

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年9月10日
【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33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートイング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インデックス・バランス・ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	上限 10兆円
【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】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

1口当たりの元本は1円です。

委託会社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「委託会社」といいます。）の依頼により、信用格付業者から提供され、若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、若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、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。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、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。）。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。

ただし、「分配金再投資コース」（ ）を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、後記「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要（４）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差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）の2つの申込方法があります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（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。

なお、「分配金再投資コース」を選択された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。

（７）【申込期間】

平成25年9月11日から平成26年9月10日までとします。

（注）お申込みの取扱いは、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。

ただし、後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針（４）分配方針 収益分配金の支払い」に規定する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、及びすでに受付けた取得申込みを取消することができます。

なお、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】

申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）の詳細につきましては、以下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】

申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込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、受託会社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】

申込みを受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】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

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。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限 1兆円

基本的性格

当ファンドは、委託会社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が投資者のために、利殖の目的をもって設定する証券投資信託で、三井住友信託銀行株式会社がその受託会社となることを引受けたものです。

当ファンドは、委託者が受託者に投資信託財産の運用を指図する委託者指図型の追加型証券投資信託で、その商品分類及び属性区分は以下のとおりです。

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)
単位型	国内	株式 債券
	海外	不動産投信
追加型	内外	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。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認ください。

< 単位型投信・追加型投信 >

- ・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います。

< 投資対象地域 >

- ・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います。

< 投資対象資産（収益の源泉） >

- ・資産複合... 目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他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
株式	年1回	グローバル		
一般		(日本を含む)		
大型株	年2回			
中小型株		日本		
	年4回			
債券		北米	ファミリー	あり
一般	年6回		ファンド	()
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性	(毎月)			
()		オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド	なし
	その他		・オブ・	
その他資産	()	アフリカ	ファンズ	
(投資信託証券(資産複合				
(株式、債券)		中近東		
資産配分固定型)		(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。

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。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認いただけます。

< 投資対象資産 >

・ その他資産 (投資信託証券)

…目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信以外の資産に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

・ 資産複合 (株式、債券) 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 (株式、債券) を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

当ファンドでは株式、債券、不動産投信以外の資産である投資信託証券を主要投資対象とし、当該投資信託証券を通じて複数資産 (株式、債券) に投資します。

なお、商品分類表の投資対象資産（収益の源泉）が「資産複合」であるのに対して、属性区分表の投資対象資産では「その他資産（投資信託証券）」と異なる区分になっていますが、これは商品分類表では収益の源泉となる資産（実質基準）を記載するのに対して、属性区分表では組入れている資産そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

< 決算頻度 >

- ・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います。

< 投資対象地域 >

- ・グローバル（日本を含む）
...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（日本を含みます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 投資形態 >

- ・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きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

< 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います。

ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド（以下これらを「マザーファンド」又は「親投資信託」という場合があります。）の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドは、それぞれが定めている以下のベンチマーク（運用成果を判断するうえで基準になる市場全体の動きを示す指数です。）と連動する投資成果を目標とする運用を行います。

日本株式マザーファンド：「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」

外国株式マザーファンド：「MSCIコクサイ指数（円ベース）」

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

TOPIX（東証株価指数）について

「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。

MSCIコクサイ指数について

「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。

シティグループ世界国債インデックスについて

「シティグループ世界国債インデックス」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インク（以下「CGMI」）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、CGMIの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、CGMIが有しています。なお、CGMIは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

（２）【ファンドの沿革】

- 平成20年3月3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22年9月11日 ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更
- 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に変更

（３）【ファンドの仕組み】

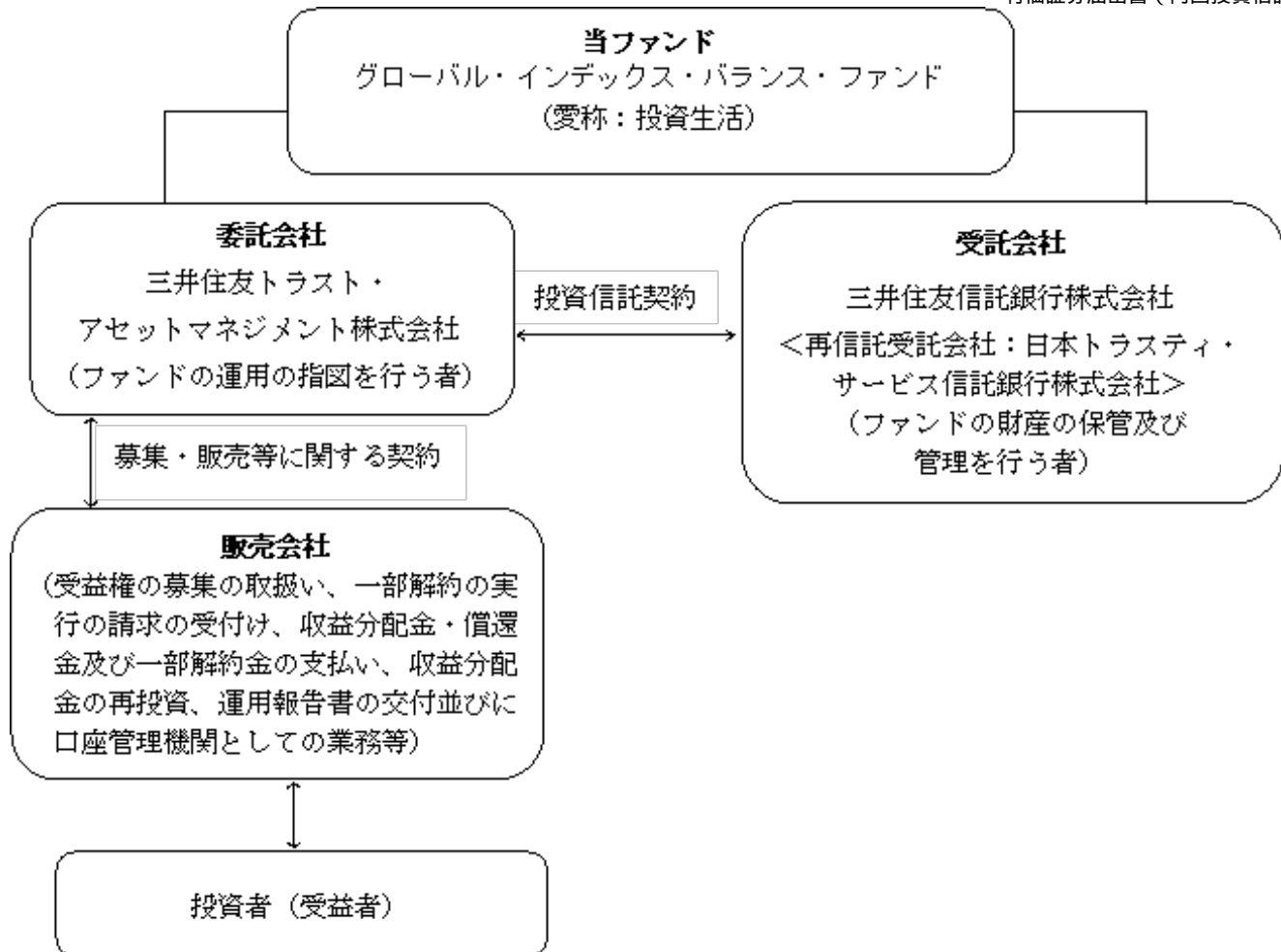
ファミリーファンド方式での運用

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（グローバル・インデックス・バランス・ファンド）とし、その資金をマザーファンド（日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）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。



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。

ファンドの関係法人



委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成25年6月28日現在）

B．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

C．大株主の状況（平成25年6月28日現在）

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】

運用方針

日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券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を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式や外国の公社債等に直接投資することもあります。

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、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3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。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、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．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．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。
- H．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。
- I．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。
- J．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、後記（5）J．、K．及びL．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

運用指図できる投資対象である有価証券

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」、「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」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．の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2．から6．までの証券並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記2．から6．までの証券の性質を有するものを以下

「公社債」といい、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

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。

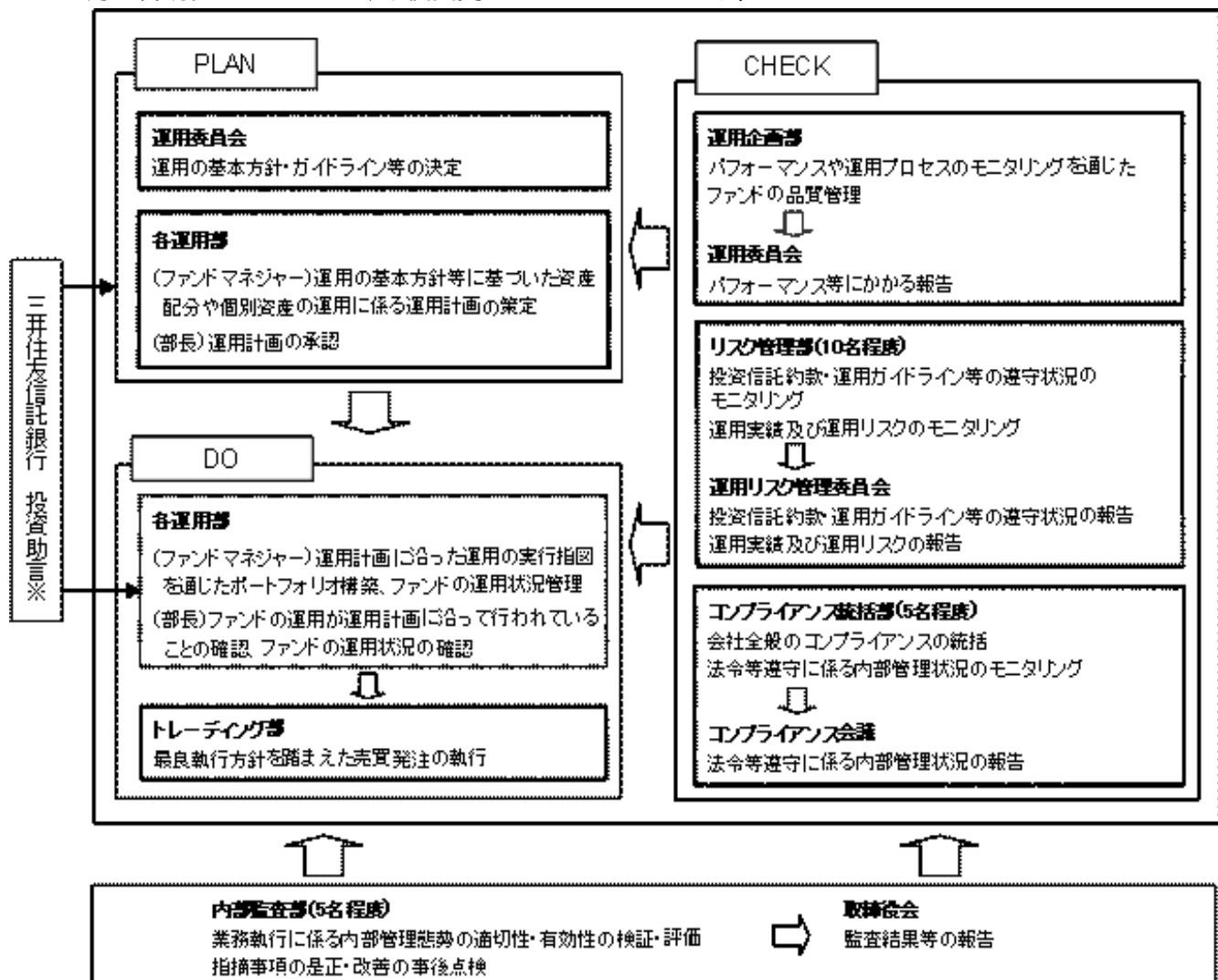
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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。

（3）【運用体制】

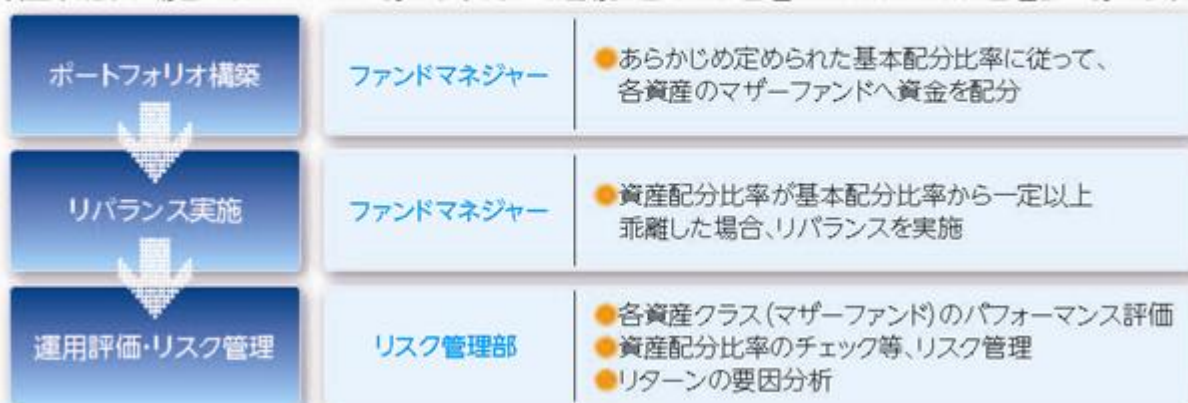
ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年9月10日現在のものであり、今後変更されることがあります。



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。

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。また、運用評価・リスク管理についてはリスク管理部が行います。



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】

分配方針

年1回の毎決算時（決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- A. 分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- B. 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C. 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

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。

分配収益の計算

- A. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
 - イ. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）とみなし配当等収益との合計額は、諸経費（後記「4 手数料等及び税金（4）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、監査費用、当該監査費用に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - ロ. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金

