶金工業	115,200	322.00	37,094,400
山陽特殊製鋼	79,000	437.00	34,523,000
愛知製鋼	77,000	392.00	30,184,000
日立金属	129,000	1,469.00	189,501,000
日本金属	38,000	136.00	5,168,000
大平洋金属	101,000	471.00	47,571,000
日本電工	62,000	281.00	17,422,000
栗本鐵工所	76,000	232.00	17,632,000
虹技	22,000	194.00	4,268,000
日本鑄鉄管	16,000	224.00	3,584,000
三菱製鋼	90,000	211.00	18,990,000
日亜鋼業	20,000	309.00	6,180,000
日本精線	11,000	417.00	4,587,000
シンニッタン	13,900	434.00	6,032,600
新家工業	32,000	152.00	4,864,000
大紀アルミニウム工業所	24,000	299.00	7,176,000
日本軽金属ホールディングス	328,900	155.00	50,979,500
三井金属鉱業	370,000	264.00	97,680,000
東邦亜鉛	82,000	360.00	29,520,000
三菱マテリアル	906,000	321.00	290,826,000
住友金属鉱山	376,000	1,557.00	585,432,000
DOWAホールディングス	160,000	936.00	149,760,000
古河機械金属	244,000	194.00	47,336,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,900	1,992.00	31,672,800
東邦チタニウム	24,600	669.00	16,457,400
UACJ	185,000	360.00	66,600,000
古河電気工業	457,000	211.00	96,427,000
住友電気工業	547,100	1,406.00	769,222,600
フジクラ	233,000	473.00	110,209,000
昭和電線ホールディングス	186,000	99.00	18,414,000
東京特殊電線	21,000	162.00	3,402,000
タツタ電線	22,300	568.00	12,666,400
沖電線	19,000	176.00	3,344,000
カナレ電気	2,100	1,569.00	3,294,900
平河ヒューテック	3,200	870.00	2,784,000
リョービ	89,000	324.00	28,836,000
アーレスティ	12,400	877.00	10,874,800
アサヒホールディングス	21,900	1,703.00	37,295,700

稲葉製作所	6,300	1,338.00	8,429,400
宮地エンジニアリンググループ	48,000	197.00	9,456,000
トーカロ	8,900	1,677.00	14,925,300
アルファC o	4,900	997.00	4,885,300
SUMCO	90,100	855.00	77,035,500
川田テクノロジーズ	3,400	4,060.00	13,804,000
東洋製罐グループホールディングス	103,200	1,545.00	159,444,000
ホッカンホールディングス	40,000	285.00	11,400,000
コロナ	7,700	1,105.00	8,508,500
横河ブリッジホールディングス	28,000	1,337.00	37,436,000
O S J Bホールディングス	31,700	143.00	4,533,100
駒井ハルテック	33,000	270.00	8,910,000
高田機工	13,000	195.00	2,535,000
三和ホールディングス	122,000	707.00	86,254,000
文化シャッター	35,000	804.00	28,140,000
三協立山	18,000	2,042.00	36,756,000
東洋シャッター	5,700	792.00	4,514,400
L I X I Lグループ	202,300	2,668.00	539,736,400
日本フィルコン	12,300	435.00	5,350,500
ノーリツ	28,500	1,987.00	56,629,500
長府製作所	15,500	2,654.00	41,137,000
リンナイ	22,500	9,400.00	211,500,000
ダイニチ工業	7,500	744.00	5,580,000
日東精工	21,000	350.00	7,350,000
三洋工業	19,000	193.00	3,667,000
岡部	28,600	1,359.00	38,867,400
東プレ	28,100	1,295.00	36,389,500
高周波熱錬	21,300	681.00	14,505,300
サンコール	10,000	619.00	6,190,000
モリテック スチール	7,600	288.00	2,188,800
パイオラックス	6,800	3,775.00	25,670,000
日本発條	115,700	945.00	109,336,500
中央発條	19,000	303.00	5,757,000
アドバネクス	43,000	168.00	7,224,000
三益半導体工業	12,300	943.00	11,598,900
日本ドライケミカル	1,800	2,263.00	4,073,400
日本製鋼所	208,000	398.00	82,784,000
三浦工業	21,600	3,205.00	69,228,000
タクマ	46,000	673.00	30,958,000
ツガミ	45,000	554.00	24,930,000
オークマ	94,000	992.00	93,248,000
東芝機械	79,000	452.00	35,708,000
アマダ	222,000	1,003.00	222,666,000
アイダエンジニアリング	34,100	977.00	33,315,700
滝澤鉄工所	52,000	183.00	9,516,000
富士機械製造	44,500	844.00	37,558,000
牧野フライス製作所	73,000	887.00	64,751,000
オーエスジー	59,700	1,798.00	107,340,600
ダイジェット工業	22,000	148.00	3,256,000

旭ダイヤモンド工業	37,300	1,671.00	62,328,300
D M G 森精機	85,900	1,347.00	115,707,300
ディスコ	16,100	6,790.00	109,319,000
日東工器	8,700	1,906.00	16,582,200
パンチ工業	3,300	941.00	3,105,300
豊和工業	8,300	751.00	6,233,300
大阪機工	56,000	140.00	7,840,000
東洋機械金属	12,100	509.00	6,158,900
津田駒工業	40,000	145.00	5,800,000
島精機製作所	18,900	1,716.00	32,432,400
日阪製作所	19,000	951.00	18,069,000
やまびこ	5,700	4,325.00	24,652,500
ペガサスマシン製造	15,500	389.00	6,029,500
ナプテスコ	66,300	2,274.00	150,766,200
三井海洋開発	13,000	2,234.00	29,042,000
レオン自動機	14,000	449.00	6,286,000
S M C	41,500	27,440.00	1,138,760,000
新川	12,800	491.00	6,284,800
ホソカワミクロン	26,000	632.00	16,432,000
ユニオンツール	6,400	2,398.00	15,347,200
オイレス工業	13,800	2,289.00	31,588,200
日精エー・エス・ピー機械	4,700	1,750.00	8,225,000
サトーホールディングス	16,000	2,429.00	38,864,000
日本エアーテック	6,100	457.00	2,787,700
日精樹脂工業	10,700	599.00	6,409,300
ワイエイシイ	7,300	652.00	4,759,600
小松製作所	677,400	2,318.00	1,570,213,200
住友重機械工業	397,000	464.00	184,208,000
日立建機	74,100	1,960.00	145,236,000
日工	22,000	497.00	10,934,000
巴工業	5,300	1,692.00	8,967,600
井関農機	149,000	263.00	39,187,000
T O W A	12,400	668.00	8,283,200
丸山製作所	33,000	236.00	7,788,000
北川鉄工所	71,000	167.00	11,857,000
クボタ	754,000	1,421.00	1,071,434,000
荏原実業	3,800	1,441.00	5,475,800
三菱化工機	49,000	189.00	9,261,000
月島機械	23,700	1,077.00	25,524,900
帝国電機製作所	5,100	2,890.00	14,739,000
新東工業	34,100	704.00	24,006,400
澁谷工業	12,300	2,735.00	33,640,500
アイチ コーポレーション	20,500	453.00	9,286,500
小森コーポレーション	35,300	1,325.00	46,772,500
鶴見製作所	11,000	1,292.00	14,212,000
住友精密工業	26,000	412.00	10,712,000
酒井重工業	28,000	342.00	9,576,000
荏原製作所	321,000	639.00	205,119,000
石井鐵工所	25,000	229.00	5,725,000

西島製作所	15,700	838.00	13,156,600	
北越工業	12,000	552.00	6,624,000	
ダイキン工業	189,400	6,426.00	1,217,084,400	
オルガノ	22,000	499.00	10,978,000	
トーヨーカネツ	78,000	265.00	20,670,000	
栗田工業	87,200	2,290.00	199,688,000	
椿本チエイン	74,000	852.00	63,048,000	
大同工業	32,000	257.00	8,224,000	
日本コンベヤ	45,000	134.00	6,030,000	
木村化工機	14,700	478.00	7,026,600	
アネスト岩田	24,400	606.00	14,786,400	
ダイフク	58,800	1,386.00	81,496,800	
サムコ	2,300	1,104.00	2,539,200	
加藤製作所	33,000	661.00	21,813,000	
油研工業	31,000	220.00	6,820,000	
タダノ	61,000	1,599.00	97,539,000	
フジテック	40,500	1,090.00	44,145,000	
C K D	39,000	937.00	36,543,000	
キトー	8,200	2,380.00	19,516,000	
平和	30,600	2,210.00	67,626,000	
理想科学工業	10,800	2,679.00	28,933,200	
S A N K Y O	42,100	3,800.00	159,980,000	
日本金銭機械	12,800	1,712.00	21,913,600	
マースエンジニアリング	7,900	1,902.00	15,025,800	
福島工業	7,800	1,562.00	12,183,600	
オーイズミ	5,200	925.00	4,810,000	
ダイコク電機	5,800	1,583.00	9,181,400	
アマノ	39,800	1,031.00	41,033,800	
サンデン	81,000	484.00	39,204,000	
マックス	22,000	1,109.00	24,398,000	
グローリー	41,400	3,140.00	129,996,000	
新晃工業	10,100	1,032.00	10,423,200	
大和冷機工業	23,000	667.00	15,341,000	
セガサミーホールディングス	149,100	1,957.00	291,788,700	
日本ピストンリング	54,000	185.00	9,990,000	
リケン	56,000	407.00	22,792,000	
T P R	15,500	2,243.00	34,766,500	
ホシザキ電機	30,400	4,830.00	146,832,000	
大豊工業	10,700	1,051.00	11,245,700	
日本精工	309,000	1,292.00	399,228,000	
N T N	323,000	435.00	140,505,000	
ジェイテクト	147,400	1,690.00	249,106,000	
不二越	129,000	682.00	87,978,000	
日本トムソン	45,000	501.00	22,545,000	
T H K	86,500	2,331.00	201,631,500	
ユーシン精機	6,200	2,517.00	15,605,400	
前澤給装工業	5,600	1,390.00	7,784,000	
イーグル工業	17,400	1,816.00	31,598,400	
前澤工業	13,400	298.00	3,993,200	

日本ビラー工業	15,700	792.00	12,434,400	
キッツ	63,100	565.00	35,651,500	
日立工機	37,400	836.00	31,266,400	
マキタ	90,500	6,060.00	548,430,000	
日立造船	109,700	510.00	55,947,000	
三菱重工業	2,470,000	621.00	1,533,870,000	
I H I	999,000	448.00	447,552,000	
イビデン	84,500	1,931.00	163,169,500	
コニカミノルタ	366,400	895.00	327,928,000	
ブラザー工業	179,300	1,645.00	294,948,500	
ミネベア	189,000	1,121.00	211,869,000	
日立製作所	3,338,000	705.00	2,353,290,000	
東芝	2,737,000	440.00	1,204,280,000	
三菱電機	1,387,000	1,226.00	1,700,462,000	
富士電機	386,000	471.00	181,806,000	
東洋電機製造	29,000	393.00	11,397,000	
安川電機	152,100	1,303.00	198,186,300	
シンフォニアテクノロジー	83,000	159.00	13,197,000	
明電舎	127,000	418.00	53,086,000	
オリジン電気	20,000	315.00	6,300,000	
山洋電気	28,000	708.00	19,824,000	
デンヨー	13,600	1,546.00	21,025,600	
東芝テック	87,000	675.00	58,725,000	
芝浦メカトロニクス	27,000	273.00	7,371,000	
マブチモーター	19,600	7,600.00	148,960,000	
日本電産	150,000	5,956.00	893,400,000	
東光高岳	8,200	1,317.00	10,799,400	
ダイヘン	82,000	438.00	35,916,000	
ヤーマン	1,800	1,293.00	2,327,400	
J V C ケンウッド	99,200	194.00	19,244,800	
第一精工	5,800	1,550.00	8,990,000	
日新電機	28,000	626.00	17,528,000	
大崎電気工業	22,000	564.00	12,408,000	
オムロン	156,500	4,000.00	626,000,000	
日東工業	20,400	2,127.00	43,390,800	
I D E C	18,100	896.00	16,217,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	267,000	614.00	163,938,000	
サクサホールディングス	35,000	161.00	5,635,000	
メルコホールディングス	6,700	1,926.00	12,904,200	
テクノメディカ	3,100	2,128.00	6,596,800	
日本電気	1,907,000	325.00	619,775,000	
富士通	1,337,000	711.00	950,607,000	
沖電気工業	539,000	216.00	116,424,000	
岩崎通信機	65,000	90.00	5,850,000	
電気興業	39,000	581.00	22,659,000	
サンケン電気	76,000	848.00	64,448,000	
ナカヨ通信機	13,000	364.00	4,732,000	
アイホン	8,000	1,930.00	15,440,000	
ルネサスエレクトロニクス	71,800	796.00	57,152,800	

セイコーエプソン	94,700	3,685.00	348,969,500
ワコム	109,300	580.00	63,394,000
アルバック	25,500	2,250.00	57,375,000
アクセル	7,000	1,439.00	10,073,000
E I Z O	12,700	2,694.00	34,213,800
ジャパンディスプレイ	233,200	591.00	137,821,200
日本信号	38,300	903.00	34,584,900
京三製作所	32,000	355.00	11,360,000
能美防災	18,000	1,436.00	25,848,000
ホーチキ	10,000	643.00	6,430,000
エレコム	5,100	2,280.00	11,628,000
日本無線	36,000	461.00	16,596,000
パナソニック	1,584,700	1,172.00	1,857,268,400
シャープ	1,000,000	303.00	303,000,000
アンリツ	80,600	1,080.00	87,048,000
富士通ゼネラル	33,000	1,119.00	36,927,000
日立国際電気	27,000	1,352.00	36,504,000
ソニー	764,900	1,647.00	1,259,790,300
T D K	83,700	4,600.00	385,020,000
帝国通信工業	33,000	167.00	5,511,000
ミツミ電機	52,800	664.00	35,059,200
タムラ製作所	53,000	374.00	19,822,000
アルプス電気	101,700	1,303.00	132,515,100
池上通信機	44,000	110.00	4,840,000
パイオニア	192,400	216.00	41,558,400
日本電波工業	13,300	930.00	12,369,000
日本トリム	3,100	4,155.00	12,880,500
ローランド ディー . ジー .	6,100	3,605.00	21,990,500
フォスター電機	14,200	1,209.00	17,167,800
クラリオン	85,000	242.00	20,570,000
S M K	41,000	409.00	16,769,000
ヨコオ	11,800	522.00	6,159,600
東光	33,000	280.00	9,240,000
ホシデン	40,800	603.00	24,602,400
ヒロセ電機	24,100	14,430.00	347,763,000
日本航空電子工業	36,000	2,007.00	72,252,000
T O A	14,900	1,295.00	19,295,500
日立マクセル	24,200	1,782.00	43,124,400
古野電気	17,900	675.00	12,082,500
ユニデン	44,000	237.00	10,428,000
アルパイン	30,100	1,330.00	40,033,000
スミダコーポレーション	12,300	674.00	8,290,200
アイコム	7,700	2,379.00	18,318,300
リオン	4,000	1,501.00	6,004,000
船井電機	14,000	997.00	13,958,000
横河電機	150,400	1,293.00	194,467,200
新電元工業	45,000	536.00	24,120,000
アズビル	42,100	2,416.00	101,713,600
東亜ディーケーケー	5,200	518.00	2,693,600



日本光電工業	29,600	4,780.00	141,488,000
チノー	25,000	226.00	5,650,000
共和電業	17,000	595.00	10,115,000
日本電子材料	5,900	468.00	2,761,200
堀場製作所	25,600	3,545.00	90,752,000
アドバンテスト	94,500	1,188.00	112,266,000
小野測器	14,000	483.00	6,762,000
エスベック	14,400	836.00	12,038,400
パナソニック デバイスSUNX	12,300	471.00	5,793,300
キーエンス	31,400	41,805.00	1,312,677,000
日置電機	7,300	1,583.00	11,555,900
シスメックス	116,200	3,675.00	427,035,000
メガチップス	12,500	1,328.00	16,600,000
OBARA GROUP	9,000	4,125.00	37,125,000
日本電産コパル電子	14,400	825.00	11,880,000
澤藤電機	9,000	212.00	1,908,000
コーセル	20,200	1,197.00	24,179,400
新日本無線	10,000	422.00	4,220,000
オブテックス	8,800	1,924.00	16,931,200
千代田インテグレ	6,300	1,513.00	9,531,900
レーザーテック	14,300	1,031.00	14,743,300
スタンレー電気	99,900	2,542.00	253,945,800
岩崎電気	53,000	245.00	12,985,000
ウシオ電機	84,200	1,285.00	108,197,000
岡谷電機産業	7,500	374.00	2,805,000
ヘリオス テクノ ホールディング	12,000	306.00	3,672,000
日本セラミック	8,000	1,755.00	14,040,000
遠藤照明	7,800	1,399.00	10,912,200
日本デジタル研究所	10,200	1,726.00	17,605,200
古河電池	11,000	647.00	7,117,000
双信電機	6,900	368.00	2,539,200
図研	9,100	917.00	8,344,700
日本電子	54,000	366.00	19,764,000
カシオ計算機	144,200	1,473.00	212,406,600
ファナック	154,700	17,600.00	2,722,720,000
日本シイエムケイ	32,800	260.00	8,528,000
エンプラス	5,200	6,960.00	36,192,000
大真空	25,000	389.00	9,725,000
ローム	73,300	5,560.00	407,548,000
浜松ホトニクス	57,700	4,955.00	285,903,500
三井ハイテック	18,400	655.00	12,052,000
新光電気工業	46,600	897.00	41,800,200
京セラ	244,000	4,749.00	1,158,756,000
太陽誘電	67,500	1,097.00	74,047,500
村田製作所	145,500	8,935.00	1,300,042,500
ユーシン	20,400	576.00	11,750,400
双葉電子工業	25,700	1,657.00	42,584,900
北陸電気工業	56,000	144.00	8,064,000
ニチコン	43,700	821.00	35,877,700

日本ケミコン	99,000	309.00	30,591,000	
K O A	17,500	968.00	16,940,000	
市光工業	38,000	151.00	5,738,000	
小糸製作所	76,200	2,566.00	195,529,200	
ミツバ	26,000	1,556.00	40,456,000	
スター精密	26,400	1,371.00	36,194,400	
大日本スクリーン製造	131,000	468.00	61,308,000	
キャノン電子	12,800	1,865.00	23,872,000	
キャノン	804,200	3,360.00	2,702,112,000	
リコー	417,000	1,228.00	512,076,000	
M U T O Hホールディングス	19,000	455.00	8,645,000	
東京エレクトロン	124,500	6,877.00	856,186,500	
トヨタ紡織	48,500	1,082.00	52,477,000	
鬼怒川ゴム工業	26,000	504.00	13,104,000	
ユニプレス	22,500	2,193.00	49,342,500	
豊田自動織機	126,300	4,940.00	623,922,000	
モリタホールディングス	24,000	907.00	21,768,000	
三櫻工業	17,600	695.00	12,232,000	
デンソー	342,700	4,810.00	1,648,387,000	
東海理化電機製作所	36,500	1,847.00	67,415,500	
三井造船	537,000	204.00	109,548,000	
佐世保重工業	98,000	110.00	10,780,000	
川崎重工業	1,080,000	399.00	430,920,000	
名村造船所	27,100	883.00	23,929,300	
サノヤスホールディングス	16,800	209.00	3,511,200	
日本車輛製造	51,000	381.00	19,431,000	
ニチユ三菱フォークリフト	16,000	679.00	10,864,000	
近畿車輛	24,000	304.00	7,296,000	
日産自動車	1,946,900	953.00	1,855,395,700	
いすゞ自動車	804,000	643.00	516,972,000	
トヨタ自動車	1,930,400	5,810.00	11,215,624,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	173,200	1,348.00	233,473,600	
三菱自動車工業	496,300	1,083.00	537,492,900	
エフテック	5,800	1,258.00	7,296,400	
レシップホールディングス	4,500	837.00	3,766,500	
G M B	1,800	1,340.00	2,412,000	
武蔵精密工業	14,800	2,469.00	36,541,200	
日産車体	67,700	1,700.00	115,090,000	
新明和工業	56,000	880.00	49,280,000	
極東開発工業	23,900	1,440.00	34,416,000	
日信工業	28,200	1,945.00	54,849,000	
トビー工業	114,000	188.00	21,432,000	
ティラド	54,000	259.00	13,986,000	
曙ブレーキ工業	64,400	483.00	31,105,200	
タチエス	20,400	1,689.00	34,455,600	
N O K	67,100	1,921.00	128,899,100	
フタバ産業	42,200	444.00	18,736,800	
カヤバ工業	131,000	442.00	57,902,000	

シロキ工業	31,000	203.00	6,293,000	
大同メタル工業	19,000	1,169.00	22,211,000	
プレス工業	54,000	383.00	20,682,000	
カルソニックカンセイ	94,000	661.00	62,134,000	
太平洋工業	28,200	815.00	22,983,000	
ケーヒン	31,900	1,524.00	48,615,600	
河西工業	19,000	697.00	13,243,000	
アイシン精機	126,900	3,720.00	472,068,000	
富士機工	16,000	398.00	6,368,000	
マツダ	2,067,000	473.00	977,691,000	
ダイハツ工業	147,200	1,818.00	267,609,600	
今仙電機製作所	10,200	1,372.00	13,994,400	
本田技研工業	1,248,200	3,563.00	4,447,336,600	
スズキ	289,900	3,103.00	899,559,700	
富士重工業	472,000	2,775.00	1,309,800,000	
ヤマハ発動機	210,900	1,710.00	360,639,000	
ショーワ	32,700	1,154.00	37,735,800	
T B K	15,000	523.00	7,845,000	
エクセディ	16,700	2,828.00	47,227,600	
豊田合成	44,800	2,021.00	90,540,800	
愛三工業	16,800	857.00	14,397,600	
ヨロズ	10,200	2,030.00	20,706,000	
エフ・シー・シー	22,700	1,775.00	40,292,500	
シマノ	59,900	10,650.00	637,935,000	
タカタ	25,100	2,244.00	56,324,400	
テイ・エス テック	29,300	2,814.00	82,450,200	
テルモ	212,600	2,165.00	460,279,000	
クリエートメディック	4,600	1,014.00	4,664,400	
日機装	45,000	1,194.00	53,730,000	
島津製作所	179,000	906.00	162,174,000	
J M S	26,000	290.00	7,540,000	
ショットモリテックス	3,000	284.00	852,000	
長野計器	8,900	691.00	6,149,900	
ブイ・テクノロジ	2,900	4,045.00	11,730,500	
東京計器	48,000	264.00	12,672,000	
愛知時計電機	18,000	291.00	5,238,000	
東京精密	24,900	1,782.00	44,371,800	
マニー	3,800	4,715.00	17,917,000	
ニコン	259,000	1,633.00	422,947,000	
トプコン	37,300	2,095.00	78,143,500	
オリンパス	206,600	3,320.00	685,912,000	
理研計器	12,300	1,020.00	12,546,000	
タムロン	10,700	2,328.00	24,909,600	
H O Y A	337,200	3,272.00	1,103,318,400	
ノーリツ鋼機	12,500	654.00	8,175,000	
エー・アンド・デイ	12,700	498.00	6,324,600	
シチズンホールディングス	170,800	795.00	135,786,000	
リズム時計工業	63,000	148.00	9,324,000	
大研医器	4,800	1,653.00	7,934,400	

松風	6,800	891.00	6,058,800
セイコーホールディングス	89,000	429.00	38,181,000
ニプロ	73,900	896.00	66,214,400
パラマウントベッドホールディングス	13,300	3,260.00	43,358,000
S H O - B I	4,800	411.00	1,972,800
前田工織	13,300	1,251.00	16,638,300
永大産業	19,000	477.00	9,063,000
アートネイチャー	4,500	2,778.00	12,501,000
ダンロップスポーツ	7,600	1,222.00	9,287,200
バンダイナムコホールディングス	153,000	2,360.00	361,080,000
共立印刷	25,500	271.00	6,910,500
フランスベッドホールディングス	88,000	184.00	16,192,000
パイロットコーポレーション	12,100	4,400.00	53,240,000
トッパン・フォームズ	24,900	978.00	24,352,200
フジシールインターナショナル	16,900	3,035.00	51,291,500
タカラトミー	46,000	535.00	24,610,000
廣済堂	12,900	445.00	5,740,500
タカノ	6,500	551.00	3,581,500
プロネクサス	14,300	812.00	11,611,600
ホクシン	13,400	131.00	1,755,400
ウッドワン	24,000	295.00	7,080,000
大建工業	57,000	306.00	17,442,000
凸版印刷	392,000	773.00	303,016,000
大日本印刷	422,000	1,039.00	438,458,000
図書印刷	23,000	462.00	10,626,000
共同印刷	43,000	294.00	12,642,000
日本写真印刷	23,500	1,555.00	36,542,500
光村印刷	13,000	256.00	3,328,000
宝印刷	7,900	752.00	5,940,800
アシックス	137,800	2,307.00	317,904,600
ツツミ	7,000	2,403.00	16,821,000
ローランド	13,700	1,874.00	25,673,800
小松ウオール工業	4,700	2,420.00	11,374,000
ヤマハ	102,000	1,635.00	166,770,000
河合楽器製作所	49,000	202.00	9,898,000
クリナップ	14,500	885.00	12,832,500
ビジョン	22,700	5,380.00	122,126,000
兼松日産農林	21,000	149.00	3,129,000
キングジム	11,700	775.00	9,067,500
リンテック	33,000	1,898.00	62,634,000
イトーキ	30,200	767.00	23,163,400
任天堂	85,400	11,890.00	1,015,406,000
三菱鉛筆	11,500	2,955.00	33,982,500
タカラスタANDARD	57,000	873.00	49,761,000
コクヨ	72,200	806.00	58,193,200
ナカバヤシ	30,000	201.00	6,030,000
グローブライド	74,000	125.00	9,250,000
岡村製作所	53,000	870.00	46,110,000
美津濃	69,000	623.00	42,987,000

アデランス	17,400	1,538.00	26,761,200
東京電力	1,176,500	424.00	498,836,000
中部電力	457,000	1,221.00	557,997,000
関西電力	566,000	907.00	513,362,000
中国電力	191,800	1,333.00	255,669,400
北陸電力	135,900	1,296.00	176,126,400
東北電力	346,500	1,089.00	377,338,500
四国電力	124,900	1,327.00	165,742,300
九州電力	306,300	1,046.00	320,389,800
北海道電力	129,800	746.00	96,830,800
沖縄電力	9,100	3,310.00	30,121,000
電源開発	86,100	3,025.00	260,452,500
東京瓦斯	1,626,000	568.00	923,568,000
大阪瓦斯	1,436,000	412.00	591,632,000
東邦瓦斯	353,000	528.00	186,384,000
北海道瓦斯	27,000	274.00	7,398,000
西部瓦斯	156,000	251.00	39,156,000
静岡瓦斯	36,100	638.00	23,031,800
SBSホールディングス	9,000	596.00	5,364,000
東武鉄道	787,000	518.00	407,666,000
相鉄ホールディングス	238,000	372.00	88,536,000
東京急行電鉄	816,000	707.00	576,912,000
京浜急行電鉄	356,000	874.00	311,144,000
小田急電鉄	444,000	942.00	418,248,000
京王電鉄	388,000	763.00	296,044,000
京成電鉄	208,000	972.00	202,176,000
富士急行	38,000	1,045.00	39,710,000
新京成電鉄	18,000	375.00	6,750,000
東日本旅客鉄道	255,200	7,881.00	2,011,231,200
西日本旅客鉄道	125,200	4,395.00	550,254,000
東海旅客鉄道	124,200	13,840.00	1,718,928,000
西武ホールディングス	110,500	2,072.00	228,956,000
鴻池運輸	9,800	1,835.00	17,983,000
西日本鉄道	179,000	400.00	71,600,000
ハマキョウレックス	4,000	2,850.00	11,400,000
サカイ引越センター	2,300	3,360.00	7,728,000
近畿日本鉄道	1,396,000	361.00	503,956,000
阪急阪神ホールディングス	931,000	563.00	524,153,000
南海電気鉄道	289,000	408.00	117,912,000
京阪電気鉄道	292,000	416.00	121,472,000
神戸電鉄	34,000	344.00	11,696,000
名糖運輸	5,700	655.00	3,733,500
名古屋鉄道	488,000	367.00	179,096,000
山陽電気鉄道	50,000	432.00	21,600,000
日本通運	549,000	508.00	278,892,000
ヤマトホールディングス	254,600	2,180.00	555,028,000
山九	169,000	468.00	79,092,000
丸運	8,700	246.00	2,140,200
丸全昭和運輸	47,000	351.00	16,497,000

センコー	56,000	547.00	30,632,000
トナミホールディングス	28,000	219.00	6,132,000
日本梱包運輸倉庫	42,300	1,764.00	74,617,200
日本石油輸送	16,000	225.00	3,600,000
福山通運	84,000	594.00	49,896,000
セイノーホールディングス	98,000	1,162.00	113,876,000
神奈川中央交通	16,000	509.00	8,144,000
日立物流	28,900	1,716.00	49,592,400
日本郵船	1,174,000	307.00	360,418,000
商船三井	785,000	386.00	303,010,000
川崎汽船	610,000	218.00	132,980,000
N S ユナイテッド海運	73,000	250.00	18,250,000
乾汽船	19,400	320.00	6,208,000
飯野海運	61,200	554.00	33,904,800
共栄タンカー	27,000	205.00	5,535,000
日本航空	117,200	5,420.00	635,224,000
ANAホールディングス	2,726,000	233.00	635,158,000
スカイマーク	39,300	290.00	11,397,000
パスコ	13,000	411.00	5,343,000
トランコム	4,000	3,820.00	15,280,000
日新	52,000	300.00	15,600,000
三菱倉庫	91,000	1,491.00	135,681,000
三井倉庫	70,000	440.00	30,800,000
住友倉庫	93,000	555.00	51,615,000
澁澤倉庫	33,000	348.00	11,484,000
東陽倉庫	24,000	259.00	6,216,000
日本トランスシティ	29,000	332.00	9,628,000
ケイヒン	25,000	150.00	3,750,000
中央倉庫	8,000	873.00	6,984,000
安田倉庫	10,800	1,082.00	11,685,600
東洋埠頭	40,000	230.00	9,200,000
宇徳	11,200	354.00	3,964,800
上組	165,000	933.00	153,945,000
サンリツ	3,400	513.00	1,744,200
キムラユニティー	3,100	926.00	2,870,600
キューソー流通システム	4,400	1,017.00	4,474,800
郵船ロジスティクス	12,700	1,145.00	14,541,500
近鉄エクスプレス	12,400	4,260.00	52,824,000
東海運	7,500	259.00	1,942,500
エーアイティー	5,100	748.00	3,814,800
N E C ネットエスアイ	15,000	2,405.00	36,075,000
システナ	13,300	737.00	9,802,100
デジタルアーツ	4,900	1,150.00	5,635,000
新日鉄住金ソリューションズ	11,400	2,541.00	28,967,400
キューブシステム	3,000	824.00	2,472,000
コア	5,100	736.00	3,753,600
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	857.00	3,770,800
I T ホールディングス	49,100	1,770.00	86,907,000
ネオス	2,900	1,070.00	3,103,000

電算システム	4,300	1,382.00	5,942,600
グリー	82,400	928.00	76,467,200
コーエーテクモホールディングス	27,100	1,309.00	35,473,900
三菱総合研究所	5,300	2,293.00	12,152,900
ボルテージ	2,400	1,413.00	3,391,200
電算	1,300	2,115.00	2,749,500
A G S	2,900	839.00	2,433,100
ヒト・コミュニケーションズ	1,900	1,799.00	3,418,100
ブレインパッド	1,400	1,502.00	2,102,800
K L a b	9,500	905.00	8,597,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,200	1,260.00	10,332,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,600	1,487.00	3,866,200
ネクソン	113,600	956.00	108,601,600
アイスタイル	4,500	456.00	2,052,000
エムアップ	3,300	1,173.00	3,870,900
エイチーム	1,700	7,830.00	13,311,000
e n i s h	2,600	1,738.00	4,518,800
コロプラ	23,800	2,653.00	63,141,400
モバイルクリエイト	1,500	3,450.00	5,175,000
オルトプラス	2,500	1,458.00	3,645,000
ブロードリーフ	18,000	1,801.00	32,418,000
ハーツユナイテッドグループ	3,100	2,171.00	6,730,100
ドワンゴ	15,800	2,756.00	43,544,800
ベリサーブ	800	1,738.00	1,390,400
ティーガイア	13,600	977.00	13,287,200
豆蔵ホールディングス	10,600	408.00	4,324,800
テクマトリックス	5,900	605.00	3,569,500
G M O ペイメントゲートウェイ	5,900	3,970.00	23,423,000
ザッパラス	7,600	653.00	4,962,800
インターネットイニシアティブ	20,100	2,503.00	50,310,300
ビットアイル	15,300	619.00	9,470,700
S R A ホールディングス	6,600	1,524.00	10,058,400
システムインテグレータ	1,400	798.00	1,117,200
朝日ネット	12,600	527.00	6,640,200
コムチュア	1,600	1,865.00	2,984,000
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,800	2,613.00	7,316,400
フェイス	4,100	1,007.00	4,128,700
野村総合研究所	77,500	3,350.00	259,625,000
サイバネットシステム	11,200	372.00	4,166,400
インテージホールディングス	7,400	1,307.00	9,671,800
東邦システムサイエンス	2,200	812.00	1,786,400
ソースネクスト	6,800	677.00	4,603,600
ティー・ワイ・オー	13,200	176.00	2,323,200
クレスコ	3,100	1,217.00	3,772,700
フジ・メディア・ホールディングス	132,400	1,550.00	205,220,000
オービック	47,200	3,195.00	150,804,000
ジャストシステム	18,700	940.00	17,578,000