額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

ハ．上記イ．及びロ．においてみなし配当等収益とは、マザーファンドの配当等収益にマザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属するマザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ．収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

ホ．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、上記ニ．に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

A．支払時期と場所

イ．収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、毎計算期間終了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計算期間終了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計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に対する支払いを開始します。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、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受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者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けを行います。当該売付け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。

ハ．上記イ．に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

B．時効

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

(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、信託財産の純資産総額の75%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、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。

E．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。以下同じ。）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。

G．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H．投資する株式等の範囲

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

I．信用取引の指図範囲

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。

J．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まれるものとします（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。

K．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たときは、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．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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．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O．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。

O．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たときは、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。
- P．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。
- Q．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。
- R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
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。
- S．再投資の指図
委託会社は、上記R．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。
- T．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等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、当該有価証券等の売却代金、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。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- U．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。

V．利害関係人等との取引等

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（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）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第2条第1項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。以下イ．及び下記ロ．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）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ．委託会社は、金融商品取引法、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、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

二．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

関連法令に基づく投資制限

A．発生し得る危険に対応する額として算出した額が運用財産の純資産額を超える場合におけるデリバティブ取引に関する制限

（金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

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第9条、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第20条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、次のイ．に掲げる数がロ．に掲げる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。

イ．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（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。ロ．において同

じ。)の総数

□. 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

(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、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、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。

「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

M S C I 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、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。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、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。

「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

シティグループ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と及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債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。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

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。

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。

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

上がりが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コンプライアンス会議に報告します。

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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

受益者の手取額は、当該解約価額から下記「（5）課税上の取扱い」「 個人の受益者に対する課税」もしくは「 法人の受益者に対する課税」に記載の税額を差引いた金額となります。

なお、当ファンドが保有する各マザーファンドの受益証券を一部解約する場合には、各マザーファンド毎に、下表のA欄の金額にB欄の率を乗じて得た信託財産留保額が控除されます。

マザーファンド名	A 欄	B 欄
日本株式マザーファンド	一部解約を行う日の前営業日の信託財産 の資産総額から負債総額を控除した金額を 受益権総口数で除した金額	0.2%
外国株式マザーファンド		0.2%
外国債券マザーファンド		0.1%

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

(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、信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。その配分は以下のとおりです。

純資産総額	信託報酬総額	配分		
		委託会社	販売会社	受託会社
	純資産総額に 対して	純資産総額に 対して	純資産総額に 対して	純資産総額に 対して
100億円以下 の部分	年率0.63% (税抜0.6%)	年率0.315% (税抜0.3%)	年率0.2625% (税抜0.25%)	年率0.0525% (税抜0.05%)
100億円超の 部分	年率0.525% (税抜0.5%)	年率0.2625% (税抜0.25%)	年率0.21% (税抜0.2%)	年率0.0525% (税抜0.05%)

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

上記 の信託報酬は、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信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

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、そのつど信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）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信託財産中から支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

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、売買委託手数料に対する消費

税等相当額、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（消費税等相当額を含みます。）等は、取引のつど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。

手数料等の合計額については、ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個別元本について

- A．追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- B．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。
- C．ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。
- D．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「収益分配金の課税について」をご参照ください。）

一部解約時及び償還時の課税について

一部解約時及び償還時の譲渡益（個人の場合）又は個別元本超過額（法人の場合）が課税対象となります。詳しくは下記 又は をご参照ください。

収益分配金の課税について

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）」（受益者毎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、

- A．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、
- B．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。

なお、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。

個人の受益者に対する課税

- A．収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金の源泉徴収の税率は以下のとおりです。

なお、原則として、確定申告により、配当控除の適用が可能です。

	税率（内訳）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成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25年1月1日から平成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）

す。)

- B．一部解約時及び償還時の譲渡益が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Aと同じです。
- C．一部解約時及び償還時の損失の金額については、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との通算が可能となります。

詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

	税 率（所得税のみ）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成25年1月1日から平成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せん。）

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。（平成26年1月1日以降）

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。

上記は、平成25年6月28日現在のものですので、税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

以下の記載は、平成25年6月28日現在の状況について記載してあります。

(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	2,423,518,249	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,592,561	0.96
合計(純資産総額)		2,447,110,810	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】

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	775,900,729	1.0426	809,031,512	1.0644	825,868,735	33.75
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	562,772,346	1.4470	814,387,280	1.4219	800,205,998	32.70
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	411,116,934	1.9644	807,638,778	1.9397	797,443,516	32.59

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

(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。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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)	522,933,234	522,933,234	10,627	10,627
第2期計算期間末 (平成21年 6月10日)	1,311,145,790	1,311,145,790	7,776	7,776
第3期計算期間末 (平成22年 6月10日)	1,596,924,893	1,596,924,893	7,467	7,467

第4期計算期間末 (平成23年 6月10日)	1,894,852,177	1,894,852,177	7,723	7,723
第5期計算期間末 (平成24年 6月11日)	1,957,886,772	1,957,886,772	7,323	7,323
第6期計算期間末 (平成25年 6月10日)	2,447,708,994	2,452,312,536	10,634	10,654
平成24年 6月末日	2,002,421,309		7,414	
7月末日	2,012,988,572		7,380	
8月末日	2,054,841,888		7,460	
9月末日	2,101,128,927		7,595	
10月末日	2,132,895,063		7,716	
11月末日	2,212,977,600		8,060	
12月末日	2,325,871,730		8,693	
平成25年 1月末日	2,432,394,372		9,437	
2月末日	2,430,422,760		9,589	
3月末日	2,481,643,047		9,982	
4月末日	2,629,643,696		10,839	
5月末日	2,567,633,255		11,009	
6月末日	2,447,110,810		10,597	

【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20年 3月 3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)	20

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成20年 3月 3日～平成20年 6月10日)	6.3
第2期計算期間(平成20年 6月11日～平成21年 6月10日)	26.8
第3期計算期間(平成21年 6月11日～平成22年 6月10日)	4.0
第4期計算期間(平成22年 6月11日～平成23年 6月10日)	3.4
第5期計算期間(平成23年 6月11日～平成24年 6月11日)	5.2
第6期計算期間(平成24年 6月12日～平成25年 6月10日)	45.5

(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20年 3月 3日～平成20年 6月10日)	510,143,440	18,045,396	492,098,044
第2期計算期間 (平成20年 6月11日～平成21年 6月10日)	1,395,056,723	201,040,178	1,686,114,589
第3期計算期間 (平成21年 6月11日～平成22年 6月10日)	816,801,713	364,200,118	2,138,716,184

第4期計算期間 (平成22年 6月11日～平成23年 6月10日)	586,983,066	272,034,617	2,453,664,633
第5期計算期間 (平成23年 6月11日～平成24年 6月11日)	487,758,083	267,858,897	2,673,563,819
第6期計算期間 (平成24年 6月12日～平成25年 6月10日)	407,062,229	778,854,935	2,301,771,113

(注)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。

(参考情報)

日本株式マザーファンド

(1)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	295,129,383,710	98.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,781,046,266	1.59
合計(純資産総額)		299,910,429,976	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。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,410,700	4,254.04	10,255,216,600	5,990.00	14,440,093,000	4.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	14,023,800	473.08	6,634,463,917	612.00	8,582,565,600	2.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,400,600	3,265.33	4,573,428,700	4,550.00	6,372,730,000	2.12
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,583,100	3,342.85	5,292,069,435	3,685.00	5,833,723,500	1.95
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	897,000	2,989.49	2,681,575,134	5,790.00	5,193,630,000	1.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	23,955,600	169.30	4,055,812,576	206.00	4,934,853,600	1.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,168,400	2,742.56	3,204,414,755	3,505.00	4,095,242,000	1.37
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	779,700	3,755.88	2,928,465,276	5,140.00	4,007,658,000	1.34
日本	株式	キヤノン	電気機器	1,165,700	3,275.10	3,817,785,088	3,235.00	3,771,039,500	1.26
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,296,000	2,138.53	2,771,540,260	2,641.00	3,422,736,000	1.14
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	736,100	4,446.14	3,272,806,908	4,480.00	3,297,728,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,506,000	540.45	2,435,278,480	637.00	2,870,322,000	0.96
日本	株式	ファナック	電気機器	195,400	14,201.03	2,774,882,201	14,380.00	2,809,852,000	0.94
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	774,700	2,668.32	2,067,153,331	3,625.00	2,808,287,500	0.94
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	3,787,700	490.94	1,859,544,417	731.00	2,768,808,700	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	522,600	3,085.30	1,612,380,432	5,160.00	2,696,616,000	0.90
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	346,100	6,005.32	2,078,444,390	7,710.00	2,668,431,000	0.89
日本	株式	三井不動産	不動産業	873,000	2,012.46	1,756,885,200	2,917.00	2,546,541,000	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,445,100	1,835.84	2,652,980,426	1,699.00	2,455,224,900	0.82
日本	株式	ソニー	電気機器	1,179,300	1,199.41	1,414,471,197	2,078.00	2,450,585,400	0.82

日本	株式	日産自動車	輸送用機器	2,370,500	867.01	2,055,250,072	1,005.00	2,382,352,500	0.79
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	15,260	131,444.28	2,005,839,742	154,100.00	2,351,566,000	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	352,500	5,459.33	1,924,415,616	6,580.00	2,319,450,000	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	426,000	4,446.51	1,894,213,260	5,390.00	2,296,140,000	0.77
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	717,400	2,636.59	1,891,493,436	3,145.00	2,256,223,000	0.75
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	8,306,000	228.25	1,895,924,720	268.00	2,226,008,000	0.74
日本	株式	デンソー	輸送用機器	463,600	3,285.83	1,523,312,756	4,665.00	2,162,694,000	0.72
日本	株式	小松製作所	機械	916,500	2,325.11	2,130,963,852	2,293.00	2,101,534,500	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	615,900	2,359.71	1,453,347,248	3,380.00	2,081,742,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,598,600	1,336.26	2,136,159,615	1,246.00	1,991,855,600	0.66

(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。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	98.41
合計	98.41

(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。

c．投資株式の業種別投資比率

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	0.43
		建設業	2.45
		食料品	4.00
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.25
		化学	5.51
		医薬品	4.47
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.93
		ガラス・土石製品	0.88
		鉄鋼	1.60
		非鉄金属	0.92
		金属製品	0.67
		機械	4.94
		電気機器	11.41
		輸送用機器	11.72
		精密機器	1.32
		その他製品	1.31
		電気・ガス業	2.61
		陸運業	3.98
		海運業	0.33
		空運業	0.61
倉庫・運輸関連業	0.22		
情報・通信業	6.66		
卸売業	4.35		
小売業	4.30		

	銀行業	10.22
	証券、商品先物取引業	1.79
	保険業	2.39
	その他金融業	1.23
	不動産業	3.42
	サービス業	2.06
合計		98.41

(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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	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	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	408	4,408,112,525	4,614,480,000	4,614,480,000	1.54

(注)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。

外国株式マザーファンド

(1)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	163,986,957,901	55.10
	イギリス	27,634,736,549	9.29
	カナダ	13,286,421,222	4.46
	スイス	13,220,433,912	4.44
	フランス	11,372,316,165	3.82
	ドイツ	11,292,824,791	3.79
	オーストラリア	9,636,449,660	3.24
	オランダ	4,382,181,145	1.47
	スウェーデン	4,009,231,102	1.35
	スペイン	3,745,974,216	1.26
	香港	3,200,100,865	1.08
	イタリア	2,508,058,778	0.84
	アイルランド	2,339,653,139	0.79
	シンガポール	2,025,060,714	0.68
	ベルギー	1,510,733,313	0.51
	デンマーク	1,473,713,196	0.50
	ジャージー	1,342,065,975	0.45
	バミューダ	1,231,935,088	0.41
	アンティル	1,107,123,083	0.37
	フィンランド	1,017,908,946	0.34
	ノルウェー	867,685,496	0.29
イスラエル	648,343,068	0.22	
ルクセンブルク	443,317,717	0.15	
オーストリア	350,751,843	0.12	

	ケイマン	321,379,415	0.11
	ポルトガル	227,641,160	0.08
	ニュージーランド	156,474,054	0.05
	パナマ	149,397,733	0.05
	マン島	74,103,939	0.02
	ガーンジー	60,914,197	0.02
	リベリア	57,172,461	0.02
	ギリシャ	49,078,118	0.02
	モーリシャス	40,092,552	0.01
	小計	283,770,231,513	95.34
投資信託受益証券	オーストラリア	117,917,606	0.04
	シンガポール	43,260,799	0.01
	香港	26,309,700	0.01
	小計	187,488,105	0.06
投資証券	アメリカ	4,419,086,096	1.48
	オーストラリア	794,377,571	0.27
	フランス	400,759,104	0.13
	イギリス	355,036,337	0.12
	香港	128,757,384	0.04
	シンガポール	106,286,632	0.04
	カナダ	63,494,767	0.02
	オランダ	36,598,417	0.01
	小計	6,304,396,308	2.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,365,516,878	2.47
合計(純資産総額)		297,627,632,804	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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	525,597	8,852.39	4,652,792,832	8,877.04	4,665,747,485	1.57
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	110,152	45,090.13	4,966,768,715	38,822.77	4,276,405,783	1.44
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	933,614	2,695.45	2,516,510,416	3,413.18	3,186,598,047	1.07
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	327,731	7,432.70	2,435,926,236	8,548.73	2,801,686,748	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	1,216,677	2,212.35	2,691,727,041	2,299.11	2,797,284,964	0.94
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	31,385	75,941.90	2,383,436,694	86,470.33	2,713,871,347	0.91
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	227,911	11,427.56	2,604,468,199	11,703.61	2,667,383,487	0.90
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	320,315	7,507.62	2,404,806,022	7,657.48	2,452,807,403	0.82
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	377,537	6,689.56	2,525,557,168	6,434.07	2,429,101,750	0.82
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	586,304	3,447.69	2,021,395,786	4,097.40	2,402,322,244	0.81

アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	124,217	19,818.56	2,461,802,291	19,289.13	2,396,038,295	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	448,064	4,792.45	2,147,328,752	5,240.05	2,347,881,571	0.79
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	843,046	2,693.47	2,270,726,528	2,778.26	2,342,206,206	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	644,004	3,493.04	2,249,534,114	3,512.76	2,262,232,585	0.76
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	2,170,518	1,071.63	2,326,011,739	1,026.09	2,227,164,394	0.75
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	82,271	21,043.70	1,731,286,571	24,578.79	2,022,122,125	0.68
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	269,340	6,543.56	1,762,445,143	6,950.26	1,871,983,567	0.63
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	470,043	3,776.98	1,775,344,373	3,969.23	1,865,710,375	0.63
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	355,177	4,244.29	1,507,477,563	4,759.92	1,690,615,952	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	335,097	4,411.90	1,478,415,292	5,028.08	1,684,897,874	0.57
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	193,089	8,645.35	1,669,323,357	8,654.23	1,671,036,655	0.56
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	354,561	4,051.06	1,436,348,983	4,661.33	1,652,727,669	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	1,265,601	1,176.17	1,488,572,938	1,282.65	1,623,330,589	0.55
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	5,738,272	255.50	1,466,185,878	280.08	1,607,198,461	0.54
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	2,241,867	698.89	1,566,829,636	686.26	1,538,525,617	0.52
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	625,516	2,089.12	1,306,779,299	2,428.27	1,518,922,800	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	180,505	7,174.39	1,295,014,043	8,058.74	1,454,644,055	0.49
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	195,999	7,030.45	1,377,961,737	7,419.88	1,454,289,726	0.49
フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	139,755	8,916.12	1,246,073,203	10,283.68	1,437,196,439	0.48
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	574,971	2,177.84	1,252,198,867	2,477.69	1,424,603,058	0.48

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	95.34
投資信託受益証券	0.06
投資証券	2.12
合計	97.53

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	10.33
		素材	5.37

資本財	7.25
商業・専門サービス	0.93
運輸	1.79
自動車・自動車部品	1.48
耐久消費財・アパレル	1.56
消費者サービス	1.69
メディア	2.85
小売	3.06
食品・生活必需品小売り	2.26
食品・飲料・タバコ	6.61
家庭用品・パーソナル用品	1.92
ヘルスケア機器・サービス	2.98
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.61
銀行	7.51
各種金融	5.40
保険	4.58
不動産	0.69
ソフトウェア・サービス	6.31
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.81
電気通信サービス	3.59
公益事業	3.32
半導体・半導体製造装置	1.47
合計	95.34

(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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	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	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	103	41,425,726	41,369,950	4,078,663,370	1.37
	S&P/TSE 60	モントリオール取引 所	買建	カナダドル	29	4,028,038.50	3,981,700	374,319,617	0.13
	SWISS MKT 1X	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	49	3,739,573	3,766,630	392,784,176	0.13
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	ユーロ	217	5,719,976.50	5,683,230	730,465,551	0.25
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリ アドル	47	5,610,354	5,609,450	511,133,084	0.17
	FTSE 100	ロンドン国際金融先 物オプション取引所	買建	イギリスポ ンド	93	5,772,523.75	5,765,535	866,559,910	0.29

(注)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。

外国債券マザーファンド

(1)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	165,931,542,764	39.98
	フランス	40,822,949,756	9.84
	イタリア	39,495,242,988	9.52
	ドイツ	36,176,437,648	8.72
	イギリス	29,639,212,415	7.14
	スペイン	19,965,773,119	4.81
	オランダ	11,151,739,477	2.69
	カナダ	10,770,418,272	2.60
	ベルギー	10,765,952,843	2.59
	オーストリア	7,249,523,435	1.75
	オーストラリア	6,131,927,965	1.48
	メキシコ	4,193,213,057	1.01
	デンマーク	3,434,352,517	0.83
	アイルランド	3,229,374,277	0.78
	ポーランド	3,017,039,938	0.73
	フィンランド	2,611,855,006	0.63
	南アフリカ	2,275,627,684	0.55
	スウェーデン	2,155,279,635	0.52
	マレーシア	2,096,149,740	0.51
	シンガポール	1,597,180,784	0.38
スイス	1,528,712,360	0.37	
ノルウェー	1,285,666,524	0.31	
小計	405,525,172,204	97.72	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,464,990,348	2.28
合計(純資産総額)		414,990,162,552	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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	26,300,000	9,761.39	2,567,247,121	9,408.02	2,474,311,297	1.750	2022/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	22,030,000	11,379.44	2,506,891,216	11,011.84	2,425,910,171	3.625	2020/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/19	24,000,000	9,951.67	2,388,401,904	9,707.26	2,329,743,330	1.250	2019/01/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 09/30/14	22,150,000	10,207.14	2,260,882,824	10,126.46	2,243,011,758	2.375	2014/09/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	22,000,000	10,206.95	2,245,529,746	10,139.17	2,230,618,008	1.750	2015/07/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/15	21,980,000	10,095.65	2,219,024,869	10,040.00	2,206,793,126	1.250	2015/09/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.75% 08/15/17	19,000,000	11,628.03	2,209,326,795	11,321.09	2,151,008,504	4.750	2017/08/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	20,500,000	10,189.27	2,088,801,682	10,108.36	2,072,214,494	2.375	2014/08/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/15	20,090,000	9,848.40	1,978,545,421	9,842.82	1,977,423,567	0.250	2015/05/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	18,900,000	10,228.71	1,933,226,662	10,157.08	1,919,688,262	1.875	2015/06/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	20,000,000	9,669.70	1,933,941,440	9,529.72	1,905,944,956	0.625	2018/04/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	18,400,000	10,194.64	1,875,814,777	10,123.76	1,862,773,325	2.125	2014/11/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 12/15/15	19,000,000	9,826.65	1,867,063,529	9,798.72	1,861,758,542	0.250	2015/12/15	0.45
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	12,220,000	14,625.62	1,787,250,946	14,604.86	1,784,714,368	3.750	2021/04/25	0.43
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	16,800,000	10,796.59	1,813,827,271	10,595.15	1,779,985,454	3.000	2017/02/28	0.43

アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/15/14	18,000,000	9,863.42	1,775,417,194	9,863.04	1,775,347,878	0.250	2014/09/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/15/15	18,000,000	9,837.24	1,770,703,360	9,819.14	1,767,445,264	0.250	2015/09/15	0.43
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	11,650,000	15,062.43	1,754,773,176	15,012.49	1,748,955,876	4.250	2023/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	15,530,000	11,450.68	1,778,292,049	11,170.13	1,734,721,413	4.500	2017/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	17,500,000	9,877.73	1,728,603,117	9,867.47	1,726,807,709	0.375	2015/04/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.375% 02/15/16	17,350,000	9,868.26	1,712,144,404	9,814.13	1,702,752,224	0.375	2016/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/21	17,500,000	10,054.20	1,759,486,435	9,696.86	1,696,951,495	2.000	2021/11/15	0.41
フランス	国債証券	BTNS 3% 07/12/14	12,730,000	13,345.39	1,698,869,220	13,225.80	1,683,644,501	3.000	2014/07/12	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	15,520,000	11,051.51	1,715,195,183	10,708.56	1,661,969,840	3.125	2019/05/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.25% 03/31/17	15,300,000	10,913.64	1,669,787,447	10,691.43	1,635,788,906	3.250	2017/03/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	14,900,000	11,299.72	1,683,658,781	10,922.69	1,627,481,363	3.500	2020/05/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.375% 10/31/14	15,950,000	10,222.55	1,630,496,824	10,142.06	1,617,658,754	2.375	2014/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/31/17	16,500,000	9,807.97	1,618,315,377	9,656.81	1,593,374,227	0.625	2017/08/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	15,500,000	10,285.13	1,594,195,491	10,201.56	1,581,242,063	2.375	2015/02/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	16,300,000	9,858.90	1,607,000,929	9,618.30	1,567,783,190	0.750	2018/02/28	0.38

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.72
合計	97.72

(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。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	41	4,938,421.71	4,961,961.04	489,199,738	0.12
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	21	2,640,177.75	2,659,453.23	262,195,493	0.06
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	13	1,744,083.25	1,762,718.75	173,786,441	0.04
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	23	2,536,187	2,538,165	326,230,347	0.08
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	25	3,116,100	3,128,000	402,041,840	0.10
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	37	5,200,498	5,234,020	672,728,590	0.16

(注) 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。

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績



第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込みの受付

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、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。

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（4））に基づいて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、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

（2）募集取扱いの単位

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」（ ）を選択された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。）。

収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差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）の2つの申込方法があります。

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。販売会社の詳細につきましては、後記「2 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。

（3）販売価額

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販売価額は、原則として、後記「3 資産管理等の概要（4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（4）その他

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。このため販売会社は総合約款を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出していただきます。

「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、自動けいぞく約款に従い分配金から税金を差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、分配金再投資に関する契約（販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとする。）を締結していただきます。

受益権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、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

2【換金（解約）手続等】

(1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

(注) 一部解約の実行の請求の受け付けは、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受け付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(2) 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、

(3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
なお、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。

(4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（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、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。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。

販売会社の詳細につきましては、以下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。)

(5) 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、上記(1)による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

(6) 上記(5)により一部解約の実行の請求の受け付け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たものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。

(7) 一部解約金は、受益者の請求を受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。

(8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

(9) 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、大口の換金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。販売会社の詳細につきましては、上記(4)に記載の照会先までお問

い合わせください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額

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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりには換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、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、前記「2 換金（解約）手続等」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。

当ファンドの主たる投資対象としている資産及び基準価額に与える影響が大きいと想定される資産の評価方法

A．親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

B．国内上場株式、国内上場投信

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。

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

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。

D．公社債等

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

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．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。）

ハ．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ます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成20年3月3日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成20年3月3日から平成20年6月10日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

上記の原則により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。

(5) 【その他】

信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A. 委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ. 受益権の口数が10億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

ロ. 受益者に有利な場合又はやむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、信託期間中において、この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とき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

ハ. 所定の手続き

a. 委託会社は、上記イ. 及びロ. の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記イ. 及びロ. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下c. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e. 上記b. からd. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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b. からd. までの手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

B. 監督官庁の命令

イ. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

ロ. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記の規定に従います。

C. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

イ. 委託会社が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、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ. 上記イ. の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 D. に該当する場合には、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

D. 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

イ. 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違反して信託財産に著しい損害を与えたこと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、下記の規定に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

ロ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

A．委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

B．委託会社は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

信託約款の変更等

A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更すること又は当ファンドと他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

B．委託会社は、上記A．の事項（上記A．の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

C．上記B．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下C．において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

D．上記B．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

E．書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

F．上記B．からE．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

G．上記A．からF．までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

反対者の買取請求権

信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取べき旨を請求することができます。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記 A．八．b．又は B．に規定する書面に付記します。

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。

信託財産の管理

A．信託業務の委託等

イ．受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合するもの（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第2条第1項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、下記ハ．及びにおいて同じ。）を含みます。）を委託先として選定します。

- 1．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
- 2．委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
- 3．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
- 4．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

ロ．受託会社は、上記イ．に定める委託先の選定に当たっては、当該委託先が上記イ．1．から4．までに掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

ハ．上記イ．及びロ．にかかわらず、受託会社は、次の1．から4．までに掲げる業務を、受託会社及び委託会社が適当と認める者（受託会社の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

- 1．信託財産の保存に係る業務
- 2．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
- 3．委託会社のみ指図により信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
- 4．受託会社が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

B．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B．において同じ。）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。

C．信託財産の登記等及び記載等の留保等

イ．信託の登記又は登録をすることができる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できます。

ロ．上記イ．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。

ハ．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信託財産については、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。

ニ．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。

運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

A．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の有効期間は、有効期間満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から何らか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。

B．上記A．の契約を変更した場合には、有価証券報告書等においてその内容を開示します。
信託事務処理の再委託

- A．受託会社は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託会社の利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを再委託することができます。
- B．上記A．における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。
- C．受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について、受託会社の利害関係人である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、毎計算期間終了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計算期間終了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計算期間終了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。）に対する支払いを開始します。

上記の規定にかかわらず、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受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者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けを行います。当該売付け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。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日（償還日）後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までの日）から、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。）に対する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、信託終了による償還金について上記に規定する支払開始日から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) 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益

者に支払われます。

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

(4) 投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」をご参照ください。

(5) 受益権均等分割

受益者は、自己に帰属する受益権の口数に応じて均等に当ファンドの受益権を保有します。

(6) 帳簿閲覧権

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信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

(7) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

当ファンドの受益者は、委託会社又は受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

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6期計算期間(平成24年6月12日から平成25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】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (平成24年 6月11日現在)	第6期 (平成25年 6月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	-	13,733,080
親投資信託受益証券	1,964,270,998	2,427,503,041
未収入金	960,469	28,312,772
未収利息	-	21
流動資産合計	1,965,231,467	2,469,548,914
資産合計		
	1,965,231,467	2,469,548,914
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	4,603,542
未払解約金	960,469	9,386,328
未払受託者報酬	527,636	648,772
未払委託者報酬	5,803,892	7,136,455
その他未払費用	52,698	64,823
流動負債合計	7,344,695	21,839,920
負債合計		
	7,344,695	21,839,920
純資産の部		
元本等		
元本	2,673,563,819	2,301,771,113
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	715,677,047	145,937,881
（分配準備積立金）	126,170,558	578,348,000
元本等合計	1,957,886,772	2,447,708,994
純資産合計		
	1,957,886,772	2,447,708,994
負債純資産合計		
	1,965,231,467	2,469,548,914

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 (自 平成23年 6月11日 至 平成24年 6月11日)	第6期 (自 平成24年 6月12日 至 平成25年 6月10日)
営業収益		
受取利息	106	4,317
有価証券売買等損益	81,958,891	894,166,800
営業収益合計	81,958,785	894,171,117
営業費用		
受託者報酬	1,011,699	1,198,532
委託者報酬	11,128,488	13,183,654
その他費用	101,038	119,738
営業費用合計	12,241,225	14,501,924
営業利益又は営業損失（ ）	94,200,010	879,669,193
経常利益又は経常損失（ ）	94,200,010	879,669,193
当期純利益又は当期純損失（ ）	94,200,010	879,669,193
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（ ）	3,691,227	157,399,892
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	558,812,456	715,677,047
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,516,749	203,024,105
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,516,749	203,024,105
剰余金減少額又は欠損金増加額	128,872,557	59,074,936
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	128,872,557	59,074,936
分配金	-	4,603,542
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	715,677,047	145,937,881

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 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。
2. その他	ファンドの計算期間 第6期(自 平成24年 6月12日 至 平成25年 6月10日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は平成24年 6月12日から平成25年 6月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (平成24年 6月11日現在)	第6期 (平成25年 6月10日現在)
1. 期首元本額	2,453,664,633円	2,673,563,819円
期中追加設定元本額	487,758,083円	407,062,229円
期中一部解約元本額	267,858,897円	778,854,935円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	2,673,563,819口	2,301,771,113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 715,677,047円	
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7323円 (7,323円)	1.0634円 (10,634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5期 自 平成23年 6月11日 至 平成24年 6月11日	第6期 自 平成24年 6月12日 至 平成25年 6月10日
費用控除後の配当等収益額	A	41,527,511円 (53,768,630円)	50,469,834円 (51,479,744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	439,087,077円
収益調整金額	C	147,464,865円	142,834,498円
分配準備積立金額	D	84,643,047円	93,394,631円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	273,635,423円	725,786,040円
当ファンドの期末残存口数	F	2,673,563,819口	2,301,771,113口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,023.48円	3,153.16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	4,603,542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、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。
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コンプライアンス会議に報告します。 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

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5期 (平成24年 6月11日現在)	第6期 (平成25年 6月10日現在)
	計算期間(自 平成23年6月11日 至 平成24年 6月11日)の損益に含まれた評価差額(円)	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)
親投資信託受益証券	69,716,373	738,344,525
合計	69,716,373	738,344,525

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、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	766,514,679	799,474,810	
	外国株式マザーファンド	564,829,949	817,421,902	
	外国債券マザーファンド	412,606,296	810,606,329	
親投資信託受益証券 小計		1,743,950,924	2,427,503,041	
合計		1,743,950,924	2,427,503,041	

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。

[次へ](#)

<参考>

「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」は、「日本株式マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」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25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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,902,526,883
株式	290,934,319,030
派生商品評価勘定	49,424,000
未収入金	1,494,172,346
未収配当金	2,559,187,275
未収利息	2,949
前払金	462,539,000
流動資産合計	297,402,171,483
資産合計	297,402,171,483
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,547,825
未払金	113,648,846
未払解約金	1,061,340,745
流動負債合計	1,267,537,416
負債合計	1,267,537,416
純資産の部	
元本等	
元本	283,920,465,158
剰余金	
剰余金又は欠損金()	12,214,168,909
元本等合計	296,134,634,067
純資産合計	296,134,634,067
負債純資産合計	297,402,171,483

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25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 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。</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 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>(1)受取配当金 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 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25年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	348,529,838,430円
計算期間中の追加設定元本額	33,326,258,044円
計算期間中の一部解約元本額	97,935,631,316円
計算日の元本額	283,920,465,158円
計算日の元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	1,948,618,288円
DC日本株式インデックスファンド	375,341,066円
DC日本株式インデックスファンドL	49,470,972,872円
DC日本株式インデックスファンドA	1,536,052,306円
DCバランスファンド30	478,516,025円
DCバランスファンド50	1,167,091,437円
DCバランスファンド70	635,064,373円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	179,304,077円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	108,052,227円
新生・4分散ファンド	168,642,253円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	766,514,679円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	30,590,116円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	122,918,778円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	55,824,036円
日本株式インデックスe	1,552,716,239円
インデックスコレクション(国内株式)	4,241,561,069円

インデックスコレクション(バランス株式30)	531,061,295円
インデックスコレクション(バランス株式50)	937,992,631円
インデックスコレクション(バランス株式70)	846,132,035円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	9,503,080,432円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	25,320,658,240円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	5,009,640,298円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	40,477,539,629円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	26,184,449,442円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	4,722,647,276円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	773,857,720円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	5,821,454,198円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	5,116,467,245円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,102,045,538円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	32,318,410,754円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,496,217,522円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	14,810,680,886円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	5,745,152,345円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	181,560,127円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,144,268,826円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,652,242,044円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	6,684,794,072円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	278,610,598円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	221,278,749円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,135,057,466円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	2,653,968,934円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,414,988,240円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	90,637,782円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,509,738,328円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	18,233,944,889円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	467,598,736円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	155,565,076円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	57,948,595円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	467,824,294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)	11,523,101円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	3,647,974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 13,840,500,000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。
3. 計算日における受益権総数	283,920,465,158口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0430円 (10,430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25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コンプライアンス会議に報告します。 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25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。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25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	54,716,245,608	
合計	54,716,245,608	

(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25年1月23日から平成25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25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	4,946,548,825	-	4,903,425,000	43,123,825
合計		4,946,548,825	-	4,903,425,000	43,123,825

(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25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25年 6月10日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成25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	90,000	226.00	20,340,000	
日本水産	227,300	198.00	45,005,400	

マルハニチロホールディングス	405,000	177.00	71,685,000	
サカタのタネ	31,200	1,249.00	38,968,800	
ホクト	21,500	1,723.00	37,044,500	
住石ホールディングス	62,100	120.00	7,452,000	
日鉄鉱業	54,000	389.00	21,006,000	
三井松島産業	138,000	148.00	20,424,000	
国際石油開発帝石	2,569	435,500.00	1,118,799,500	
日本海洋掘削	5,300	8,130.00	43,089,000	
関東天然瓦斯開発	21,000	580.00	12,180,000	
石油資源開発	30,100	3,985.00	119,948,500	
ショーボンドホールディングス	18,800	3,800.00	71,440,000	
ミライト・ホールディングス	60,100	927.00	55,712,700	
タマホーム	9,500	1,085.00	10,307,500	
ダイセキ環境ソリューション	24	140,000.00	3,360,000	
安藤・間	119,200	208.00	24,793,600	
東急建設	89,820	226.00	20,299,320	
コムシスホールディングス	102,600	1,270.00	130,302,000	
ミサワホーム	26,300	1,858.00	48,865,400	
高松コンストラクショングループ	16,200	1,504.00	24,364,800	
東建コーポレーション	8,330	4,875.00	40,608,750	
ヤマウラ	17,500	272.00	4,760,000	
大成建設	1,070,000	326.00	348,820,000	
大林組	635,000	484.00	307,340,000	
清水建設	648,000	348.00	225,504,000	
長谷工コーポレーション	1,321,000	123.00	162,483,000	
松井建設	29,000	317.00	9,193,000	
鹿島建設	930,000	295.00	274,350,000	
不動テトラ	149,200	155.00	23,126,000	
鉄建建設	128,000	109.00	13,952,000	
太平工業	42,000	344.00	14,448,000	
西松建設	274,000	218.00	59,732,000	
三井住友建設	364,700	80.00	29,176,000	
前田建設工業	134,000	448.00	60,032,000	
ナカノフドー建設	35,500	218.00	7,739,000	
奥村組	188,000	344.00	64,672,000	
大和小田急建設	10,000	196.00	1,960,000	
東鉄工業	27,500	1,594.00	43,835,000	
イチケン	41,000	159.00	6,519,000	
戸田建設	246,000	271.00	66,666,000	
熊谷組	153,000	95.00	14,535,000	
青木あすなる建設	12,500	494.00	6,175,000	
北野建設	50,000	198.00	9,900,000	
植木組	39,000	170.00	6,630,000	

三井ホーム	31,000	475.00	14,725,000	
矢作建設工業	30,600	380.00	11,628,000	
ピーエス三菱	15,300	384.00	5,875,200	
大東建託	80,300	9,020.00	724,306,000	
新日本建設	33,000	286.00	9,438,000	
N I P P O	49,000	1,433.00	70,217,000	
東亜道路工業	45,000	458.00	20,610,000	
前田道路	61,000	1,342.00	81,862,000	
日本道路	66,000	516.00	34,056,000	
東亜建設工業	185,000	135.00	24,975,000	
東洋建設	65,700	249.00	16,359,300	
五洋建設	251,500	237.00	59,605,500	
大林道路	29,000	394.00	11,426,000	
福田組	37,000	323.00	11,951,000	
住友林業	145,800	1,168.00	170,294,400	
日本基礎技術	25,500	298.00	7,599,000	
日成ビルド工業	87,000	156.00	13,572,000	
バコーポレーション	28,600	327.00	9,352,200	
パナホーム	80,000	634.00	50,720,000	
大和ハウス工業	527,000	1,894.00	998,138,000	
ライト工業	48,100	537.00	25,829,700	
積水ハウス	635,000	1,337.00	848,995,000	
日特建設	23,500	309.00	7,261,500	
北陸電気工事	15,000	314.00	4,710,000	
ユアテック	33,000	282.00	9,306,000	
西部電気工業	18,000	409.00	7,362,000	
四電工	18,000	327.00	5,886,000	
中電工	30,600	968.00	29,620,800	
関電工	96,000	433.00	41,568,000	
きんでん	140,000	807.00	112,980,000	
東京エネシス	22,000	436.00	9,592,000	
トーエネック	30,000	448.00	13,440,000	
住友電設	15,200	1,336.00	20,307,200	
日本電設工業	38,000	1,020.00	38,760,000	
協和エクシオ	76,000	1,118.00	84,968,000	
新日本空調	19,300	549.00	10,595,700	
N D S	32,000	273.00	8,736,000	
九電工	34,000	426.00	14,484,000	
三機工業	51,000	557.00	28,407,000	
日揮	213,000	3,415.00	727,395,000	
中外炉工業	75,000	248.00	18,600,000	
ヤマト	23,000	325.00	7,475,000	
太平電業	26,000	611.00	15,886,000	

高砂熱学工業	60,800	779.00	47,363,200	
三晃金属工業	35,000	232.00	8,120,000	
朝日工業社	25,000	322.00	8,050,000	
大気社	30,300	2,289.00	69,356,700	
ダイダン	29,000	515.00	14,935,000	
日比谷総合設備	25,900	897.00	23,232,300	
東芝プラントシステム	35,000	1,406.00	49,210,000	
東洋エンジニアリング	114,000	463.00	52,782,000	
千代田化工建設	153,000	1,139.00	174,267,000	
新興プランテック	43,500	740.00	32,190,000	
日本製粉	130,000	465.00	60,450,000	
日清製粉グループ本社	191,500	1,161.00	222,331,500	
日東富士製粉	17,000	298.00	5,066,000	
昭和産業	87,000	291.00	25,317,000	
鳥越製粉	16,800	611.00	10,264,800	
協同飼料	73,000	106.00	7,738,000	
中部飼料	18,700	517.00	9,667,900	
日本配合飼料	60,000	117.00	7,020,000	
東洋精糖	34,000	94.00	3,196,000	
日本甜菜製糖	108,000	165.00	17,820,000	
三井製糖	83,000	294.00	24,402,000	
森永製菓	207,000	192.00	39,744,000	
中村屋	49,000	396.00	19,404,000	
江崎グリコ	76,000	904.00	68,704,000	
名糖産業	9,400	977.00	9,183,800	
不二家	121,000	185.00	22,385,000	
山崎製パン	155,000	1,106.00	171,430,000	
モロゾフ	32,000	299.00	9,568,000	
亀田製菓	11,800	2,453.00	28,945,400	
カルビー	19,300	9,580.00	184,894,000	
森永乳業	181,000	271.00	49,051,000	
ヤクルト本社	123,600	4,140.00	511,704,000	
明治ホールディングス	62,600	4,385.00	274,501,000	
雪印メグミルク	41,400	1,382.00	57,214,800	
プリマハム	120,000	199.00	23,880,000	
日本ハム	161,000	1,448.00	233,128,000	
伊藤ハム	116,000	435.00	50,460,000	
丸大食品	101,000	292.00	29,492,000	
米久	8,500	773.00	6,570,500	
S F o o d s	13,500	807.00	10,894,500	
サッポロホールディングス	349,000	356.00	124,244,000	
アサヒグループホールディングス	424,800	2,483.00	1,054,778,400	
キリンホールディングス	904,000	1,627.00	1,470,808,000	