TDCソフトウェアエンジニアリング	3,000	830.00	2,490,000	
ヤフー	981,000	490.00	480,690,000	
トレンドマイクロ	60,400	3,300.00	199,320,000	
日本オラクル	21,900	4,650.00	101,835,000	
アルファシステムズ	4,500	1,463.00	6,583,500	
フューチャーアーキテクト	16,400	582.00	9,544,800	
CAC Holdings	8,300	1,198.00	9,943,400	
ソフトバンク・テクノロジー	3,200	1,530.00	4,896,000	
トーセ	3,300	737.00	2,432,100	
オービックビジネスコンサルタント	7,000	3,250.00	22,750,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	15,500	4,195.00	65,022,500	
アイティフォー	15,200	437.00	6,642,400	
東計電算	2,400	1,404.00	3,369,600	
エクスネット	1,200	1,364.00	1,636,800	
大塚商会	12,300	14,060.00	172,938,000	
サイボウズ	20,400	385.00	7,854,000	
ソフトブレイン	18,700	136.00	2,543,200	
アグレックス	3,200	1,059.00	3,388,800	
電通国際情報サービス	8,400	1,249.00	10,491,600	
EMシステムズ	1,800	1,773.00	3,191,400	
ウェザーニューズ	4,100	2,787.00	11,426,700	
C I J	12,600	456.00	5,745,600	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,505.00	2,107,000	
日本エンタープライズ	8,500	260.00	2,210,000	
WOWOW	4,200	3,645.00	15,309,000	
日本コロムビア	6,800	614.00	4,175,200	
イマジカ・ロボットホールディングス	7,200	528.00	3,801,600	
ネットワンシステムズ	53,700	730.00	39,201,000	
アルゴグラフィックス	5,100	1,628.00	8,302,800	
マーベラスAQL	20,800	819.00	17,035,200	
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,200	1,676.00	42,235,200	
日本ユニシス	33,100	897.00	29,690,700	
兼松エレクトロニクス	8,600	1,399.00	12,031,400	
東京放送ホールディングス	73,800	1,181.00	87,157,800	
日本テレビホールディングス	136,300	1,648.00	224,622,400	
テレビ朝日ホールディングス	34,700	1,782.00	61,835,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	103,900	546.00	56,729,400	
テレビ東京ホールディングス	11,200	1,501.00	16,811,200	
コネクシオ	12,000	868.00	10,416,000	
クロップス	900	507.00	456,300	
日本電信電話	537,900	6,046.00	3,252,143,400	代用有価証券で 200,000株 担保差入
KDDI	424,900	5,870.00	2,494,163,000	
光通信	12,300	7,800.00	95,940,000	
NTTドコモ	1,127,900	1,732.00	1,953,522,800	
GMOインターネット	45,700	1,108.00	50,635,600	
学研ホールディングス	46,000	282.00	12,972,000	
ゼンリン	18,100	1,155.00	20,905,500	



昭文社	8,200	628.00	5,149,600	
KADOKAWA	13,900	3,265.00	45,383,500	
インプレスホールディングス	9,700	125.00	1,212,500	
アイネット	5,700	752.00	4,286,400	
松竹	90,000	891.00	80,190,000	
東宝	97,700	2,250.00	219,825,000	
東映	57,000	561.00	31,977,000	
AOI Pro.	6,300	647.00	4,076,100	
エヌ・ティ・ティ・データ	96,600	3,780.00	365,148,000	
DTS	13,000	1,760.00	22,880,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,800	1,642.00	81,771,600	
シーイーシー	8,100	661.00	5,354,100	
カプコン	35,000	1,711.00	59,885,000	
ジャステック	8,700	736.00	6,403,200	
SCSK	32,600	2,691.00	87,726,600	
日本システムウエア	5,100	567.00	2,891,700	
アイネス	18,600	679.00	12,629,400	
TKC	11,500	2,244.00	25,806,000	
富士ソフト	17,400	2,160.00	37,584,000	
NSD	29,000	1,382.00	40,078,000	
コナミ	61,800	2,268.00	140,162,400	
福井コンピュータホールディングス	1,900	845.00	1,605,500	
JBCCHホールディングス	11,400	762.00	8,686,800	
ミロク情報サービス	9,000	429.00	3,861,000	
ソフトバンク	672,200	7,559.00	5,081,159,800	
ハウスイ	11,000	129.00	1,419,000	
高千穂交易	5,800	1,015.00	5,887,000	
伊藤忠食品	3,400	3,445.00	11,713,000	
エレマテック	6,400	1,865.00	11,936,000	
JALUX	3,900	1,131.00	4,410,900	
あらた	31,000	329.00	10,199,000	
トーメンデバイス	2,100	1,745.00	3,664,500	
東京エレクトロン デバイス	2,800	1,366.00	3,824,800	
双日	916,300	168.00	153,938,400	
アルフレッサ ホールディングス	40,500	6,250.00	253,125,000	
横浜冷凍	34,000	787.00	26,758,000	
山下医科器械	1,100	1,773.00	1,950,300	
ラサ商事	6,000	470.00	2,820,000	
アルコニックス	4,100	2,515.00	10,311,500	
神戸物産	1,900	3,095.00	5,880,500	
あい ホールディングス	22,000	1,673.00	36,806,000	
ダイワボウホールディングス	124,000	193.00	23,932,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,800	779.00	20,098,200	
八洲電機	10,700	457.00	4,889,900	
UKCホールディングス	8,800	1,606.00	14,132,800	
TOKAIホールディングス	67,000	387.00	25,929,000	
三洋貿易	8,200	1,039.00	8,519,800	
ミタチ産業	3,300	619.00	2,042,700	

シップヘルスケアホールディングス	19,700	3,495.00	68,851,500
スターティア	1,200	1,553.00	1,863,600
富士興産	5,000	660.00	3,300,000
協栄産業	17,000	184.00	3,128,000
小野建	12,000	1,147.00	13,764,000
佐島電機	10,900	649.00	7,074,100
エコートレーディング	3,500	698.00	2,443,000
伯東	8,400	970.00	8,148,000
コンドーテック	11,300	695.00	7,853,500
中山福	7,900	837.00	6,612,300
ナガイレーベン	19,800	2,057.00	40,728,600
三菱食品	15,000	2,420.00	36,300,000
松田産業	10,000	1,232.00	12,320,000
メディバルホールディングス	137,000	1,401.00	191,937,000
アドヴァン	7,000	1,085.00	7,595,000
S P K	3,200	1,879.00	6,012,800
アズワン	8,900	3,195.00	28,435,500
スズデン	5,000	604.00	3,020,000
尾家産業	4,500	825.00	3,712,500
シモジマ	9,500	1,059.00	10,060,500
ドウシシャ	14,500	1,679.00	24,345,500
高速	8,200	910.00	7,462,000
黒田電気	21,900	1,490.00	32,631,000
丸文	12,200	583.00	7,112,600
ハピネット	8,300	1,709.00	14,184,700
トーメンエレクトロニクス	7,600	1,647.00	12,517,200
エクセル	6,300	1,903.00	11,988,900
マルカキカイ	4,500	1,374.00	6,183,000
ガリバーインターナショナル	46,100	859.00	39,599,900
日本エム・ディ・エム	11,700	288.00	3,369,600
進和	8,100	1,250.00	10,125,000
エスケイジャパン	3,500	249.00	871,500
ダイトエレクトロン	6,400	395.00	2,528,000
シークス	8,700	1,606.00	13,972,200
田中商事	4,300	602.00	2,588,600
オーハシテクニカ	7,100	952.00	6,759,200
マクニカ	7,000	3,055.00	21,385,000
白銅	4,500	925.00	4,162,500
伊藤忠商事	1,092,100	1,229.00	1,342,190,900
丸紅	1,198,000	714.00	855,372,000
高島	26,000	240.00	6,240,000
長瀬産業	77,500	1,220.00	94,550,000
蝶理	8,800	1,163.00	10,234,400
豊田通商	152,500	2,712.00	413,580,000
三共生興	23,400	398.00	9,313,200
兼松	291,000	171.00	49,761,000
ツカモトコーポレーション	25,000	133.00	3,325,000
三井物産	1,237,900	1,549.00	1,917,507,100
日本紙パルプ商事	71,000	346.00	24,566,000

日立ハイテクノロジー	41,600	2,412.00	100,339,200
カメイ	17,900	759.00	13,586,100
東都水産	25,000	195.00	4,875,000
OUGホールディングス	20,000	207.00	4,140,000
スターゼン	49,000	277.00	13,573,000
山善	52,600	715.00	37,609,000
椿本興業	16,000	283.00	4,528,000
住友商事	807,900	1,344.00	1,085,817,600
内田洋行	34,000	318.00	10,812,000
三菱商事	1,068,200	2,039.00	2,178,059,800
第一実業	31,000	479.00	14,849,000
キャノンマーケティングジャパン	39,100	1,864.00	72,882,400
西華産業	45,000	250.00	11,250,000
佐藤商事	12,300	672.00	8,265,600
菱洋エレクトロ	15,800	1,180.00	18,644,000
東京産業	13,800	404.00	5,575,200
ユアサ商事	140,000	209.00	29,260,000
神鋼商事	35,000	236.00	8,260,000
小林産業	9,300	291.00	2,706,300
阪和興業	137,000	392.00	53,704,000
カナデン	14,000	707.00	9,898,000
菱電商事	20,000	719.00	14,380,000
フルサト工業	7,600	1,202.00	9,135,200
岩谷産業	152,000	602.00	91,504,000
すてきナイスグループ	58,000	201.00	11,658,000
昭光通商	44,000	144.00	6,336,000
ニチモウ	22,000	170.00	3,740,000
極東貿易	16,000	199.00	3,184,000
イワキ	21,000	201.00	4,221,000
三愛石油	32,000	803.00	25,696,000
稲畑産業	33,800	910.00	30,758,000
G S Iクレオス	37,000	135.00	4,995,000
明和産業	12,800	486.00	6,220,800
ワキタ	26,900	1,273.00	34,243,700
東邦ホールディングス	43,900	1,923.00	84,419,700
サンゲツ	24,300	2,649.00	64,370,700
ミツウロコグループホールディングス	22,100	560.00	12,376,000
シナネン	30,000	396.00	11,880,000
伊藤忠エネクス	30,300	688.00	20,846,400
サンリオ	34,500	3,010.00	103,845,000
サンワテクノス	7,400	997.00	7,377,800
リョーサン	20,400	2,019.00	41,187,600
新光商事	15,100	914.00	13,801,400
トーヨー	29,000	377.00	10,933,000
三信電気	16,500	715.00	11,797,500
東陽テクニカ	20,100	1,164.00	23,396,400
モスフードサービス	18,000	2,122.00	38,196,000
加賀電子	12,400	1,207.00	14,966,800
ソーダニッカ	14,000	444.00	6,216,000

立花エレテック	8,400	1,227.00	10,306,800
P a l t a c	19,200	1,372.00	26,342,400
ヤマタネ	68,000	173.00	11,764,000
丸紅建材リース	12,000	208.00	2,496,000
日鉄住金物産	90,000	383.00	34,470,000
トラスコ中山	15,700	2,379.00	37,350,300
オートバックスセブン	48,100	1,668.00	80,230,800
加藤産業	19,800	2,117.00	41,916,600
イノテック	12,700	505.00	6,413,500
イエローハット	11,900	2,231.00	26,548,900
富士エレクトロニクス	7,100	1,247.00	8,853,700
J Kホールディングス	12,500	537.00	6,712,500
日伝	6,200	2,398.00	14,867,600
北沢産業	11,700	176.00	2,059,200
杉本商事	7,400	975.00	7,215,000
因幡電機産業	18,900	3,230.00	61,047,000
バイテック	4,700	763.00	3,586,100
ミスミグループ本社	54,900	2,729.00	149,822,100
江守グループホールディングス	5,900	1,791.00	10,566,900
アルテック	6,700	242.00	1,621,400
タキヒヨー	23,000	413.00	9,499,000
スズケン	56,700	3,585.00	203,269,500
ジェコス	9,500	1,032.00	9,804,000
ローソン	56,200	7,320.00	411,384,000
サンエー	10,300	3,050.00	31,415,000
キリン堂	4,900	654.00	3,204,600
ダイユーエイト	2,800	660.00	1,848,000
カワチ薬品	9,500	1,863.00	17,698,500
エービーシー・マート	19,500	5,300.00	103,350,000
ハードオフコーポレーション	6,600	857.00	5,656,200
アスクル	14,200	2,693.00	38,240,600
ゲオホールディングス	23,400	831.00	19,445,400
アダストリアホールディングス	10,500	2,444.00	25,662,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	17,000	169.00	2,873,000
くらコーポレーション	8,000	2,342.00	18,736,000
キャンドゥ	6,500	1,553.00	10,094,500
パル	8,000	2,420.00	19,360,000
エディオン	62,700	712.00	44,642,400
サーラコーポレーション	11,800	545.00	6,431,000
ワッツ	5,400	964.00	5,205,600
あみやき亭	2,400	3,210.00	7,704,000
ひらまつ	16,800	632.00	10,617,600
ゲンキー	1,300	2,751.00	3,576,300
大黒天物産	3,300	2,568.00	8,474,400
ハニーズ	10,800	943.00	10,184,400
アルペン	12,200	1,766.00	21,545,200
クオール	10,000	597.00	5,970,000
ジェイアイエヌ	9,300	2,853.00	26,532,900
ビックカメラ	59,400	767.00	45,559,800

DCMホールディングス	66,300	714.00	47,338,200	
MonotaRO	21,200	2,495.00	52,894,000	
J・フロントリテイリング	323,000	710.00	229,330,000	
ドトール・日レスホールディングス	24,000	1,775.00	42,600,000	
マツモトキヨシホールディングス	28,200	3,685.00	103,917,000	
ブロンコビリー	2,100	2,507.00	5,264,700	
スタートトゥデイ	42,600	2,511.00	106,968,600	
物語コーポレーション	3,400	3,105.00	10,557,000	
ココカラファイン	14,300	2,936.00	41,984,800	
三越伊勢丹ホールディングス	272,100	1,316.00	358,083,600	
ウエルシアホールディングス	6,200	6,180.00	38,316,000	
クリエイトSDホールディングス	5,800	3,375.00	19,575,000	
丸善CHIホールディングス	12,000	327.00	3,924,000	
エー・ピーカンパニー	1,600	2,012.00	3,219,200	
チムニー	5,000	2,255.00	11,275,000	
ジョイフル本田	7,500	4,810.00	36,075,000	
ブックオフコーポレーション	7,600	758.00	5,760,800	
あさひ	7,900	1,355.00	10,704,500	
日本調剤	1,730	2,637.00	4,562,010	
コスモス薬品	7,800	10,900.00	85,020,000	
トーエル	7,300	586.00	4,277,800	
一六堂	2,900	458.00	1,328,200	
セブン&アイ・ホールディングス	572,700	4,119.00	2,358,951,300	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2,300	2,925.00	6,727,500	
ツルハホールディングス	26,900	5,380.00	144,722,000	
サンマルクホールディングス	4,400	5,050.00	22,220,000	
フェリシモ	3,900	1,034.00	4,032,600	
トリドール	11,900	912.00	10,852,800	
クスリのアオキ	6,100	3,680.00	22,448,000	
メディカルシステムネットワーク	11,200	365.00	4,088,000	
総合メディカル	3,300	4,335.00	14,305,500	
はるやま商事	5,700	714.00	4,069,800	
カップ・クリエイトホールディングス	20,100	990.00	19,899,000	
ライトオン	10,200	720.00	7,344,000	
良品計画	14,500	11,200.00	162,400,000	
三城ホールディングス	16,900	483.00	8,162,700	
コナカ	16,100	703.00	11,318,300	
ハウスオブローゼ	1,500	1,366.00	2,049,000	
G-7ホールディングス	4,000	802.00	3,208,000	
イオン北海道	10,100	598.00	6,039,800	
コジマ	20,200	315.00	6,363,000	
ヒマラヤ	3,200	1,101.00	3,523,200	
コーナン商事	17,900	1,018.00	18,222,200	
エコス	4,700	690.00	3,243,000	
ワタミ	16,200	1,323.00	21,432,600	
マルシェ	3,300	831.00	2,742,300	
ドンキホーテホールディングス	47,300	5,770.00	272,921,000	
西松屋チェーン	27,000	803.00	21,681,000	

ゼンショーホールディングス	62,800	990.00	62,172,000	
幸楽苑	8,500	1,338.00	11,373,000	
ハークスレイ	3,800	792.00	3,009,600	
サイゼリヤ	20,300	1,272.00	25,821,600	
ポプラ	5,000	544.00	2,720,000	
ユナイテッドアローズ	17,900	4,070.00	72,853,000	
ハイデイ日高	8,600	2,241.00	19,272,600	
京都きもの友禅	9,100	1,019.00	9,272,900	
コロワイド	45,400	1,135.00	51,529,000	
壱番屋	5,500	4,065.00	22,357,500	
トップカルチャー	5,000	460.00	2,300,000	
P L A N T	3,500	998.00	3,493,000	
スギホールディングス	24,500	4,620.00	113,190,000	
スクロール	17,800	264.00	4,699,200	
ヨンドシーホールディングス	10,400	1,918.00	19,947,200	
ファミリーマート	46,300	4,345.00	201,173,500	
木曽路	16,700	1,883.00	31,446,100	
サトレストランシステムズ	12,800	780.00	9,984,000	
千趣会	24,600	881.00	21,672,600	
タカキュー	10,600	205.00	2,173,000	
ケーヨー	23,300	474.00	11,044,200	
上新電機	30,000	900.00	27,000,000	
日本瓦斯	20,400	2,040.00	41,616,000	
ベスト電器	44,100	150.00	6,615,000	
マルエツ	29,000	362.00	10,498,000	
ロイヤルホールディングス	22,900	1,620.00	37,098,000	
東天紅	10,000	177.00	1,770,000	
いなげや	15,300	1,008.00	15,422,400	
島忠	33,200	2,310.00	76,692,000	
チヨダ	16,100	2,212.00	35,613,200	
ライフコーポレーション	11,100	1,644.00	18,248,400	
カスミ	28,200	717.00	20,219,400	
リンガーハット	13,300	1,544.00	20,535,200	
M r M a x	13,700	328.00	4,493,600	
テンアライド	10,300	314.00	3,234,200	
A O K Iホールディングス	23,600	1,430.00	33,748,000	
オークワ	22,000	955.00	21,010,000	
コメリ	21,100	2,767.00	58,383,700	
青山商事	34,400	2,726.00	93,774,400	
しまむら	15,900	9,960.00	158,364,000	
C F Sコーポレーション	9,200	481.00	4,425,200	
はせがわ	4,800	576.00	2,764,800	
高島屋	185,000	992.00	183,520,000	
松屋	29,000	1,053.00	30,537,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	112,650	765.00	86,177,250	
近鉄百貨店	52,000	360.00	18,720,000	
ニッセンホールディングス	27,400	389.00	10,658,600	
パルコ	13,100	816.00	10,689,600	
丸井グループ	178,500	934.00	166,719,000	

アクシアル リテイリング	7,600	1,600.00	12,160,000
ダイエー	84,500	304.00	25,688,000
イオン	546,900	1,228.00	671,593,200
ユニーグループ・ホールディングス	131,200	642.00	84,230,400
イズミ	30,600	3,140.00	96,084,000
東武ストア	18,000	267.00	4,806,000
平和堂	27,800	1,466.00	40,754,800
フジ	15,300	2,033.00	31,104,900
ヤオコー	6,900	5,000.00	34,500,000
ゼビオ	16,500	1,998.00	32,967,000
ケーズホールディングス	28,900	3,005.00	86,844,500
Olympicグループ	8,100	1,006.00	8,148,600
日産東京販売ホールディングス	20,000	328.00	6,560,000
アインファーマシーズ	7,600	4,585.00	34,846,000
元気寿司	4,200	1,720.00	7,224,000
ヤマダ電機	541,100	377.00	203,994,700
アークランドサカモト	8,900	2,045.00	18,200,500
ニトリホールディングス	54,200	5,010.00	271,542,000
グルメ杵屋	10,000	774.00	7,740,000
愛眼	10,900	267.00	2,910,300
ケーユーホールディングス	5,700	616.00	3,511,200
吉野家ホールディングス	37,100	1,323.00	49,083,300
松屋フーズ	6,600	1,842.00	12,157,200
サガミチェーン	17,000	946.00	16,082,000
関西スーパーマーケット	10,200	821.00	8,374,200
王将フードサービス	9,000	4,305.00	38,745,000
プレナス	15,300	2,257.00	34,532,100
ミニストップ	10,200	1,567.00	15,983,400
アークス	23,300	2,071.00	48,254,300
パロー	29,500	1,587.00	46,816,500
藤久	1,100	1,675.00	1,842,500
ベルク	6,700	2,215.00	14,840,500
大庄	7,300	1,314.00	9,592,200
ファーストリテイリング	27,400	34,335.00	940,779,000
サンドラッグ	28,900	4,680.00	135,252,000
東京デリカ	6,900	1,791.00	12,357,900
ヤマザワ	3,200	1,590.00	5,088,000
やまや	2,800	1,888.00	5,286,400
ベルーナ	34,200	503.00	17,202,600
島根銀行	2,900	1,292.00	3,746,800
じもとホールディングス	98,200	208.00	20,425,600
足利ホールディングス	71,800	390.00	28,002,000
新生銀行	1,184,000	214.00	253,376,000
あおぞら銀行	711,000	319.00	226,809,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,370,000	602.00	6,242,740,000
りそなホールディングス	1,301,200	542.00	705,250,400
三井住友トラスト・ホールディングス	2,689,000	442.00	1,188,538,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,035,300	4,205.00	4,353,436,500
第四銀行	173,000	363.00	62,799,000

北越銀行	148,000	208.00	30,784,000	
西日本シティ銀行	480,000	228.00	109,440,000	
千葉銀行	528,000	683.00	360,624,000	
横浜銀行	890,000	567.00	504,630,000	
常陽銀行	510,000	512.00	261,120,000	
群馬銀行	307,000	552.00	169,464,000	
武蔵野銀行	21,800	3,425.00	74,665,000	
千葉興業銀行	28,400	714.00	20,277,600	
筑波銀行	56,900	346.00	19,687,400	
東京都民銀行	24,100	1,148.00	27,666,800	
七十七銀行	215,000	498.00	107,070,000	
青森銀行	100,000	287.00	28,700,000	
秋田銀行	94,000	275.00	25,850,000	
山形銀行	83,000	460.00	38,180,000	
岩手銀行	9,000	4,540.00	40,860,000	
東邦銀行	122,000	370.00	45,140,000	
東北銀行	70,000	149.00	10,430,000	
みちのく銀行	73,000	210.00	15,330,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	555,000	451.00	250,305,000	
静岡銀行	401,000	1,014.00	406,614,000	
十六銀行	171,000	353.00	60,363,000	
スルガ銀行	133,000	1,837.00	244,321,000	
八十二銀行	252,000	587.00	147,924,000	
山梨中央銀行	87,000	452.00	39,324,000	
大垣共立銀行	171,000	277.00	47,367,000	
福井銀行	117,000	238.00	27,846,000	
北國銀行	152,000	335.00	50,920,000	
清水銀行	4,700	2,683.00	12,610,100	
滋賀銀行	129,000	575.00	74,175,000	
南都銀行	132,000	404.00	53,328,000	
百五銀行	123,000	402.00	49,446,000	
京都銀行	261,000	866.00	226,026,000	
紀陽銀行	53,700	1,265.00	67,930,500	
三重銀行	57,000	224.00	12,768,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	931,000	205.00	190,855,000	
広島銀行	404,000	462.00	186,648,000	
山陰合同銀行	84,000	718.00	60,312,000	
中国銀行	98,500	1,458.00	143,613,000	
鳥取銀行	44,000	194.00	8,536,000	
伊予銀行	146,400	969.00	141,861,600	
百十四銀行	150,000	351.00	52,650,000	
四国銀行	99,000	226.00	22,374,000	
阿波銀行	112,000	563.00	63,056,000	
鹿児島銀行	95,000	653.00	62,035,000	
大分銀行	84,000	376.00	31,584,000	
宮崎銀行	91,000	330.00	30,030,000	
肥後銀行	112,000	527.00	59,024,000	
佐賀銀行	83,000	226.00	18,758,000	
十八銀行	85,000	259.00	22,015,000	



沖縄銀行	10,200	4,430.00	45,186,000
琉球銀行	26,500	1,409.00	37,338,500
八千代銀行	6,500	3,070.00	19,955,000
セブン銀行	512,900	393.00	201,569,700
みずほフィナンシャルグループ	17,767,900	206.00	3,660,187,400
高知銀行	53,000	151.00	8,003,000
山口フィナンシャルグループ	137,000	998.00	136,726,000
長野銀行	45,000	181.00	8,145,000
名古屋銀行	124,000	387.00	47,988,000
北洋銀行	206,200	408.00	84,129,600
愛知銀行	4,900	5,040.00	24,696,000
第三銀行	77,000	177.00	13,629,000
中京銀行	56,000	186.00	10,416,000
東日本銀行	60,000	250.00	15,000,000
大光銀行	48,000	221.00	10,608,000
愛媛銀行	80,000	239.00	19,120,000
トマト銀行	53,000	174.00	9,222,000
みなと銀行	124,000	177.00	21,948,000
京葉銀行	113,000	475.00	53,675,000
関西アーバン銀行	191,000	119.00	22,729,000
栃木銀行	69,000	422.00	29,118,000
北日本銀行	4,300	2,562.00	11,016,600
東和銀行	167,000	96.00	16,032,000
福島銀行	168,000	84.00	14,112,000
大東銀行	88,000	113.00	9,944,000
トモニホールディングス	105,000	433.00	45,465,000
フィデアホールディングス	78,800	194.00	15,287,200
池田泉州ホールディングス	102,700	489.00	50,220,300
F P G	12,200	900.00	10,980,000
S B I ホールディングス	165,200	1,178.00	194,605,600
ジャフコ	19,000	4,295.00	81,605,000
大和証券グループ本社	1,356,000	843.00	1,143,108,000
野村ホールディングス	2,798,900	679.00	1,900,453,100
岡三証券グループ	108,000	824.00	88,992,000
丸三証券	40,800	777.00	31,701,600
東洋証券	55,000	304.00	16,720,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	145,100	755.00	109,550,500
光世証券	37,000	227.00	8,399,000
水戸証券	41,500	383.00	15,894,500
いちよし証券	26,900	1,405.00	37,794,500
松井証券	69,700	1,056.00	73,603,200
だいこう証券ビジネス	7,900	671.00	5,300,900
マネックスグループ	148,900	362.00	53,901,800
カブドットコム証券	53,300	477.00	25,424,100
極東証券	17,000	1,653.00	28,101,000
岩井コスモホールディングス	13,000	1,125.00	14,625,000
マネースクウェア・ジャパン	4,200	1,126.00	4,729,200
マネーパートナーズグループ	14,300	251.00	3,589,300

N K S Jホールディングス	304,100	2,846.00	865,468,600	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	409,100	2,494.00	1,020,295,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	131,100	1,782.00	233,620,200	
第一生命保険	689,100	1,505.00	1,037,095,500	
東京海上ホールディングス	530,200	3,357.00	1,779,881,400	
T & Dホールディングス	469,600	1,353.00	635,368,800	
全国保証	35,900	2,645.00	94,955,500	
クレディセゾン	114,300	1,993.00	227,799,900	
芙蓉総合リース	15,300	4,050.00	61,965,000	
興銀リース	25,900	2,541.00	65,811,900	
東京センチュリーリース	32,900	3,200.00	105,280,000	
日本証券金融	69,300	620.00	42,966,000	
ポケットカード	25,400	723.00	18,364,200	
リコーリース	10,600	2,725.00	28,885,000	
イオンフィナンシャルサービス	81,000	2,661.00	215,541,000	
アコム	295,000	397.00	117,115,000	
ジャックス	95,000	467.00	44,365,000	
オリエントコーポレーション	332,700	231.00	76,853,700	
日立キャピタル	29,300	2,611.00	76,502,300	
アプラスフィナンシャル	118,700	136.00	16,143,200	
オリックス	854,600	1,629.00	1,392,143,400	
三菱U F Jリース	351,100	550.00	193,105,000	
日本取引所グループ	204,500	2,370.00	484,665,000	
イー・ギャランティ	6,300	2,163.00	13,626,900	
アサックス	2,400	1,202.00	2,884,800	
N E Cキャピタルソリューション	8,600	1,742.00	14,981,200	
日本駐車場開発	149,200	123.00	18,351,600	
ヒューリック	231,100	1,362.00	314,758,200	
東京建物不動産販売	7,100	409.00	2,903,900	
三栄建築設計	5,600	856.00	4,793,600	
野村不動産ホールディングス	90,500	1,941.00	175,660,500	
プレサンスコーポレーション	3,300	2,949.00	9,731,700	
常和ホールディングス	4,800	3,790.00	18,192,000	
フージャースホールディングス	20,500	508.00	10,414,000	
オープンハウス	8,500	2,366.00	20,111,000	
東急不動産ホールディングス	303,700	805.00	244,478,500	
飯田グループホールディングス	60,000	1,468.00	88,080,000	
パーク24	71,900	1,929.00	138,695,100	
パラカ	5,100	745.00	3,799,500	
三井不動産	645,000	3,395.00	2,189,775,000	
三菱地所	958,000	2,504.00	2,398,832,000	
平和不動産	27,600	1,629.00	44,960,400	
東京建物	280,000	986.00	276,080,000	
ダイビル	40,300	1,002.00	40,380,600	
京阪神ビルディング	22,800	531.00	12,106,800	
住友不動産	328,000	4,480.00	1,469,440,000	
大京	230,000	213.00	48,990,000	
テーオーシー	47,200	686.00	32,379,200	

東京楽天地	23,000	493.00	11,339,000
レオパレス21	157,500	458.00	72,135,000
フジ住宅	17,600	582.00	10,243,200
空港施設	16,600	707.00	11,736,200
明和地所	6,700	437.00	2,927,900
住友不動産販売	9,900	3,040.00	30,096,000
ゴールドクレスト	10,800	2,071.00	22,366,800
日本エスリード	5,400	1,015.00	5,481,000
日神不動産	18,300	387.00	7,082,100
タカラレーベン	45,000	351.00	15,795,000
サンヨーハウジング名古屋	7,800	1,025.00	7,995,000
イオンモール	88,400	2,580.00	228,072,000
ファースト住建	5,100	1,319.00	6,726,900
トーセイ	18,800	724.00	13,611,200
穴吹興産	13,000	338.00	4,394,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	85,100	1,080.00	91,908,000
サンフロンティア不動産	12,900	1,125.00	14,512,500
エフ・ジェー・ネクスト	7,400	481.00	3,559,400
ランドビジネス	6,900	405.00	2,794,500
グランディハウス	10,800	357.00	3,855,600
日本空港ビルデング	47,300	2,796.00	132,250,800
日本工営	49,000	500.00	24,500,000
ネクスト	12,300	890.00	10,947,000
日本M&Aセンター	22,400	2,616.00	58,598,400
ノバレーゼ	3,700	959.00	3,548,300
アコーディア・ゴルフ	59,100	1,300.00	76,830,000
タケエイ	10,100	1,074.00	10,847,400
トラスト・テック	2,500	1,721.00	4,302,500
パソナグループ	11,000	541.00	5,951,000
CDS	3,000	1,039.00	3,117,000
リンクアンドモチベーション	19,200	172.00	3,302,400
GCAサヴィアン	8,700	851.00	7,403,700
エス・エム・エス	8,200	2,733.00	22,410,600
テンプホールディングス	31,700	3,245.00	102,866,500
リニカル	3,900	937.00	3,654,300
クックパッド	7,200	2,598.00	18,705,600
エスクリ	5,300	875.00	4,637,500
アイ・ケイ・ケイ	3,200	828.00	2,649,600
学情	5,200	790.00	4,108,000
スタジオアリス	6,000	1,524.00	9,144,000
シミックホールディングス	5,600	1,546.00	8,657,600
総合警備保障	52,800	2,524.00	133,267,200
カカクコム	88,000	1,793.00	157,784,000
ルネサンス	6,500	845.00	5,492,500
ディップ	3,400	2,557.00	8,693,800
オプト	7,800	780.00	6,084,000
ツクイ	16,000	935.00	14,960,000
総合臨床ホールディングス	6,600	490.00	3,234,000
キャリアデザインセンター	4,900	932.00	4,566,800