宝ホールディングス	167,000	926.00	154,642,000	
オエノンホールディングス	55,000	228.00	12,540,000	
養命酒製造	16,000	792.00	12,672,000	
三国コカ・コーラボトリング	22,000	1,128.00	24,816,000	
コカ・コーラウエスト	71,600	1,742.00	124,727,200	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	26,400	1,437.00	37,936,800	
ダイトードリンコ	10,700	3,930.00	42,051,000	
伊藤園	57,500	2,146.00	123,395,000	
キーコーヒー	18,400	1,521.00	27,986,400	
ユニカフェ	5,700	496.00	2,827,200	
ジャパンフーズ	2,800	1,250.00	3,500,000	
日清オイリオグループ	91,000	353.00	32,123,000	
不二製油	51,300	1,573.00	80,694,900	
かどや製油	1,700	2,729.00	4,639,300	
J-オイルミルズ	88,000	295.00	25,960,000	
キッコーマン	173,000	1,624.00	280,952,000	
味の素	521,000	1,434.00	747,114,000	
キュービー	107,500	1,356.00	145,770,000	
ハウス食品	74,300	1,515.00	112,564,500	
カゴメ	75,900	1,644.00	124,779,600	
焼津水産化学工業	9,900	820.00	8,118,000	
アリアケジャパン	19,200	2,126.00	40,819,200	
ニチレイ	225,000	497.00	111,825,000	
東洋水産	97,000	3,175.00	307,975,000	
日清食品ホールディングス	82,600	3,750.00	309,750,000	
永谷園	20,000	847.00	16,940,000	
フジッコ	23,000	1,084.00	24,932,000	
ロック・フィールド	11,000	1,664.00	18,304,000	
日本たばこ産業	1,174,500	3,480.00	4,087,260,000	
ケンコーマヨネーズ	6,500	820.00	5,330,000	
わらべや日洋	12,700	1,469.00	18,656,300	
なとり	9,700	897.00	8,700,900	
ミヨシ油脂	68,000	142.00	9,656,000	
片倉工業	24,900	1,279.00	31,847,100	
グンゼ	148,000	229.00	33,892,000	
東洋紡	835,000	152.00	126,920,000	
ユニチカ	541,000	53.00	28,673,000	
富士紡ホールディングス	95,000	229.00	21,755,000	
日清紡ホールディングス	126,000	724.00	91,224,000	
倉敷紡績	203,000	165.00	33,495,000	
シキボウ	121,000	111.00	13,431,000	
日本毛織	62,000	692.00	42,904,000	
トーア紡コーポレーション	89,000	67.00	5,963,000	

ダイドーリミテッド	22,300	628.00	14,004,400	
帝国繊維	21,000	743.00	15,603,000	
帝人	750,000	220.00	165,000,000	
東レ	1,529,000	660.00	1,009,140,000	
サカイオーベックス	53,000	120.00	6,360,000	
住江織物	58,000	224.00	12,992,000	
日本フェルト	11,300	412.00	4,655,600	
イチカワ	14,000	281.00	3,934,000	
日本バイリーン	25,000	445.00	11,125,000	
芦森工業	53,000	131.00	6,943,000	
アツギ	166,000	109.00	18,094,000	
ダイニック	37,000	170.00	6,290,000	
セーレン	53,200	638.00	33,941,600	
東海染工	28,000	107.00	2,996,000	
小松精練	34,000	435.00	14,790,000	
ワコールホールディングス	118,000	999.00	117,882,000	
ホギメディカル	12,500	5,370.00	67,125,000	
レナウン	42,700	121.00	5,166,700	
クラウドシア	2,900	1,205.00	3,494,500	
T S Iホールディングス	102,900	627.00	64,518,300	
三陽商会	105,000	258.00	27,090,000	
オンワードホールディングス	132,000	846.00	111,672,000	
ルック	36,000	311.00	11,196,000	
ゴールドウイン	46,000	441.00	20,286,000	
デサント	50,000	647.00	32,350,000	
ヤマトインターナショナル	12,500	417.00	5,212,500	
特種東海製紙	115,000	189.00	21,735,000	
王子ホールディングス	873,000	352.00	307,296,000	
日本製紙	95,300	1,241.00	118,267,300	
三菱製紙	281,000	91.00	25,571,000	
北越紀州製紙	122,500	432.00	52,920,000	
中越パルプ工業	75,000	145.00	10,875,000	
巴川製紙所	30,000	157.00	4,710,000	
大王製紙	83,000	542.00	44,986,000	
レンゴー	159,000	461.00	73,299,000	
トーモク	62,000	297.00	18,414,000	
ザ・バック	14,000	1,595.00	22,330,000	
クラレ	336,400	1,425.00	479,370,000	
旭化成	1,232,000	663.00	816,816,000	
共和レザー	11,500	284.00	3,266,000	
コープケミカル	30,000	125.00	3,750,000	
昭和電工	1,228,000	145.00	178,060,000	
住友化学	1,357,000	309.00	419,313,000	

日本化成	37,000	129.00	4,773,000	
住友精化	37,000	383.00	14,171,000	
日産化学工業	135,300	1,308.00	176,972,400	
ラサ工業	70,000	117.00	8,190,000	
クレハ	138,000	335.00	46,230,000	
テイカ	33,000	276.00	9,108,000	
石原産業	355,000	73.00	25,915,000	
片倉チッカリン	13,000	248.00	3,224,000	
日本曹達	118,000	498.00	58,764,000	
東ソー	528,000	324.00	171,072,000	
トクヤマ	287,000	320.00	91,840,000	
セントラル硝子	176,000	297.00	52,272,000	
東亜合成	232,000	398.00	92,336,000	
ダイソー	79,000	289.00	22,831,000	
関東電化工業	47,000	269.00	12,643,000	
電気化学工業	395,000	327.00	129,165,000	
信越化学工業	354,300	6,450.00	2,285,235,000	
日本カーバイド工業	58,000	545.00	31,610,000	
堺化学工業	74,000	279.00	20,646,000	
エア・ウォーター	163,000	1,395.00	227,385,000	
大陽日酸	260,000	677.00	176,020,000	
日本化学工業	73,000	117.00	8,541,000	
日本パーカライズン	47,000	1,727.00	81,169,000	
高压ガス工業	29,000	493.00	14,297,000	
チタン工業	23,000	209.00	4,807,000	
四国化成工業	28,000	653.00	18,284,000	
戸田工業	28,000	282.00	7,896,000	
ステラ ケミファ	8,700	1,575.00	13,702,500	
保土谷化学工業	44,000	181.00	7,964,000	
日本触媒	143,000	945.00	135,135,000	
大日精化工業	71,000	399.00	28,329,000	
カネカ	246,000	629.00	154,734,000	
三菱瓦斯化学	311,000	707.00	219,877,000	
三井化学	838,000	221.00	185,198,000	
J S R	181,200	1,999.00	362,218,800	
東京応化工業	38,200	2,280.00	87,096,000	
大阪有機化学工業	13,100	411.00	5,384,100	
三菱ケミカルホールディングス	1,235,000	457.00	564,395,000	
日本合成化学工業	40,000	1,062.00	42,480,000	
ダイセル	235,000	776.00	182,360,000	
住友ベークライト	154,000	369.00	56,826,000	
積水化学工業	405,000	1,036.00	419,580,000	
日本ゼオン	170,000	997.00	169,490,000	

アイカ工業	55,400	1,943.00	107,642,200	
宇部興産	946,000	188.00	177,848,000	
積水樹脂	28,000	1,221.00	34,188,000	
タキロン	46,000	405.00	18,630,000	
旭有機材工業	70,000	211.00	14,770,000	
日立化成	85,400	1,591.00	135,871,400	
ニチバン	19,000	367.00	6,973,000	
リケンテクノス	32,000	297.00	9,504,000	
大倉工業	47,000	345.00	16,215,000	
積水化成品工業	51,000	248.00	12,648,000	
群栄化学工業	53,000	356.00	18,868,000	
タイガースポリマー	9,700	387.00	3,753,900	
ミライアル	4,900	1,779.00	8,717,100	
日本カーリット	15,700	564.00	8,854,800	
日本化薬	139,000	1,162.00	161,518,000	
日本精化	16,400	573.00	9,397,200	
A D E K A	85,000	925.00	78,625,000	
日油	153,000	525.00	80,325,000	
ハリマ化成グループ	16,800	470.00	7,896,000	
花王	523,900	3,170.00	1,660,763,000	
第一工業製薬	36,000	247.00	8,892,000	
三洋化成工業	62,000	586.00	36,332,000	
大日本塗料	113,000	137.00	15,481,000	
日本ペイント	171,000	1,086.00	185,706,000	
関西ペイント	224,000	1,285.00	287,840,000	
中国塗料	61,000	446.00	27,206,000	
日本特殊塗料	15,200	387.00	5,882,400	
藤倉化成	23,000	427.00	9,821,000	
太陽ホールディングス	16,100	3,205.00	51,600,500	
D I C	700,000	228.00	159,600,000	
サカタインクス	40,000	668.00	26,720,000	
東洋インキ S C ホールディングス	178,000	457.00	81,346,000	
T & K T O K A	6,600	1,794.00	11,840,400	
富士フイルムホールディングス	422,000	2,075.00	875,650,000	
資生堂	351,400	1,505.00	528,857,000	
ライオン	228,000	546.00	124,488,000	
高砂香料工業	65,000	465.00	30,225,000	
マンダム	21,200	3,095.00	65,614,000	
ミルボン	9,700	3,225.00	31,282,500	
ファンケル	49,600	1,138.00	56,444,800	
コーセー	35,500	2,403.00	85,306,500	
ドクターシーラボ	134	285,600.00	38,270,400	
シーボン	1,500	1,947.00	2,920,500	

ポーラ・オルビスホールディングス	23,500	3,280.00	77,080,000	
ノビアホールディングス	12,300	1,420.00	17,466,000	
エステー	12,100	980.00	11,858,000	
コニシ	14,300	1,678.00	23,995,400	
長谷川香料	25,000	1,437.00	35,925,000	
星光PMC	8,100	364.00	2,948,400	
小林製薬	29,900	4,745.00	141,875,500	
荒川化学工業	15,400	824.00	12,689,600	
メック	14,100	487.00	6,866,700	
日本高純度化学	52	215,000.00	11,180,000	
JCU	2,900	4,100.00	11,890,000	
新田ゼラチン	8,200	1,229.00	10,077,800	
アース製薬	14,200	3,355.00	47,641,000	
イハラケミカル工業	33,000	607.00	20,031,000	
北興化学工業	19,000	300.00	5,700,000	
大成ラミック	5,500	2,321.00	12,765,500	
クミアイ化学工業	41,000	569.00	23,329,000	
日本農薬	45,000	936.00	42,120,000	
アキレス	156,000	130.00	20,280,000	
有沢製作所	30,800	423.00	13,028,400	
日東電工	162,800	5,920.00	963,776,000	
レック	6,100	1,118.00	6,819,800	
きもと	17,600	715.00	12,584,000	
藤森工業	16,700	2,889.00	48,246,300	
前澤化成工業	13,800	937.00	12,930,600	
JSP	12,900	1,404.00	18,111,600	
エフピコ	9,700	6,370.00	61,789,000	
天馬	15,700	1,211.00	19,012,700	
信越ポリマー	38,700	354.00	13,699,800	
東リ	51,000	194.00	9,894,000	
ニフコ	44,100	2,162.00	95,344,200	
日本バルカー工業	82,000	234.00	19,188,000	
ユニ・チャーム	109,100	5,930.00	646,963,000	
協和発酵キリン	236,000	1,060.00	250,160,000	
武田薬品工業	740,000	4,470.00	3,307,800,000	代用有価証券で 600,000株 担保差入
アステラス製薬	438,500	5,180.00	2,271,430,000	
大日本住友製薬	139,800	1,316.00	183,976,800	
塩野義製薬	287,900	2,042.00	587,891,800	
田辺三菱製薬	164,400	1,276.00	209,774,400	
わかもと製薬	22,000	281.00	6,182,000	
あすか製薬	23,000	623.00	14,329,000	
日本新薬	41,000	1,488.00	61,008,000	

中外製薬	229,500	2,061.00	472,999,500	
科研製薬	78,000	1,452.00	113,256,000	
エーザイ	243,200	3,870.00	941,184,000	
ロート製薬	83,000	1,462.00	121,346,000	
小野薬品工業	96,600	6,720.00	649,152,000	
久光製薬	61,300	4,870.00	298,531,000	
有機合成薬品工業	14,000	266.00	3,724,000	
持田製薬	73,000	1,237.00	90,301,000	
参天製薬	67,700	4,500.00	304,650,000	
扶桑薬品工業	66,000	330.00	21,780,000	
日本ケミファ	27,000	525.00	14,175,000	
ツムラ	53,900	2,747.00	148,063,300	
日医工	28,600	2,053.00	58,715,800	
キッセイ薬品工業	36,700	1,879.00	68,959,300	
生化学工業	37,700	1,230.00	46,371,000	
栄研化学	14,000	1,705.00	23,870,000	
日水製薬	7,900	1,055.00	8,334,500	
鳥居薬品	11,800	2,279.00	26,892,200	
東和薬品	10,100	4,195.00	42,369,500	
富士製薬工業	5,300	1,844.00	9,773,200	
沢井製薬	13,000	10,870.00	141,310,000	
ゼリア新薬工業	28,000	1,367.00	38,276,000	
第一三共	622,900	1,643.00	1,023,424,700	
キョーリン製薬ホールディングス	52,700	2,217.00	116,835,900	
大幸薬品	9,200	1,320.00	12,144,000	
ダイト	6,400	1,244.00	7,961,600	
大塚ホールディングス	392,000	3,180.00	1,246,560,000	
大正製薬ホールディングス	47,500	6,690.00	317,775,000	
日本コークス工業	159,500	106.00	16,907,000	
昭和シェル石油	176,600	762.00	134,569,200	
コスモ石油	546,000	183.00	99,918,000	
ニチレキ	24,000	668.00	16,032,000	
東燃ゼネラル石油	298,000	974.00	290,252,000	
ユシロ化学工業	10,700	903.00	9,662,100	
ビーピー・カストロール	8,100	418.00	3,385,800	
AOCホールディングス	45,800	314.00	14,381,200	
MORESCO	3,700	1,094.00	4,047,800	
出光興産	23,400	7,700.00	180,180,000	
JXホールディングス	2,192,300	471.00	1,032,573,300	
横浜ゴム	221,000	996.00	220,116,000	
東洋ゴム工業	164,000	498.00	81,672,000	
ブリヂストン	619,100	3,285.00	2,033,743,500	
住友ゴム工業	154,100	1,561.00	240,550,100	

藤倉ゴム工業	11,000	337.00	3,707,000	
オカモト	69,000	306.00	21,114,000	
フコク	8,300	797.00	6,615,100	
ニッタ	19,500	1,831.00	35,704,500	
東海ゴム工業	36,600	855.00	31,293,000	
三ツ星ベルト	50,000	463.00	23,150,000	
バンドー化学	66,000	360.00	23,760,000	
日東紡績	145,000	317.00	45,965,000	
旭硝子	973,000	713.00	693,749,000	
日本板硝子	900,000	100.00	90,000,000	
石塚硝子	26,000	212.00	5,512,000	
日本山村硝子	79,000	166.00	13,114,000	
日本電気硝子	350,000	505.00	176,750,000	
オハラ	7,600	641.00	4,871,600	
住友大阪セメント	351,000	300.00	105,300,000	
太平洋セメント	1,090,000	293.00	319,370,000	
デイ・シイ	22,700	280.00	6,356,000	
日本ヒューム	19,000	588.00	11,172,000	
日本コンクリート工業	34,000	260.00	8,840,000	
ジャパンパイル	15,600	604.00	9,422,400	
東海カーボン	172,000	281.00	48,332,000	
日本カーボン	105,000	192.00	20,160,000	
東洋炭素	11,000	1,874.00	20,614,000	
ノリタケカンパニーリミテド	102,000	254.00	25,908,000	
TOTO	305,000	1,050.00	320,250,000	
日本碍子	257,000	1,249.00	320,993,000	
日本特殊陶業	170,000	1,810.00	307,700,000	
MARUWA	4,400	3,765.00	16,566,000	
品川リフラクトリーズ	50,000	193.00	9,650,000	
黒崎播磨	48,000	202.00	9,696,000	
東京窯業	25,000	166.00	4,150,000	
ニッカトー	6,700	442.00	2,961,400	
フジインコーポレーテッド	18,100	1,018.00	18,425,800	
ニチアス	88,000	610.00	53,680,000	
ニチハ	21,900	1,384.00	30,309,600	
新日鐵住金	8,349,000	255.00	2,128,995,000	
神戸製鋼所	2,738,000	137.00	375,106,000	
合同製鐵	112,000	163.00	18,256,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	503,800	2,064.00	1,039,843,200	
日新製鋼ホールディングス	84,100	844.00	70,980,400	
東京製鐵	109,600	348.00	38,140,800	
共英製鋼	18,500	1,521.00	28,138,500	
大和工業	40,900	3,060.00	125,154,000	

東京鐵鋼	39,000	349.00	13,611,000	
大阪製鐵	10,000	1,562.00	15,620,000	
淀川製鋼所	140,000	424.00	59,360,000	
東洋鋼鈹	42,000	328.00	13,776,000	
住友鋼管	13,500	952.00	12,852,000	
丸一鋼管	66,100	2,505.00	165,580,500	
モリ工業	30,000	306.00	9,180,000	
大同特殊鋼	306,000	511.00	156,366,000	
日本高周波鋼業	79,000	86.00	6,794,000	
日本冶金工業	153,000	115.00	17,595,000	
山陽特殊製鋼	98,000	496.00	48,608,000	
愛知製鋼	105,000	440.00	46,200,000	
日立金属	140,000	1,070.00	149,800,000	
日本金属	51,000	119.00	6,069,000	
大平洋金属	126,000	467.00	58,842,000	
日本電工	78,000	290.00	22,620,000	
栗本鐵工所	86,000	273.00	23,478,000	
日本鑄鉄管	22,000	220.00	4,840,000	
三菱製鋼	120,000	208.00	24,960,000	
日亜鋼業	28,000	290.00	8,120,000	
日本精線	14,000	408.00	5,712,000	
シンニッタン	15,500	350.00	5,425,000	
新家工業	43,000	131.00	5,633,000	
大紀アルミニウム工業所	34,000	276.00	9,384,000	
日本輕金属ホールディングス	416,300	113.00	47,041,900	
三井金属鈹業	504,000	227.00	114,408,000	
東邦亜鉛	112,000	306.00	34,272,000	
三菱マテリアル	1,156,000	339.00	391,884,000	
住友金属鈹山	511,000	1,288.00	658,168,000	
DOWAホールディングス	218,000	810.00	176,580,000	
古河機械金属	333,000	158.00	52,614,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	1,860.00	36,270,000	
東邦チタニウム	33,600	776.00	26,073,600	
住友輕金属工業	478,000	96.00	45,888,000	
古河スカイ	67,000	282.00	18,894,000	
古河電氣工業	621,000	242.00	150,282,000	
住友電氣工業	697,600	1,198.00	835,724,800	
フジクラ	317,000	370.00	117,290,000	
昭和電線ホールディングス	253,000	81.00	20,493,000	
タツタ電線	37,100	937.00	34,762,700	
日立電線	154,000	183.00	28,182,000	
沖電線	21,000	146.00	3,066,000	
カナレ電氣	2,900	1,495.00	4,335,500	

平河ヒューテック	4,800	745.00	3,576,000	
リョービ	111,000	267.00	29,637,000	
アサヒホールディングス	29,800	1,573.00	46,875,400	
稲葉製作所	8,500	1,266.00	10,761,000	
トーカロ	11,200	1,380.00	15,456,000	
アルファＣｏ	8,000	969.00	7,752,000	
SUMCO	121,600	1,127.00	137,043,200	
川田テクノロジーズ	5,100	2,575.00	13,132,500	
東洋製罐グループホールディングス	140,300	1,446.00	202,873,800	
ホッカンホールディングス	53,000	298.00	15,794,000	
コロナ	9,100	1,021.00	9,291,100	
横河ブリッジホールディングス	38,000	847.00	32,186,000	
駒井ハルテック	44,000	204.00	8,976,000	
高田機工	20,000	206.00	4,120,000	
三和ホールディングス	182,000	554.00	100,828,000	
文化シャッター	52,000	522.00	27,144,000	
三協立山	26,600	2,267.00	60,302,200	
東洋シャッター	6,700	583.00	3,906,100	
LIXILグループ	275,100	2,316.00	637,131,600	
日本フィルコン	17,200	378.00	6,501,600	
ノーリツ	38,700	1,687.00	65,286,900	
長府製作所	19,000	2,008.00	38,152,000	
リンナイ	31,800	7,420.00	235,956,000	
ダイニチ工業	10,200	724.00	7,384,800	
日東精工	29,000	302.00	8,758,000	
三洋工業	32,000	182.00	5,824,000	
岡部	39,600	846.00	33,501,600	
東プレ	38,100	884.00	33,680,400	
高周波熱錬	27,100	672.00	18,211,200	
パイオラックス	8,500	2,520.00	21,420,000	
日本発條	143,000	1,136.00	162,448,000	
中央発條	27,000	302.00	8,154,000	
三益半導体工業	17,100	877.00	14,996,700	
アタカ大機	13,000	358.00	4,654,000	
日本製鋼所	305,000	593.00	180,865,000	
三浦工業	29,400	2,283.00	67,120,200	
タクマ	67,000	830.00	55,610,000	
ツガミ	53,000	556.00	29,468,000	
オークマ	129,000	782.00	100,878,000	
東芝機械	98,000	490.00	48,020,000	
アマダ	302,000	723.00	218,346,000	
アイダエンジニアリング	46,400	695.00	32,248,000	
滝澤鉄工所	57,000	160.00	9,120,000	

牧野フライス製作所	93,000	623.00	57,939,000	
オーエスジー	81,100	1,471.00	119,298,100	
ダイジェット工業	32,000	153.00	4,896,000	
旭ダイヤモンド工業	47,300	957.00	45,266,100	
森精機製作所	104,100	1,127.00	117,320,700	
ディスコ	21,900	6,480.00	141,912,000	
日東工器	11,600	1,705.00	19,778,000	
豊和工業	124,000	100.00	12,400,000	
大阪機工	76,000	146.00	11,096,000	
東洋機械金属	17,300	238.00	4,117,400	
津田駒工業	48,000	171.00	8,208,000	
島精機製作所	25,700	2,103.00	54,047,100	
日阪製作所	25,000	833.00	20,825,000	
やまびこ	7,800	3,170.00	24,726,000	
ペガサスミシン製造	20,800	444.00	9,235,200	
ナブテスコ	97,700	2,070.00	202,239,000	
三井海洋開発	16,300	3,055.00	49,796,500	
レオン自動機	19,000	226.00	4,294,000	
S M C	58,900	19,940.00	1,174,466,000	
新川	17,200	777.00	13,364,400	
ホソカワミクロン	34,000	690.00	23,460,000	
ユニオンツール	11,100	1,847.00	20,501,700	
オイレス工業	20,600	1,980.00	40,788,000	
サトーホールディングス	21,000	1,710.00	35,910,000	
日本エアーテック	8,200	465.00	3,813,000	
日精樹脂工業	15,900	786.00	12,497,400	
ワイエイシイ	8,900	571.00	5,081,900	
小松製作所	921,300	2,503.00	2,306,013,900	
住友重機械工業	540,000	416.00	224,640,000	
日立建機	100,800	2,300.00	231,840,000	
日工	27,000	338.00	9,126,000	
巴工業	7,600	1,650.00	12,540,000	
井関農機	190,000	312.00	59,280,000	
T O W A	19,000	655.00	12,445,000	
丸山製作所	47,000	264.00	12,408,000	
北川鉄工所	86,000	148.00	12,728,000	
クボタ	1,030,000	1,554.00	1,600,620,000	
荏原実業	4,700	1,312.00	6,166,400	
三菱化工機	64,000	175.00	11,200,000	
月島機械	32,000	1,003.00	32,096,000	
帝国電機製作所	6,400	1,794.00	11,481,600	
新東工業	39,800	782.00	31,123,600	
澁谷工業	12,400	815.00	10,106,000	

アイチ コーポレーション	32,600	479.00	15,615,400	
小森コーポレーション	48,000	1,106.00	53,088,000	
鶴見製作所	15,000	845.00	12,675,000	
住友精密工業	33,000	410.00	13,530,000	
酒井重工業	37,000	259.00	9,583,000	
荏原製作所	406,000	505.00	205,030,000	
石井鐵工所	37,000	256.00	9,472,000	
西島製作所	23,000	824.00	18,952,000	
ダイキン工業	257,600	4,335.00	1,116,696,000	
オルガノ	34,000	515.00	17,510,000	
トーヨーカネツ	106,000	278.00	29,468,000	
栗田工業	108,900	2,136.00	232,610,400	
椿本チエイン	101,000	604.00	61,004,000	
大同工業	46,000	240.00	11,040,000	
日本コンベヤ	61,000	78.00	4,758,000	
木村化工機	19,500	588.00	11,466,000	
アネスト岩田	31,000	434.00	13,454,000	
ダイフク	86,500	847.00	73,265,500	
加藤製作所	48,000	430.00	20,640,000	
油研工業	46,000	212.00	9,752,000	
タダノ	91,000	1,322.00	120,302,000	
フジテック	55,000	842.00	46,310,000	
C K D	52,900	785.00	41,526,500	
キトー	12,200	1,400.00	17,080,000	
平和	41,600	1,630.00	67,808,000	
理想科学工業	12,600	2,252.00	28,375,200	
S A N K Y O	57,200	4,155.00	237,666,000	
日本金銭機械	17,400	1,291.00	22,463,400	
マースエンジニアリング	10,700	1,827.00	19,548,900	
福島工業	5,400	2,492.00	13,456,800	
オーイズミ	6,700	1,005.00	6,733,500	
ダイコク電機	8,100	1,913.00	15,495,300	
アマノ	53,900	960.00	51,744,000	
サンデン	111,000	342.00	37,962,000	
マックス	30,000	1,060.00	31,800,000	
グローリー	56,400	2,401.00	135,416,400	
大和冷機工業	31,000	534.00	16,554,000	
セガサミーホールディングス	202,700	2,462.00	499,047,400	
日本ピストンリング	69,000	170.00	11,730,000	
リケン	70,000	399.00	27,930,000	
T P R	21,700	1,465.00	31,790,500	
ホシザキ電機	41,200	2,883.00	118,779,600	
大豊工業	13,900	1,243.00	17,277,700	

日本精工	420,000	941.00	395,220,000	
NTN	409,000	309.00	126,381,000	
ジェイテクト	200,400	1,071.00	214,628,400	
不二越	177,000	431.00	76,287,000	
日本トムソン	66,000	475.00	31,350,000	
THK	125,400	2,168.00	271,867,200	
ユーシン精機	9,500	1,716.00	16,302,000	
前澤給装工業	7,200	1,205.00	8,676,000	
イーグル工業	24,000	1,150.00	27,600,000	
前澤工業	15,800	355.00	5,609,000	
日本ピラー工業	20,000	665.00	13,300,000	
キッツ	78,800	472.00	37,193,600	
日立工機	50,500	771.00	38,935,500	
マキタ	114,800	5,540.00	635,992,000	
日立造船	746,000	143.00	106,678,000	
三菱重工業	3,161,000	549.00	1,735,389,000	
IHI	1,290,000	364.00	469,560,000	
イビデン	114,900	1,580.00	181,542,000	
コニカミノルタ	498,500	717.00	357,424,500	
ブラザー工業	243,900	1,105.00	269,509,500	
ミネベア	257,000	359.00	92,263,000	
日立製作所	4,529,000	670.00	3,034,430,000	
東芝	3,723,000	463.00	1,723,749,000	
三菱電機	1,886,000	949.00	1,789,814,000	
富士電機	569,000	330.00	187,770,000	
東洋電機製造	37,000	265.00	9,805,000	
安川電機	207,000	1,321.00	273,447,000	
シンフォニアテクノロジー	114,000	163.00	18,582,000	
明電舎	187,000	325.00	60,775,000	
オリジン電気	28,000	327.00	9,156,000	
山洋電気	29,000	772.00	22,388,000	
デンヨー	18,600	1,277.00	23,752,200	
東芝テック	118,000	487.00	57,466,000	
芝浦メカトロニクス	34,000	247.00	8,398,000	
マブチモーター	26,600	4,995.00	132,867,000	
日本電産	102,000	6,720.00	685,440,000	
東光高岳ホールディングス	9,600	1,438.00	13,804,800	
ダイヘン	103,000	385.00	39,655,000	
ヤーマン	2,000	1,192.00	2,384,000	
JVCケンウッド	114,400	246.00	28,142,400	
第一精工	6,000	1,368.00	8,208,000	
日新電機	38,000	629.00	23,902,000	
大崎電気工業	25,000	542.00	13,550,000	