エムスリー	97,500	1,628.00	158,730,000
ベストブライダル	8,500	632.00	5,372,000
アウトソーシング	6,900	1,494.00	10,308,600
ディー・エヌ・エー	78,000	1,490.00	116,220,000
博報堂DYホールディングス	200,900	943.00	189,448,700
ぐるなび	20,200	1,632.00	32,966,400
一休	10,400	1,274.00	13,249,600
ジャパンベストレスキューシステム	11,900	370.00	4,403,000
ファンコミュニケーションズ	24,900	1,516.00	37,748,400
ジェイコムホールディングス	3,000	722.00	2,166,000
PGMホールディングス	20,500	1,065.00	21,832,500
WDBホールディングス	1,700	1,328.00	2,257,600
バリューコマース	9,100	1,005.00	9,145,500
J Pホールディングス	32,600	420.00	13,692,000
イーピーエス	17,200	1,181.00	20,313,200
プレステージ・インターナショナル	10,000	877.00	8,770,000
アミューズ	4,000	1,825.00	7,300,000
ドリームインキュベータ	3,900	1,613.00	6,290,700
TAC	7,700	293.00	2,256,100
ケネディクス	173,200	458.00	79,325,600
電通	136,700	4,235.00	578,924,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,600	1,418.00	9,358,800
ぴあ	4,300	1,728.00	7,430,400
イオンファンタジー	4,700	1,254.00	5,893,800
ネクシィーズ	6,000	975.00	5,850,000
みらかホールディングス	38,100	4,850.00	184,785,000
アルプス技研	5,900	1,076.00	6,348,400
サニックス	21,100	1,442.00	30,426,200
ダイオーズ	2,600	867.00	2,254,200
日本空調サービス	7,100	732.00	5,197,200
オリエンタルランド	39,200	17,045.00	668,164,000
ダスキン	38,300	1,887.00	72,272,100
明光ネットワークジャパン	14,500	1,259.00	18,255,500
ファルコSDホールディングス	7,500	1,017.00	7,627,500
秀英予備校	4,600	321.00	1,476,600
田谷	2,200	762.00	1,676,400
ラウンドワン	42,200	669.00	28,231,800
リゾートトラスト	49,200	1,879.00	92,446,800
ビー・エム・エル	9,500	3,945.00	37,477,500
ワタベウェディング	4,700	598.00	2,810,600
もしもしホットライン	27,100	993.00	26,910,300
早稲田アカデミー	2,200	773.00	1,700,600
ユー・エス・エス	175,400	1,695.00	297,303,000
東京個別指導学院	7,700	347.00	2,671,900
楽天	628,500	1,263.00	793,795,500
テー・オー・ダブリュー	4,800	711.00	3,412,800
セントラルスポーツ	4,500	1,547.00	6,961,500
フルキャストホールディングス	13,300	412.00	5,479,600
リゾートソリューション	12,000	232.00	2,784,000

リブセンス	8,100	1,181.00	9,566,100	
ジャパンマテリアル	1,700	2,493.00	4,238,100	
サクセスホールディングス	1,200	1,678.00	2,013,600	
アサンテ	2,800	1,230.00	3,444,000	
E R Iホールディングス	3,400	1,203.00	4,090,200	
リロ・ホールディング	5,500	6,370.00	35,035,000	
東祥	3,100	1,785.00	5,533,500	
エイチ・アイ・エス	23,600	3,010.00	71,036,000	
共立メンテナンス	7,200	3,915.00	28,188,000	
イチネンホールディングス	16,100	743.00	11,962,300	
建設技術研究所	8,600	1,084.00	9,322,400	
スペース	7,100	1,040.00	7,384,000	
燦ホールディングス	2,900	1,388.00	4,025,200	
スバル興業	10,000	375.00	3,750,000	
東京テアトル	55,000	139.00	7,645,000	
よみうりランド	32,000	454.00	14,528,000	
東京都競馬	112,000	317.00	35,504,000	
カナモト	18,500	3,790.00	70,115,000	
東京ドーム	110,000	509.00	55,990,000	
西尾レントオール	11,700	4,010.00	46,917,000	
トランス・コスモス	19,000	2,113.00	40,147,000	
乃村工藝社	28,600	807.00	23,080,200	
藤田観光	37,000	365.00	13,505,000	
K N T - C Tホールディングス	46,000	180.00	8,280,000	
日本管財	6,200	2,404.00	14,904,800	
トーカイ	6,400	2,619.00	16,761,600	
白洋舎	16,000	241.00	3,856,000	
セコム	150,700	6,378.00	961,164,600	
セントラル警備保障	6,400	1,043.00	6,675,200	
丹青社	18,300	499.00	9,131,700	
メイテック	19,600	3,295.00	64,582,000	
アサツー ディ・ケイ	25,500	2,532.00	64,566,000	
応用地質	13,900	1,605.00	22,309,500	
船井総合研究所	14,900	862.00	12,843,800	
進学会	6,100	362.00	2,208,200	
ベネッセホールディングス	48,600	4,260.00	207,036,000	
イオンディライト	14,000	2,457.00	34,398,000	
ナック	7,300	1,478.00	10,789,400	
ニチイ学館	31,600	894.00	28,250,400	
ダイセキ	21,400	1,819.00	38,926,600	
ステップ	4,900	776.00	3,802,400	
合計	224,627,680	-	243,241,754,160	

(注)代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

#### B. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表  
 該当事項はありません。

商品明細表  
 該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表  
 該当事項はありません。

借入金明細表  
 該当事項はありません。

## 日本債券マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成26年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,512,083,564
国債証券	279,775,065,790
地方債証券	22,262,584,026
特殊債券	30,964,876,082
社債券	21,121,135,640
派生商品評価勘定	248,380
未収入金	39,352
未収利息	1,314,867,420
前払費用	29,383,949
流動資産合計	356,980,284,203
資産合計	356,980,284,203
負債の部	
流動負債	
未払解約金	462,397,921
流動負債合計	462,397,921
負債合計	462,397,921
純資産の部	
元本等	
元本	282,952,145,016
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,565,741,266

元本等合計	356,517,886,282
純資産合計	356,517,886,282
負債純資産合計	356,980,284,203

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 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、特殊債券及び社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	340,407,543,738円
計算期間中の追加設定元本額	26,821,456,895円
計算期間中の一部解約元本額	84,276,855,617円
計算日の元本額	282,952,145,016円
計算日の元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	3,644,301,317円
DC日本債券インデックスファンド	2,235,528,991円
DC日本債券インデックスファンドL	27,314,578,186円
DCバランスファンド30	2,535,617,797円
DCバランスファンド50	1,708,423,688円
DCバランスファンド70	482,334,255円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	118,335,496円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	59,131,580円
日本債券インデックスファンド(SMA専用)	356,921,751円
新生・4分散ファンド	113,201,307円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	22,303,611円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	84,197,154円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	170,980,237円
日本債券インデックスe	1,283,788,277円
インデックスコレクション(国内債券)	3,027,883,703円

インデックスコレクション(バランス株式30)	2,099,871,670円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,247,164,316円
インデックスコレクション(バランス株式70)	553,732,987円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	45,558,210,965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)	715,254,973円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	4,676,838,057円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	17,211,344,736円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	11,396,687,698円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	891,375,932円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	5,165,677,533円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	10,810,173,367円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,319,472,856円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	25,243,140,954円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	235,563,612円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	27,045,734,042円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	5,546,085,473円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	471,232,109円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,555,668,398円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	996,134,335円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	5,402,824,301円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	822,841,045円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,557,679,092円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,244,281,011円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	4,291,736,467円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	6,613,686,272円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	502,288,860円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	3,332,737,430円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	48,613,396,206円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,122,126,156円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	259,497,544円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	110,203,375円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,156,362,931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)	10,889,979円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	14,702,984円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券 105,961,000円
3. 計算日における受益権総数	282,952,145,016口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2600円 (12,600円)



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。

	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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26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	984,885,390	
地方債証券	57,407,728	
特殊債券	77,172,917	
社債券	84,515,590	
合計	1,203,981,625	

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成26年1月23日から平成26年6月10日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
- 債券関連

区分	種類	平成26年 6月10日現在			
		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	725,901,620	-	726,150,000	248,380
	合計	725,901,620	-	726,150,000	248,380

## (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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## 附属明細表

(平成26年6月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 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330回利付国債(2年)	760,000,000	760,988,000	
	第331回利付国債(2年)	1,880,000,000	1,880,432,400	
	第332回利付国債(2年)	1,560,000,000	1,560,390,000	
	第333回利付国債(2年)	890,000,000	890,231,400	
	第334回利付国債(2年)	1,370,000,000	1,370,383,600	
	第335回利付国債(2年)	1,200,000,000	1,200,360,000	
	第336回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,310,000	
	第337回利付国債(2年)	1,120,000,000	1,120,280,000	
	第338回利付国債(2年)	1,080,000,000	1,080,280,800	
	第339回利付国債(2年)	680,000,000	680,183,600	
	第340回利付国債(2年)	3,550,000,000	3,550,994,000	
	第91回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,070,000	
	第92回利付国債(5年)	2,180,000,000	2,186,082,200	
	第93回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,113,419,000	
	第94回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,310,283,000	
	第95回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,009,190,000	
	第96回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,722,688,200	
	第97回利付国債(5年)	2,300,000,000	2,314,835,000	
	第98回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,305,772,000	
	第99回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,893,216,400	
	第100回利付国債(5年)	1,150,000,000	1,155,474,000	
	第101回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,269,664,200	
	第102回利付国債(5年)	2,445,000,000	2,457,616,200	
	第103回利付国債(5年)	2,980,000,000	2,996,866,800	
	第104回利付国債(5年)	200,000,000	200,580,000	
	第105回利付国債(5年)	3,512,000,000	3,522,571,120	
	第106回利付国債(5年)	4,700,000,000	4,713,771,000	
	第107回利付国債(5年)	2,110,000,000	2,115,908,000	
	第108回利付国債(5年)	1,180,000,000	1,179,162,200	
	第109回利付国債(5年)	1,230,000,000	1,228,610,100	
	第110回利付国債(5年)	370,000,000	372,356,900	
	第111回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,899,025,600	
	第112回利付国債(5年)	660,000,000	666,857,400	
	第113回利付国債(5年)	3,110,000,000	3,129,872,900	
	第114回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,308,281,000	
	第115回利付国債(5年)	2,730,000,000	2,735,787,600	
	第116回利付国債(5年)	4,300,000,000	4,306,751,000	
	第117回利付国債(5年)	4,470,000,000	4,475,274,600	
	第1回利付国債(40年)	270,000,000	315,281,700	
	第2回利付国債(40年)	500,000,000	558,905,000	
	第3回利付国債(40年)	510,000,000	569,889,300	
	第4回利付国債(40年)	850,000,000	949,382,000	
	第5回利付国債(40年)	830,000,000	881,186,100	
	第6回利付国債(40年)	670,000,000	691,614,200	
	第7回利付国債(40年)	140,000,000	136,438,400	
	第272回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,525,185,000	
	第273回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,425,298,000	

第274回利付国債(10年)	800,000,000	817,280,000	
第275回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,030,280,800	
第276回利付国債(10年)	800,000,000	818,496,000	
第277回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,129,546,000	
第278回利付国債(10年)	800,000,000	824,312,000	
第279回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,168,340,900	
第280回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,192,239,500	
第281回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,038,750,000	
第282回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,969,635,000	
第283回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,350,596,000	
第284回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,497,272,000	
第285回利付国債(10年)	3,300,000,000	3,446,289,000	
第286回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,471,694,000	
第287回利付国債(10年)	1,450,000,000	1,528,633,500	
第288回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,157,244,000	
第289回利付国債(10年)	2,350,000,000	2,464,633,000	
第290回利付国債(10年)	900,000,000	943,056,000	
第291回利付国債(10年)	820,000,000	856,145,600	
第292回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,270,908,000	
第293回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,279,920,000	
第294回利付国債(10年)	900,000,000	956,340,000	
第295回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,328,796,000	
第296回利付国債(10年)	2,150,000,000	2,273,259,500	
第297回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,213,756,000	
第298回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,429,292,000	
第299回利付国債(10年)	1,140,000,000	1,200,944,400	
第300回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,116,066,000	
第301回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,811,231,000	
第302回利付国債(10年)	870,000,000	922,591,500	
第303回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,743,615,200	
第304回利付国債(10年)	740,000,000	782,890,400	
第305回利付国債(10年)	2,300,000,000	2,438,207,000	
第306回利付国債(10年)	1,290,000,000	1,377,500,700	
第307回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,136,479,100	
第308回利付国債(10年)	970,000,000	1,031,643,500	
第309回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,314,587,500	
第310回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,381,142,400	
第311回利付国債(10年)	840,000,000	868,534,800	
第312回利付国債(10年)	2,707,000,000	2,868,364,270	(注)
第313回利付国債(10年)	1,880,000,000	2,006,054,000	
第314回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,074,855,600	
第315回利付国債(10年)	1,560,000,000	1,655,409,600	
第316回利付国債(10年)	570,000,000	600,945,300	
第317回利付国債(10年)	790,000,000	832,320,300	
第318回利付国債(10年)	1,880,000,000	1,967,363,600	
第319回利付国債(10年)	740,000,000	779,538,200	
第320回利付国債(10年)	2,190,000,000	2,290,980,900	
第321回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,976,184,000	
第322回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,152,246,600	

第323回利付国債（10年）	940,000,000	975,391,000
第324回利付国債（10年）	2,170,000,000	2,233,971,600
第325回利付国債（10年）	3,200,000,000	3,291,968,000
第326回利付国債（10年）	900,000,000	917,334,000
第327回利付国債（10年）	2,360,000,000	2,424,805,600
第328回利付国債（10年）	3,865,000,000	3,900,712,600
第329回利付国債（10年）	3,840,000,000	3,937,728,000
第330回利付国債（10年）	2,830,000,000	2,898,797,300
第331回利付国債（10年）	1,570,000,000	1,579,702,600
第332回利付国債（10年）	4,030,000,000	4,048,215,600
第333回利付国債（10年）	3,430,000,000	3,439,501,100
第1回利付国債（30年）	50,000,000	62,421,000
第2回利付国債（30年）	100,000,000	119,151,000
第3回利付国債（30年）	200,000,000	235,092,000
第4回利付国債（30年）	190,000,000	239,785,700
第5回利付国債（30年）	180,000,000	207,970,200
第6回利付国債（30年）	270,000,000	319,261,500
第7回利付国債（30年）	390,000,000	453,316,500
第8回利付国債（30年）	270,000,000	290,517,300
第9回利付国債（30年）	180,000,000	181,602,000
第10回利付国債（30年）	170,000,000	162,538,700
第11回利付国債（30年）	280,000,000	294,607,600
第12回利付国債（30年）	370,000,000	413,071,700
第13回利付国債（30年）	350,000,000	383,964,000
第14回利付国債（30年）	350,000,000	407,347,500
第15回利付国債（30年）	500,000,000	589,695,000
第16回利付国債（30年）	250,000,000	294,590,000
第17回利付国債（30年）	510,000,000	591,304,200
第18回利付国債（30年）	640,000,000	730,329,600
第19回利付国債（30年）	370,000,000	422,025,700
第20回利付国債（30年）	170,000,000	199,996,500
第21回利付国債（30年）	500,000,000	569,715,000
第22回利付国債（30年）	400,000,000	470,272,000
第23回利付国債（30年）	530,000,000	622,887,800
第24回利付国債（30年）	420,000,000	493,416,000
第25回利付国債（30年）	400,000,000	454,636,000
第26回利付国債（30年）	860,000,000	993,050,600
第27回利付国債（30年）	720,000,000	845,661,600
第28回利付国債（30年）	820,000,000	962,835,800
第29回利付国債（30年）	730,000,000	843,157,300
第30回利付国債（30年）	890,000,000	1,010,372,500
第31回利付国債（30年）	1,100,000,000	1,225,389,000
第32回利付国債（30年）	990,000,000	1,123,620,300
第33回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,393,600,000
第34回利付国債（30年）	1,230,000,000	1,370,884,200
第35回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,393,444,000
第36回利付国債（30年）	1,440,000,000	1,543,320,000
第37回利付国債（30年）	1,480,000,000	1,552,830,800
第38回利付国債（30年）	885,000,000	907,355,100

第39回利付国債（30年）	540,000,000	565,936,200
第40回利付国債（30年）	1,050,000,000	1,074,717,000
第41回利付国債（30年）	685,000,000	685,000,000
第42回利付国債（30年）	1,050,000,000	1,048,960,500
第29回利付国債（20年）	100,000,000	105,254,000
第30回利付国債（20年）	200,000,000	209,220,000
第31回利付国債（20年）	280,000,000	296,948,400
第32回利付国債（20年）	80,000,000	85,125,600
第33回利付国債（20年）	430,000,000	466,304,900
第34回利付国債（20年）	70,000,000	76,584,200
第35回利付国債（20年）	270,000,000	293,905,800
第37回利付国債（20年）	410,000,000	449,991,400
第39回利付国債（20年）	640,000,000	699,302,400
第40回利付国債（20年）	450,000,000	491,188,500
第41回利付国債（20年）	620,000,000	659,010,400
第42回利付国債（20年）	380,000,000	423,787,400
第43回利付国債（20年）	340,000,000	388,212,000
第44回利付国債（20年）	370,000,000	418,421,900
第45回利付国債（20年）	270,000,000	303,793,200
第46回利付国債（20年）	290,000,000	324,156,200
第47回利付国債（20年）	470,000,000	526,959,300
第48回利付国債（20年）	230,000,000	263,060,200
第49回利付国債（20年）	280,000,000	313,779,200
第50回利付国債（20年）	590,000,000	653,330,600
第51回利付国債（20年）	240,000,000	268,068,000
第52回利付国債（20年）	430,000,000	484,081,100
第53回利付国債（20年）	350,000,000	394,751,000
第54回利付国債（20年）	280,000,000	317,853,200
第55回利付国債（20年）	490,000,000	549,927,000
第56回利付国債（20年）	410,000,000	460,987,600
第57回利付国債（20年）	360,000,000	401,968,800
第58回利付国債（20年）	250,000,000	279,472,500
第59回利付国債（20年）	440,000,000	485,342,000
第60回利付国債（20年）	570,000,000	614,448,600
第61回利付国債（20年）	390,000,000	407,066,400
第62回利付国債（20年）	250,000,000	256,362,500
第63回利付国債（20年）	570,000,000	634,512,600
第64回利付国債（20年）	410,000,000	460,667,800
第65回利付国債（20年）	370,000,000	416,331,400
第66回利付国債（20年）	330,000,000	368,161,200
第67回利付国債（20年）	310,000,000	348,960,800
第68回利付国債（20年）	230,000,000	265,431,500
第69回利付国債（20年）	530,000,000	606,728,100
第70回利付国債（20年）	490,000,000	576,097,900
第71回利付国債（20年）	400,000,000	462,468,000
第72回利付国債（20年）	710,000,000	814,639,800
第73回利付国債（20年）	540,000,000	614,827,800
第74回利付国債（20年）	310,000,000	356,025,700
第75回利付国債（20年）	360,000,000	413,787,600

第76回利付国債（20年）	340,000,000	383,741,000	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	330,234,600	
第78回利付国債（20年）	200,000,000	225,828,000	
第79回利付国債（20年）	570,000,000	649,475,100	
第80回利付国債（20年）	250,000,000	287,577,500	
第81回利付国債（20年）	340,000,000	387,603,400	
第82回利付国債（20年）	485,000,000	558,283,500	
第83回利付国債（20年）	420,000,000	483,730,800	
第84回利付国債（20年）	750,000,000	855,787,500	
第85回利付国債（20年）	460,000,000	530,025,800	
第86回利付国債（20年）	370,000,000	434,846,200	
第87回利付国債（20年）	230,000,000	267,660,200	
第88回利付国債（20年）	530,000,000	623,338,300	
第89回利付国債（20年）	480,000,000	559,214,400	
第90回利付国債（20年）	830,000,000	967,439,700	
第91回利付国債（20年）	510,000,000	600,530,100	
第92回利付国債（20年）	1,130,000,000	1,304,630,200	
第93回利付国債（20年）	500,000,000	571,170,000	
第94回利付国債（20年）	610,000,000	703,915,600	
第95回利付国債（20年）	590,000,000	695,598,200	
第96回利付国債（20年）	450,000,000	519,295,500	
第97回利付国債（20年）	720,000,000	839,944,800	
第98回利付国債（20年）	500,000,000	577,305,000	
第99回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,234,469,700	
第100回利付国債（20年）	980,000,000	1,143,081,800	
第101回利付国債（20年）	500,000,000	596,265,000	
第102回利付国債（20年）	620,000,000	739,474,000	
第103回利付国債（20年）	300,000,000	353,832,000	
第104回利付国債（20年）	570,000,000	657,204,300	
第105回利付国債（20年）	520,000,000	599,305,200	
第106回利付国債（20年）	310,000,000	361,432,100	
第107回利付国債（20年）	700,000,000	806,337,000	
第108回利付国債（20年）	810,000,000	911,112,300	
第109回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,202,433,900	
第110回利付国債（20年）	825,000,000	949,723,500	
第111回利付国債（20年）	320,000,000	372,582,400	
第112回利付国債（20年）	930,000,000	1,069,890,600	
第113回利付国債（20年）	1,070,000,000	1,230,018,500	
第114回利付国債（20年）	900,000,000	1,033,722,000	
第115回利付国債（20年）	550,000,000	639,545,500	
第116回利付国債（20年）	600,000,000	697,122,000	
第117回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,147,490,000	
第118回利付国債（20年）	500,000,000	565,920,000	
第119回利付国債（20年）	550,000,000	606,155,000	
第120回利付国債（20年）	500,000,000	536,610,000	
第121回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,226,544,000	
第122回利付国債（20年）	660,000,000	725,769,000	
第123回利付国債（20年）	980,000,000	1,120,149,800	
第124回利付国債（20年）	600,000,000	676,446,000	

第125回利付国債（20年）	300,000,000	346,965,000	
第126回利付国債（20年）	620,000,000	698,008,400	
第127回利付国債（20年）	760,000,000	844,284,000	
第128回利付国債（20年）	870,000,000	964,255,800	
第129回利付国債（20年）	450,000,000	491,634,000	
第130回利付国債（20年）	880,000,000	959,657,600	
第131回利付国債（20年）	500,000,000	537,305,000	
第133回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,500,957,000	
第134回利付国債（20年）	350,000,000	379,645,000	
第135回利付国債（20年）	980,000,000	1,047,159,400	
第136回利付国債（20年）	400,000,000	421,272,000	
第137回利付国債（20年）	500,000,000	532,700,000	
第138回利付国債（20年）	600,000,000	619,782,000	
第139回利付国債（20年）	540,000,000	566,546,400	
第140回利付国債（20年）	1,790,000,000	1,901,338,000	
第141回利付国債（20年）	990,000,000	1,048,330,800	
第142回利付国債（20年）	640,000,000	688,281,600	
第143回利付国債（20年）	1,170,000,000	1,216,530,900	
第144回利付国債（20年）	440,000,000	449,882,400	
第145回利付国債（20年）	1,900,000,000	2,000,643,000	
第146回利付国債（20年）	1,910,000,000	2,004,564,100	
第147回利付国債（20年）	1,590,000,000	1,636,237,200	
第148回利付国債（20年）	1,710,000,000	1,725,783,300	
国債証券 小計	264,959,000,000	279,775,065,790	
地方債証券			
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,375,000	
第3回東京都公募公債（7年）	100,000,000	101,741,000	
第4回東京都公募公債（7年）	100,000,000	101,466,000	
第7回東京都公募公債（30年）	200,000,000	227,834,000	
第11回東京都公募公債（20年）	200,000,000	231,902,000	
第18回東京都公募公債（20年）	200,000,000	231,554,000	
第20回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,769,000	
第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,067,000	
第637回東京都公募公債	180,000,000	186,957,000	
第642回東京都公募公債	100,000,000	104,336,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	105,640,000	
第647回東京都公募公債	100,000,000	105,580,000	
第657回東京都公募公債	100,000,000	106,231,000	
第673回東京都公募公債	100,000,000	106,080,000	
第681回東京都公募公債	100,000,000	106,604,000	
第682回東京都公募公債	100,000,000	106,148,000	
第686回東京都公募公債	100,000,000	104,863,000	
第692回東京都公募公債	100,000,000	106,683,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	105,791,000	
第700回東京都公募公債	100,000,000	104,492,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	104,201,000	
平成17年度第12回北海道公募公債	200,000,000	204,876,000	
平成19年度第14回北海道公募公債（10年）	100,000,000	105,426,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	106,922,000	
平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	106,752,000	



平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	106,645,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	103,714,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,408,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,801,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	105,603,000	
第135回神奈川県公募公債	100,000,000	102,051,000	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	106,963,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	106,139,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	106,105,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	105,334,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	104,829,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	104,518,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	103,131,000	
第285回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,047,000	
第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,173,000	
第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,283,000	
第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,533,000	
第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,605,000	
第309回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,145,000	
第324回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,593,000	
第331回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,995,000	
第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,542,000	
第335回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,656,000	
第339回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,233,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	135,545,800	
第363回大阪府公募公債（10年）	114,000,000	116,110,140	
第376回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,665,000	
平成17年度第3回京都府公募公債	100,000,000	102,114,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	106,046,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	106,096,000	
平成22年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,558,000	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	110,000,000	113,968,800	
平成18年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	104,275,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	106,565,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	106,527,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	105,782,000	
平成22年度第20回兵庫県公募公債（5年）	100,000,000	100,721,000	
平成17年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	102,843,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	105,780,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,746,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,925,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	106,531,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	106,986,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,482,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債（10年）	129,000,000	134,069,700	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,053,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,733,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,748,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,708,000	

平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	112,913,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,854,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,647,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,898,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,969,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	117,192,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	105,996,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	287,305,440	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	102,694,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	105,750,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	105,506,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	106,817,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,627,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	105,334,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,102,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,406,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,379,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	116,025,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	218,802,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,464,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,061,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,612,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	116,150,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	114,658,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	175,000,000	181,938,750	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	104,492,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	107,083,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,324,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,370,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,767,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,094,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	143,322,543	
第2回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	102,158,000	
平成18年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	103,969,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	143,077,464	
第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	164,060,800	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,679,000	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,356,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,113,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,418,000	
第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,285,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,863,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,032,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,706,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,592,000	
第72回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,951,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,642,000	
第76回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,962,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,781,000	

第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,093,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,893,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,034,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,518,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,731,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,447,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,823,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,062,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,324,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,959,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,936,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,240,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,343,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,958,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,626,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,559,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,811,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,637,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,462,000	
第103回共同発行市場公募地方債	377,400,000	393,341,376	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,715,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,663,000	
第111回共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,852,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,310,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,755,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,030,000	
平成23年度第1回熊本県公募公債（5年）	100,000,000	100,744,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	102,289,000	
平成18年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,354,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,485,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	208,208,000	
平成21年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	212,284,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	106,598,000	
第1回名古屋市長官公債（20年）	100,000,000	112,527,000	
第12回す号名古屋市長官公債	100,000,000	102,782,000	
第455回名古屋市長官公債（10年）	186,700,000	193,439,870	
第464回名古屋市長官公債（10年）	100,000,000	106,095,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	114,189,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	105,574,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	106,667,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	114,929,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	106,054,000	
平成22年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,419,000	
平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	105,380,000	
平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	104,021,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,684,000	
平成23年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	104,577,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	105,794,000	
平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	103,807,000	

	平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,483,000	
	平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,947,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	105,614,000	
	平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	105,754,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	104,960,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	105,937,000	
	平成17年度第1回広島市公募公債	100,000,000	102,090,000	
	平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	158,123,343	
	平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	106,778,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	102,330,000	
	平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	102,290,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	104,142,000	
	地方債証券 小計	21,059,530,000	22,262,584,026	
特殊債券	第36回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	103,263,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	234,492,300	
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,553,000	
	第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	200,672,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,348,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,268,000	
	第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,053,000	
	第41回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,016,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,582,000	
	第3回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,580,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	176,028,000	
	第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	162,716,370	
	第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	105,059,190	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,617,000	
	第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,156,000	
	第21回道路債券	100,000,000	119,656,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,942,000	
	第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	130,532,500	
	第27回道路債券	100,000,000	115,788,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,415,000	
	第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	193,000,000	201,495,860	
	第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,728,000	
	第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,184,000	
	第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,523,000	
	第33回道路債券	100,000,000	120,676,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,657,000	
	第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,334,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,184,000	
	第38回道路債券	100,000,000	114,573,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,470,000	
	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	211,400,000	
	第42回道路債券	100,000,000	114,202,000	
	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	117,290,000	
	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	210,822,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,037,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,550,000	

第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,911,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,624,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,584,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,702,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,777,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,000,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,150,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,188,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,333,000	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,679,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,418,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,292,000	
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,766,000	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,165,000	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,225,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,618,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,376,000	
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	112,852,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,692,000	
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	228,286,000	
第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,221,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,378,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,342,000	
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	211,920,000	
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	230,904,000	
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	106,575,000	
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	111,940,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,064,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,702,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,172,000	
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	109,899,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,199,000	
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	112,269,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	176,477,000	
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	107,794,000	
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	106,549,000	
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	105,132,000	

第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,343,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	130,398,750	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,536,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,051,000	
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	103,431,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,891,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,770,000	
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	205,280,000	
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	105,288,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	109,000,000	110,260,040	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,013,000	
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	103,100,000	
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	102,037,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,614,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	111,904,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	212,494,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	115,585,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,604,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,081,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	112,946,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,215,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,167,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	228,664,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,343,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,667,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	113,969,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,700,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,047,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,662,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,513,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	111,924,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,180,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,982,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,042,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	331,494,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	417,736,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	233,580,000	

第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	107,824,000	
第19回公営企業債券	100,000,000	103,322,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,768,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,480,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	311,235,000	
第24回政府保証地方公共団体金融機構債券	181,000,000	190,393,900	
第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,788,000	
第25回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,529,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,147,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,418,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,058,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	224,299,880	
第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,122,000	
第859回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,275,000	
第860回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,540,000	
第862回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,137,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,699,000	
第864回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,630,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,412,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,497,000	
第877回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,976,000	
第879回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,244,000	
第884回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,767,000	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,041,000	
第886回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,558,000	
第187回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,111,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	210,210,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	109,311,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	107,712,000	
第25回国際協力銀行債券	100,000,000	103,327,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	105,082,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	105,636,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,579,000	
第49回都市再生債券	100,000,000	106,829,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	108,561,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	101,158,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,805,000	25,973,563	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,810,000	209,140,223	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	59,862,000	64,142,731	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,713,000	33,200,138	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,472,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	76,752,000	81,475,318	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,317,000	27,843,912	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,206,000	29,383,296	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,974,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,269,000	19,088,547	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	109,732,000	118,456,791	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	28,574,000	30,740,480	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,840,000	87,304,456	

第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	28,194,000	30,381,290
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,558,000	43,093,568
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,125,000	31,335,005
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,494,000	22,859,977
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,115,000
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,844,000	24,968,721
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	43,813,000	46,908,826
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,160,000
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	144,387,000	152,003,414
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,128,000
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,911,000	28,479,373
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,368,000	50,629,204
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,838,000	58,489,662
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,848,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,278,000	56,737,313
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,640,000	33,307,428
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,960,000	56,218,122
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,356,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,584,000	108,140,875
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,326,000	37,300,370
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	115,743,000	122,610,032
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,458,000
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,982,000
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,539,000	42,727,295
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	129,906,000	136,816,999
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,425,000	47,087,834
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,769,000	69,783,539
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,828,000	76,287,800
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,858,000	42,375,431
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,966,000	77,264,427
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,775,000	43,342,194
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	117,270,000	124,392,979
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,192,000	161,694,544
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,508,000	85,813,477
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,112,000	44,144,832
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,496,000
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,776,000	41,051,556
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,718,000	85,840,604
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,518,000	87,597,019
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,850,000
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	251,049,000	266,317,800
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	329,416,000	349,612,494
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,631,000	39,554,153
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,263,000	88,129,722
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,266,000	87,686,591
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	113,544,000	122,702,459
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,528,000	89,935,257
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,268,000	42,194,644
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,084,000	90,631,802



第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,424,000	90,948,061	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,696,000	91,952,917	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,669,000	92,104,923	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,580,000	94,675,821	
第67回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,100,000	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,305,000	96,753,157	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	283,506,000	290,494,422	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,467,000	95,488,188	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,811,000	95,844,439	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,501,000	98,171,207	
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,830,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,090,000	
第19回政府保証国民生活債券	125,000,000	129,973,750	
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	104,417,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,417,000	
い第731号商工債	100,000,000	101,002,000	
い第734号商工債	200,000,000	201,632,000	
い第740号商工債	200,000,000	201,438,000	
い第741号商工債	200,000,000	201,482,000	
い第758号商工債	100,000,000	100,736,000	
い第725号農林債	100,000,000	100,289,000	
い第728号農林債	200,000,000	201,172,000	
い第729号農林債	100,000,000	100,957,000	
い第730号農林債	100,000,000	100,918,000	
い第732号農林債	200,000,000	201,602,000	
い第736号農林債	100,000,000	100,686,000	
い第745号農林債	120,000,000	120,471,600	
い第749号農林債	100,000,000	100,234,000	
い第751号農林債	100,000,000	100,228,000	
い第766号農林債	200,000,000	199,952,000	
第251回信金中金債（5年）	100,000,000	100,261,000	
第257回信金中金債（5年）	100,000,000	101,012,000	
第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,795,000	
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,837,000	
第266回信金中金債（5年）	100,000,000	100,732,000	
第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,755,000	
第275回信金中金債（5年）	100,000,000	100,386,000	
第278回信金中金債（5年）	100,000,000	100,378,000	
第280回信金中金債（5年）	100,000,000	99,981,000	
第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,285,000	
第159号商工債（3年）	100,000,000	100,159,000	
第167号商工債（3年）	200,000,000	200,126,000	
第168号商工債（3年）	100,000,000	100,064,000	
第5回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	104,163,000	
第21回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	101,275,000	
第5回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	106,771,000	
第6回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	106,482,000	
第8回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,096,000	
第10回政府保証中日本高速道路債券	172,000,000	179,053,720	