オムロン	199,600	3,115.00	621,754,000	
日東工業	27,800	1,756.00	48,816,800	
I D E C	24,700	889.00	21,958,300	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	364,000	440.00	160,160,000	
サクサホールディングス	48,000	165.00	7,920,000	
メルコホールディングス	11,800	1,404.00	16,567,200	
テクノメディカ	14	560,000.00	7,840,000	
日本電気	2,441,000	229.00	558,989,000	
富士通	1,819,000	415.00	754,885,000	
沖電気工業	686,000	185.00	126,910,000	
岩崎通信機	83,000	90.00	7,470,000	
電気興業	50,000	535.00	26,750,000	
サンケン電気	96,000	523.00	50,208,000	
ナカヨ通信機	19,000	307.00	5,833,000	
アイホン	11,000	1,536.00	16,896,000	
ルネサスエレクトロニクス	48,900	439.00	21,467,100	
セイコーエプソン	128,800	1,174.00	151,211,200	
ワコム	138,700	1,130.00	156,731,000	
アルバック	31,800	924.00	29,383,200	
アクセル	9,500	1,795.00	17,052,500	
E I Z O	16,000	1,917.00	30,672,000	
日本信号	47,700	674.00	32,149,800	
京三製作所	41,000	321.00	13,161,000	
能美防災	25,000	826.00	20,650,000	
ホーチキ	17,000	437.00	7,429,000	
エレコム	6,000	1,308.00	7,848,000	
日本無線	41,000	343.00	14,063,000	
パナソニック	2,155,100	752.00	1,620,635,200	
シャープ	976,000	462.00	450,912,000	
アンリツ	101,200	1,302.00	131,762,400	
富士通ゼネラル	45,000	998.00	44,910,000	
日立国際電気	43,000	1,056.00	45,408,000	
ソニー	1,185,400	1,980.00	2,347,092,000	
T D K	106,300	3,875.00	411,912,500	
帝国通信工業	45,000	180.00	8,100,000	
ミツミ電機	71,900	734.00	52,774,600	
タムラ製作所	73,000	215.00	15,695,000	
アルプス電気	138,400	711.00	98,402,400	
パイオニア	229,600	207.00	47,527,200	
日本電波工業	15,900	959.00	15,248,100	
日本トリム	2,450	5,230.00	12,813,500	
ローランド ディー . ジー .	8,400	2,080.00	17,472,000	
フォスター電機	19,300	1,652.00	31,883,600	

クラリオン	99,000	133.00	13,167,000	
S M K	56,000	291.00	16,296,000	
ヨコオ	14,900	492.00	7,330,800	
東光	110,000	296.00	32,560,000	
ホシデン	51,300	540.00	27,702,000	
ヒロセ電機	32,800	13,460.00	441,488,000	
日本航空電子工業	43,000	1,015.00	43,645,000	
T O A	20,000	684.00	13,680,000	
ユニデン	56,000	245.00	13,720,000	
アルパイン	36,900	945.00	34,870,500	
スミダコーポレーション	13,300	482.00	6,410,600	
アイコム	10,500	2,263.00	23,761,500	
リオン	4,300	904.00	3,887,200	
船井電機	19,100	1,050.00	20,055,000	
横河電機	188,900	1,166.00	220,257,400	
新電元工業	61,000	472.00	28,792,000	
アズビル	52,800	2,138.00	112,886,400	
日本光電工業	37,600	3,520.00	132,352,000	
チノー	34,000	213.00	7,242,000	
共和電業	21,000	287.00	6,027,000	
日本電子材料	8,300	380.00	3,154,000	
堀場製作所	37,400	3,420.00	127,908,000	
アドバンテスト	128,600	1,601.00	205,888,600	
小野測器	22,000	470.00	10,340,000	
エスペック	19,700	738.00	14,538,600	
パナソニック デバイス S U N X	16,800	392.00	6,585,600	
キーエンス	46,300	32,250.00	1,493,175,000	
日置電機	9,900	1,540.00	15,246,000	
シスメックス	66,700	6,490.00	432,883,000	
メガチップス	15,600	1,410.00	21,996,000	
O B A R A G R O U P	12,300	2,735.00	33,640,500	
日本電産コバル電子	19,700	436.00	8,589,200	
東京電波	5,700	786.00	4,480,200	
澤藤電機	12,000	233.00	2,796,000	
コーセル	27,500	1,268.00	34,870,000	
日立メディコ	14,000	1,295.00	18,130,000	
新日本無線	14,000	369.00	5,166,000	
オブテックス	12,000	1,534.00	18,408,000	
千代田インテグレ	8,400	1,283.00	10,777,200	
レーザーテック	6,800	2,420.00	16,456,000	
スタンレー電気	146,800	1,873.00	274,956,400	
岩崎電気	69,000	190.00	13,110,000	
ウシオ電機	114,600	1,284.00	147,146,400	

岡谷電機産業	10,400	318.00	3,307,200	
ヘリオス テクノ ホールディング	16,500	226.00	3,729,000	
日本セラミック	12,400	1,409.00	17,471,600	
日本デジタル研究所	16,000	1,003.00	16,048,000	
古河電池	14,000	552.00	7,728,000	
双信電機	9,500	337.00	3,201,500	
図研	11,100	708.00	7,858,800	
日本電子	70,000	463.00	32,410,000	
カシオ計算機	179,900	910.00	163,709,000	
ファナック	196,400	14,980.00	2,942,072,000	
日本シイエムケイ	41,000	334.00	13,694,000	
エンプラス	8,300	6,260.00	51,958,000	
ローム	99,700	3,900.00	388,830,000	
浜松ホトニクス	73,600	3,535.00	260,176,000	
三井ハイテック	27,500	621.00	17,077,500	
新光電気工業	63,400	1,151.00	72,973,400	
京セラ	156,900	9,930.00	1,558,017,000	
太陽誘電	91,800	1,658.00	152,204,400	
村田製作所	197,900	7,840.00	1,551,536,000	
ユーシン	26,400	747.00	19,720,800	
双葉電子工業	35,000	1,230.00	43,050,000	
北陸電気工業	76,000	146.00	11,096,000	
ニチコン	59,500	988.00	58,786,000	
日本ケミコン	109,000	363.00	39,567,000	
K O A	23,800	927.00	22,062,600	
市光工業	46,000	142.00	6,532,000	
小糸製作所	94,000	1,820.00	171,080,000	
ミツバ	35,000	1,396.00	48,860,000	
スター精密	33,200	1,060.00	35,192,000	
大日本スクリーン製造	194,000	535.00	103,790,000	
キヤノン電子	17,400	1,829.00	31,824,600	
キヤノン	1,171,700	3,285.00	3,849,034,500	
リコー	567,000	1,140.00	646,380,000	
M U T O Hホールディングス	26,000	273.00	7,098,000	
東京エレクトロン	158,700	5,080.00	806,196,000	
トヨタ紡織	65,900	1,378.00	90,810,200	
鬼怒川ゴム工業	35,000	548.00	19,180,000	
ユニプレス	33,200	1,772.00	58,830,400	
豊田自動織機	171,800	3,980.00	683,764,000	
モリタホールディングス	33,000	821.00	27,093,000	
三櫻工業	23,900	720.00	17,208,000	
デンソー	466,000	4,355.00	2,029,430,000	
東海理化電機製作所	44,200	1,885.00	83,317,000	

三井造船	730,000	159.00	116,070,000	
佐世保重工業	123,000	96.00	11,808,000	
川崎重工業	1,469,000	332.00	487,708,000	
日本車輛製造	69,000	493.00	34,017,000	
ニチユ三菱フォークリフト	25,000	491.00	12,275,000	
近畿車輛	32,000	324.00	10,368,000	
日産自動車	2,382,900	1,054.00	2,511,576,600	
いすゞ自動車	1,093,000	806.00	880,958,000	
トヨタ自動車	2,423,200	5,950.00	14,418,040,000	代用有価証券で 1,500,000株 担保差 入
日野自動車	236,000	1,446.00	341,256,000	
三菱自動車工業	4,704,000	151.00	710,304,000	
エフテック	6,500	1,484.00	9,646,000	
武蔵精密工業	20,100	2,365.00	47,536,500	
日産車体	64,000	1,068.00	68,352,000	
新明和工業	76,000	725.00	55,100,000	
極東開発工業	35,000	1,062.00	37,170,000	
日信工業	38,300	1,844.00	70,625,200	
トピー工業	141,000	198.00	27,918,000	
ティラド	64,000	366.00	23,424,000	
曙ブレーキ工業	87,600	462.00	40,471,200	
タチエス	25,300	1,359.00	34,382,700	
NOK	91,300	1,669.00	152,379,700	
フタバ産業	57,400	455.00	26,117,000	
カヤバ工業	144,000	538.00	77,472,000	
シロキ工業	42,000	199.00	8,358,000	
大同メタル工業	26,000	659.00	17,134,000	
プレス工業	80,000	455.00	36,400,000	
カルソニックカンセイ	128,000	405.00	51,840,000	
太平洋工業	38,400	695.00	26,688,000	
ケーヒン	39,000	1,483.00	57,837,000	
河西工業	23,000	503.00	11,569,000	
アイシン精機	172,600	3,610.00	623,086,000	
富士機工	22,000	320.00	7,040,000	
マツダ	2,986,000	379.00	1,131,694,000	
ダイハツ工業	200,000	1,994.00	398,800,000	
今仙電機製作所	13,800	1,450.00	20,010,000	
本田技研工業	1,591,300	3,655.00	5,816,201,500	
スズキ	394,300	2,433.00	959,331,900	
富士重工業	596,000	2,291.00	1,365,436,000	
ヤマハ発動機	286,800	1,487.00	426,471,600	
ショーワ	44,500	1,261.00	56,114,500	

T B K	19,000	494.00	9,386,000	
エクセディ	25,600	2,478.00	63,436,800	
豊田合成	53,300	2,448.00	130,478,400	
愛三工業	19,500	904.00	17,628,000	
ヨロズ	13,800	1,754.00	24,205,200	
エフ・シー・シー	30,800	2,434.00	74,967,200	
シマノ	76,000	8,150.00	619,400,000	
タカタ	34,100	2,112.00	72,019,200	
テイ・エス テック	39,800	3,145.00	125,171,000	
日本電産トーソク	9,000	835.00	7,515,000	
テルモ	144,600	4,905.00	709,263,000	
クリエートメディック	5,700	864.00	4,924,800	
日機装	66,000	1,260.00	83,160,000	
島津製作所	225,000	766.00	172,350,000	
J M S	31,000	350.00	10,850,000	
ショットモリテックス	4,100	294.00	1,205,400	
長野計器	13,300	738.00	9,815,400	
ブイ・テクノロジー	39	250,000.00	9,750,000	
東京計器	60,000	203.00	12,180,000	
愛知時計電機	22,000	278.00	6,116,000	
東京精密	33,800	2,173.00	73,447,400	
マニー	5,800	3,175.00	18,415,000	
ニコン	352,200	2,574.00	906,562,800	
トプコン	43,500	967.00	42,064,500	
オリンパス	222,500	3,200.00	712,000,000	
理研計器	15,300	742.00	11,352,600	
タムロン	14,500	2,257.00	32,726,500	
H O Y A	458,600	1,945.00	891,977,000	
ノーリツ鋼機	17,000	639.00	10,863,000	
エー・アンド・デイ	17,200	793.00	13,639,600	
日本電産コバル	14,800	819.00	12,121,200	
シチズンホールディングス	212,900	577.00	122,843,300	
リズム時計工業	85,000	145.00	12,325,000	
大研医器	2,300	3,405.00	7,831,500	
松風	9,300	843.00	7,839,900	
セイコーホールディングス	120,000	424.00	50,880,000	
ニプロ	100,500	1,180.00	118,590,000	
パラマウントベッドホールディングス	16,200	3,330.00	53,946,000	
S H O - B I	5,300	407.00	2,157,100	
前田工織	1,800	3,625.00	6,525,000	
永大産業	25,000	384.00	9,600,000	
ダンロップスポーツ	10,200	1,123.00	11,454,600	
バンダイナムコホールディングス	195,000	1,493.00	291,135,000	