	第20回政府保証日本高速道路債券	100,000,000	104,679,000	
	第3回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,147,000	
	第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,057,000	
	第21回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,057,000	
	特殊債券 小計	29,219,111,000	30,964,876,082	
社債券	第2回ディー・エヌ・ピー・バンク エイ・エス・エイ 円貨社債	100,000,000	100,324,000	
	第4回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリク ト円貨社債	100,000,000	100,467,000	
	第5回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリク ト円貨社債	100,000,000	101,419,000	
	第12回株式会社ポスコ円貨社債(2013)	100,000,000	99,814,000	
	第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コー ポ円貨社債	100,000,000	102,321,000	
	第13回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー 円貨社債	100,000,000	100,228,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	107,260,000	
	第25回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,634,000	
	第4回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,378,000	
	第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	202,112,000	
	第6回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,627,000	
	第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	205,338,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	200,806,000	
	第7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	101,026,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション 円貨社債	100,000,000	102,551,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,172,000	
	第20回第ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	100,491,000	
	第21回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	202,252,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	100,838,000	
	第3回株式会社ケーティ円貨社債	100,000,000	100,266,000	
	第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	101,171,000	
	第20回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,810,000	
	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	100,292,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,416,000	
	第8回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,676,000	
	第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	101,461,000	
	第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保 社債	100,000,000	101,879,000	
	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	100,559,000	
	第29回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	103,025,000	
	第29回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,400,000	
	第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,436,000	
	第37回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	107,160,000	
	第9回宇部興産株式会社無担保社債	100,000,000	101,134,000	
	第13回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,096,000	
	第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	103,054,000	

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	100,306,000	
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	101,000,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	104,029,000	
第3回出光興産株式会社無担保社債	100,000,000	101,349,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,135,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	102,931,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,139,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,313,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,936,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,861,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	102,025,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,154,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,918,000	
第55回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,483,000	
第1回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	100,437,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	101,115,000	
第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,142,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	106,207,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	100,467,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,819,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,163,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	300,000,000	304,524,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,714,000	
第56回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,960,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	107,346,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,586,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,159,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,701,000	
第92回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,783,000	
第58回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,351,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,514,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,600,000	
第75回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,015,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	112,560,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,292,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,000,000	
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	105,305,000	
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	106,992,000	
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	107,566,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,909,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	227,210,000	

第83回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,497,000	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,837,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,522,000	
第139回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第1回みずほ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	205,050,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,046,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	214,514,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	214,786,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	113,681,000	
第50回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,380,000	
第51回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,252,000	
第52回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,636,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	109,274,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,877,000	
第14回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,601,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,450,000	
第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,228,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,859,000	
第63回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	101,738,000	
第9回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,932,000	
第42回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,871,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,374,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,616,000	
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	100,151,000	
第12回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,707,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	103,819,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	107,234,000	
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	101,691,000	
第2回大和証券キャピタル・マーケット株式会社無担保社債	100,000,000	100,693,000	
第5回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	100,560,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	104,140,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	105,315,000	
第78回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,231,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,367,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	116,451,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,282,000	
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,865,000	
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	102,722,000	
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,650,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,280,000	

第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,263,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,934,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,816,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,454,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,440,000	
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,442,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,358,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,636,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,723,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,231,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,008,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	210,298,000	
第25回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,707,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,097,000	
第62回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,938,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	103,940,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	116,177,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	114,420,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	104,324,000	
第27回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	105,244,000	
第12回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	101,296,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,345,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,798,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,839,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,389,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,695,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	106,637,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	106,856,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,386,000	
第513回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,087,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,122,000	
第515回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,043,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,039,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,625,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,857,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,375,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,588,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,940,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,942,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,322,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	110,952,000	
第478回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,754,000	
第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	108,884,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,305,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,093,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,448,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,272,000	
第311回中国電力株式会社社債	100,000,000	108,760,000	
第354回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,233,000	

第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,039,000	
第283回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,073,000	
第288回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,418,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,888,000	
第383回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,903,000	
第416回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,710,000	
第459回東北電力株式会社社債	173,000,000	175,712,640	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,674,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,609,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,967,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,490,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,410,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,528,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,015,000	
第396回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,901,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,040,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,331,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,749,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	102,413,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,593,000	
第29回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,360,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,531,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,780,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	109,740,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,873,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	105,107,000	
社債券 小計	20,373,000,000	21,121,135,640	
合計	335,610,641,000	354,123,661,538	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド

### 貸借対照表

項目	平成26年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,120,811,030
コール・ローン	1,442,698,860
株式	242,953,581,397
投資信託受益証券	195,037,647
投資証券	5,254,537,948
派生商品評価勘定	162,359,235
未収入金	100,024,861
未収配当金	504,751,893
未収利息	1,982
差入委託証拠金	1,888,887,336
流動資産合計	257,622,692,189
資産合計	257,622,692,189
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,797,737
未払解約金	764,227,306
流動負債合計	769,025,043
負債合計	769,025,043
純資産の部	
元本等	
元本	139,044,492,301
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	117,809,174,845
元本等合計	256,853,667,146
純資産合計	256,853,667,146
負債純資産合計	257,622,692,189

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
--	---------------

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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)投資信託受益証券及び投資証券 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>
<p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)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>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</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>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	210,171,706,543円



計算期間中の追加設定元本額	17,030,868,023円
計算期間中の一部解約元本額	88,158,082,265円
計算日の元本額	139,044,492,301円
計算日の元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,727,520,685円
DC外国株式インデックスファンド	4,329,872,379円
DC外国株式インデックスファンドL	17,651,671,302円
DCバランスファンド30	314,922,133円
DCバランスファンド50	631,141,174円
DCバランスファンド70	425,791,878円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	89,961,434円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	45,198,824円
新生・4分散ファンド	82,301,213円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	458,939,459円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	16,723,145円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	62,322,138円
外国株式インデックスe	5,950,359,892円
インデックスコレクション(外国株式)	2,486,946,346円
インデックスコレクション(バランス株式30)	267,586,085円
インデックスコレクション(バランス株式50)	459,891,908円
インデックスコレクション(バランス株式70)	481,768,523円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	6,121,056,736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)	444,845,339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)	5,671,386,637円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	1,494,614,558円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	12,778,402,806円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	6,843,010,904円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,633,837,259円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	236,210,440円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	11,983,920,351円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,097,877,478円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,013,840,909円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	18,950,796,626円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	1,531,200,920円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	22,598,221,890円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	2,574,841,288円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	82,045,766円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,271,952,022円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	774,605,155円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	429,771,135円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,084,865,573円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	220,586,627円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,494,438,335円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	52,009,825円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	340,481,387円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	805,258,094円
私募外国株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	31,495,723円

2. 計算日における受益権総数	139,044,492,301口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8473円 (18,473円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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せん。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26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	19,379,945,016	
投資信託受益証券	28,457,083	
投資証券	512,246,553	
合計	19,920,648,652	

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成26年2月8日から平成26年6月10日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

## 株式関連

区分	種類	平成26年 6月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,582,225,492	-	6,739,316,407	157,090,915
	合計	6,582,225,492	-	6,739,316,407	157,090,915

## (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。

## 通貨関連

区分	種類	平成26年 6月10日現在		
		契約額等(円)		時価 (円)
			うち1年超	
市場取引	為替予約取引			

以外の取引	買 建				
	アメリカドル	714,625,858	-	716,432,850	1,806,992
	イギリスポンド	117,637,429	-	117,419,940	217,489
	ユーロ	169,892,395	-	168,189,840	1,702,555
	計	1,002,155,682	-	1,002,042,630	113,052
	売 建				
	アメリカドル	1,309,610,664	-	1,309,311,000	299,664
	カナダドル	98,478,791	-	98,501,100	22,309
	オーストラリアドル	70,910,574	-	70,884,600	25,974
	イギリスポンド	205,952,574	-	205,915,320	37,254
	スイスフラン	86,515,822	-	86,449,400	66,422
	シンガポールドル	38,434,221	-	38,429,860	4,361
	スウェーデンクローナ	35,426,012	-	35,404,520	21,492
	ユーロ	189,782,037	-	189,631,260	150,777
	計	2,035,110,695	-	2,034,527,060	583,635
	合計	3,037,266,377	-	3,036,569,690	470,583

## (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。

## . ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## 附属明細表

(平成26年6月10日現在)

有価証券明細表

## A. 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	40,455	103.07	4,169,696.85	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,927	62.26	182,235.02	
	APACHE CORP	30,658	94.65	2,901,779.70	
	BAKER HUGHES	34,349	71.75	2,464,540.75	
	CABOT OIL & GAS CORP	32,702	35.83	1,171,712.66	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	16,690	65.46	1,092,527.40	
	CHENIERE ENERGY INC	16,218	66.69	1,081,578.42	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	42,704	29.58	1,263,184.32	
	CHEVRON CORP	150,472	124.37	18,714,202.64	

CIMAREX ENERGY CO	6,814	134.18	914,302.52
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	26,453	18.40	486,735.20
CONCHO RESOURCES INC	8,298	133.81	1,110,355.38
CONOCOPHILLIPS	95,737	80.85	7,740,336.45
CONSOL ENERGY INC	18,221	46.99	856,204.79
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,202	145.81	612,693.62
CORE LABORATORIES N.V.	3,623	160.36	580,984.28
DENBURY RESOURCES INC	24,897	17.18	427,730.46
DEVON ENERGY CORPORATION	30,939	74.45	2,303,408.55
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,327	47.30	204,667.10
ENERGEN CORP	5,192	88.08	457,311.36
ENSCO PLC-CL A	17,384	52.08	905,358.72
EOG RESOURCES INC	42,922	109.51	4,700,388.22
EQT CORPORATION	11,652	104.73	1,220,313.96
EXXON MOBIL	340,776	101.52	34,595,579.52
FMC TECHNOLOGIES INC	17,954	59.15	1,061,979.10
HALLIBURTON CO	66,843	67.17	4,489,844.31
HELMERICH & PAYNE	9,146	112.92	1,032,766.32
HESS CORP	22,849	94.10	2,150,090.90
HOLLYFRONTIER CORP	14,934	47.50	709,365.00
KINDER MORGAN INC	54,420	35.06	1,907,965.20
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	8,779	75.16	659,829.64
MARATHON OIL CORP	55,350	37.84	2,094,444.00
MARATHON PETROLEUM CORP	23,161	87.50	2,026,587.50
MURPHY OIL CORP	13,818	63.80	881,588.40
NABORS INDUSTRIES LTD	21,912	27.12	594,253.44
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,271	78.06	2,597,134.26
NOBLE CORP PLC	19,072	31.77	605,917.44
NOBLE ENERGY INC	27,876	74.23	2,069,235.48
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,452	100.19	6,257,065.88
OCEANEERING INTL INC	8,808	75.54	665,356.32
ONEOK INC	16,300	65.68	1,070,584.00
PEABODY ENERGY CORP	22,800	16.51	376,428.00
PHILLIPS 66	46,095	83.73	3,859,534.35
PIONEER NATURAL RESOURCES	11,445	220.47	2,523,279.15
QEP RESOURCES INC	15,102	31.92	482,055.84
RANGE RESOURCES CORP	12,591	92.24	1,161,393.84
SCHLUMBERGER	102,939	106.72	10,985,650.08
SOUTHWESTERN ENERGY CO	27,961	45.74	1,278,936.14
SPECTRA ENERGY CORP	54,203	41.49	2,248,882.47
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	12,437	35.12	436,787.44
TESORO CORP	10,480	57.18	599,246.40
VALERO ENERGY CORP	41,914	54.84	2,298,563.76
WEATHERFORD INTL LTD	60,429	22.75	1,374,759.75
WHITING PETROLEUM CORP	10,135	74.37	753,739.95
WILLIAMS COS	55,259	47.76	2,639,169.84
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,001	122.95	2,090,272.95
AIRGAS INC	4,848	109.56	531,146.88

ALBEMARLE CORP	7,066	72.23	510,377.18
ALCOA	85,773	14.35	1,230,842.55
ASHLAND INC	6,192	106.00	656,352.00
AVERY DENNISON CORP	7,854	50.08	393,328.32
BALL CORP	11,512	61.23	704,879.76
CELANESE CORP-SERIES A	12,311	63.78	785,195.58
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,295	243.76	1,046,949.20
CROWN HOLDINGS INC	11,485	50.68	582,059.80
DOW CHEMICAL CO	95,743	52.99	5,073,421.57
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	73,152	69.43	5,078,943.36
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,753	89.68	1,054,009.04
ECOLAB INC	21,792	110.05	2,398,209.60
FMC CORP	11,231	78.06	876,691.86
FREEMONT-MCMOR-B	81,260	34.66	2,816,471.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,914	101.66	702,877.24
INT'L PAPER CO	33,774	48.19	1,627,569.06
LYONDELLBASELL INDU-CL A	36,585	98.92	3,618,988.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,792	127.97	485,262.24
MEADWESTVACO CORP	14,465	44.23	639,786.95
MONSANTO CO	41,340	121.35	5,016,609.00
MOSAIC CO/THE	24,951	49.07	1,224,345.57
NEWMONT MINING CORP	38,613	22.67	875,356.71
NUCOR CORP	24,137	50.79	1,225,918.23
OWENS-ILLINOIS INC	13,348	33.72	450,094.56
PPG INDUSTRIES INC	10,885	205.11	2,232,622.35
PRAXAIR INC	23,061	133.78	3,085,100.58
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,650	102.18	577,317.00
SEALED AIR CORP	16,878	33.06	557,986.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,836	204.30	1,396,594.80
SIGMA-ALDRICH	9,327	100.19	934,472.13
VULCAN MATERIALS CO	10,089	63.40	639,642.60
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,689	81.93	220,309.77
3 M COMPANY	49,406	145.32	7,179,679.92
AGCO CORP	7,969	56.20	447,857.80
AMETEK INC	17,893	54.20	969,800.60
B/E AEROSPACE INC	8,711	98.88	861,343.68
BOEING CO	55,520	137.96	7,659,539.20
CATERPILLAR	49,900	108.75	5,426,625.00
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	8,092	83.82	678,271.44
CUMMINS INC	13,611	160.25	2,181,162.75
DANAHER CORP	48,638	80.55	3,917,790.90
DEERE&CO	27,176	93.00	2,527,368.00
DOVER CORP	12,811	88.87	1,138,513.57
EATON CORP	38,254	75.56	2,890,472.24
EMERSON ELECTRIC CO	54,472	68.10	3,709,543.20
FASTENAL CO	22,209	50.59	1,123,553.31
FLOWSERVE CORP	11,803	77.80	918,273.40
FLUOR CORP	13,321	79.31	1,056,488.51

GENERAL DYNAMICS CORP	22,665	120.62	2,733,852.30
GENERAL ELECTRIC CO	790,258	27.44	21,684,679.52
GRAINGER (WW) INC	4,674	267.39	1,249,780.86
HONEYWELL INTL INC	58,226	95.81	5,578,633.06
ILLINOIS TOOL WORKS	31,115	89.04	2,770,479.60
INGERSOLL-RAND PLC	23,056	62.51	1,441,230.56
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,052	57.07	630,737.64
JOY GLOBAL INC	8,783	64.52	566,679.16
KBR INC	11,994	26.34	315,921.96
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,917	126.76	876,798.92
LOCKHEED MARTIN CORP	21,483	168.08	3,610,862.64
MASCO CORP	27,811	22.43	623,800.73
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,013	124.46	1,992,977.98
PACCAR INC	28,171	64.95	1,829,706.45
PALL CORP	9,402	86.60	814,213.20
PARKER HANNIFIN CORP	11,753	129.41	1,520,955.73
PENTAIR PLC	15,945	78.50	1,251,682.50
PRECISION CASTPARTS CORP	11,262	273.69	3,082,296.78
QUANTA SERVICES INC	16,920	35.39	598,798.80
RAYTHEON COMPANY	24,562	98.50	2,419,357.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,965	127.83	1,401,655.95
ROCKWELL COLLIN	8,790	80.26	705,485.40
ROPER INDUSTRIES INC	7,311	146.57	1,071,573.27
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,900	44.10	568,890.00
SPX CORP	3,122	109.30	341,234.60
STANLEY BLACK&DECKER	12,261	88.26	1,082,155.86
TEXTRON	23,779	40.93	973,274.47
TRANSDIGM GROUP INC	3,814	197.00	751,358.00
UNITED RENTALS INC	6,841	107.74	737,049.34
UNITED TECHNOLOGIES CORP	68,178	120.09	8,187,496.02
XYLEM INC	15,576	38.11	593,601.36
ADT CORPORATION	13,286	33.75	448,402.50
CINTAS CORP	8,681	63.67	552,719.27
DUN & BRADSTREET CORP	3,311	105.83	350,403.13
EQUIFAX INC	8,955	72.42	648,521.10
IHS INC-CLASS A	5,841	130.62	762,951.42
IRON MOUNTAIN INC	11,645	31.76	369,845.20
MANPOWER GROUP	6,513	85.85	559,141.05
NIELSEN NV	20,944	47.59	996,724.96
REPUBLIC SERVICES INC	21,098	36.35	766,912.30
ROBERT HALF INTL INC	10,224	47.40	484,617.60
STERICYCLE INC	6,552	116.08	760,556.16
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,463	110.43	603,279.09
TYCO INTERNATIONAL LTD	36,956	44.84	1,657,107.04
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	12,733	61.79	786,772.07
WASTE MANAGEMENT INC	33,763	44.53	1,503,466.39
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,242	43.59	533,628.78
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,598	60.91	706,434.18

CSX CORP	81,367	30.42	2,475,184.14
DELTA AIR LINES INC	16,811	41.87	703,876.57
EXPEDITORS INTL WASH INC	17,397	45.86	797,826.42
FEDEX CORP	23,079	143.65	3,315,298.35
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	36,752	26.93	989,731.36
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,540	77.41	506,261.40
KANSAS CITY SOUTHERN	8,178	107.06	875,536.68
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,944	102.40	2,554,265.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,433	27.45	396,185.85
UNION PACIFIC CORP	71,406	102.14	7,293,408.84
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,600	46.38	398,868.00
UNITED PARCEL SERVICE B	55,683	103.49	5,762,633.67
AUTOLIV INC	6,782	107.37	728,183.34
BORGWARNER INC	18,252	65.91	1,202,989.32
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	23,499	70.24	1,650,569.76
FORD MOTOR COMPANY	287,676	17.00	4,890,492.00
GENERAL MOTORS CO	98,906	36.50	3,610,069.00
HARLEY-DAVIDSON	17,484	72.51	1,267,764.84
JOHNSON CONTROLS INC	51,299	50.05	2,567,514.95
TESLA MOTORS INC	6,862	205.31	1,408,837.22
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	8,364	86.33	722,064.12
COACH INC	22,192	40.83	906,099.36
DR HORTON INC	24,653	24.61	606,710.33
FOSSIL GROUP INC	3,522	107.10	377,206.20
GARMIN LTD	8,731	60.78	530,670.18
HASBRO INC	9,841	53.08	522,360.28
LEGGETT & PLATT INC	11,061	34.80	384,922.80
LENNAR CORP-CL A	13,535	41.84	566,304.40
LULULEMON ATHLETICA INC	8,662	44.99	389,703.38
MATTEL INC	28,084	39.13	1,098,926.92
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	15,604	93.93	1,465,683.72
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,288	135.71	717,634.48
NEWELL RUBBERMAID	19,943	31.21	622,421.03
NIKE B	55,353	76.67	4,243,914.51
POLARIS INDUSTRIES INC	5,085	132.69	674,728.65
PULTE GROUP INC	26,803	20.23	542,224.69
PVH CORP	6,397	121.57	777,683.29
RALPH LAUREN CORPORATION	4,257	155.31	661,154.67
TOLL BROTHERS INC	13,992	37.27	521,481.84
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,202	55.86	793,323.72
VF CORP	28,258	63.54	1,795,513.32
WHIRLPOOL CORP	6,514	141.93	924,532.02
BLOCK H & R INC	23,608	30.60	722,404.80
CARNIVAL CORPORATION	30,660	40.55	1,243,263.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,476	568.50	1,407,606.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,779	50.91	548,758.89
LAS VEGAS SANDS CORP	31,472	72.84	2,292,420.48
MARRIOTT INTL A	17,607	62.82	1,106,071.74



MCDONALD'S CORP	77,454	101.38	7,852,286.52
MGM RESORTS INTERNATIONAL	31,540	24.53	773,676.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,785	57.12	787,399.20
STARBUCKS CORP	58,950	75.18	4,431,861.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	15,537	80.59	1,252,126.83
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	10,559	74.36	785,167.24
WYNN RESORTS LTD	6,494	199.05	1,292,630.70
YUM BRANDS INC	34,367	79.82	2,743,173.94
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,555	17.32	269,412.60
CBS CORP-CL B	43,008	60.74	2,612,305.92
CHARTER COMMUNICATION-A	5,112	148.73	760,307.76
COMCAST CORP-CL A	168,695	52.95	8,932,400.25
COMCAST CORP-SPECIAL A	34,380	52.42	1,802,199.60
DIRECTV	37,945	83.33	3,161,956.85
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	11,585	80.35	930,854.75
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,173	78.82	486,555.86
DISH NETWORK CORPORATION-A	17,245	58.95	1,016,592.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	31,538	19.63	619,090.94
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,326	45.13	827,052.38
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,980	43.49	1,869,200.20
LIBERTY MEDIA CORP	6,970	132.25	921,782.50
NEWS CORP-CLASS A	31,557	17.66	557,296.62
OMNICOM GROUP	21,173	71.44	1,512,599.12
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,470	78.37	585,423.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	241,521	3.37	813,925.77
THE WALT DISNEY CO	131,157	85.48	11,211,300.36
TIME INC	8,719	23.30	203,152.70
TIME WARNER CABLE-A	21,802	144.16	3,142,976.32
TIME WARNER INC	69,754	68.99	4,812,328.46
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	112,794	36.21	4,084,270.74
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,147	35.36	1,278,157.92
VIACOM INC-CLASS B	30,145	87.85	2,648,238.25
ADVANCE AUTO PARTS	5,773	127.71	737,269.83
AMAZON.COM	30,534	327.50	9,999,885.00
AUTONATION INC	4,738	57.05	270,302.90
AUTOZONE INC	2,742	532.57	1,460,306.94
BED BATH & BEYOND INC	17,016	62.15	1,057,544.40
BEST BUY COMPANY INC	24,410	28.97	707,157.70
CARMAX INC	18,757	46.27	867,886.39
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,232	44.85	369,205.20
DOLLAR GENERAL CORP	24,687	62.25	1,536,765.75
DOLLAR TREE INC	17,393	55.50	965,311.50
EXPEDIA INC	8,928	74.55	665,582.40
FAMILY DOLLAR STORES	7,207	68.62	494,544.34
GAMESTOP CORP-CLASS A	11,161	36.52	407,599.72
GAP	20,058	41.82	838,825.56

GENUINE PARTS CO	11,409	86.81	990,415.29
HOME DEPOT	110,624	80.61	8,917,400.64
KOHL'S CORP	16,319	53.71	876,493.49
L BRANDS INC	19,598	59.35	1,163,141.30
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	37,830	29.86	1,129,603.80
LKQ CORP	22,443	28.21	633,117.03
LOWE'S COMPANIES	80,482	47.61	3,831,748.02
MACY'S INC	29,573	59.23	1,751,608.79
NETFLIX INC	4,292	423.09	1,815,902.28
NORDSTROM INC	10,255	68.65	704,005.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,612	152.36	1,312,124.32
PETSMART INC	8,503	58.59	498,190.77
PRICELINE GROUP INC/THE	4,093	1,229.92	5,034,062.56
ROSS STORES INC	17,211	68.72	1,182,739.92
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,166	40.98	129,742.68
STAPLES INC	53,576	11.13	596,300.88
TARGET (DAYTON HUDSON)	46,523	57.60	2,679,724.80
TIFFANY & CO	10,439	100.41	1,048,179.99
TJX COMPANIES INC	55,288	56.22	3,108,291.36
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,907	66.19	721,934.33
TRIPADVISOR INC	9,829	103.70	1,019,267.30
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,684	85.41	485,470.44
URBAN OUTFITTERS INC	9,630	34.68	333,968.40
COSTCO WHOLESALE CORP	34,418	117.78	4,053,752.04
CVS CAREMARK CORPORATION	93,209	78.55	7,321,566.95
KROGER CO	39,836	48.46	1,930,452.56
SAFEWAY INC	18,848	34.29	646,297.92
SYSCO CORP	47,009	37.71	1,772,709.39
WALGREEN CO	71,144	74.92	5,330,108.48
WAL-MART STORES	127,216	77.01	9,796,904.16
WHOLE FOODS MKT INC	28,393	41.14	1,168,088.02
ALTRIA GROUP INC	156,823	41.61	6,525,405.03
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,337	45.14	2,407,632.18
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,835	93.37	918,293.95
BUNGE LIMITED	10,808	76.33	824,974.64
CAMPBELL SOUP CO (US)	16,139	45.86	740,134.54
COCA-COLA CO	312,408	40.91	12,780,611.28
COCA-COLA ENTERPRISES	18,318	45.78	838,598.04
CONAGRA	33,581	32.55	1,093,061.55
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,374	82.61	1,022,216.14
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,915	58.56	931,982.40
GENERAL MILLS INC	48,731	55.17	2,688,489.27
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,379	97.27	1,204,105.33
HORMEL FOODS CORP	12,194	49.57	604,456.58
JM SMUCKER CO	7,617	105.66	804,812.22
KELLOGG CO	21,924	68.12	1,493,462.88
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	9,743	114.10	1,111,676.30
KRAFT FOODS GROUP INC	48,304	60.43	2,919,010.72

LORILLARD INC	29,429	60.40	1,777,511.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,793	73.07	642,504.51
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,860	87.39	1,386,005.40
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,991	67.11	804,716.01
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	135,125	38.07	5,144,208.75
MONSTER BEVERAGE CORP	12,248	68.28	836,293.44
PEPSICO INC	119,485	88.00	10,514,680.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,705	88.33	11,015,192.65
REYNOLDS AMERICAN INC	25,749	59.43	1,530,263.07
TYSON FOODS INC	20,639	37.50	773,962.50
AVON PRODUCTS INC	33,623	14.74	495,603.02
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,826	69.99	757,711.74
CLOROX COMPANY	9,891	92.66	916,500.06
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,887	68.44	4,919,946.28
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,395	118.60	639,847.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,112	76.50	1,462,068.00
HERBALIFE LTD	6,196	63.60	394,065.60
KIMBERLY-CLARK CORP	29,926	111.98	3,351,113.48
PROCTER & GAMBLE CO	213,849	80.09	17,127,166.41
ABBOTT LABORATORIES	120,536	40.13	4,837,109.68
AETNA INC	29,336	79.17	2,322,531.12
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,523	72.34	1,339,953.82
BARD C R INC	6,289	148.05	931,086.45
BAXTER INTERNATIONAL	42,196	73.64	3,107,313.44
BECTON DICKINSON & CO	14,573	120.33	1,753,569.09
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,231	12.76	1,368,267.56
CARDINAL HEALTH	27,121	70.71	1,917,725.91
CAREFUSION CORP	14,931	43.39	647,856.09
CERNER CORP	24,850	53.76	1,335,936.00
CIGNA CORP	22,271	89.84	2,000,826.64
COVIDIEN PLC	34,758	73.13	2,541,852.54
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	12,930	71.93	930,054.90
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	11,646	48.21	561,453.66
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,119	80.81	736,906.39
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	60,606	71.67	4,343,632.02
HCA HOLDINGS INC	24,772	55.38	1,371,873.36
HENRY SCHEIN INC	6,087	119.98	730,318.26
HOLOGIC INC	15,643	25.01	391,231.43
HUMANA INC	12,550	125.38	1,573,519.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,206	374.84	1,201,737.04
LABORATORY CRP OF AMER	7,250	103.02	746,895.00
MCKESSON CORP	18,561	186.69	3,465,153.09
MEDTRONIC	78,182	62.24	4,866,047.68
OMNICARE INC	8,575	65.87	564,835.25
PATTERSON COMPANIES INC	6,178	39.60	244,648.80
QUEST DIAGNOSTICS	12,594	61.70	777,049.80
RESMED INC	12,084	51.60	623,534.40
ST JUDE MEDICAL INC	23,467	66.41	1,558,443.47

STRYKER CORP	25,879	85.50	2,212,654.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,656	79.76	6,193,842.56
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,557	94.00	710,358.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,827	81.75	721,607.25
WELLPOINT INC	22,010	105.28	2,317,212.80
ZIMMER HOLDINGS INC	13,553	106.81	1,447,595.93
ABBVIE INC	125,108	53.84	6,735,814.72
ACTAVIS PLC	13,716	208.32	2,857,317.12
AGILENT TECHNOLOGIES	26,546	59.28	1,573,646.88
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	15,834	167.81	2,657,103.54
ALLERGAN INC	23,458	164.15	3,850,630.70
AMGEN	59,364	116.40	6,909,969.60
BIOGEN IDEC INC	18,577	318.16	5,910,458.32
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,108	61.51	744,763.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	129,844	46.59	6,049,431.96
CELGENE CORP	31,805	161.74	5,144,140.70
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,127	68.62	694,914.74
FOREST LABORATORIES INC	19,379	94.05	1,822,594.95
GILEAD SCIENCES INC	121,094	79.02	9,568,847.88
HOSPIRA INC	14,518	51.00	740,418.00
ILLUMINA INC	10,209	171.35	1,749,312.15
JOHNSON & JOHNSON	222,991	103.22	23,017,131.02
LILLY (ELI) & CO	79,130	59.74	4,727,226.20
MERCK & CO	232,003	57.94	13,442,253.82
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,499	251.45	628,373.55
MYLAN INC	30,904	49.42	1,527,275.68
PERRIGO CO PLC	10,636	140.03	1,489,359.08
PFIZER	502,973	29.35	14,762,257.55
PHARMACYCLICS INC	5,215	97.10	506,376.50
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	3,098	52.98	164,132.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,312	313.74	1,980,326.88
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,267	119.58	3,619,327.86
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,728	74.61	1,397,296.08
WATERS CORP	6,634	105.50	699,887.00
ZOETIS INC	37,755	32.01	1,208,537.55
BANK OF AMERICA CORP	833,066	15.84	13,195,765.44
BB&T CORP	56,766	39.10	2,219,550.60
CIT GROUP INC	14,842	45.87	680,802.54
CITIGROUP	238,665	49.58	11,833,010.70
COMERICA INC	15,925	50.81	809,149.25
FIFTH THIRD BANCORP	65,713	21.63	1,421,700.75
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,475	54.42	461,209.50
HUDSON CITY BANCORP INC	39,785	10.14	403,419.90
JPMORGAN CHASE & CO	298,605	57.42	17,145,899.10
KEY CORP	67,859	14.49	983,276.91
M & T BANK CORP	8,954	125.61	1,124,711.94
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	38,479	15.92	612,585.68
OCWEN FINANCIAL CORP	9,330	37.36	348,568.80

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	26,440	14.92	394,484.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	42,845	88.51	3,792,210.95
REGIONS FINL CORP	109,154	10.85	1,184,320.90
SUNTRUST BANKS	42,956	40.46	1,737,999.76
US BANCORP	143,530	43.52	6,246,425.60
WELLS FARGO & CO	394,058	52.51	20,691,985.58
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,257	201.02	855,742.14
AMERICAN EXPRESS	75,368	95.57	7,202,919.76
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,808	117.77	1,743,938.16
BANK NEW YORK CO	88,964	35.44	3,152,884.16
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	88,322	127.99	11,304,332.78
BLACKROCK INC	10,489	314.57	3,299,524.73
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,028	81.99	3,691,845.72
CME GROUP INC	25,600	70.61	1,807,616.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	36,964	61.76	2,282,896.64
EATON VANCE CORP	10,560	37.63	397,372.80
FRANKLIN RESOURCES INC	32,898	56.58	1,861,368.84
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,844	166.00	5,618,104.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	9,149	188.91	1,728,337.59
INVESCO LTD	35,172	38.20	1,343,570.40
LEGG MASON INC	9,125	50.48	460,630.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	23,996	26.30	631,094.80
MCGRAW-HILL FINANCIAL	20,690	84.23	1,742,718.70
MOODY'S CORP	15,399	87.29	1,344,178.71
MORGAN STANLEY	118,199	31.98	3,780,004.02
NASDAQ OMX GROUP	8,655	37.72	326,466.60
NAVIENT CORP	36,956	16.81	621,230.36
NORTHERN TRUST CORP	17,303	62.64	1,083,859.92
PRICE T ROWE GROUP INC	20,756	84.49	1,753,674.44
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,978	50.49	554,279.22
SCHWAB (CHARLES) CORP	93,878	26.45	2,483,073.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,978	33.17	397,310.26
STATE STREET CORP	33,651	67.21	2,261,683.71
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,077	31.10	624,394.70
VOYA FINANCIAL INC	8,860	36.45	322,947.00
ACE LTD	26,279	104.99	2,759,032.21
AFLAC	35,564	63.07	2,243,021.48
ALLEGHANY CORP	1,477	429.76	634,755.52
ALLSTATE CORP	36,417	59.16	2,154,429.72
AMERICAN INT'L GROUP	109,362	55.07	6,022,565.34
AON PLC	22,895	90.61	2,074,515.95
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,600	57.60	610,560.00
ASSURANT INC	6,358	68.83	437,621.14
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,522	46.73	398,233.06
CHUBB CORPORATION	18,912	94.06	1,778,862.72
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,224	49.26	552,894.24
EVEREST RE GROUP LTD	3,801	160.75	611,010.75
FIDELITY NATIONAL FINL-A	21,984	33.80	743,059.20

GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	34,828	17.94	624,814.32
HARTFORD FINANCIAL SVCS	33,511	36.16	1,211,757.76
LINCOLN NATIONAL CORP	20,204	50.95	1,029,393.80
LOEWS CORP	27,536	44.01	1,211,859.36
MARSH & MCLENNAN COS	44,036	51.25	2,256,845.00
METLIFE INC	74,874	54.66	4,092,612.84
PARTNERRE LTD	3,278	108.61	356,023.58
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,332	49.37	1,201,270.84
PROGRESSIVE CORP	45,611	25.17	1,148,028.87
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,019	89.43	3,221,179.17
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,261	105.69	344,655.09
TORCHMARK CORP	7,913	82.46	652,505.98
TRAVELERS COS INC/THE	27,421	94.66	2,595,671.86
UNUM GROUP	22,500	35.56	800,100.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,670	42.93	500,993.10
WR BERKLEY CORP	10,021	45.45	455,454.45
XL GROUP PLC	19,636	33.14	650,737.04
CBRE GROUP INC-A	22,871	30.40	695,278.40
REALOGY HOLDINGS CORP	13,107	37.43	490,595.01
WEYERHAEUSER CO	45,873	31.32	1,436,742.36
ACCENTURE PLC-CL A	49,807	84.26	4,196,737.82
ACTIVISION BLIZZARD INC	38,750	21.29	824,987.50
ADOBE SYSTEMS INC	38,355	66.93	2,567,100.15
AKAMA I TECHNOLOGIES, INC	15,068	58.13	875,902.84
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,230	267.25	1,130,467.50
ANSYS INC	7,978	76.51	610,396.78
AUTODESK INC	18,991	54.51	1,035,199.41
AUTOMATIC DATA PROCESS	38,652	80.00	3,092,160.00
CA INC	26,963	29.07	783,814.41
CITRIX SYSTEMS INC	14,531	62.76	911,965.56
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	49,096	49.82	2,445,962.72
COMPUTER SCIENCES CORP	12,540	63.69	798,672.60
EBAY	95,558	49.58	4,737,765.64
ELECTRONIC ARTS INC	24,315	34.91	848,836.65
EQUINIX INC	4,154	201.70	837,861.80
FACEBOOK INC-A	147,933	62.88	9,302,027.04
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	23,157	55.15	1,277,108.55
FIREEYE INC	2,504	34.16	85,536.64
FISERV INC	19,305	61.24	1,182,238.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,875	130.99	769,566.25
GOOGLE INC-CL A	22,140	570.73	12,635,962.20
GOOGLE INC-CL C	22,587	562.12	12,696,604.44
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,885	186.22	14,503,744.70
INTUIT INC	21,598	79.84	1,724,384.32
LINKEDIN CORP - A	8,217	156.39	1,285,056.63
MASTERCARD INC-CLASS A	80,584	76.86	6,193,686.24
MICROSOFT CORP	621,913	41.27	25,666,349.51

NETSUITE INC	2,299	79.40	182,540.60
NUANCE COMMUNICATIONS INC	24,768	17.20	426,009.60
ORACLE CORP	283,440	42.70	12,102,888.00
PAYCHEX INC	24,594	41.35	1,016,961.90
RACKSPACE HOSTING INC	11,481	37.74	433,292.94
RED HAT INC	16,200	51.43	833,166.00
SALESFORCE.COM INC	46,398	51.71	2,399,240.58
SERVICENOW INC	10,082	55.94	563,987.08
SYMANTEC CORP	55,197	21.39	1,180,663.83
SYNOPSYS INC	12,497	39.06	488,132.82
TERADATA CORP	12,581	43.23	543,876.63
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,765	31.03	427,127.95
TWITTER INC	6,925	34.47	238,704.75
VANTIV INC - CL A	8,790	32.38	284,620.20
VERISIGN INC	9,399	51.27	481,886.73
VISA INC-CLASS A SHARES	39,674	212.58	8,433,898.92
VMWARE INC-CLASS A	6,521	96.57	629,732.97
WESTERN UNION CO	41,436	16.46	682,036.56
WORKDAY INC-CLASS A	6,399	80.28	513,711.72
XEROX CORP	86,324	12.92	1,115,306.08
YAHOO	77,946	36.04	2,809,173.84
AMPHENOL CORPORATION	12,583	98.20	1,235,650.60
APPLE INC	492,240	93.70	46,122,888.00
ARROW ELECTRONICS INC	8,225	59.94	493,006.50
AVNET INC	11,176	44.43	496,549.68
CISCO SYSTEMS	403,987	24.80	10,018,877.60
CORNING	108,703	21.46	2,332,766.38
EMC CORP	157,985	26.65	4,210,300.25
F5 NETWORKS INC	5,958	111.37	663,542.46
FLEXTRONICS INTL LTD	50,061	11.17	559,181.37
FLIR SYSTEMS INC	11,766	36.13	425,105.58
HARRIS CORP	9,357	77.55	725,635.35
HEWLETT-PACKARD CO	149,794	33.74	5,054,049.56
JUNIPER NETWORKS INC	37,928	24.74	938,338.72
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,890	67.67	1,142,946.30
NETAPP INC	24,963	35.74	892,177.62
QUALCOMM	132,426	79.95	10,587,458.70
SANDISK CORP	17,545	98.17	1,722,392.65
SEAGATE TECHNOLOGY	25,611	54.65	1,399,641.15
TE CONNECTIVITY LTD	33,020	62.14	2,051,862.80
TRIMBLE NAVIGATION LTD	20,253	38.98	789,461.94
WESTERN DIGITAL CORP	17,191	91.64	1,575,383.24
AT&T INC	410,431	35.01	14,369,189.31
CENTURYLINK INC	45,146	36.87	1,664,533.02
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	85,399	5.56	474,818.44
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	12,824	42.98	551,175.52
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,978	100.25	1,000,294.50
SPRINT CORP	61,098	8.77	535,829.46

T-MOBILE US INC	18,011	33.89	610,392.79
VERIZON COMMUNICATIONS	326,583	49.57	16,188,719.31
WINDSTREAM HOLDINGS INC	47,567	9.70	461,399.90
AES CORP	57,042	14.39	820,834.38
ALLIANT ENERGY CORPORATION	9,967	58.43	582,371.81
AMEREN CORPORATION	17,993	39.00	701,727.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,029	53.49	2,087,661.21
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,393	48.11	692,447.23
CALPINE CORP	31,514	23.96	755,075.44
CENTERPOINT ENERGY INC	31,868	23.93	762,601.24
CMS ENERGY CORP	21,161	29.83	631,232.63
CONSOLIDATED EDISON INC	23,406	54.90	1,284,989.40
DOMINION RESOURCES	47,010	69.01	3,244,160.10
DTE ENERGY COMPANY	14,026	75.52	1,059,243.52
DUKE ENERGY CORP	55,250	70.86	3,915,015.00
EDISON INTL	23,825	55.72	1,327,529.00
ENTERGY CORP	15,113	78.69	1,189,241.97
EXELON CORP	69,403	37.08	2,573,463.24
FIRSTENERGY CORP	31,529	34.59	1,090,588.11
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,588	57.99	324,048.12
MDU RESOURCES GROUP INC	16,003	33.56	537,060.68
NEXTERA ENERGY INC	34,200	96.38	3,296,196.00
NISOURCE INC	24,782	37.48	928,829.36
NORTHEAST UTILITIES	23,585	45.17	1,065,334.45
NRG ENERGY INC	25,606	36.45	933,338.70
OGE ENERGY CORP	14,225	36.74	522,626.50
PEPCO HOLDINGS INC	19,425	27.18	527,971.50
PG&E CORP	36,208	46.14	1,670,637.12
PINNACLE WEST CAPITAL	9,679	54.53	527,795.87
PPL CORPORATION	50,657	34.22	1,733,482.54
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,772	38.29	1,561,159.88
SCANA CORP	11,945	51.10	610,389.50
SEMPRA ENERGY	18,654	101.01	1,884,240.54
SOUTHERN CO	71,194	43.64	3,106,906.16
WISCONSIN ENERGY CORP	17,725	45.53	807,019.25
XCEL ENERGY INC	39,898	31.00	1,236,838.00
ALTERA CORPORATION	26,978	33.67	908,349.26
ANALOG DEVICES	23,195	55.31	1,282,915.45
APPLIED MATERIALS	96,441	21.91	2,113,022.31
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	19,176	71.79	1,376,645.04
BROADCOM CORP-CL A	41,236	38.11	1,571,503.96
CREE INC	9,546	47.72	455,535.12
INTEL CORP	389,632	27.91	10,874,629.12
KLA-TENCOR CORP	13,737	68.02	934,390.74
LAM RESEARCH CORP	13,441	65.04	874,202.64
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,912	47.04	795,540.48
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	26,984	14.84	400,442.56
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,989	35.41	814,040.49



	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,233	49.30	849,586.90
	MICRON TECHNOLOGY	85,171	29.00	2,469,959.00
	NVIDIA CORP	47,883	19.05	912,171.15
	TEXAS INSTRUMENTS	83,853	47.88	4,014,881.64
	XILINX INC	22,352	46.09	1,030,203.68
	アメリカドル小計	24,432,805		1,410,180,642.26 (144,487,108,605)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,879	49.25	437,290.75
	ARC RESOURCES LTD	26,046	32.35	842,588.10
	ATHABASCA OIL CORPORATION	29,900	7.22	215,878.00
	BAYTEX ENERGY CORP	8,833	47.04	415,504.32
	CAMECO CORP	30,440	21.29	648,067.60
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,083	46.31	4,032,813.73
	CANADIAN OIL SANDS LTD	39,014	23.22	905,905.08
	CENOVUS ENERGY INC	59,599	32.56	1,940,543.44
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	32,690	44.83	1,465,492.70
	ENBRIDGE	64,002	50.83	3,253,221.66
	ENCANA CORP	57,251	25.48	1,458,755.48
	ENERPLUS CORP	18,609	24.97	464,666.73
	HUSKY ENERGY INC	27,010	35.97	971,549.70
	IMPERIAL OIL	22,241	54.35	1,208,798.35
	INTER PIPELINE LTD	23,421	32.27	755,795.67
	KEYERA CORP	6,153	74.72	459,752.16
	MEG ENERGY CORP	13,539	37.59	508,931.01
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	23,201	22.32	517,846.32
	PEMBINA PIPELINE CORP	24,405	44.69	1,090,659.45
	PENGROWTH ENERGY CORP	50,212	7.21	362,028.52
	PENN WEST PETROLEUM LTD	34,568	10.66	368,494.88
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	13,219	40.40	534,047.60
	SUNCOR ENERGY	115,379	43.39	5,006,294.81
	TALISMAN ENERGY INC	87,591	11.16	977,515.56
	TOURMALINE OIL CORP	11,836	56.54	669,207.44
	TRANSCANADA CORP	56,454	50.64	2,858,830.56
	VERMILION ENERGY INC	7,014	74.67	523,735.38
	AGNICO EAGLE MINES	12,432	33.48	416,223.36
	AGRIUM INC	10,991	99.09	1,089,098.19
	BARRICK GOLD CORP	91,776	17.42	1,598,737.92
	ELDORADO GOLD CORP	58,874	6.56	386,213.44
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	46,979	21.63	1,016,155.77
	FRANCO-NEVADA CORP	11,354	50.51	573,490.54
	GOLDCORP INC	63,981	25.13	1,607,842.53
	KINROSS GOLD CORP	95,851	4.23	405,449.73
	METHANEX CORP	7,700	65.21	502,117.00
	NEW GOLD INC	38,800	5.87	227,756.00
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	68,878	38.77	2,670,400.06
	SILVER WHEATON CORP	27,103	22.81	618,219.43
	TECK RESOURCES LTD-CL B	42,775	23.61	1,009,917.75
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,543	4.09	198,540.87

YAMANA GOLD INC	62,705	8.08	506,656.40
BOMBARDIER B	104,404	3.79	395,691.16
CAE INC	26,139	14.83	387,641.37
FINNING INTERNATIONAL INC	15,934	29.67	472,761.78
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,026	54.93	605,658.18
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,176	67.39	4,324,820.64
CP RAILWAY LIMITED	13,926	195.90	2,728,103.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,900	117.05	1,978,145.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,121	59.91	486,529.11
TIM HORTONS INC	11,090	59.76	662,738.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	33,112	26.93	891,706.16
THOMSON REUTERS CORP	27,357	38.47	1,052,423.79
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,677	105.42	598,469.34
DOLLARAMA INC	6,047	96.40	582,930.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,371	29.30	1,007,070.30
EMPIRE CO LTD 'A'	4,016	66.60	267,465.60
LOBLAW COMPANIES LTD	16,616	47.76	793,580.16
METRO INC	7,659	67.61	517,824.99
WESTON (GEORGE) LTD	3,406	80.52	274,251.12
SAPUTO INC	9,702	62.25	603,949.50
CATAMARAN CORPORATION	17,440	48.21	840,782.40
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	25,530	138.03	3,523,905.90
BANK MONTREAL	51,833	76.76	3,978,701.08
BANK NOVA SCOTIA	95,051	70.71	6,721,056.21
CANADIAN IMPERIAL BANK	32,099	96.76	3,105,899.24
NATIONAL BANK OF CANADA	25,100	45.79	1,149,329.00
ROYAL BANK OF CANADA	113,266	75.24	8,522,133.84
TORONTO-DOMINION BANK	144,534	55.24	7,984,058.16
CI FINANCIAL CORP	12,246	35.16	430,569.36
IGM FINANCIAL INC	6,544	51.65	337,997.60
ONEX CORP	7,134	67.04	478,263.36
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,580	502.81	794,439.80
GREAT-WEST LIFECO INC	24,803	29.50	731,688.50
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,595	42.76	282,002.20
INTACT FINANCIAL CORP	10,898	73.96	806,016.08
MANULIFE FINANCIAL CORP	143,923	20.83	2,997,916.09
POWER CORP OF CANADA	29,644	29.68	879,833.92
POWER FINANCIAL CORP	18,553	33.56	622,638.68
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,033	38.48	1,848,309.84
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	43,626	47.79	2,084,886.54
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	18.85	131,950.00
CGI GROUP INC - CL A	14,985	36.90	552,946.50
OPEN TEXT CORP	10,456	52.48	548,730.88
BLACKBERRY LIMITED	35,879	8.63	309,635.77
BCE INC	21,653	50.46	1,092,610.38
BELL ALIANT INC	6,300	29.00	182,700.00

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,767	44.48	1,235,076.16
	TELUS CORP	18,262	41.00	748,742.00
	ATCO LTD -CLASS I	6,986	51.62	360,617.32
	CANADIAN UTILITIES LTD A	8,412	39.23	330,002.76
	FORTIS INC	15,900	31.86	506,574.00
	TRANSALTA CORP	24,744	12.70	314,248.80
	カナダドル小計	3,143,786		118,787,057.16 (11,155,292,537)
オーストラリア アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,819	22.40	287,145.60
	ORIGIN ENERGY LIMITED	84,001	14.53	1,220,534.53
	SANTOS	81,752	14.58	1,191,944.16
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,813	41.74	2,120,934.62
	WORLEYPARSONS LTD	19,991	16.17	323,254.47
	ALUMINA LIMITED	249,166	1.43	356,307.38
	AMCOR	101,013	10.64	1,074,778.32
	BHP BILLITON LTD	253,158	36.24	9,174,445.92
	BORAL LIMITED	69,891	5.26	367,626.66
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	118,297	4.52	534,702.44
	ILUKA RESOURCES LTD	28,163	8.50	239,385.50
	INCITEC PIVOT LTD	108,462	2.73	296,101.26
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	40,354	14.48	584,325.92
	NECREST MINING LIMITED	63,327	9.77	618,704.79
	ORICA LTD	26,570	19.24	511,206.80
	RIO TINTO LTD	34,281	59.40	2,036,291.40
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	6,260	20.44	127,954.40
	ALS LTD	37,855	8.70	329,338.50
	BRAMBLES LTD	118,833	9.51	1,130,101.83
	SEEK LTD	29,392	16.83	494,667.36
	ASCIANO GROUP	62,700	5.49	344,223.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	167,568	4.96	831,137.28
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	97,415	1.37	133,945.62
	TOLL HOLDINGS LIMITED	64,709	5.32	344,251.88
	TRANSURBAN GROUP	104,607	7.51	785,598.57
	CROWN RESORTS LTD	29,978	15.76	472,453.28
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	5,590	46.90	262,171.00
	TABCORP HOLDINGS	70,012	3.47	242,941.64
	TATTS GROUP LTD	87,232	3.01	262,568.32
	REA GROUP LTD	3,000	42.93	128,790.00
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,357	2.99	159,537.43
	METCASH LTD	80,938	2.93	237,148.34
WESFARMERS LIMITED	91,635	42.42	3,887,156.70	
WOOLWORTHS LTD	100,399	37.04	3,718,778.96	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,671	9.41	439,174.11	
TREASURY WINE ESTATES LTD	61,428	4.92	302,225.76	
COCHLEAR LIMITED	5,406	59.62	322,305.72	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,132	45.70	417,332.40	
SONIC HEALTHCARE LTD	26,678	17.30	461,529.40	
CSL LIMITED	37,767	70.49	2,662,195.83	

	AUST AND NZ BANKING GROUP	216,032	33.67	7,273,797.44	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	26,211	12.22	320,298.42	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	39,586	11.91	471,469.26	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	126,696	81.77	10,359,931.92	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	185,150	33.53	6,208,079.50	
	WESTPAC BANKING	243,762	34.55	8,421,977.10	
	ASX LTD	15,073	35.59	536,448.07	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	22,219	60.10	1,335,361.90	
	AMP LTD	227,300	5.34	1,213,782.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	177,565	5.87	1,042,306.55	
	QBE INSURANCE GROUP	103,967	10.93	1,136,359.31	
	SUNCORP GROUP LIMITED	97,999	13.30	1,303,386.70	
	COMPUTERSHARE LIMITED	34,261	12.62	432,373.82	
	TELSTRA CORP	340,462	5.23	1,780,616.26	
	TPG TELECOM LTD	8,100	5.84	47,304.00	
	AGL ENERGY LTD	45,461	15.31	696,007.91	
	SP AUSNET	172,854	1.35	233,352.90	
	オーストラリアドル小計	4,823,318		82,248,070.16 (7,880,187,602)	
イギリス ボンド	AMEC PLC	22,875	12.62	288,682.50	
	BG GROUP	268,278	12.51	3,356,157.78	
	BP PLC	1,454,992	5.05	7,356,439.55	
	PETROFAC LTD	16,540	12.52	207,080.80	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	306,799	23.67	7,263,466.32	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	192,953	24.69	4,764,974.33	
	TULLOW OIL PLC	71,091	8.44	600,008.04	
	ANGLO AMERICAN PLC	112,817	14.71	1,660,102.15	
	ANTOFAGASTA PLC	31,803	7.81	248,381.43	
	BHP BILLITON PLC	166,645	19.04	3,172,920.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,712	25.20	295,142.40	
	FRESNILLO PLC	14,610	7.84	114,542.40	
	GLENCORE PLC	819,169	3.26	2,672,948.44	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,935	33.04	526,492.40	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,875	43.80	257,325.00	
	REXAM PLC	61,464	5.30	326,066.52	
	RIO TINTO PLC REG	100,350	31.72	3,183,603.75	
	BAE SYSTEMS PLC	258,249	4.30	1,112,020.19	
	BUNZL PLC	25,201	16.77	422,620.77	
	COBHAM PLC	91,422	3.26	298,127.14	
	IMI PLC	21,206	16.07	340,780.42	
	MEGGITT PLC	66,022	5.24	345,955.28	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	95,076	2.86	272,297.66	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	151,953	10.71	1,627,416.63	
	SMITHS GROUP PLC	33,106	13.42	444,282.52	
	TRAVIS PERKINS PLC	21,014	17.10	359,339.40	
WEIR GROUP PLC/THE	18,079	26.34	476,200.86		
WOLSELEY LTD	21,432	33.84	725,258.88		
AGGREKO PLC	22,985	16.79	385,918.15		

BABCOCK INTL GROUP PLC	34,453	12.26	422,393.78
CAPITA GROUP PLC	50,508	11.43	577,306.44
EXPERIAN PLC	75,753	10.55	799,194.15
G4S PLC	136,353	2.51	342,518.73
INTERTEK GROUP PLC	14,205	29.06	412,797.30
EASYJET PLC	15,000	16.08	241,200.00
ROYAL MAIL PLC	48,500	5.01	242,985.00
NEW GKN	134,107	3.92	525,699.44
BURBERRY GROUP PLC	34,636	14.84	513,998.24
PERSIMMON PLC	25,901	13.11	339,562.11
CARNIVAL PLC	15,227	24.79	377,477.33
COMPASS GROUP PLC	144,100	10.06	1,449,646.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,731	23.19	457,561.89
TUI TRAVEL PLC	43,042	4.09	176,256.99
WHITBREAD PLC	14,253	43.13	614,731.89
WILLIAM HILL	71,899	3.47	249,920.92
BRITISH SKY BROADCASTING	82,718	8.76	724,609.68
ITV PLC	321,966	1.79	578,894.86
PEARSON	64,084	11.49	736,325.16
REED ELSEVIER PLC	91,383	9.49	867,224.67
WPP PLC	104,846	13.00	1,362,998.00
ASOS PLC	4,000	32.00	128,000.00
KINGFISHER PLC	186,868	3.86	721,684.21
MARKS & SPENCER GROUP PLC	127,744	4.54	580,085.50
NEXT PLC	12,432	66.25	823,620.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	12,900	8.25	106,425.00
MORRISON SUPERMARKETS	163,403	1.94	317,982.23
SAINSBURY (J) PLC	107,933	3.28	354,667.83
TESCO	637,427	2.94	1,874,672.80
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29,020	30.57	887,141.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	148,645	35.31	5,249,398.17
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,138	13.86	182,092.68
DIAGEO	197,378	18.91	3,733,404.87
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	75,627	26.03	1,968,570.81
SABMILLER PLC	75,488	32.77	2,474,119.20
TATE & LYLE	38,590	6.84	264,148.55
UNILEVER PLC	100,831	26.56	2,678,071.36
RECKITT BENCKISER PLC	51,123	51.20	2,617,497.60
SMITH & NEPHEW PLC	70,235	10.75	755,026.25
ASTRAZENECA	99,440	43.27	4,302,768.80
GLAXOSMITHKLINE	382,856	15.98	6,119,953.16
SHIRE PLC	46,121	35.86	1,653,899.06
BARCLAYS	1,264,434	2.44	3,094,702.21
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,860	6.28	9,335,658.38
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,422,432	0.78	3,485,760.90
ROYAL BANK OF SCOTLAND	186,948	3.43	641,605.53
STANDARD CHARTERED PLC	191,501	13.38	2,563,240.88
3I GROUP PLC	76,008	4.28	325,314.24

ABERDEEN ASSET MGMT PLC	69,585	4.54	316,333.41	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,952	12.94	258,178.88	
ICAP PLC	40,718	4.01	163,604.92	
INVESTEC PLC	44,939	5.27	237,053.22	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	15,143	19.76	299,225.68	
SCHRODERS PLC	9,263	26.65	246,858.95	
ADMIRAL GROUP PLC	17,104	15.10	258,270.40	
AVIVA PIC	232,567	5.33	1,240,744.94	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	93,600	2.61	244,670.40	
FRIENDS LIFE GROUP LTD	114,141	3.27	373,469.35	
LEGAL & GENERAL GROUP	475,076	2.35	1,118,328.90	
OLD MUTUAL PLC	386,755	2.04	790,913.97	
PRUDENTIAL	201,864	13.80	2,785,723.20	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	68,001	4.92	334,564.92	
STANDARD LIFE PLC	187,855	3.97	747,099.33	
SAGE GROUP PLC	93,378	4.12	384,904.11	
BT GROUP PLC	623,657	4.06	2,532,671.07	
INMARSAT PLC	40,009	7.64	305,668.76	
VODAFONE GROUP PLC	2,085,152	2.07	4,336,073.58	
CENTRICA PLC	409,885	3.33	1,368,606.01	
NATIONAL GRID PLC	294,362	8.39	2,469,697.18	
SEVERN TRENT PLC	18,253	19.94	363,964.82	
SSE PLC	77,565	15.70	1,217,770.50	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,278	8.93	520,713.93	
ARM HOLDINGS PLC	112,799	9.09	1,025,906.90	
イギリス債券小計	22,040,601		136,298,384.04 (23,467,855,764)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	28,501	37.90	1,080,187.90	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	674	340.00	229,160.00	
GIVAUDAN-REG	716	1,463.00	1,047,508.00	
HOLCIM LTD	18,112	82.80	1,499,673.60	
SIKA AG-BR	174	3,735.00	649,890.00	
SYNGENTA AG	7,502	347.70	2,608,445.40	
ABB LTD	170,243	21.13	3,597,234.59	
GEBERIT AG-REG	2,997	302.30	905,993.10	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,564	135.50	211,922.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,773	137.30	518,032.90	
SULZER AG-REG	2,388	137.60	328,588.80	
ADECCO	12,484	76.80	958,771.20	
SGS SA	451	2,223.00	1,002,573.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,597	122.10	561,293.70	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,591	91.95	3,732,342.45	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,485	529.50	1,315,807.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,638	98.45	358,161.10	
ARYZTA AG	6,675	84.10	561,367.50	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	129	1,184.00	152,736.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	86	4,481.00	385,366.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	53,995.00	377,965.00	

	NESTLE SA - REGISTERED	254,278	68.95	17,532,468.10
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,215	137.30	578,719.50
	ACTELION LTD-REG	8,106	90.60	734,403.60
	LONZA GROUP AG-REG	4,572	98.70	451,256.40
	NOVARTIS	181,134	79.60	14,418,266.40
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,350	267.20	14,789,520.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	118,799	27.52	3,269,348.48
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,532	38.85	719,968.20
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	82.20	188,155.80
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,424	244.20	347,740.80
	UBS AG-REG	287,065	18.09	5,193,005.85
	BALOISE HOLDING AG	3,778	107.50	406,135.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,428	212.40	515,707.20
	SWISS RE LTD	28,554	79.25	2,262,904.50
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	267.20	3,115,552.00
	SWISS PRIME SITE-REG	4,659	73.05	340,339.95
	SWISSCOM	1,790	530.00	948,700.00
	スイスフラン小計	1,296,420		87,895,211.52 (10,037,633,155)
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	168,000	105.40	17,707,200.00
	NWS HOLDINGS LTD	157,500	14.02	2,208,150.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	103,000	14.50	1,493,500.00
	MTR CORP	110,500	29.40	3,248,700.00
	LI & FUNG	487,400	11.02	5,371,148.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,000	24.60	2,066,400.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	71,000	24.45	1,735,950.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	173,000	56.80	9,826,400.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	88,400	24.80	2,192,320.00
	SANDS CHINA LTD	189,000	52.90	9,998,100.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	154,000	12.28	1,891,120.00
	SJM HOLDINGS LTD	140,000	20.25	2,835,000.00
	WYNN MACAU LTD	137,200	30.15	4,136,580.00
	BANK EAST ASIA	114,964	31.80	3,655,855.20
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	312,000	23.30	7,269,600.00
	HANG SENG BANK	57,400	128.50	7,375,900.00
	FIRST PACIFIC CO	238,000	8.96	2,132,480.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	84,600	146.40	12,385,440.00
	AIA GROUP LTD	937,200	39.05	36,597,660.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS	113,000	136.80	15,458,400.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	151,000	24.10	3,639,100.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	62,843	52.80	3,318,110.40
	HYSAN DEVELOPMENT CO	61,000	36.40	2,220,400.00
	KERRY PROPERTIES LTD	65,000	26.25	1,706,250.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	375,000	9.00	3,375,000.00
	SINO LAND CO	186,600	12.52	2,336,232.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	130,000	107.70	14,001,000.00
	SWIRE PACIFIC A	51,000	93.80	4,783,800.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	67,000	23.70	1,587,900.00

	WHARF HOLDINGS	124,000	55.85	6,925,400.00
	WHEELLOCK & CO LTD	63,000	32.40	2,041,200.00
	PCCW LTD	429,000	4.20	1,801,800.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	44,000	53.10	2,336,400.00
	CLP HOLDINGS	151,000	63.45	9,580,950.00
	HONG KONG & CHINA GAS	462,667	16.78	7,763,552.26
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,500	66.45	7,409,175.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,700	88.75	1,925,875.00
	香港ドル小計	6,476,474		226,338,047.86 (2,992,188,992)
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	108,500	10.70	1,160,950.00
	NOBLE GROUP LTD	292,145	1.46	426,531.70
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,000	5.36	332,320.00
	SEMBCORP MARINE LTD	81,400	4.09	332,926.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	108,000	3.93	424,440.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	152,000	1.02	155,040.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	184,000	2.47	454,480.00
	SINGAPORE AIRLINES	46,600	10.56	492,096.00
	GENTING SINGAPORE PLC	414,400	1.34	557,368.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	112,250	4.21	472,572.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	45.02	360,160.00
	OLAM INTERNATIONAL LTD	38,000	2.50	95,000.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	486,720	0.58	282,297.60
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	138,000	3.23	445,740.00
	DBS GROUP	133,000	17.07	2,270,310.00
	OCBC BANK	210,000	9.74	2,045,400.00
	UNITED OVERSEAS BANK	104,000	22.68	2,358,720.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	56,000	7.00	392,000.00
	CAPITALAND LTD	199,000	3.23	642,770.00
	CAPITAMALLS ASIA LTD	119,000	2.35	279,650.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	41,000	10.34	423,940.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	230,000	2.77	637,100.00
KEPPEL LAND LTD	68,000	3.47	235,960.00	
UOL GROUP LIMITED	47,400	6.80	322,320.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	626,880	3.88	2,432,294.40	
STARHUB LTD	64,000	4.25	272,000.00	
	シンガポールドル小計	4,130,295		18,304,386.20 (1,500,044,449)
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	53,297	9.15	487,667.55
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	80,261	3.92	314,623.12
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	8.47	186,340.00
	XERO LTD	2,333	29.42	68,636.86
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	145,967	2.71	396,300.40
	CONTACT ENERGY LTD	34,237	5.30	181,456.10
	ニュージーランドドル小計	338,095		1,635,024.03 (142,377,892)
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	21,069	130.30	2,745,290.70
	BOLIDEN AB	20,397	94.15	1,920,377.55



ALFA LAVAL AB	23,908	173.90	4,157,601.20		
ASSA ABLOY B	26,551	341.10	9,056,546.10		
ATLAS COPCO A	51,092	194.70	9,947,612.40		
ATLAS COPCO B	28,755	181.20	5,210,406.00		
SANDVIK AB	83,650	93.10	7,787,815.00		
SKANSKA B	29,417	158.00	4,647,886.00		
SKF AB-B	31,156	171.50	5,343,254.00		
VOLVO B	122,998	93.90	11,549,512.20		
SECURITAS B	26,913	79.10	2,128,818.30		
ELECTROLUX AB-SER B	16,750	167.20	2,800,600.00		
HUSQVARNA AB-B SHS	35,160	52.25	1,837,110.00		
HENNES & MAURITZ B	73,307	286.10	20,973,132.70		
SWEDISH MATCH AB	17,413	228.80	3,984,094.40		
SCA SV CELLULOSA B	44,576	190.40	8,487,270.40		
ELEKTA AB-B SHS	30,486	88.10	2,685,816.60		
GETINGE AB-B SHS	16,752	178.10	2,983,531.20		
NORDEA BANK AB	235,442	100.00	23,544,200.00		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	116,178	93.15	10,821,980.70		
SVENSKA HANDELSBK A	40,761	338.00	13,777,218.00		
SWEDBANK AB-A	73,735	181.80	13,405,023.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	130.00	1,122,030.00		
INVESTOR AB-B SHS	36,955	262.80	9,711,774.00		
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	20,215	260.40	5,263,986.00		
ERICSSON (LM) B	245,361	82.75	20,303,622.75		
HEXAGON AB-B SHS	18,575	218.70	4,062,352.50		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,957	620.50	3,075,818.50		
TELE2 AB-B SHS	29,400	81.05	2,382,870.00		
TELIASONERA AB	197,228	49.94	9,849,566.32		
スウェーデンクローナ小計	1,727,788		225,567,116.52 (3,457,943,896)		
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	15,080	114.40	1,725,152.00	
	SEADRILL LTD	28,906	233.40	6,746,660.40	
	STATOIL ASA	87,821	184.60	16,211,756.60	
	SUBSEA 7 SA	25,126	121.50	3,052,809.00	
	NORSK HYDRO	107,419	32.95	3,539,456.05	
	YARA INTERNATIONAL ASA	14,188	292.70	4,152,827.60	
	ORKLA	57,069	54.00	3,081,726.00	
	DNB ASA	79,010	116.80	9,228,368.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,350	115.80	1,661,730.00	
	TELENOR ASA	56,688	147.50	8,361,480.00	
ノルウェークローネ小計	485,657		57,761,965.65 (991,195,330)		
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	18,022	272.00	4,901,984.00	
	VESTAS WIND SYSEMS	16,116	300.20	4,838,023.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	240	13,720.00	3,292,800.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	550	14,470.00	7,958,500.00	
	DSV A/S	15,765	183.90	2,899,183.50	
	PANDORA A/S	7,158	413.50	2,959,833.00	

	CARLSBERG AS-B	8,644	571.50	4,940,046.00
	COLOPLAST-B	8,863	502.50	4,453,657.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	956	492.60	470,925.60
	NOVO NORDISK A/S-B	156,424	236.60	37,009,918.40
	DANSKE BANK A/S	51,154	155.50	7,954,447.00
	TRYG A/S	2,274	532.50	1,210,905.00
	TDC A/S	59,213	53.60	3,173,816.80
	デンマーククローネ小計	345,379		86,064,040.00 (1,605,954,986)
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	310	1,475.00	457,250.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,484	30.58	871,040.72
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	256	2,038.00	521,728.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	68,510	177.30	12,146,823.00
	BANK HAPOALIM BM	92,737	20.51	1,902,035.87
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	82,035	13.69	1,123,059.15
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,694	45.71	534,532.74
	NICE SYSTEMS LTD	4,815	138.30	665,914.50
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	173,157	6.18	1,070,110.26
	イスラエルシェケル小計	461,998		19,292,494.24 (571,443,679)
ユーロ	ENI	197,588	19.15	3,783,810.20
	FUGRO NV-CVA	4,683	43.21	202,352.43
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	26,226	13.00	340,938.00
	NESTE OIL OYJ	11,555	15.19	175,520.45
	OMV AG	11,309	30.29	342,549.61
	REPSOL SA	66,798	19.40	1,295,881.20
	SAIPEM	23,606	20.10	474,480.60
	TECHNIP S.A.	8,772	79.47	697,110.84
	TENARIS SA	39,499	17.20	679,382.80
	TOTAL SA	168,638	52.04	8,775,921.52
	VOPAK	6,661	38.23	254,683.33
	AIR LIQUIDE	27,146	99.04	2,688,539.84
	AKZO NOBEL	19,790	55.66	1,101,511.40
	ARCELORMITTAL	74,783	11.40	852,900.11
	ARKEMA	4,246	77.34	328,385.64
	BASF SE	71,773	86.10	6,179,655.30
	CRH	57,499	21.21	1,219,553.79
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,446	35.12	156,165.75
	HEIDELBERGCEMENT AG	11,051	64.71	715,110.21
	IMERYSA SA	3,585	64.86	232,523.10
	K+S AG	14,642	24.90	364,659.01
	KONINKLIJKE DSM NV	13,534	52.57	711,482.38
	LAFARGE (FRANCE)	14,782	67.13	992,315.66
	LANXESS	6,450	51.63	333,013.50
	LINDE AG	14,284	155.70	2,224,018.80
	SOLVAY SA	4,895	120.70	590,826.50
STORA ENSO OYJ R	49,587	7.80	386,778.60	
THYSSEN KRUPP	37,049	22.12	819,523.88	

UMICORE	7,723	34.30	264,898.90
UPM KYMMENE CORP	39,953	13.31	531,774.43
VOESTALPINE AG	10,486	34.71	364,021.49
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,499	33.87	491,081.13
AIRBUS GROUP NV	46,422	53.22	2,470,578.84
ALSTOM RGPT	16,420	29.80	489,316.00
ANDRITZ AG	6,090	42.98	261,748.20
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,895	42.58	251,038.57
BOUYGUES ORD	14,799	34.32	507,901.68
BRENTAG AG	4,081	141.15	576,033.15
CNH INDUSTRIAL NV	77,776	8.04	625,707.92
FERROVIAL SA	29,809	16.41	489,165.69
FINMECCANICA SPA	38,417	6.62	254,512.62
GEA GROUP AG	14,210	33.02	469,214.20
HOCHTIEF AG	2,182	66.65	145,430.30
KONE OYJ-B	23,590	30.25	713,597.50
KONINKLIJKE PHILIPS	78,070	23.99	1,873,289.65
LEGRAND SA	21,943	47.03	1,032,089.00
MAN SE	2,691	90.50	243,535.50
METSO OYJ	8,009	27.40	219,446.60
OCI NV	6,651	28.35	188,555.85
OSRAM LICHT AG	7,339	37.25	273,377.75
PRYSMIAN SPA	18,458	16.96	313,047.68
REXEL SA	17,749	17.34	307,767.66
SAFRAN SA	21,863	50.63	1,106,923.69
SAINT-GOBAIN	34,778	44.62	1,551,968.25
SCHNEIDER ELECTRIC	40,803	70.75	2,886,812.25
SIEMENS	61,959	99.56	6,168,638.04
THALES SA	8,086	46.47	375,796.85
VALLOUREC	9,820	40.09	393,732.90
VINCI S.A.	38,087	56.63	2,156,866.81
WARTSILA OYJ	11,075	40.60	449,645.00
ZARDOYA OTIS SA	16,507	13.35	220,368.45
ZODIAC AEROSPACE	14,520	26.64	386,885.40
BUREAU VERITAS SA	19,841	21.61	428,863.21
EDENRED	16,898	23.07	389,836.86
RANDSTAD HOLDING NV	9,459	44.05	416,668.95
SOCIETE BIC SA	2,119	96.84	205,203.96
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	32,869	16.77	551,213.13
ADP	2,976	97.42	289,921.92
ATLANTIA SPA	29,160	21.12	615,859.20
BOLLORE	270	470.00	126,900.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,741	19.93	393,438.13
DEUTSCHE POST AG-REG	74,646	27.31	2,038,582.26
FRAPORT AG	3,788	55.39	209,817.32
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	35,363	9.87	349,103.53
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	82,352	5.19	427,653.93
TNT EXPRESS	30,460	6.68	203,716.48

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,707	92.58	2,472,534.06
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,741	70.83	335,805.03
CONTINENTAL AG	8,886	175.60	1,560,381.60
DAIMLER AG	75,100	70.09	5,263,759.00
FIAT ORD	70,851	7.91	560,431.41
MICHELIN	14,416	91.84	1,323,965.44
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,560	30.42	321,235.20
PEUGEOT SA	31,000	10.44	323,795.00
PIRELLI & CO	21,825	12.68	276,741.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,248	78.56	962,202.88
RENAULT SA	15,440	70.84	1,093,769.60
VALEO SA	6,350	105.15	667,702.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,530	197.00	2,271,410.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,034	194.65	395,918.10
ADIDAS AG	16,744	77.09	1,290,794.96
CHRISTIAN DIOR	4,337	150.00	650,550.00
HUGO BOSS AG	3,036	105.80	321,208.80
KERING	5,834	160.25	934,898.50
LUXOTTICA GROUP SPA	13,324	42.04	560,140.96
LVMH	21,503	143.45	3,084,605.35
ACCOR	12,024	39.11	470,258.64
SODEXO	7,375	79.05	582,993.75
ALTICE SA	3,615	56.00	202,440.00
AXEL SPRINGER SE	3,824	47.24	180,645.76
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,417	24.91	284,397.47
JC DECAUX SA	6,530	28.70	187,443.65
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,691	105.95	179,161.45
LAGADERE S.C.A	10,764	25.61	275,719.86
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	17,031	34.25	583,311.75
PUBLICIS GROUPE	14,233	61.82	879,884.06
REED ELSEVIER NV	53,084	16.37	869,250.50
RTL GROUP	3,000	85.19	255,588.00
SES	24,308	26.85	652,669.80
SKY DEUTSCHLAND AG	34,000	6.90	234,600.00
TELENET GROUP HOLDING NV	4,084	43.63	178,205.34
WOLTERS KLUWER	25,621	21.95	562,380.95
INDITEX	17,360	108.75	1,887,900.00
CARREFOUR	48,452	26.83	1,300,209.42
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,981	95.52	475,785.12
COLRUYT SA	5,355	41.14	220,304.70
DELHAIZE GROUP	7,899	52.35	413,512.65
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	48,188	6.79	327,533.83
JERONIMO MARTINS	19,371	12.52	242,524.92
KONINKLIJKE AHOLD NV	72,538	13.42	973,822.65
METRO STAMM	12,444	30.91	384,706.26
ANHEUSER-BUSCH INBEV	63,186	81.42	5,144,604.12
DANONE (GROUPE)	44,644	54.56	2,435,776.64

HEINEKEN HOLDING NV	7,826	47.68	373,143.68
HEINEKEN NV	18,564	51.18	950,105.52
KERRY GROUP PLC-A	13,223	55.82	738,107.86
PERNOD-RICARD	17,088	87.96	1,503,060.48
REMY COINTREAU	2,682	66.00	177,012.00
UNILEVER NV-CVA	128,086	31.78	4,070,573.08
BEIERSDORF AG	8,344	73.17	610,530.48
HENKEL AG & CO KGAA	8,478	74.95	635,426.10
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,142	85.00	1,202,070.00
LOREAL	18,976	127.60	2,421,337.60
CELESIO AG	3,460	26.13	90,427.10
ESSILOR INTERNATIONAL	16,391	76.70	1,257,189.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,829	47.86	853,385.08
FRESENIUS SE&CO KGAA	10,042	110.60	1,110,645.20
BAYER	64,687	105.00	6,792,135.00
GRIFOLS SA	13,170	41.88	551,559.60
MERCK KGAA	5,429	127.05	689,754.45
ORION OYJ-CLASS B	6,539	26.57	173,741.23
QIAGEN N.V.	19,385	17.02	329,932.70
SANOFI	93,868	79.04	7,419,326.72
UCB (GROUPE)	8,718	57.05	497,361.90
BANCA MONTE DEI PASCHI - RTS	5,718	21.50	122,937.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	5,718	1.84	10,566.86
BANCO BILBAO VIZCAYA	462,657	9.91	4,587,244.15
BANCO DE SABADELL SA	287,128	2.64	760,314.94
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	162,149	1.10	178,363.90
BANCO POPOLARE SPA	27,800	14.84	412,552.00
BANCO POPULAR ESPANOL	133,962	5.45	730,628.74
BANCO SANTANDER SA	930,640	7.88	7,338,096.40
BANK OF IRELAND	2,170,000	0.28	616,280.00
BANKIA SA	325,444	1.52	497,603.87
BNP PARIBAS	82,055	52.32	4,293,117.60
CAIXABANK	148,954	4.73	704,999.28
CAIXABANK SA-RTS	148,954	0.05	8,043.51
COMMERZBANK AG	77,609	12.49	969,724.45
CREDIT AGRICOLE SA	78,959	11.95	943,560.05
ERSTE GROUP BANK AG	20,082	26.13	524,843.07
INTESA SANPAOLO	940,906	2.61	2,457,646.47
INTESA SANPAOLO-RNC	44,487	2.21	98,583.19
KBC GROEP NV	19,386	43.32	839,801.52
NATIXIS	72,797	5.25	382,184.25
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	25.96	204,201.36
SOCIETE GENERALE	56,424	44.61	2,517,356.76
UNICREDIT SPA	351,264	6.80	2,388,595.20
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	66,759	7.19	479,997.21
DEUTSCHE BANK AG-RTS	78,844	1.63	128,515.72
DEUTSCHE BANK NAMEN	78,844	28.33	2,234,044.74
DEUTSCHE BOERSE	15,512	55.57	862,001.84

EURAZEO	2,843	63.59	180,786.37
EXOR SPA	7,647	31.87	243,709.89
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,379	77.38	493,607.02
ING GROEP	302,957	10.88	3,297,686.94
MEDIOBANCA	39,830	7.98	317,843.40
WENDEL	2,923	112.00	327,376.00
AEGON	139,970	6.56	918,203.20
AGEAS	17,661	30.62	540,868.12
ALLIANZ SE-REG	35,549	125.05	4,445,402.45
ASSICURAZIONI GENERALI	93,495	16.75	1,566,041.25
AXA	145,308	18.68	2,715,079.98
CNP ASSURANCES	15,411	16.19	249,504.09
DELTA LLOYD NV	13,451	18.48	248,641.73
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,984	65.48	326,352.32
MAPFRE SA	76,919	3.07	236,525.92
MUENCHENER RUECKVERSICH.	14,498	161.25	2,337,802.50
SAMPO OYJ-A SHS	34,297	37.97	1,302,257.09
SCOR SE	13,911	25.72	357,790.92
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	66,000	2.53	167,244.00
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	3,668	39.60	145,252.80
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	22,664	16.30	369,423.20
IMMOFINANZ AG	68,368	2.67	182,542.56
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	29,823	31.76	947,178.48
ATOS	5,308	65.51	347,727.08
CAP GEMINI SA	12,129	54.37	659,453.73
DASSAULT SYSTEMES SA	4,786	93.77	448,783.22
GEMALTO	6,164	81.96	505,201.44
SAP AG	71,662	55.32	3,964,341.84
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,983	35.53	283,635.99
ALCATEL-LUCENT	218,338	2.93	639,730.34
NOKIA CORP	299,046	5.80	1,734,466.80
BELGACOM	10,282	24.65	253,502.71
DEUTSCHE TELEKOM	240,486	12.68	3,050,564.91
ELISA A	10,777	22.74	245,068.98
ILIAD SA	2,223	238.70	530,630.10
KPN (KON.)	243,038	2.73	664,951.96
ORANGE	148,939	12.81	1,907,908.59
TELECOM ITALIA ORD	753,893	0.98	745,223.23
TELECOM ITALIA RNC	475,204	0.77	366,857.48
TELEFONICA	321,156	12.48	4,008,026.88
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,607	5.87	173,941.12
TELEKOM AUSTRIA AG	18,792	7.11	133,705.08
VIVENDI	97,246	19.25	1,872,471.73
ZIGGO NV	11,724	34.62	405,943.50
E.ON SE	153,736	14.41	2,216,104.44
ELECTRICITE DE FRANCE	19,078	26.37	503,182.25
ENAGAS	15,215	21.96	334,197.47

ENEL	531,845	4.33	2,305,016.23	
ENEL GREEN POWER SPA	142,752	2.15	306,916.80	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	166,510	3.67	612,423.78	
FORTUM OYJ	37,927	18.72	709,993.44	
GAS NATURAL SDG SA	26,254	22.00	577,588.00	
GDF SUEZ	110,400	20.95	2,312,880.00	
IBERDROLA SA	391,404	5.40	2,115,930.02	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,195	64.86	596,387.70	
RWE STAMM	37,178	29.63	1,101,770.03	
SNAM SPA	165,423	4.44	734,478.12	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	21,575	15.34	331,068.37	
TERNA SPA	119,765	4.04	484,090.13	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,360	14.27	419,114.00	
ASML HOLDING NV	28,415	65.65	1,865,444.75	
INFINEON TECHNOLOGIES	90,009	9.12	821,692.16	
STMICROELECTRONICS	46,205	7.12	329,210.62	
ユーロ小計	16,666,494		248,953,996.77 (34,664,354,510)	
合計	86,369,110		242,953,581,397 (242,953,581,397)	

## B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	526,000.00	397,130.00	
		アメリカドル小計	526,000.00	397,130.00 (40,689,939)	
	オーストラリア ドル	APA GROUP	58,103.00	407,883.06	
		LEND LEASE GROUP	42,331.00	571,468.50	
		SYDNEY AIRPORT	87,840.00	382,104.00	
	オーストラリアドル小計	188,274.00	1,361,455.56 (130,441,057)		
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	213,000.00	1,808,370.00	
香港ドル小計	213,000.00	1,808,370.00 (23,906,651)			
投資信託受益証券合計				195,037,647 (195,037,647)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	30,165.00	718,530.30	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	58,193.00	715,191.97	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	30,644.00	2,747,541.04	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	77,958.00	905,871.96	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,811.00	1,372,755.12	
		BOSTON PROPERTIES	11,648.00	1,394,731.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,847.00	481,617.98	
		CROWN CASTLE INTL CORP	26,929.00	2,040,410.33	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,579.00	555,773.58	
		DUKE REALTY CORP	25,178.00	450,686.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,463.00	1,695,016.36	

	ESSEX PROPERTY TRUST	5,000.00	909,050.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,180.00	622,791.40	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	43,204.00	1,032,143.56	
	HCP INC	34,771.00	1,450,646.12	
	HEALTH CARE REIT INC	22,253.00	1,409,727.55	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	62,075.00	1,399,170.50	
	KIMCO REALTY CORP	29,008.00	666,603.84	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	10,090.00	394,014.50	
	MACERICH CO/THE	12,120.00	805,616.40	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	14,335.00	639,484.35	
	PROLOGIS INC	39,679.00	1,643,900.97	
	PUBLIC STORAGE	11,808.00	2,023,064.64	
	RAYONIER INC	10,390.00	505,889.10	
	REALTY INCOME CORP	17,509.00	757,439.34	
	REGENCY CENTERS CORP	6,134.00	335,345.78	
	SIMON PROPERTY GROUP	24,548.00	4,099,516.00	
	SL GREEN REALTY CORP	8,155.00	907,814.60	
	UDR INC	19,406.00	532,888.76	
	VENTAS INC	23,607.00	1,518,874.38	
	VORNADO REALTY TRUST	13,321.00	1,418,020.45	
	アメリカドル小計	727,008.00	36,150,128.60 (3,703,942,176)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	12,000.00	281,040.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,756.00	380,903.64	
	カナダドル小計	25,756.00	661,943.64 (62,163,127)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,417.00	266,739.87	
	DEXUS PROPERTY GROUP	478,916.00	550,753.40	
	FEDERATION CENTRES	134,986.00	341,514.58	
	GOODMAN GROUP	139,089.00	716,308.35	
	GPT GROUP	138,256.00	546,111.20	
	MIRVAC GROUP	298,691.00	554,071.80	
	STOCKLAND	190,002.00	760,008.00	
	WESTFIELD GROUP	149,065.00	1,597,976.80	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	241,278.00	762,438.48	
	オーストラリアドル小計	1,896,700.00	6,095,922.48 (584,050,332)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	81,877.00	596,883.33	
	HAMMERSON PLC	62,162.00	378,877.39	
	INTU PROPERTIES PLC	53,831.00	174,950.75	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	62,251.00	681,648.45	
	SEGRO PLC	62,978.00	236,734.30	
	イギリスポンド小計	323,099.00	2,069,094.22 (356,256,642)	
香港ドル	LINK REIT	186,000.00	7,793,400.00	
	香港ドル小計	186,000.00	7,793,400.00 (103,028,748)	



シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,000.00	320,160.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	183,150.00	
	CAPITAMALL TRUST	144,600.00	293,538.00	
シンガポールドル小計		392,600.00	796,848.00 (65,301,693)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584.00	0.00	
	CORIO NV	4,870.00	186,983.65	
	FONCIERE DES REGIONS	1,902.00	148,603.26	
	GECINA SA	2,157.00	232,308.90	
	ICADE	2,664.00	205,394.40	
	KLEPIERRE	8,081.00	300,613.20	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,832.00	1,653,726.80	
ユーロ小計		1,633,090.00	2,727,630.21 (379,795,230)	
投資証券合計			5,254,537,948 (5,254,537,948)	
合計			5,449,575,595 (5,449,575,595)	

(注)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	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率	
アメリカドル	株式	587銘柄	97.5%	58.2%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	31銘柄	2.5%	1.5%
カナダドル	株式	93銘柄	99.4%	4.5%
	投資証券	2銘柄	0.6%	0.0%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	91.7%	3.2%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.5%	0.1%
	投資証券	9銘柄	6.8%	0.2%
イギリスポンド	株式	102銘柄	98.5%	9.4%
	投資証券	5銘柄	1.5%	0.1%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.0%	4.0%
香港ドル	株式	37銘柄	95.9%	1.2%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.8%	0.0%
	投資証券	1銘柄	3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	26銘柄	95.8%	0.6%
	投資証券	3銘柄	4.2%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%	1.4%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	13銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	234銘柄	98.9%	14.0%
	投資証券	7銘柄	1.1%	0.2%

(注)組入時価比率は、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。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

項目	平成26年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	256,535,336
コール・ローン	3,163,441,299
国債証券	290,305,471,356
派生商品評価勘定	7,152,914
未収入金	15,016,466
未収利息	2,820,123,851
前払費用	50,298,445
差入委託証拠金	205,052,350
流動資産合計	296,823,092,017
資産合計	296,823,092,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,277,601
未払金	47,093,044
未払解約金	950,352,244
流動負債合計	1,001,722,889
負債合計	1,001,722,889

純資産の部	
元本等	
元本	136,121,081,679
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	159,700,287,449
元本等合計	295,821,369,128
純資産合計	295,821,369,128
負債純資産合計	296,823,092,017

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 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 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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あります。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あります。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上してあります。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
--	---------------

1. 計算期間の期首元本額	219,933,320,446円
計算期間中の追加設定元本額	6,792,311,685円
計算期間中の一部解約元本額	90,604,550,452円
計算日の元本額	136,121,081,679円
計算日の元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	3,686,204,374円
DC外国債券インデックスファンド	1,854,416,832円
DC外国債券インデックスファンドL	9,410,958,871円
物価連動債組入世界債券ファンド	45,938,467円
DCバランスファンド30	246,237,284円
DCバランスファンド50	249,992,506円
DCバランスファンド70	55,709,112円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	72,363,516円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	35,896,985円
新生・4分散ファンド	67,696,618円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	377,184,949円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	12,934,451円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	50,709,512円
外国債券インデックスe	1,313,018,528円
インデックスコレクション(外国債券)	1,231,131,230円
インデックスコレクション(バランス株式30)	200,786,765円
インデックスコレクション(バランス株式50)	181,155,212円
インデックスコレクション(バランス株式70)	59,136,262円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	2,724,307,650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)	371,883,032円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	212,561,372円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	5,109,249,503円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	2,727,433,189円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	10,001,418,211円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	27,501,695,082円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	2,188,763,755円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	99,818,579円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	5,016,956,448円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	5,594,526,057円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,480,005,307円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	15,149,063,468円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	621,104,375円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	22,074,757,300円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	3,233,862,974円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	274,803,222円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,509,915,272円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,257,358,084円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	239,894,261円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	100,929,489円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	724,006,644円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	5,005,327,896円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	29,380,592円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	569,673,825円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	190,380,974円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	2,921,891,376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) 世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	37,752,031円 890,237円
2. 計算日における受益権総数	136,121,081,679口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1732円 (21,732円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 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金融商品に係るリスク	<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、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、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リスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券</p> <p>「(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>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26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	4,920,787,883	
合計	4,920,787,883	

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成26年2月8日から平成26年6月10日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
- 債券関連

区分	種類	平成26年 6月10日現在			
		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	1,151,561,134	-	1,149,318,863	2,242,271
	合計	1,151,561,134	-	1,149,318,863	2,242,271

## (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。

## 通貨関連

区分	種類	平成26年 6月10日現在			
		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				
	アメリカドル	627,327,390	-	630,067,500	2,740,110
	カナダドル	75,137,778	-	75,112,000	25,778
	イギリスポンド	146,916,706	-	148,057,600	1,140,894
	ユーロ	628,057,242	-	629,319,600	1,262,358
	計	1,477,439,116	-	1,482,556,700	5,117,584
	合計	1,477,439,116	-	1,482,556,700	5,117,584

## (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。

## . ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## 附属明細表

(平成26年6月10日現在)

有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/16	5,000,000.00	4,988,281.25	
		T 0.25% 05/15/16	9,000,000.00	8,973,457.02	
		T 0.25% 07/15/15	10,000,000.00	10,011,132.80	
		T 0.25% 07/31/15	10,000,000.00	10,011,328.10	
		T 0.25% 08/15/15	5,000,000.00	5,004,980.45	
		T 0.25% 09/15/15	5,000,000.00	5,003,906.25	
		T 0.25% 09/30/15	3,000,000.00	3,002,226.57	
		T 0.25% 10/15/15	5,000,000.00	5,002,246.10	
		T 0.25% 10/31/15	7,000,000.00	7,002,597.63	
		T 0.25% 12/15/15	7,000,000.00	6,997,949.21	
		T 0.375% 01/31/16	10,000,000.00	10,012,695.30	
		T 0.375% 02/15/16	17,350,000.00	17,366,265.62	
		T 0.375% 03/15/16	15,000,000.00	15,006,152.40	
		T 0.375% 08/31/15	3,800,000.00	3,809,351.57	
		T 0.375% 11/15/15	6,000,000.00	6,011,250.00	

T 0.5% 06/15/16	1,050,000.00	1,051,291.99	
T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,908,820.53	
T 0.625% 02/15/17	5,000,000.00	4,983,691.40	
T 0.625% 04/30/18	20,000,000.00	19,487,109.40	
T 0.625% 05/31/17	3,000,000.00	2,976,621.09	
T 0.625% 07/15/16	7,000,000.00	7,022,011.71	
T 0.625% 08/15/16	9,050,000.00	9,072,094.76	
T 0.625% 08/31/17	8,500,000.00	8,395,576.14	
T 0.625% 09/30/17	12,000,000.00	11,835,000.00	
T 0.625% 10/15/16	9,000,000.00	9,007,031.25	
T 0.625% 11/15/16	8,500,000.00	8,498,173.86	
T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,914,453.15	
T 0.625% 12/15/16	9,000,000.00	8,989,804.71	
T 0.75% 02/28/18	13,300,000.00	13,062,574.25	
T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,901,367.20	
T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,978,750.00	
T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,582,062.49	
T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,927,148.45	
T 0.875% 01/31/17	2,000,000.00	2,007,695.32	
T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,977,031.26	
T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,017,109.36	
T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,007,617.20	
T 0.875% 04/30/17	3,350,000.00	3,352,813.46	
T 0.875% 05/15/17	6,000,000.00	6,002,578.14	
T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,785,937.50	
T 0.875% 09/15/16	5,000,000.00	5,036,328.15	
T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,011,796.88	
T 0.875% 12/31/16	5,000,000.00	5,024,218.75	
T 1% 03/31/17	5,000,000.00	5,027,050.80	
T 1% 05/31/18	1,000,000.00	986,757.81	
T 1% 06/30/19	5,000,000.00	4,826,074.20	
T 1% 08/31/16	4,850,000.00	4,900,773.43	
T 1% 08/31/19	6,000,000.00	5,769,140.64	
T 1% 09/30/16	3,000,000.00	3,029,765.64	
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,799,023.45	
T 1% 10/31/16	6,200,000.00	6,258,367.17	
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,832,767.60	
T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,910,898.44	
T 1.125% 05/31/19	4,800,000.00	4,673,156.25	
T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	4,996,875.00	
T 1.25% 01/31/19	4,800,000.00	4,728,750.00	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,962,343.76	
T 1.25% 08/31/15	11,990,000.00	12,149,008.02	
T 1.25% 09/30/15	15,430,000.00	15,641,861.15	
T 1.25% 10/31/15	10,000,000.00	10,141,601.60	
T 1.375% 02/28/19	5,500,000.00	5,439,951.16	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,831,640.65	
T 1.375% 06/30/18	3,500,000.00	3,499,658.19	



T 1.375% 07/31/18	6,000,000.00	5,991,914.04	
T 1.375% 09/30/18	8,520,000.00	8,483,723.45	
T 1.375% 11/30/15	4,550,000.00	4,625,003.92	
T 1.375% 11/30/18	3,000,000.00	2,981,308.59	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,671,166.01	
T 1.5% 01/31/19	8,550,000.00	8,513,762.70	
T 1.5% 02/28/19	6,100,000.00	6,069,261.73	
T 1.5% 06/30/16	7,450,000.00	7,607,876.00	
T 1.5% 07/31/16	8,500,000.00	8,681,787.12	
T 1.5% 08/31/18	6,500,000.00	6,514,853.54	
T 1.5% 12/31/18	2,500,000.00	2,493,066.40	
T 1.625% 03/31/19	4,400,000.00	4,397,937.50	
T 1.625% 04/30/19	7,000,000.00	6,988,105.46	
T 1.625% 08/15/22	5,700,000.00	5,366,015.62	
T 1.625% 11/15/22	9,500,000.00	8,899,570.36	
T 1.75% 05/15/22	7,600,000.00	7,256,812.50	
T 1.75% 05/15/23	12,750,000.00	11,964,829.11	
T 1.75% 05/31/16	4,600,000.00	4,719,582.01	
T 1.75% 07/31/15	14,550,000.00	14,814,002.91	
T 1.75% 10/31/18	1,800,000.00	1,820,496.09	
T 1.875% 06/30/15	12,500,000.00	12,729,003.87	
T 1.875% 06/30/20	10,200,000.00	10,131,468.75	
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,055,273.44	
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,242,660.54	
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,030,443.34	
T 2% 01/31/16	3,000,000.00	3,083,261.73	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	5,861,835.96	
T 2% 02/15/23	9,500,000.00	9,142,636.69	
T 2% 02/28/21	1,550,000.00	1,534,227.54	
T 2% 04/30/16	6,090,000.00	6,274,841.00	
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,000,000.00	
T 2% 11/15/21	7,300,000.00	7,156,851.59	
T 2% 11/30/20	6,000,000.00	5,961,796.86	
T 2.125% 01/31/21	5,000,000.00	4,993,457.05	
T 2.125% 08/15/21	6,900,000.00	6,847,306.63	
T 2.125% 08/31/20	6,000,000.00	6,029,882.82	
T 2.125% 12/31/15	11,000,000.00	11,313,671.93	
T 2.25% 03/31/16	9,150,000.00	9,461,314.47	
T 2.25% 04/30/21	4,700,000.00	4,717,900.37	
T 2.25% 07/31/18	4,500,000.00	4,655,742.21	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,076,796.88	
T 2.375% 03/31/16	7,900,000.00	8,189,769.55	
T 2.375% 05/31/18	3,800,000.00	3,954,671.89	
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,601,025.40	
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,087,421.88	
T 2.375% 12/31/20	7,200,000.00	7,313,203.15	
T 2.5% 06/30/17	3,200,000.00	3,352,124.99	
T 2.5% 08/15/23	7,000,000.00	6,980,996.12	

T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,520,794.93	
T 2.625% 02/29/16	12,850,000.00	13,361,239.30	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,315,654.31	
T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,781,968.76	
T 2.625% 08/15/20	13,000,000.00	13,461,855.42	
T 2.625% 11/15/20	13,000,000.00	13,432,910.14	
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,104,687.50	
T 2.75% 02/15/24	9,000,000.00	9,124,101.54	
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	306,278.51	
T 2.75% 05/31/17	4,900,000.00	5,168,447.28	
T 2.75% 08/15/42	12,150,000.00	10,644,301.77	
T 2.75% 11/15/23	7,950,000.00	8,077,790.04	
T 2.75% 11/15/42	2,900,000.00	2,535,574.22	
T 2.75% 11/30/16	3,000,000.00	3,155,214.84	
T 2.75% 12/31/17	11,000,000.00	11,614,453.18	
T 2.875% 03/31/18	4,800,000.00	5,089,781.23	
T 2.875% 05/15/43	9,300,000.00	8,322,410.13	
T 3% 02/28/17	4,600,000.00	4,877,078.14	
T 3% 05/15/42	9,680,000.00	8,949,462.50	
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,086,468.94	
T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,224,296.88	
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,252,500.00	
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	3,605,472.64	
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,452,988.27	
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,218,787.09	
T 3.125% 05/15/19	3,620,000.00	3,870,783.97	
T 3.125% 05/15/21	4,190,000.00	4,447,046.69	
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,483,890.63	
T 3.125% 11/15/41	5,400,000.00	5,132,003.88	
T 3.25% 03/31/17	5,000,000.00	5,340,722.65	
T 3.25% 05/31/16	3,250,000.00	3,431,796.87	
T 3.25% 06/30/16	2,500,000.00	2,643,408.20	
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,770,192.97	
T 3.25% 12/31/16	2,800,000.00	2,982,164.05	
T 3.375% 11/15/19	8,390,000.00	9,083,158.22	
T 3.5% 02/15/18	6,850,000.00	7,416,462.87	
T 3.5% 02/15/39	1,600,000.00	1,640,968.75	
T 3.5% 05/15/20	7,900,000.00	8,597,730.44	
T 3.625% 02/15/20	9,800,000.00	10,736,167.93	
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	5,725,113.48	
T 3.625% 02/15/44	5,100,000.00	5,276,707.04	
T 3.625% 08/15/19	1,400,000.00	1,532,507.81	
T 3.625% 08/15/43	3,200,000.00	3,313,624.99	
T 3.75% 08/15/41	6,400,000.00	6,825,500.03	
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,533,860.93	
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,264,281.25	
T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	5,351,900.00	
T 4.0% 08/15/18	4,000,000.00	4,427,109.36	

T 4.25% 05/15/39	1,750,000.00	2,021,728.52	
T 4.25% 08/15/15	10,500,000.00	11,005,517.56	
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,493,727.53	
T 4.25% 11/15/40	4,500,000.00	5,207,431.63	
T 4.375% 02/15/38	1,150,000.00	1,351,250.00	
T 4.375% 05/15/40	4,750,000.00	5,600,546.87	
T 4.375% 05/15/41	3,350,000.00	3,957,122.07	
T 4.375% 11/15/39	4,800,000.00	5,653,687.48	
T 4.5% 02/15/16	2,420,000.00	2,590,250.77	
T 4.5% 02/15/36	3,600,000.00	4,307,203.11	
T 4.5% 05/15/17	3,500,000.00	3,869,072.27	
T 4.5% 05/15/38	2,500,000.00	2,992,138.67	
T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,498,779.30	
T 4.5% 11/15/15	2,160,000.00	2,291,667.18	
T 4.625% 02/15/17	5,500,000.00	6,069,658.21	
T 4.625% 02/15/40	4,000,000.00	4,892,265.64	
T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,686,673.82	
T 4.75% 02/15/41	2,300,000.00	2,872,439.45	
T 4.75% 08/15/17	3,000,000.00	3,356,250.00	
T 4.875% 08/15/16	750,000.00	821,250.00	
T 5.0% 05/15/37	1,150,000.00	1,470,270.50	
T 5.125% 05/15/16	2,000,000.00	2,181,718.76	
T 5.25% 02/15/29	1,600,000.00	2,030,218.75	
T 5.25% 11/15/28	1,350,000.00	1,712,153.32	
T 5.375% 02/15/31	2,500,000.00	3,243,945.32	
T 5.5% 08/15/28	1,250,000.00	1,620,214.85	
T 6.0% 02/15/26	1,350,000.00	1,792,494.14	
T 6.125% 11/15/27	2,300,000.00	3,134,244.13	
T 6.25% 05/15/30	1,500,000.00	2,108,115.24	
T 6.25% 08/15/23	3,600,000.00	4,722,117.19	
T 6.5% 11/15/26	1,150,000.00	1,600,476.56	
T 7.25% 05/15/16	1,670,000.00	1,889,774.60	
T 7.5% 11/15/16	3,250,000.00	3,791,264.65	
T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,630,148.44	
T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,319,312.50	
T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,512,160.15	
アメリカドル小計		1,049,040,000.00	1,072,875,565.09 (109,926,830,399)
カナダドル	CAN 1% 05/01/16	600,000.00	599,262.00
	CAN 1% 08/01/16	1,050,000.00	1,048,230.75
	CAN 1% 11/01/15	1,450,000.00	1,449,637.50
	CAN 1.25% 02/01/16	2,400,000.00	2,407,920.00
	CAN 1.25% 03/01/18	2,650,000.00	2,638,989.25
	CAN 1.25% 09/01/18	1,050,000.00	1,039,211.25
	CAN 1.5% 02/01/17	1,300,000.00	1,311,349.00
	CAN 1.5% 03/01/17	600,000.00	605,802.00
	CAN 1.5% 06/01/23	2,750,000.00	2,590,706.25
	CAN 1.5% 08/01/15	1,400,000.00	1,407,994.00

	CAN 1.5% 09/01/17	2,200,000.00	2,215,642.00	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,150,000.00	1,158,515.75	
	CAN 1.75% 09/01/19	700,000.00	701,946.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,900,000.00	1,934,437.50	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,980,000.00	4,038,227.40	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,950,000.00	1,981,034.25	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,950,000.00	2,046,330.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,860,000.00	2,964,404.30	
	CAN 3% 12/01/15	2,310,000.00	2,376,655.05	
	CAN 3.25% 06/01/21	2,250,000.00	2,445,615.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,400,000.00	2,637,336.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,100,000.00	3,522,778.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,650,000.00	4,022,774.50	
	CAN 4% 06/01/16	3,450,000.00	3,647,029.50	
	CAN 4% 06/01/17	1,750,000.00	1,894,795.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	3,050,000.00	3,702,227.25	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,500,000.00	2,773,187.50	
	CAN 4.5% 06/01/15	2,200,000.00	2,274,767.00	
	CAN 5% 06/01/37	2,550,000.00	3,488,081.25	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,100,000.00	2,915,482.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,600,000.00	3,750,916.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	840,000.00	1,354,588.20	
	<b>カナダドル小計</b>	<b>66,690,000.00</b>	<b>72,945,871.95</b> <b>(6,850,346,834)</b>	
オーストラリア ドル	ACGB 2.75% 04/21/24	2,950,000.00	2,709,235.75	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,600,000.00	1,518,160.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,100,000.00	994,444.00	
	ACGB 3.25% 10/21/18	1,400,000.00	1,408,897.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,450,000.00	1,498,662.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	2,850,000.00	2,965,838.25	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,750,000.00	3,986,475.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,150,000.00	1,182,849.75	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,250,000.00	2,425,848.75	
	ACGB 4.75% 06/15/16	3,950,000.00	4,108,671.50	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,150,000.00	2,212,199.50	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,600,000.00	3,933,594.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,850,000.00	4,182,062.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,050,000.00	4,609,953.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	3,600,000.00	4,106,880.00	
ACGB 5.75% 07/15/22	3,400,000.00	3,912,482.00		
ACGB 6% 02/15/17	4,250,000.00	4,600,136.25		
	<b>オーストラリアドル小計</b>	<b>47,350,000.00</b>	<b>50,356,389.25</b> <b>(4,824,645,654)</b>	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	5,600,000.00	5,534,396.00	
	UKT 1.25% 07/22/18	3,450,000.00	3,389,038.50	
	UKT 1.75% 01/22/17	2,900,000.00	2,947,748.50	
	UKT 1.75% 07/22/19	1,150,000.00	1,138,005.50	
	UKT 1.75% 09/07/22	5,050,000.00	4,750,232.00	

UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,164,325.00	
UKT 2.25% 09/07/23	4,450,000.00	4,289,310.50	
UKT 2.75% 09/07/24	850,000.00	844,925.50	
UKT 3.25% 01/22/44	2,750,000.00	2,637,208.75	
UKT 3.5% 07/22/68	1,700,000.00	1,734,000.00	
UKT 3.75% 07/22/52	2,820,000.00	3,004,808.70	
UKT 3.75% 09/07/19	4,050,000.00	4,412,677.50	
UKT 3.75% 09/07/20	4,400,000.00	4,809,838.00	
UKT 3.75% 09/07/21	3,500,000.00	3,830,067.50	
UKT 4% 01/22/60	2,000,000.00	2,278,260.00	
UKT 4% 03/07/22	2,600,000.00	2,891,148.00	
UKT 4% 09/07/16	4,000,000.00	4,276,660.00	
UKT 4.25% 03/07/36	3,650,000.00	4,139,246.00	
UKT 4.25% 06/07/32	4,000,000.00	4,535,740.00	
UKT 4.25% 09/07/39	2,750,000.00	3,134,546.25	
UKT 4.25% 12/07/27	2,450,000.00	2,778,471.50	
UKT 4.25% 12/07/40	3,550,000.00	4,053,461.00	
UKT 4.25% 12/07/46	3,250,000.00	3,759,990.00	
UKT 4.25% 12/07/49	2,850,000.00	3,329,113.50	
UKT 4.25% 12/07/55	2,750,000.00	3,264,497.50	
UKT 4.5% 03/07/19	4,500,000.00	5,046,142.50	
UKT 4.5% 09/07/34	3,480,000.00	4,073,427.00	
UKT 4.5% 12/07/42	4,100,000.00	4,892,858.00	
UKT 4.75% 03/07/20	3,850,000.00	4,410,733.25	
UKT 4.75% 09/07/15	4,600,000.00	4,839,913.00	
UKT 4.75% 12/07/30	2,970,000.00	3,559,767.75	
UKT 4.75% 12/07/38	3,050,000.00	3,737,348.00	
UKT 5% 03/07/18	4,100,000.00	4,618,158.00	
UKT 5% 03/07/25	3,700,000.00	4,449,712.50	
UKT 6.0% 12/07/28	1,900,000.00	2,549,762.00	
UKT 8% 06/07/21	2,700,000.00	3,697,447.50	
UKT 8% 12/07/15	2,100,000.00	2,333,961.00	
UKT 8.75% 08/25/17	1,070,000.00	1,319,074.60	
イギリスポンド小計	121,740,000.00	134,456,020.80 (23,150,637,661)	
スイスフラン	SWISS 2% 04/28/21	500,000.00	556,752.50
	SWISS 2.25% 07/06/20	750,000.00	840,993.75
	SWISS 2.5% 03/12/16	1,050,000.00	1,098,704.25
	SWISS 3% 01/08/18	1,200,000.00	1,328,844.00
	SWISS 3% 05/12/19	1,250,000.00	1,426,393.75
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	831,200.00
	SWISS 4% 02/11/23	900,000.00	1,165,702.50
	SWISS 4% 04/08/28	1,100,000.00	1,516,542.50
	SWISS 4.25% 06/05/17	1,400,000.00	1,580,355.00
スイスフラン小計	8,950,000.00	10,345,488.25 (1,181,454,758)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	450,000.00	444,366.00
	SIGB 1.125% 04/01/16	1,450,000.00	1,468,306.25

	SIGB 2.25% 06/01/21	820,000.00	834,136.80	
	SIGB 2.375% 04/01/17	700,000.00	737,691.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	750,000.00	794,298.75	
	SIGB 2.75% 04/01/42	550,000.00	517,030.25	
	SIGB 2.75% 07/01/23	450,000.00	463,124.25	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,000,000.00	1,026,875.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	500,000.00	492,900.00	
	SIGB 3% 09/01/24	650,000.00	679,084.25	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,050,000.00	1,123,006.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,100,000.00	1,198,070.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	450,000.00	472,261.50	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,000,000.00	1,076,345.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	890,000.00	954,805.35	
	SIGB 4% 09/01/18	900,000.00	1,014,556.50	
	シンガポールドル小計	12,710,000.00	13,296,858.40 (1,089,677,545)	
マレーシア リングgit	MGS 3.172% 07/15/16	950,000.00	947,226.00	
	MGS 3.197% 10/15/15	2,960,000.00	2,963,478.00	
	MGS 3.26% 03/01/18	1,200,000.00	1,185,234.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,950,000.00	1,872,126.75	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,536,584.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	3,000,000.00	2,936,370.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,680,000.00	1,554,008.40	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,491,162.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,600,000.00	1,612,864.00	
	MGS 3.835% 08/12/15	3,250,000.00	3,276,893.75	
	MGS 3.844% 04/15/33	850,000.00	773,644.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,050,000.00	1,049,233.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	640,000.00	613,859.20	
	MGS 4.127% 04/15/32	850,000.00	807,738.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,900,000.00	2,933,828.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	7,350,000.00	7,506,297.75	
	MGS 4.262% 09/15/16	5,350,000.00	5,460,691.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	4,100,000.00	4,208,670.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,450,000.00	2,482,732.00	
MGS 4.498% 04/15/30	950,000.00	965,632.25		
MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,075,560.00		
	マレーシアリングgit小計	49,080,000.00	49,253,835.10 (1,577,107,799)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	14,750,000.00	14,353,372.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	5,100,000.00	5,374,125.00	
	SGB 3% 07/12/16	9,550,000.00	10,041,920.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,000,000.00	9,380,320.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	12,250,000.00	13,971,186.25	
	SGB 3.75% 08/12/17	11,750,000.00	12,867,836.25	
	SGB 4.25% 03/12/19	16,800,000.00	19,294,548.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	13,450,000.00	14,083,427.75	
	SGB 5% 12/01/20	8,400,000.00	10,276,602.00	

スウェーデンクローナ小計		100,050,000.00	109,643,338.25 (1,680,832,375)
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	8,000,000.00	7,681,200.00
	NGB 3% 03/14/24	5,250,000.00	5,430,363.75
	NGB 3.75% 05/25/21	11,700,000.00	12,848,998.50
	NGB 4.25% 05/19/17	11,500,000.00	12,369,285.00
	NGB 4.5% 05/22/19	10,250,000.00	11,506,496.25
ノルウェークローネ小計		46,700,000.00	49,836,343.50 (855,191,654)
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	10,800,000.00	10,918,854.00
	DGB 2.5% 11/15/16	8,150,000.00	8,622,985.25
	DGB 3% 11/15/21	19,550,000.00	22,379,569.25
	DGB 4% 11/15/15	15,800,000.00	16,687,486.00
	DGB 4% 11/15/17	9,900,000.00	11,177,446.50
	DGB 4% 11/15/19	17,900,000.00	21,183,039.00
	DGB 4.5% 11/15/39	22,400,000.00	31,716,048.00
	DGB 7% 11/10/24	4,100,000.00	6,333,803.00
デンマーククローネ小計		108,600,000.00	129,019,231.00 (2,407,498,850)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	12,500,000.00	17,424,937.50
	MBONO 10% 12/05/24	20,550,000.00	27,608,616.75
	MBONO 4.75% 06/14/18	18,200,000.00	18,434,416.00
	MBONO 5% 06/15/17	24,150,000.00	24,968,805.75
	MBONO 6% 06/18/15	11,750,000.00	12,089,222.50
	MBONO 6.25% 06/16/16	29,050,000.00	30,654,867.25
	MBONO 6.5% 06/09/22	22,300,000.00	23,841,376.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	23,830,000.00	25,718,527.50
	MBONO 7.25% 12/15/16	22,500,000.00	24,462,112.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	18,550,000.00	21,232,886.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,000,000.00	25,119,270.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	15,750,000.00	17,836,481.25
	MBONO 7.75% 12/14/17	23,700,000.00	26,525,869.50
	MBONO 8% 06/11/20	15,100,000.00	17,474,777.00
	MBONO 8% 12/07/23	13,150,000.00	15,460,257.75
	MBONO 8% 12/17/15	23,050,000.00	24,662,578.00
MBONO 8.5% 05/31/29	22,700,000.00	27,903,634.50	
MBONO 8.5% 11/18/38	19,300,000.00	23,558,159.00	
MBONO 8.5% 12/13/18	11,450,000.00	13,342,112.50	
メキシコペソ小計		369,580,000.00	418,318,907.75 (3,296,352,993)
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/16	3,400,000.00	3,267,723.00
	POLGB 0% 07/25/15	1,800,000.00	1,753,857.00
	POLGB 0% 07/25/16	1,350,000.00	1,280,704.50
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,800,000.00	3,744,311.00
	POLGB 3.75% 04/25/18	3,800,000.00	3,931,917.00
	POLGB 4% 10/25/23	4,900,000.00	5,091,296.00
	POLGB 4.75% 04/25/17	3,550,000.00	3,756,982.75
	POLGB 4.75% 10/25/16	4,400,000.00	4,622,398.00

	POLGB 5% 04/25/16	3,750,000.00	3,919,762.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	3,550,000.00	3,837,603.25	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,550,000.00	3,966,752.25	
	POLGB 5.5% 10/25/19	3,500,000.00	3,925,232.50	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,600,000.00	1,941,168.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,600,000.00	4,196,196.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	3,850,000.00	4,451,562.50	
	POLGB 6.25% 10/24/15	6,550,000.00	6,883,100.25	
	ポーランドズロチ小計	56,950,000.00	60,570,566.50 (2,056,976,438)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	26,400,000.00	31,106,328.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	16,750,000.00	12,531,345.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	13,650,000.00	10,219,209.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	18,900,000.00	17,820,810.00	
	SAGB 7% 02/28/31	14,100,000.00	11,976,610.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	16,350,000.00	16,029,049.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,150,000.00	6,021,588.00	
	SAGB 8% 01/31/30	3,150,000.00	2,960,291.25	
	SAGB 8% 12/21/18	15,600,000.00	15,919,176.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	15,050,000.00	15,488,933.25	
	SAGB 8.5% 01/31/37	3,300,000.00	3,162,835.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	8,900,000.00	8,598,957.50	
	南アフリカランド小計	158,300,000.00	151,835,133.50 (1,462,172,335)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,800,000.00	1,860,453.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	2,300,000.00	2,426,810.50	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,150,000.00	1,234,162.75	
	BGB 2.75% 03/28/16	1,740,000.00	1,821,962.70	
	BGB 3% 06/22/34	850,000.00	894,863.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,800,000.00	2,013,813.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	2,800,000.00	3,000,354.00	
	BGB 3.5% 06/28/17	2,400,000.00	2,636,112.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	800,000.00	943,480.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	2,050,000.00	2,147,200.75	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,400,000.00	3,984,970.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,400,000.00	2,729,208.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,000,000.00	3,605,775.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,550,000.00	1,876,003.75	
	BGB 4.0% 03/28/17	1,600,000.00	1,769,584.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,200,000.00	2,556,609.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,550,000.00	3,259,665.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,900,000.00	3,524,239.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,450,000.00	2,993,483.50	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,500,000.00	1,883,010.00	
	BGB 5% 03/28/35	3,500,000.00	4,810,452.50	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,250,000.00	4,506,905.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,800,000.00	2,108,322.00	
	BKO 0.25% 09/11/15	1,500,000.00	1,503,547.50	



BTNS 1% 07/25/17	3,890,000.00	3,983,943.50	
BTNS 1.75% 02/25/17	3,150,000.00	3,285,875.25	
BTNS 2% 07/12/15	5,000,000.00	5,103,575.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	6,490,000.00	6,727,566.45	
BTNS 2.5% 07/25/16	5,600,000.00	5,881,484.00	
BTPS 1.5% 12/15/16	100,000.00	101,867.00	
BTPS 2.25% 05/15/16	750,000.00	774,135.00	
BTPS 2.5% 05/01/19	1,000,000.00	1,057,010.00	
BTPS 3% 06/15/15	6,150,000.00	6,307,593.75	
BTPS 3% 11/01/15	6,800,000.00	7,034,192.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,300,000.00	1,332,825.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	3,144,296.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	1,600,000.00	1,760,192.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,240,000.00	4,730,080.40	
BTPS 3.75% 04/15/16	5,330,000.00	5,643,590.55	
BTPS 3.75% 05/01/21	1,000,000.00	1,112,965.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	5,130,000.00	5,320,502.55	
BTPS 3.75% 08/01/16	4,350,000.00	4,638,035.25	
BTPS 3.75% 08/01/21	5,300,000.00	5,892,142.50	
BTPS 4% 02/01/17	6,200,000.00	6,724,923.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,650,000.00	4,956,156.00	
BTPS 4% 09/01/20	4,950,000.00	5,614,339.50	
BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000.00	6,767,262.25	
BTPS 4.25% 03/01/20	5,200,000.00	5,961,462.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	5,500,000.00	6,303,192.50	
BTPS 4.5% 02/01/18	6,100,000.00	6,859,419.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	4,420,000.00	5,127,774.60	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,650,000.00	5,357,195.25	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,500,000.00	2,885,737.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,600,000.00	5,269,208.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,366,140.75	
BTPS 4.5% 07/15/15	1,410,000.00	1,471,659.30	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,950,000.00	7,906,076.75	
BTPS 4.75% 05/01/17	2,160,000.00	2,400,224.40	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,600,000.00	4,009,428.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,750,000.00	5,591,272.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	6,500,000.00	7,656,642.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,600,000.00	3,037,346.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,000,000.00	2,301,200.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	4,400,000.00	4,800,136.00	
BTPS 5% 03/01/22	3,900,000.00	4,667,266.50	
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	6,742,201.50	
BTPS 5% 08/01/34	4,400,000.00	5,288,096.00	
BTPS 5% 09/01/40	4,050,000.00	4,839,102.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,700,000.00	4,440,777.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	4,800,000.00	5,445,144.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,350,000.00	6,581,008.25	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,200,000.00	3,938,016.00	

BTPS 5.5% 11/01/22	4,350,000.00	5,350,086.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,000,000.00	3,915,300.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,450,000.00	7,239,262.25	
BTPS 6.5% 11/01/27	4,650,000.00	6,335,322.75	
BTPS 7.25% 11/01/26	2,600,000.00	3,703,349.00	
BTPS 9% 11/01/23	2,700,000.00	4,141,111.50	
DBR 1.5% 02/15/23	3,400,000.00	3,497,444.00	
DBR 1.5% 05/15/23	4,050,000.00	4,153,295.25	
DBR 1.5% 05/15/24	500,000.00	505,612.50	
DBR 1.5% 09/04/22	4,000,000.00	4,134,920.00	
DBR 1.75% 02/15/24	1,800,000.00	1,868,274.00	
DBR 1.75% 07/04/22	5,800,000.00	6,125,670.00	
DBR 2% 01/04/22	4,900,000.00	5,283,817.00	
DBR 2% 08/15/23	1,800,000.00	1,918,710.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,750,000.00	3,020,173.75	
DBR 2.25% 09/04/21	3,250,000.00	3,568,857.50	
DBR 2.5% 01/04/21	3,950,000.00	4,402,828.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,700,000.00	2,816,221.50	
DBR 2.5% 08/15/46	200,000.00	208,131.00	
DBR 3% 07/04/20	5,070,000.00	5,795,314.20	
DBR 3.25% 01/04/20	3,100,000.00	3,568,689.00	
DBR 3.25% 07/04/15	6,350,000.00	6,564,503.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,100,000.00	3,620,226.50	
DBR 3.25% 07/04/42	3,050,000.00	3,657,209.25	
DBR 3.5% 01/04/16	6,250,000.00	6,587,437.50	
DBR 3.5% 07/04/19	4,810,000.00	5,559,109.40	
DBR 3.75% 01/04/17	4,350,000.00	4,759,378.50	
DBR 3.75% 01/04/19	5,300,000.00	6,130,033.00	
DBR 4% 07/04/16	3,550,000.00	3,837,621.00	
DBR 4.0% 01/04/18	5,820,000.00	6,615,739.50	
DBR 4.0% 01/04/37	4,150,000.00	5,416,268.75	
DBR 4.25% 07/04/17	2,750,000.00	3,097,311.25	
DBR 4.25% 07/04/18	5,300,000.00	6,162,707.50	
DBR 4.25% 07/04/39	2,650,000.00	3,646,426.50	
DBR 4.75% 07/04/28	2,100,000.00	2,854,992.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,800,000.00	5,371,281.00	
DBR 4.75% 07/04/40	3,050,000.00	4,526,779.50	
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	4,597,021.00	
DBR 5.625% 01/04/28	3,100,000.00	4,528,232.00	
DBR 6% 06/20/16	900,000.00	1,008,000.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,322,088.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,700,000.00	2,672,408.50	
DBR 6.5% 07/04/27	1,600,000.00	2,497,968.00	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,100,000.00	2,104,756.50	
FRTR 1% 05/25/18	2,400,000.00	2,461,308.00	
FRTR 1% 05/25/19	3,100,000.00	3,165,472.00	
FRTR 1% 11/25/18	4,100,000.00	4,199,876.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	2,500,000.00	2,555,562.50	

FRTR 2.25% 05/25/24	5,300,000.00	5,565,715.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,800,000.00	5,136,504.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	1,000,000.00	1,012,375.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	6,500,000.00	7,148,082.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	3,850,000.00	4,113,879.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,200,000.00	7,019,144.00	
FRTR 3% 10/25/15	8,700,000.00	9,046,695.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	7,600,000.00	8,045,740.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,500,000.00	1,637,287.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,550,000.00	6,383,721.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	7,350,000.00	8,504,060.25	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,700,000.00	5,438,722.50	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,400,000.00	4,849,196.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,500,000.00	7,682,642.50	
FRTR 3.75% 10/25/19	5,350,000.00	6,233,606.00	
FRTR 4% 04/25/18	5,000,000.00	5,707,050.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,700,000.00	3,442,419.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,050,000.00	2,629,145.50	
FRTR 4% 10/25/38	4,300,000.00	5,327,098.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	5,750,000.00	6,782,786.25	
FRTR 4.25% 10/25/17	7,150,000.00	8,113,033.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	5,270,000.00	6,146,242.90	
FRTR 4.25% 10/25/23	7,650,000.00	9,450,771.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,850,000.00	6,505,014.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	4,100,000.00	5,547,648.50	
FRTR 5% 10/25/16	5,410,000.00	6,034,259.90	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,250,000.00	7,390,372.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,950,000.00	7,368,817.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	4,600,000.00	6,529,792.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	2,600,000.00	4,134,611.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,350,000.00	1,914,185.25	
IRISH 3.4% 03/18/24	850,000.00	922,339.25	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,050,000.00	1,196,076.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,600,000.00	1,873,520.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,250,000.00	2,653,717.50	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,850,000.00	2,152,872.75	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,800,000.00	1,941,354.00	
IRISH 5% 10/18/20	1,500,000.00	1,824,300.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	2,300,000.00	2,901,266.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	950,000.00	1,106,308.25	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,350,000.00	1,693,548.00	
NETHER 0% 04/15/16	1,650,000.00	1,647,269.25	
NETHER 0.5% 04/15/17	1,500,000.00	1,513,492.50	
NETHER 1.25% 01/15/18	3,200,000.00	3,311,104.00	
NETHER 1.25% 01/15/19	1,700,000.00	1,761,319.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,900,000.00	2,979,605.00	
NETHER 2% 07/15/24	1,350,000.00	1,400,969.25	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,850,000.00	1,994,364.75	

NETHER 2.5% 01/15/17	3,100,000.00	3,288,697.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,950,000.00	2,030,856.75	
NETHER 2.75% 01/15/47	700,000.00	750,858.50	
NETHER 3.25% 07/15/15	3,900,000.00	4,035,252.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,850,000.00	3,283,143.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,750,000.00	3,193,327.50	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,750,000.00	3,294,857.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,600,000.00	3,337,464.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,600,000.00	3,371,823.00	
NETHER 4% 07/15/16	2,650,000.00	2,865,286.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,700,000.00	3,167,275.50	
NETHER 4.0% 07/15/18	3,400,000.00	3,903,404.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,200,000.00	2,491,038.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,500,000.00	3,566,000.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,054,875.50	
OBL 0.25% 04/13/18	3,750,000.00	3,752,868.75	
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,083,733.00	
OBL 0.5% 04/07/17	3,950,000.00	3,994,595.50	
OBL 0.5% 04/12/19	200,000.00	200,864.00	
OBL 0.5% 10/13/17	2,800,000.00	2,833,600.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,800,000.00	3,868,533.00	
OBL 1% 02/22/19	1,500,000.00	1,544,122.50	
OBL 1% 10/12/18	450,000.00	463,439.25	
OBL 1.25% 10/14/16	3,500,000.00	3,596,617.50	
OBL 1.75% 10/09/15	4,980,000.00	5,091,402.60	
OBL 2% 02/26/16	3,150,000.00	3,254,816.25	
OBL 2.75% 04/08/16	2,450,000.00	2,569,952.00	
RAGB 1.15% 10/19/18	800,000.00	826,412.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	700,000.00	715,960.00	
RAGB 1.95% 06/18/19	1,150,000.00	1,229,574.25	
RAGB 2.4% 05/23/34	400,000.00	406,416.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	900,000.00	1,031,382.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,850,000.00	2,000,645.50	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,749,052.50	
RAGB 3.5% 07/15/15	2,250,000.00	2,333,542.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,050,000.00	3,572,739.50	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,200,000.00	2,604,811.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	700,000.00	948,615.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,300,000.00	2,722,234.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,200,000.00	2,392,731.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,400,000.00	3,139,992.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,200,000.00	1,358,910.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,200,000.00	2,600,224.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	2,700,000.00	3,124,197.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,500,000.00	1,981,080.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,400,000.00	2,100,399.00	
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	567,275.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	1,000,000.00	1,009,135.00	

RFGB 1.625% 09/15/22	900,000.00	923,382.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	1,250,000.00	1,288,687.50	
RFGB 1.875% 04/15/17	900,000.00	943,654.50	
RFGB 2% 04/15/24	900,000.00	935,901.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	650,000.00	681,401.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	850,000.00	923,780.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,437,006.25	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,100,000.00	1,281,775.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,500,000.00	1,678,485.00	
RFGB 4% 07/04/25	950,000.00	1,165,996.75	
RFGB 4.25% 07/04/15	850,000.00	887,638.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	850,000.00	1,011,597.75	
SPGB 2.1% 04/30/17	1,900,000.00	1,973,891.00	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,300,000.00	2,470,200.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	4,150,000.00	4,332,869.75	
SPGB 3.25% 04/30/16	4,250,000.00	4,468,025.00	
SPGB 3.3% 07/30/16	2,300,000.00	2,433,503.50	
SPGB 3.75% 10/31/15	3,150,000.00	3,295,545.75	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,750,000.00	1,951,626.25	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,690,000.00	5,075,447.65	
SPGB 3.8% 04/30/24	4,750,000.00	5,253,215.00	
SPGB 4% 04/30/20	4,700,000.00	5,376,118.50	
SPGB 4% 07/30/15	2,950,000.00	3,070,271.50	
SPGB 4.1% 07/30/18	4,500,000.00	5,068,777.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,950,000.00	3,254,056.50	
SPGB 4.25% 10/31/16	4,800,000.00	5,214,240.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	3,250,000.00	3,759,405.00	
SPGB 4.4% 10/31/23	3,000,000.00	3,478,755.00	
SPGB 4.5% 01/31/18	4,800,000.00	5,416,656.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	4,500,000.00	5,256,000.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	3,200,000.00	3,777,776.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,100,000.00	2,465,316.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,750,000.00	3,284,806.25	
SPGB 4.85% 10/31/20	3,800,000.00	4,546,111.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,600,000.00	3,150,563.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	700,000.00	860,622.00	
SPGB 5.15% 10/31/44	950,000.00	1,179,691.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	3,500,000.00	4,335,100.00	
SPGB 5.5% 04/30/21	2,800,000.00	3,468,612.00	
SPGB 5.5% 07/30/17	3,850,000.00	4,410,194.25	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,850,000.00	3,790,941.75	
SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,750,749.20	
SPGB 5.9% 07/30/26	2,550,000.00	3,322,599.00	
SPGB 6.0% 01/31/29	3,970,000.00	5,277,678.30	
ユーロ小計	811,190,000.00	933,250,115.35 (129,945,746,061)	
国債証券合計		290,305,471,356 (290,305,471,356)	

合計		290,305,471,356 (290,305,471,356)	
----	--	--------------------------------------	--

(注)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	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 195銘柄	100.0%	37.9%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.4%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.7%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 21銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.1%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.7%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	0.5%
ユーロ	国債証券 260銘柄	100.0%	44.8%

(注)組入時価比率は、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。

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 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。

#### 不動産等明細表

該当事項はありません。

#### 商品明細表

該当事項はありません。

#### 商品投資等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。

#### その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

#### 借入金明細表

該当事項はありません。

## 貸借対照表

項目	平成26年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	232,048,887
投資証券	107,033,928,300
未収入金	2,022,611,539
未収配当金	675,803,795
未収利息	318
流動資産合計	109,964,392,839
資産合計	109,964,392,839
負債の部	
流動負債	
未払金	617,078,200
未払解約金	1,082,733,230
流動負債合計	1,699,811,430
負債合計	1,699,811,430
純資産の部	
元本等	
元本	54,939,603,187
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,324,978,222
元本等合計	108,264,581,409
純資産合計	108,264,581,409
負債純資産合計	109,964,392,839

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	16,512,987,661円
計算期間中の追加設定元本額	42,680,149,431円
計算期間中の一部解約元本額	4,253,533,905円
計算日の元本額	54,939,603,187円
計算日の元本額の内訳	
Jリートファンド	52,794,894,642円
3資産バランスオープン	1,073,066,872円
3資産バランスオープンアルファ	170,935,492円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	81,833,585円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	41,670,513円
Jリートアクティブファンド(1年決算型)	777,202,083円
2. 計算日における受益権総数	54,939,603,187口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9706円 (19,706円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(リートの価格変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)投資証券 「(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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成26年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		8,580,129,942
合計		8,580,129,942

(注)当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)」の期首から計算日までの期間(平成25年8月16日から平成26年6月10日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在
該当事項はありません。

## 附属明細表

(平成26年6月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	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	6,242	2,281,451,000	
	森ヒルズリート投資法人	20,688	2,813,568,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	1,382	746,280,000	
	産業ファンド投資法人	2,276	2,043,848,000	
	大和ハウスリート投資法人	4,096	1,740,800,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,234	4,507,444,800	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	3,915	876,568,500	

アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,305	2,776,200,000	
G L P 投資法人	28,682	3,143,547,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,312	961,696,000	
日本プロロジスリート投資法人	23,644	5,419,204,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	27,221	3,217,522,200	
イオンリート投資法人	16,276	2,115,880,000	
ヒューリックリート投資法人	10,698	1,591,862,400	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12,420	1,319,004,000	
日本ビルファンド投資法人	20,716	12,077,428,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,588	10,725,276,000	
日本リテールファンド投資法人	30,801	6,689,977,200	
オリックス不動産投資法人	25,195	3,418,961,500	
日本プライムリアルティ投資法人	10,276	3,678,808,000	
プレミア投資法人	1,188	463,914,000	
東急リアル・エステート投資法人	13,364	1,837,550,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,465	727,421,500	
野村不動産オフィスファンド投資法人	5,417	2,545,990,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	32,751	5,256,535,500	
森トラスト総合リート投資法人	19,044	3,121,311,600	
フロンティア不動産投資法人	7,040	3,836,800,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,145	2,818,854,500	
福岡リート投資法人	6,110	1,024,036,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,671	1,890,565,000	
積水ハウス・S I 投資法人	9,827	959,115,200	
大和証券オフィス投資法人	5,035	2,527,570,000	
阪急リート投資法人	951	514,491,000	
トップリート投資法人	2,320	1,045,160,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4,335	1,883,557,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,945	2,125,045,500	
ジャパンエクセレント投資法人	16,854	2,310,683,400	
投資証券 小計	469,429	107,033,928,300	
合計	469,429	107,033,928,300	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 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。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等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。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

## 海外リートマザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成26年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	30,408,078
コール・ローン	5,477,857
投資証券	672,501,737
未収配当金	686,957
未収利息	7
流動資産合計	709,074,636
資産合計	709,074,636
負債の部	
流動負債	
未払金	1,345,088
未払解約金	999,600
流動負債合計	2,344,688
負債合計	2,344,688
純資産の部	
元本等	
元本	749,206,399
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	42,476,451
元本等合計	706,729,948
純資産合計	706,729,948
負債純資産合計	709,074,636

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 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 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>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金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の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

		平成26年 6月10日現在
1.	計算期間の期首元本額	1,030,241,389円
	計算期間中の追加設定元本額	5,932,480円
	計算期間中の一部解約元本額	286,967,470円
	計算日の元本額	749,206,399円
	計算日の元本額の内訳	
	グローバル3資産バランスオープン	486,821,485円
	ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	173,904,973円
	ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	88,479,941円
2.	計算日における受益権総数	749,206,399口
3.	「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 42,476,451円
4.	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9433円 (9,433円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年 6月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)投資証券 「(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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26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		81,010,623
合計		81,010,623

(注) 当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」の期首から計算日までの期間(平成25年9月11日から平成26年6月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在	
該当事項はありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

平成26年 6月10日現在	
該当事項はありません。	

附属明細表

(平成26年6月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	369.00	10,332.00	
		AGREE REALTY CORP	148.00	4,555.44	
		ALEXANDER'S INC	17.00	6,332.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	514.00	39,670.52	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	216.00	7,467.12	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	822.00	31,720.98	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	450.00	7,960.50	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	6,580.00	80,868.20	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	130.00	2,431.00	
		AMREIT INC	150.00	2,691.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	1,042.00	32,656.28	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	190.00	1,869.60	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	151.00	2,508.11	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	497.00	5,397.42	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	456.00	8,189.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	891.00	124,668.72	
		AVIV REIT INC	150.00	4,381.50	
		BIOMED REALTY TRUST INC	1,509.00	33,590.34	
		BOSTON PROPERTIES	1,122.00	134,348.28	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	1,085.00	16,784.95	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	362.00	7,920.56	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	615.00	43,259.10	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	469.00	4,169.41	
CBL & ASSOCIATES PRTYS	1,193.00	22,619.28			

CEDAR REALTY TRUST INC	763.00	4,722.97	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	1,990.00	16,178.70	
CHATHAM LODGING TRUST	200.00	4,538.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	325.00	9,711.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	880.00	23,874.40	
COMMONWEALTH REIT	863.00	24,103.59	
CORESITE REALTY CORP	172.00	5,662.24	
CORPORATE OFFICE PPTYS	603.00	16,974.45	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	903.00	29,817.06	
COUSINS PROPERTIES INC	1,257.00	15,511.38	
CUBESMART	993.00	18,350.64	
CYRUSONE INC	180.00	4,098.60	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2,471.00	20,015.10	
DDR CORPORATION	2,082.00	36,726.48	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,344.00	17,055.36	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,011.00	58,658.22	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	1,008.00	28,728.00	
DUKE REALTY CORP	2,348.00	42,029.20	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	431.00	11,645.62	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	209.00	13,628.89	
EDUCATION REALTY TRUST INC	732.00	7,583.52	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	481.00	8,215.48	
EPR PROPERTIES	370.00	20,294.50	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	615.00	26,580.30	
EQUITY ONE INC	474.00	11,063.16	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	2,465.00	152,139.80	
ESSEX PROPERTY TRUST	449.00	81,632.69	
EXCEL TRUST INC	376.00	5,185.04	
EXTRA SPACE STORAGE INC	790.00	42,351.90	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	484.00	58,191.32	
FELCOR LODGING TRUST INC	902.00	9,218.44	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	765.00	14,496.75	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	440.00	5,878.40	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	638.00	8,128.12	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	3,807.00	90,949.23	
GEO GROUP INC/THE	498.00	17,031.60	
GETTY REALTY CORP	204.00	4,063.68	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	144.00	2,498.40	
GLIMCHER REALTY TRUST	1,087.00	11,924.39	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	409.00	10,515.39	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	400.00	2,400.00	
HCP INC	3,353.00	139,887.16	
HEALTH CARE REIT INC	2,257.00	142,980.95	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	658.00	16,785.58	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	1,363.00	16,901.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,592.00	10,252.48	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	699.00	29,316.06	
HOME PROPERTIES INC	444.00	27,266.04	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,169.00	34,403.67	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	5,541.00	124,894.14	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	357.00	8,864.31	
INLAND REAL ESTATE CORP	730.00	7,738.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	838.00	7,676.08	
KILROY REALTY CORPORATION	588.00	36,503.04	
KIMCO REALTY CORP	2,975.00	68,365.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	1,000.00	6,150.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	809.00	27,853.87	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	1,572.00	18,078.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,052.00	41,080.60	
LTC PROPERTIES INC	297.00	11,894.85	
MACERICH CO/THE	1,022.00	67,932.34	
MACK-CALI REALTY CORP	598.00	13,150.02	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,306.00	17,879.14	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	538.00	38,660.68	
MONMOUTH REIT -CL A	286.00	2,725.58	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	952.00	34,195.84	
NATL HEALTH INVESTORS INC	195.00	12,370.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	971.00	36,082.36	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	148.00	3,214.56	
PARKWAY PROPERTIES INC	545.00	11,423.20	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	521.00	19,079.02	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	435.00	7,695.15	
PHYSICIANS REALTY TRUST	110.00	1,575.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	1,189.00	23,351.96	
POST PROPERTIES	420.00	21,718.20	
PROLOGIS INC	3,665.00	151,840.95	
PS BUSINESS PARKS INC	153.00	13,124.34	
PUBLIC STORAGE	1,062.00	181,952.46	
QTS REALTY TRUST INC	117.00	3,425.76	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	537.00	9,064.56	
REALTY INCOME CORP	1,639.00	70,903.14	
REGENCY CENTERS CORP	659.00	36,027.53	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	558.00	8,732.70	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	1,444.00	21,919.92	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	150.00	2,166.00	
RLJ LODGING TRUST	955.00	26,854.60	
ROUSE PROPERTIES INC	350.00	5,869.50	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	389.00	18,531.96	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	358.00	10,518.04	
SAUL CENTERS INC	92.00	4,546.64	
SELECT INCOME REIT	200.00	5,734.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	1,472.00	35,534.08	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	350.00	5,495.00	
SIMON PROPERTY GROUP	2,318.00	387,106.00	
SL GREEN REALTY CORP	692.00	77,033.44	



	SOVRAN SELF STORAGE INC	225.00	17,460.00	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,743.00	30,995.90	
	STAG INDUSTRIAL INC	348.00	8,560.80	
	STARWOOD WAYPOINT RESIDE	350.00	9,712.50	
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	1,787.00	19,978.66	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	798.00	8,259.30	
	SUN COMMUNITIES INC	253.00	12,470.37	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	1,416.00	21,381.60	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	741.00	26,757.51	
	TAUBMAN CENTERS INC	451.00	33,915.20	
	TERRENO REALTY CORP	204.00	3,994.32	
	UDR INC	1,814.00	49,812.44	
	UMH PROPERTIES INC	200.00	1,994.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	90.00	3,975.30	
	URSTADT BIDDLE - CL A	194.00	4,138.02	
	VENTAS INC	2,159.00	138,910.06	
	VORNADO REALTY TRUST	1,277.00	135,936.65	
	WASHINGTON PRIME GROUP	1,159.00	22,264.39	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	555.00	14,763.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	874.00	27,985.48	
	WHITESTONE REIT	227.00	3,300.58	
	WINTHROP REALTY TRUST	149.00	2,245.43	
	WP CAREY INC	455.00	29,142.75	
	アメリカドル小計	127,850.00	4,421,045.04 (452,980,274)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	205.00	7,279.55	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	534.00	8,325.06	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	165.00	10,774.50	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	103.00	2,753.19	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	429.00	11,677.38	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	329.00	7,488.04	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	281.00	12,906.33	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	760.00	8,375.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	430.00	4,592.40	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	501.00	9,534.03	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	180.00	2,394.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	120.00	1,365.60	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	532.00	5,112.52	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	270.00	2,608.20	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	352.00	10,334.72	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	180.00	7,153.20	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	991.00	23,209.22	

	HEALTHLEASE PROPERTIES REAL	130.00	1,376.70	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	91.00	468.65	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	301.00	1,691.62	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	180.00	1,931.40	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	150.00	1,594.50	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	230.00	4,002.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	75.00	2,115.75	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	230.00	2,295.40	
	PLAZA RETAIL REIT	400.00	1,616.00	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	660.00	3,121.80	
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	283.00	1,327.27	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,130.00	31,289.70	
	<b>カナダドル小計</b>	<b>10,222.00</b>	<b>188,713.93</b> <b>(17,722,125)</b>	
オーストラリア ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	2,056.00	5,119.44	
	ALE PROPERTY GROUP	1,182.00	3,522.36	
	ASPEN GROUP	1,618.00	2,095.31	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	915.00	3,467.85	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	3,163.00	14,518.17	
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	900.00	1,827.00	
	BWP TRUST	3,454.00	8,807.70	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	19,240.00	40,596.40	
	CHARTER HALL GROUP	1,845.00	8,044.20	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	2,907.00	11,540.79	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	10,165.00	10,063.35	
	DEXUS PROPERTY GROUP	40,325.00	46,373.75	
	FEDERATION CENTRES	11,020.00	27,880.60	
	GDI PROPERTY GROUP	4,400.00	4,114.00	
	GOODMAN GROUP	11,148.00	57,412.20	
	GPT GROUP	12,523.00	49,465.85	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	1,200.00	3,024.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES-RIGHT	128.00	6.40	
	INDUSTRIA REIT	1,000.00	2,050.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	6,200.00	2,852.00	
	INVESTA OFFICE FUND	4,162.00	13,942.70	
	MIRVAC GROUP	26,308.00	48,801.34	
	NATIONAL STORAGE REIT	2,100.00	2,772.00	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	5,298.00	9,271.50		
STOCKLAND	16,747.00	66,988.00		
WESTFIELD GROUP	14,273.00	153,006.56		
WESTFIELD RETAIL TRUST	21,803.00	68,897.48		
	<b>オーストラリアドル小計</b>	<b>226,080.00</b>	<b>666,460.95</b> <b>(63,853,623)</b>	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	1,041.00	5,225.82	
	BRITISH LAND CO PLC	7,283.00	53,093.07	
	DERWENT LONDON PLC	607.00	17,014.21	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	2,685.00	18,056.62	
	HAMMERSON PLC	5,154.00	31,413.63	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	5,883.00	6,283.04	
	INTU PROPERTIES PLC	6,899.00	22,421.75	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	5,706.00	62,480.70	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,960.00	7,092.80	
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	410.00	1,823.47	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	511.00	1,814.05	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	4,700.00	2,679.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,650.00	3,630.00	
	SEGRO PLC	5,291.00	19,888.86	
	SHAFTESBURY PLC	2,170.00	14,712.60	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,000.00	2,150.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	783.00	4,925.07	
	イギリスポンド小計	57,733.00	274,704.69 (47,298,653)	
香港ドル	CHAMPION REIT	19,000.00	69,730.00	
	FORTUNE REIT	8,000.00	54,640.00	
	LINK REIT	17,500.00	733,250.00	
	PROSPERITY REIT	9,000.00	21,780.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	10,000.00	20,800.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	4,000.00	12,480.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,000.00	19,560.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	12,000.00	44,640.00	
	香港ドル小計	85,500.00	976,880.00 (12,914,353)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	4,000.00	5,760.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	4,000.00	3,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	15,000.00	34,800.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	6,000.00	7,380.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	4,000.00	4,900.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	6,000.00	4,650.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	17,000.00	28,305.00	
	CAPITAMALL TRUST	20,000.00	40,600.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	5,000.00	7,525.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	6,000.00	10,260.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	4,000.00	3,500.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,000.00	4,700.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	4,000.00	7,440.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	4,000.00	5,440.00	
	KEPPEL REIT	6,000.00	7,590.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	14,000.00	5,740.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	11,000.00	14,080.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	13,000.00	11,310.00	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	10,000.00	14,400.00		

	MAPLE TREE LOGISTICS TRUST	11,000.00	12,815.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	4,000.00	3,200.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	2,000.00	4,880.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	3,000.00	3,180.00	
	SAIZEN REIT	2,400.00	2,316.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	5,000.00	4,000.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	8,000.00	6,560.00	
	SUNTEC REIT	18,000.00	33,120.00	
	シンガポールドル小計	210,400.00	291,451.00 (23,884,409)	
ニュージーランド ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	1,208.00	1,956.96	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	6,705.00	7,174.35	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	7,805.00	9,209.90	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	2,631.00	3,512.38	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	3,009.00	4,032.06	
	ニュージーランドドル小計	21,358.00	25,885.65 (2,254,122)	
イスラエルシェケ ル	REIT 1 LTD	828.00	7,761.67	
	イスラエルシェケル小計	828.00	7,761.67 (229,900)	
ユーロ	AEDIFICA	47.00	2,405.93	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	468.00	4,657.06	
	ALTAREA	25.00	3,395.00	
	ANF IMMOBILIER	106.00	2,570.50	
	BEFIMMO S.C.A.	150.00	8,410.50	
	BENI STABILI SPA	7,810.00	5,392.80	
	BGP HOLDINGS PLC	900,544.00	0.00	
	COFINIMMO	115.00	10,501.80	
	CORIO NV	755.00	28,988.22	
	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTATE	145.00	1,290.50	
	EUROCOMMERCIAL	262.00	9,787.01	
	FONCIERE DES REGIONS	341.00	26,642.33	
	GECINA SA	202.00	21,755.40	
	GREEN REIT PLC	4,889.00	6,468.14	
	HAMBORNER REIT AG	343.00	2,630.81	
	HIBERNIA REIT PLC	3,100.00	3,391.40	
	ICADE	266.00	20,508.60	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	584.00	849.72	
	KLEPIERRE	693.00	25,779.60	
	MERCIALYS	343.00	5,867.01	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	872.00	4,394.88	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	24.00	1,322.40	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	716.00	151,183.40	
	VASTNED RETAIL	126.00	4,914.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	99.00	5,494.50	
	WERELDHAVE NV	154.00	10,288.74	

	ユーロ小計	923,179.00	368,890.25 (51,364,278)	
	投資証券合計		672,501,737 (672,501,737)	
	合計		672,501,737 (672,501,737)	

(注)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	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 142銘柄	100.0%	67.4%
カナダドル	投資証券 29銘柄	100.0%	2.6%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	100.0%	9.5%
イギリスポンド	投資証券 17銘柄	100.0%	7.0%
香港ドル	投資証券 8銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 27銘柄	100.0%	3.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	7.6%

(注)組入時価比率は、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。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(平成26年 6月11日から平成26年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （平成26年6月10日現在）	第8期中間計算期間 （平成26年12月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,207,778	761,174
親投資信託受益証券	479,680,898	444,447,654
未収入金	3,970,750	4,557,760
未収利息	1	-
流動資産合計	484,859,427	449,766,588
資産合計	484,859,427	449,766,588
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	873,944	-
未払解約金	-	798,303
未払受託者報酬	107,830	98,488
未払委託者報酬	2,426,185	2,215,900
その他未払費用	13,421	12,250
流動負債合計	3,421,380	3,124,941
負債合計	3,421,380	3,124,941
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	436,972,245	353,070,782
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	44,465,802	93,570,865
（分配準備積立金）	64,110,700	50,302,092
元本等合計	481,438,047	446,641,647
純資産合計	481,438,047	446,641,647
負債純資産合計	484,859,427	449,766,588

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自 平成25年 6月11日 至 平成25年12月10日	第8期中間計算期間 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,031	337
有価証券売買等損益	60,461,395	64,976,058
営業収益合計	60,462,426	64,976,395
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	141,246	98,488
委託者報酬	3,178,012	2,215,900
その他費用	17,593	12,250
営業費用合計	3,336,851	2,326,638
営業利益又は営業損失（ ）	57,125,575	62,649,757
経常利益又は経常損失（ ）	57,125,575	62,649,757
中間純利益又は中間純損失（ ）	57,125,575	62,649,757
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	8,722,130	5,705,830
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,752,532	44,465,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,647,685	1,879,932
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,647,685	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,879,932
剰余金減少額又は欠損金増加額	111,259	9,718,796
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	9,718,796
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	111,259	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	27,187,339	93,570,865



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 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。
-----------------	---------------------------------------

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第7期 (平成26年 6月10日現在)	第8期中間計算期間 (平成26年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	436,972,245口	353,070,782口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1018円 (11,018円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2650円 (12,650円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第8期中間計算期間 (平成26年12月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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。

	第8期中間計算期間 (平成26年12月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

（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7期 自 平成25年 6月11日 至 平成26年 6月10日	第8期中間計算期間末 自 平成26年 6月11日 至 平成26年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	728,255,740円	436,972,245円
期中追加設定元本額	15,668,706円	11,339,847円
期中一部解約元本額	306,952,201円	95,241,310円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

「ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）」は、「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド（M）」、「海外リートマザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成26年12月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,206,735,523
株式	247,338,748,740
派生商品評価勘定	16,828,920
未収入金	1,711,347,531
未収配当金	71,042,615
未収利息	2,709
差入委託証拠金	13,970,000
流動資産合計	251,358,676,038
資産合計	251,358,676,038
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,622,080
前受金	8,209,000
未払金	5,700,000
未払解約金	1,049,182,845
流動負債合計	1,071,713,925
負債合計	1,071,713,925
純資産の部	
元本等	
元本	184,209,623,849
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,077,338,264
元本等合計	250,286,962,113
純資産合計	250,286,962,113
負債純資産合計	251,358,676,038

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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26年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	184,209,623,849口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 5,050,700,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3587円 (1万口当たり純資産額) (13,587円)

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)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。 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。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	210,678,487,456円
期中追加設定元本額	8,957,254,139円
期中一部解約元本額	35,426,117,746円
期末元本額	184,209,623,849円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	1,276,304,585円
D C日本株式インデックスファンド	350,399,608円
D C日本株式インデックスファンドL	47,977,469,555円
D C日本株式インデックスファンドA	1,381,425,471円
D Cバランスファンド3 0	1,381,842,960円
D Cバランスファンド5 0	2,165,466,614円
D Cバランスファンド7 0	1,218,261,417円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	98,393,667円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	53,310,431円
新生・4分散ファンド	104,456,189円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	696,848,538円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	21,810,820円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	77,279,010円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	32,607,142円
日本株式インデックスe	1,859,987,414円
インデックスコレクション(国内株式)	5,777,430,713円
インデックスコレクション(バランス株式3 0)	918,833,303円
インデックスコレクション(バランス株式5 0)	1,032,443,686円
インデックスコレクション(バランス株式7 0)	994,134,757円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	10,068,583,243円
日本株式インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	7,834,678,900円
バランスV A 3 0(適格機関投資家専用)	1,575,549,645円
バランスV A 5 0(適格機関投資家専用)	13,868,767,379円
V Aバランスファンド(株2 5 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	5,598,239,875円
V Aバランスファンド(株5 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	1,865,202,000円
V Aバランス株式3 0(適格機関投資家専用)	648,603,080円
V Aバランスファンド(株6 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	2,477,260,228円
バランスV A 2 5(適格機関投資家専用)	3,893,679,844円
バランスV A 3 7 . 5(適格機関投資家専用)	1,508,615,323円
バランスV A 5 0 L(適格機関投資家専用)	25,454,329,255円
バランスV A 7 5(適格機関投資家専用)	1,903,753,155円
V Aバランスファンド(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	8,518,033,648円

VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,474,102,620円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	107,017,088円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	1,468,546,408円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	608,824,655円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	5,338,839,215円
VAバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	182,321,023円
VAバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	154,885,661円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	111,770,232円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	2,037,840,908円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	1,882,674,949円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	59,809,210円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	916,604,924円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	14,436,753,652円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	301,565,184円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	102,475,916円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	31,946,030円
VAバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	348,304,811円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	9,390,286円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,949,622円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成26年12月10日現在）

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

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 日本債券マザーファンド

## 貸借対照表

	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,932,813,574
国債証券	283,980,993,880
地方債証券	22,049,274,046
特殊債券	30,525,928,371
社債券	20,506,716,800
派生商品評価勘定	348,380
未収入金	1,699,506,300
未収利息	1,264,814,242
前払費用	35,747,853
流動資産合計	361,996,143,446
資産合計	361,996,143,446
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	251,620
前受金	100,000
未払金	50,000
未払解約金	845,597,156
流動負債合計	845,998,776
負債合計	845,998,776
純資産の部	
元本等	
元本	280,376,950,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,773,194,494
元本等合計	361,150,144,670
純資産合計	361,150,144,670
負債純資産合計	361,996,143,446

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

	平成26年12月10日現在
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

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

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3) 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26年12月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	282,952,145,016円
期中追加設定元本額	25,954,723,110円
期中一部解約元本額	28,529,917,950円
期末元本額	280,376,950,176円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	2,747,767,123円
D C日本債券インデックスファンド	2,580,912,434円
D C日本債券インデックスファンドL	28,645,884,398円
D Cバランスファンド30	4,343,513,815円
D Cバランスファンド50	3,020,611,149円
D Cバランスファンド70	773,759,532円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	95,910,185円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	54,354,769円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	350,321,496円
新生・4分散ファンド	105,159,157円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	21,779,529円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	75,985,259円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	143,550,015円
日本債券インデックスe	1,876,886,452円
インデックスコレクション（国内債券）	5,098,811,952円
インデックスコレクション（バランス株式30）	2,861,785,367円

区分	平成26年12月10日現在
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,430,270,539円
インデックスコレクション（バランス株式70）	634,065,879円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	48,123,437,896円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	4,942,756,096円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	3,855,391,396円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	14,162,065,353円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	6,876,558,389円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	750,492,204円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	3,936,764,800円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,627,752,815円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,257,424,592円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	25,493,398,930円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	228,009,745円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	22,559,988,551円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	5,518,030,489円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	453,324,940円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	2,265,409,334円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	659,979,626円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	5,402,824,301円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	771,966,626円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	1,476,136,847円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	478,154,950円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,315,967,014円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	6,456,198,906円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	460,403,774円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	3,112,631,922円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	47,824,130,223円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,009,989,467円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	260,555,977円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	102,873,354円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,106,291,358円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	11,617,244円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	15,094,007円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成26年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				

	買建	1,471,303,240	-	1,471,400,000	96,760
	合計	1,471,303,240	-	1,471,400,000	96,760

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式マザーファンド

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	平成26年12月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、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>

	平成26年12月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(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。

## (貸借対照表に関する注記)

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

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)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。 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。

	平成26年12月10日現在

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	139,044,492,301円
期中追加設定元本額	4,787,288,937円
期中一部解約元本額	28,954,635,256円
期末元本額	114,877,145,982円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	2,560,641,456円
DC外国株式インデックスファンド	4,569,353,747円
DC外国株式インデックスファンドL	17,455,098,590円
DCバランスファンド30	436,372,175円
DCバランスファンド50	937,401,758円
DCバランスファンド70	593,911,129円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	67,005,775円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	35,731,572円
新生・4分散ファンド	66,909,978円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	457,747,721円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	14,494,839円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	49,790,274円
外国株式インデックスe	6,431,165,244円
インデックスコレクション（外国株式）	2,987,125,851円
インデックスコレクション（バランス株式30）	292,856,591円
インデックスコレクション（バランス株式50）	439,063,982円
インデックスコレクション（バランス株式70）	482,699,922円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	5,579,830,551円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,256,441,747円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	4,193,420,305円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,034,387,219円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	8,853,126,969円

区分	平成26年12月10日現在
V Aバランスファンド（株25 / 100）（適格機関投資家専用）	3,534,948,455円
V Aバランスファンド（株50 / 100）（適格機関投資家専用）	1,177,610,852円
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	208,434,132円
V Aバランスファンド（株60 / 100）（適格機関投資家専用）	7,818,664,250円
バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	1,760,015,254円
バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	855,511,177円
バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	16,023,212,531円
バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	1,400,564,028円
V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	16,132,797,060円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	2,193,073,199円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	67,571,028円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	946,328,016円
V Aバランス株式40（適格機関投資家専用）	387,248,322円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	345,140,764円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	880,097,272円
バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	72,088,176円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	1,286,518,625円
バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用）	41,213,889円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	263,757,666円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	659,555,594円
私募外国株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	28,218,297円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成26年12月10日現在）

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

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成26年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,010,808,848	-	1,039,937,600	29,128,752
	アメリカドル	738,727,440	-	762,027,200	23,299,760
	ユーロ	161,563,808	-	165,614,400	4,050,592
	イギリスポンド	110,517,600	-	112,296,000	1,778,400
	売建	1,291,774,185	-	1,285,907,200	5,866,985
	アメリカドル	804,901,720	-	800,315,000	4,586,720
	カナダドル	68,035,505	-	67,795,000	240,505
	ユーロ	207,516,420	-	207,032,000	484,420
	スイスフラン	90,070,375	-	89,819,200	251,175
	スウェーデンクローナ	22,277,720	-	22,204,000	73,720
	ノルウェークローネ	6,715,360	-	6,712,000	3,360
	デンマーククローネ	21,945,830	-	21,857,000	88,830
	香港ドル	30,819,200	-	30,800,000	19,200
	シンガポールドル	27,356,535	-	27,237,000	119,535
	イスラエルシェケル	12,135,520	-	12,136,000	480
	合計		2,302,583,033	-	2,325,844,800

## (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。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成26年12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	216,449,552
コール・ローン	6,291,997,262
国債証券	265,379,453,522
派生商品評価勘定	15,216,773
未収入金	99,320,612
未収利息	2,386,601,354
前払費用	36,820,178
差入委託証拠金	158,534,107
流動資産合計	274,584,393,360
資産合計	274,584,393,360



	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,322,482
前受金	2,229,232
未払金	9,905,500
未払解約金	1,777,104,480
流動負債合計	1,792,561,694
負債合計	1,792,561,694
純資産の部	
元本等	
元本	109,005,662,924
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	163,786,168,742
元本等合計	272,791,831,666
純資産合計	272,791,831,666
負債純資産合計	274,584,393,360

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

		平成26年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			109,005,662,924口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		2.5025円 (25,025円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

		平成26年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) 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>		

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	136,121,081,679円
期中追加設定元本額	5,943,273,989円
期中一部解約元本額	33,058,692,744円
期末元本額	109,005,662,924円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	3,263,250,752円
DC外国債券インデックスファンド	1,839,257,407円
DC外国債券インデックスファンドL	9,838,671,991円
物価連動債組入世界債券ファンド	45,469,178円
DCバランスファンド30	378,196,466円
DCバランスファンド50	403,926,130円
DCバランスファンド70	80,105,161円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	54,513,933円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	28,639,657円
新生・4分散ファンド	56,229,140円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	380,334,744円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	11,661,686円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	42,077,334円
外国債券インデックスe	1,561,779,829円
インデックスコレクション(外国債券)	1,587,650,506円
インデックスコレクション(バランス株式30)	253,234,565円
インデックスコレクション(バランス株式50)	189,767,104円
インデックスコレクション(バランス株式70)	60,071,242円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	2,783,886,701円
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	2,995,210,901円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	190,058,774円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,819,293,708円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	1,965,878,382円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	7,261,808,515円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	14,786,149,063円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,641,695,507円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	90,018,855円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	3,406,427,968円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	4,928,466,479円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,314,991,594円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	13,594,007,206円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	579,334,657円

V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	16,400,814,646円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	2,866,342,917円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	235,502,972円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	1,181,383,140円
V Aバランス株式 4 0（適格機関投資家専用）	677,805,014円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	200,497,339円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	85,204,105円
バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	247,407,092円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	4,483,875,712円
バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用）	24,863,861円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	479,499,404円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	163,383,892円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	2,490,354,834円
私募外国債券インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	35,840,819円
世界バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	822,042円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（平成26年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,412,879,519	-	2,415,108,751	2,229,232
合計		2,412,879,519	-	2,415,108,751	2,229,232

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成26年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	3,181,699,834	-	3,191,362,400	9,662,566
	アメリカドル	1,351,678,107	-	1,358,032,800	6,354,693
	カナダドル	117,272,643	-	117,836,400	563,757
	ユーロ	1,460,513,964	-	1,460,955,600	441,636
	イギリスポンド	252,235,120	-	254,537,600	2,302,480
	売建	119,641,023	-	119,638,530	2,493
	イギリスポンド	119,641,023	-	119,638,530	2,493
合計	3,301,340,857	-	3,311,000,930	9,665,059	

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## Jリートマザーファンド(M)

## 貸借対照表

項目	平成26年12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	305,384,136
投資証券	100,973,301,800
未収入金	1,598,639,106
未収配当金	577,234,791
未収利息	374
流動資産合計	103,454,560,207
資産合計	103,454,560,207
負債の部	
流動負債	
未払解約金	643,053,167
流動負債合計	643,053,167
負債合計	643,053,167
純資産の部	
元本等	

	平成26年12月10日現在
項目	金額（円）
元本	43,522,331,161
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,289,175,879
元本等合計	102,811,507,040
純資産合計	102,811,507,040
負債純資産合計	103,454,560,207

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	平成26年12月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	54,939,603,187円
期中追加設定元本額	1,686,358,696円
期中一部解約元本額	13,103,630,722円
期末元本額	43,522,331,161円
期末元本額の内訳	
Jリートファンド	41,128,125,433円
3 資産バランスオープン	859,102,735円
3 資産バランスオープンアルファ	141,526,939円
ベスタ・世界6 資産ファンド（毎月決算型）	60,669,734円
ベスタ・世界6 資産ファンド（1年決算型）	32,254,425円
Jリートアクティブファンド（1年決算型）	1,300,651,895円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 海外リートマザーファンド

## 貸借対照表

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>



平成26年12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26年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	582,563,897口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1596円 (11,596円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成26年12月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 6月11日
期首元本額	749,206,399円
期中追加設定元本額	712,453円
期中一部解約元本額	167,354,955円
期末元本額	582,563,897円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	390,747,454円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	125,206,677円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	66,609,766円

（デリバティブ取引に関する注記）

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（1年決算型）】

## 【純資産額計算書】

（平成26年12月30日現在）

資産総額	439,794,129円
負債総額	2,957,631円
純資産総額（ - ）	436,836,498円
発行済口数	340,375,256口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2834円
（1万口当たり純資産額）	（12,834円）

（参考）

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

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

## 日本債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

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

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

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

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

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

## Jリートマザーファンド（M）

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

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

## 海外リートマザーファンド

## 純資産額計算書

（平成26年12月30日現在）

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

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（平成26年12月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社に取締役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、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リスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

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

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	396	5,990,397
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	8	52,515
単位型公社債投資信託	0	0
合計	404	6,042,912

## 3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。



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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。
- また、第29期事業年度の中間会計期間(自平成26年4月1日至平成26年9月30日)の中間財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

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

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

(単位：千円)

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	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	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638

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

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

##### 時価のあるもの

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

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

### (貸借対照表関係)

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

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

### (損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

決議	株式の種 類	配当金の 総額(千 円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成26年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## (リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

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



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

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

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

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### 3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

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

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

### (税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

#### 3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%に変更されております。

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

### (持分法損益等)

該当事項はありません。

### (セグメント情報等)

#### (セグメント情報)

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

## （関連情報）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## （ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-
-----	----------------------	---------	---------	------	----------	-------	----------	--------	---	---

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	73,276	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成25年3月31日）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

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

(企業結合等関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

## (4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## (5) その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

## 2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間末  
(平成26年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

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

## 固定資産

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

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		65,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		8,721,600



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

## 中間損益計算書

(単位：千円)

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

## 中間株主資本等変動計算書

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：千円)

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

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

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

## 重要な会計方針

第29期中間会計期間 （自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）
<p>1．資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>    その他有価証券</p> <p>        時価のあるもの</p> <p>            中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。</p> <p>            （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p>        時価のないもの</p> <p>            移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2．固定資産の減価償却の方法</p> <p>（1）有形固定資産</p> <p>    定率法によっております。</p>

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第29期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 40,466千円
	器具備品 187,949千円
	計 228,416千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

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

受取利息	3,339千円
------	---------

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(リ-ス取引関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

平成26年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。  
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	10,736,816	10,736,816	-
(2)未収委託者報酬	3,496,458	3,496,458	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,778	58,778	-
(4)未払金	(2,137,961)	(2,137,961)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## (1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (3)投資有価証券

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

## (4)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（3）投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成26年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

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

（関連情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

## (2)有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	1,703,639千円
J-REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	1,456,865千円

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,846,686円70銭
1株当たり中間純利益	434,102円38銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益	1,302,307千円
普通株式に係る中間純利益	1,302,307千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

**（重要な後発事象）**

該当事項はありません。

**4【利害関係人との取引制限】**

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

**(1)自己又はその役員との取引**

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

**(2)運用財産相互間の取引**

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

**(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引**

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

**(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引**

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

**(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為**

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

**5【その他】****(1)定款の変更**

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

**(2)訴訟事件その他の重要事項**

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

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

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年9月末日現在）	事業の内容
株式会社青森銀行	19,562	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社池田泉州銀行	50,710	
株式会社岩手銀行	12,089	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社荘内銀行	7,000	
株式会社西日本シティ銀行	85,745	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社北越銀行	24,538	
株式会社北陸銀行	140,409	
株式会社北海道銀行	93,524	
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。
西日本シティTT証券株式会社	1,575	

## 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、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

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



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

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成26年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 浩之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

平成26年8月8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

松崎雅則

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（1年決算型）の平成25年6月11日から平成26年6月10日までの計算期間の財務諸表、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（1年決算型）の平成26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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成26年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）の平成26年6月11日から平成26年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）の平成26年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年6月11日から平成26年12月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。