共立印刷	28,700	252.00	7,232,400	
フランスベッドホールディングス	118,000	188.00	22,184,000	
パイロットコーポレーション	169	329,000.00	55,601,000	
トッパン・フォームズ	33,700	815.00	27,465,500	
フジシールインターナショナル	23,000	2,614.00	60,122,000	
タカラトミー	63,000	448.00	28,224,000	
廣済堂	16,100	461.00	7,422,100	
タカノ	8,400	439.00	3,687,600	
プロネクサス	22,100	581.00	12,840,100	
ホクシン	13,300	155.00	2,061,500	
ウッドワン	36,000	297.00	10,692,000	
大建工業	77,000	246.00	18,942,000	
凸版印刷	533,000	658.00	350,714,000	
大日本印刷	574,000	846.00	485,604,000	
図書印刷	34,000	241.00	8,194,000	
共同印刷	64,000	270.00	17,280,000	
日本写真印刷	29,300	1,643.00	48,139,900	
光村印刷	18,000	256.00	4,608,000	
宝印刷	10,700	656.00	7,019,200	
アシックス	175,700	1,477.00	259,508,900	
ツツミ	9,500	2,363.00	22,448,500	
ローランド	16,900	895.00	15,125,500	
小松ウオール工業	7,400	2,001.00	14,807,400	
ヤマハ	138,600	1,087.00	150,658,200	
河合楽器製作所	72,000	153.00	11,016,000	
クリナップ	19,400	735.00	14,259,000	
ビジョン	14,300	7,430.00	106,249,000	
兼松日産農林	29,000	143.00	4,147,000	
キングジム	15,700	765.00	12,010,500	
リンテック	40,400	1,785.00	72,114,000	
イトーキ	40,500	479.00	19,399,500	
任天堂	107,900	9,940.00	1,072,526,000	
三菱鉛筆	15,500	1,952.00	30,256,000	
タカラスタンダード	87,000	646.00	56,202,000	
コクヨ	98,000	674.00	66,052,000	
ナカバヤシ	40,000	198.00	7,920,000	
グローブライド	91,000	111.00	10,101,000	
岡村製作所	73,000	596.00	43,508,000	
美津濃	93,000	472.00	43,896,000	
アデランス	23,800	1,190.00	28,322,000	
東京電力	1,600,000	565.00	904,000,000	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	577,100	1,257.00	725,414,700	

関西電力	769,700	1,178.00	906,706,600	
中国電力	260,800	1,377.00	359,121,600	
北陸電力	184,800	1,375.00	254,100,000	
東北電力	471,200	1,166.00	549,419,200	
四国電力	169,900	1,507.00	256,039,300	
九州電力	416,600	1,321.00	550,328,600	
北海道電力	176,500	1,189.00	209,858,500	
沖縄電力	11,300	4,045.00	45,708,500	
電源開発	117,100	3,040.00	355,984,000	
東京瓦斯	2,265,000	513.00	1,161,945,000	
大阪瓦斯	1,830,000	385.00	704,550,000	
東邦瓦斯	480,000	473.00	227,040,000	
北海道瓦斯	34,000	248.00	8,432,000	
西部瓦斯	212,000	224.00	47,488,000	
静岡瓦斯	49,000	644.00	31,556,000	
東武鉄道	1,071,000	492.00	526,932,000	
相鉄ホールディングス	302,000	330.00	99,660,000	
東京急行電鉄	1,110,000	629.00	698,190,000	
京浜急行電鉄	485,000	801.00	388,485,000	
小田急電鉄	604,000	958.00	578,632,000	
京王電鉄	527,000	675.00	355,725,000	
京成電鉄	283,000	843.00	238,569,000	
富士急行	51,000	1,078.00	54,978,000	
新京成電鉄	24,000	366.00	8,784,000	
東日本旅客鉄道	347,900	7,420.00	2,581,418,000	
西日本旅客鉄道	162,600	4,140.00	673,164,000	
東海旅客鉄道	156,800	11,000.00	1,724,800,000	
鴻池運輸	7,500	1,334.00	10,005,000	
西日本鉄道	244,000	369.00	90,036,000	
ハマキョウレックス	5,400	3,335.00	18,009,000	
サカイ引越センター	3,400	2,576.00	8,758,400	
近畿日本鉄道	1,704,000	406.00	691,824,000	
阪急阪神ホールディングス	1,191,000	514.00	612,174,000	
南海電気鉄道	393,000	370.00	145,410,000	
京阪電気鉄道	423,000	399.00	168,777,000	
名糖運輸	7,700	604.00	4,650,800	
名古屋鉄道	658,000	265.00	174,370,000	
日本通運	747,000	429.00	320,463,000	
ヤマトホールディングス	351,300	1,897.00	666,416,100	
山九	229,000	361.00	82,669,000	
丸運	10,200	231.00	2,356,200	
丸全昭和運輸	63,000	322.00	20,286,000	
センコー	76,000	469.00	35,644,000	

トナミホールディングス	39,000	194.00	7,566,000	
日本梱包運輸倉庫	57,600	1,380.00	79,488,000	
日本石油輸送	21,000	207.00	4,347,000	
福山通運	114,000	504.00	57,456,000	
セイノーホールディングス	146,000	771.00	112,566,000	
神奈川中央交通	22,000	502.00	11,044,000	
日立物流	32,700	1,585.00	51,829,500	
日本郵船	1,498,000	256.00	383,488,000	
商船三井	925,000	356.00	329,300,000	
川崎汽船	838,000	188.00	157,544,000	
N S ユナイテッド海運	81,000	142.00	11,502,000	
乾汽船	24,500	328.00	8,036,000	
飯野海運	90,400	511.00	46,194,400	
共栄タンカー	33,000	207.00	6,831,000	
日本航空	212,400	5,230.00	1,110,852,000	
A N A ホールディングス	3,707,000	204.00	756,228,000	
パスコ	17,000	371.00	6,307,000	
トランコム	5,000	2,516.00	12,580,000	
日新	71,000	254.00	18,034,000	
三菱倉庫	134,000	1,384.00	185,456,000	
三井倉庫	87,000	504.00	43,848,000	
住友倉庫	126,000	543.00	68,418,000	
澁澤倉庫	49,000	399.00	19,551,000	
東陽倉庫	30,000	245.00	7,350,000	
日本トランスシティ	43,000	298.00	12,814,000	
ケイヒン	34,000	143.00	4,862,000	
安田倉庫	14,700	811.00	11,921,700	
東洋埠頭	54,000	165.00	8,910,000	
宇徳	15,300	332.00	5,079,600	
上組	209,000	747.00	156,123,000	
サンリツ	4,900	535.00	2,621,500	
キムラユニティー	4,200	860.00	3,612,000	
キューソー流通システム	5,200	922.00	4,794,400	
郵船ロジスティクス	14,800	920.00	13,616,000	
近鉄エクスプレス	16,900	3,880.00	65,572,000	
東海運	10,200	229.00	2,335,800	
エーアイティー	3,000	1,104.00	3,312,000	
N E C ネットズエスアイ	17,500	2,095.00	36,662,500	
システナ	19,900	738.00	14,686,200	
デジタルアーツ	6,900	1,050.00	7,245,000	
新日鉄住金ソリューションズ	12,500	1,718.00	21,475,000	
コア	7,100	722.00	5,126,200	
ソフトクリエイイトホールディングス	2,000	1,930.00	3,860,000	

デジタルハーツ	3,400	2,400.00	8,160,000	
I Tホールディングス	61,800	1,405.00	86,829,000	
ネオス	38	56,600.00	2,150,800	
電算システム	2,100	2,174.00	4,565,400	
グリー	96,400	979.00	94,375,600	
コーエーテクモホールディングス	36,900	870.00	32,103,000	
三菱総合研究所	7,300	1,933.00	14,110,900	
ボルテージ	2,700	800.00	2,160,000	
電算	1,100	1,631.00	1,794,100	
K L a b	6,300	590.00	3,717,000	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	3,200	2,288.00	7,321,600	
ネクソン	153,600	1,025.00	157,440,000	
アイスタイル	4,200	685.00	2,877,000	
エイチーム	1,400	3,475.00	4,865,000	
ブロードリーフ	17,500	1,536.00	26,880,000	
ドワンゴ	84	470,500.00	39,522,000	
ベリサーブ	11	186,100.00	2,047,100	
マクロミル	14,600	1,221.00	17,826,600	
ティーガイア	23,200	859.00	19,928,800	
テクマトリックス	5,600	530.00	2,968,000	
G M Oペイメントゲートウェイ	6,500	2,004.00	13,026,000	
ザッパラス	104	79,800.00	8,299,200	
インターネットイニシアティブ	21,800	3,690.00	80,442,000	
S R Aホールディングス	9,000	1,026.00	9,234,000	
朝日ネット	15,000	418.00	6,270,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	4,400	2,121.00	9,332,400	
フェイス	638	10,990.00	7,011,620	
野村総合研究所	105,400	3,000.00	316,200,000	
サイバネットシステム	154	30,250.00	4,658,500	
インテージ	5,500	2,270.00	12,485,000	
シンプレクス・ホールディングス	348	34,350.00	11,953,800	
ソースネクスト	4,600	688.00	3,164,800	
クレスコ	4,300	709.00	3,048,700	
フジ・メディア・ホールディングス	1,801	184,100.00	331,564,100	
オービック	6,420	24,580.00	157,803,600	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	3,800	788.00	2,994,400	
ヤフー	13,475	47,900.00	645,452,500	
トレンドマイクロ	74,000	3,105.00	229,770,000	
日本オラクル	37,200	3,960.00	147,312,000	
アルファシステムズ	6,200	1,082.00	6,708,400	
フューチャーアーキテクト	225	45,700.00	10,282,500	

シーエーシー	11,400	888.00	10,123,200	
ソフトバンク・テクノロジー	4,400	1,248.00	5,491,200	
トーセ	4,700	618.00	2,904,600	
オービックビジネスコンサルタント	5,900	5,710.00	33,689,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	22,000	4,180.00	91,960,000	
アイティフォー	20,900	410.00	8,569,000	
東計電算	3,300	1,313.00	4,332,900	
エクスネット	18	130,400.00	2,347,200	
大塚商会	16,700	9,510.00	158,817,000	
サイボウズ	312	23,930.00	7,466,160	
ソフトブレーン	278	12,860.00	3,575,080	
アグレックス	5,000	800.00	4,000,000	
電通国際情報サービス	11,500	1,126.00	12,949,000	
E Mシステムズ	2,900	1,811.00	5,251,900	
ウェザーニューズ	4,900	2,080.00	10,192,000	
C I J	17,400	402.00	6,994,800	
WOWOW	57	258,600.00	14,740,200	
ネットワンシステムズ	67,900	769.00	52,215,100	
アルゴグラフィックス	6,800	1,435.00	9,758,000	
マーベラスAQL	229	37,900.00	8,679,100	
エイベックス・グループ・ホールディングス	35,200	2,975.00	104,720,000	
日本ユニシス	51,500	820.00	42,230,000	
兼松エレクトロニクス	11,800	1,217.00	14,360,600	
東京放送ホールディングス	100,400	1,215.00	121,986,000	
日本テレビホールディングス	170,000	1,626.00	276,420,000	
テレビ朝日	47,200	1,851.00	87,367,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,616	45,650.00	73,770,400	
テレビ東京ホールディングス	13,500	1,306.00	17,631,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	16,500	820.00	13,530,000	
N E C モバイルリング	7,200	5,410.00	38,952,000	
日本電信電話	783,800	5,160.00	4,044,408,000	代用有価証券で 400,000株 担保差入
K D D I	525,300	4,495.00	2,361,223,500	
光通信	18,800	5,350.00	100,580,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	15,339	149,700.00	2,296,248,300	
G M O インターネット	62,200	951.00	59,152,200	
学研ホールディングス	60,000	266.00	15,960,000	
ゼンリン	24,700	1,047.00	25,860,900	
昭文社	11,300	555.00	6,271,500	
角川グループホールディングス	16,000	2,910.00	46,560,000	
インプレスホールディングス	15,900	125.00	1,987,500	
アイネット	8,100	760.00	6,156,000	
松竹	123,000	904.00	111,192,000	

東宝	132,900	1,898.00	252,244,200	
東映	78,000	609.00	47,502,000	
A O I P r o .	8,700	557.00	4,845,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,150	345,000.00	396,750,000	
D T S	17,800	1,374.00	24,457,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,600	1,180.00	79,768,000	
シーイーシー	12,200	610.00	7,442,000	
カプコン	35,700	1,539.00	54,942,300	
ジャステック	10,800	655.00	7,074,000	
S C S K	44,300	1,977.00	87,581,100	
日本システムウエア	7,200	413.00	2,973,600	
アイネス	25,400	657.00	16,687,800	
T K C	15,700	1,594.00	25,025,800	
富士ソフト	25,700	2,024.00	52,016,800	
N S D	36,800	994.00	36,579,200	
コナミ	84,100	2,460.00	206,886,000	
福井コンピュータホールディングス	2,600	654.00	1,700,400	
J B C Cホールディングス	15,600	1,008.00	15,724,800	
ミロク情報サービス	12,500	323.00	4,037,500	
ソフトバンク	901,600	5,520.00	4,976,832,000	
ハウスイ	15,000	115.00	1,725,000	
高千穂交易	7,800	888.00	6,926,400	
伊藤忠食品	4,600	3,285.00	15,111,000	
エレマテック	8,700	1,252.00	10,892,400	
J A L U X	5,300	950.00	5,035,000	
あらた	42,000	366.00	15,372,000	
トーメンデバイス	2,800	1,694.00	4,743,200	
東京エレクトロン デバイス	38	147,600.00	5,608,800	
双日	1,172,700	171.00	200,531,700	
アルフレッサ ホールディングス	48,200	4,870.00	234,734,000	
横浜冷凍	46,200	759.00	35,065,800	
山下医科器械	1,500	1,780.00	2,670,000	
ラサ商事	8,200	411.00	3,370,200	
アルコニックス	5,300	1,879.00	9,958,700	
あい ホールディングス	33,200	865.00	28,718,000	
ダイワボウホールディングス	169,000	157.00	26,533,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	35,100	713.00	25,026,300	
八洲電機	13,600	396.00	5,385,600	
U K Cホールディングス	11,100	1,640.00	18,204,000	
T O K A Iホールディングス	73,000	300.00	21,900,000	
ミタチ産業	4,500	439.00	1,975,500	
シップヘルスケアホールディングス	26,600	3,455.00	91,903,000	
富士興産	6,700	587.00	3,932,900	

協栄産業	23,000	187.00	4,301,000	
小野建	16,300	941.00	15,338,300	
佐島電機	13,800	489.00	6,748,200	
エコトレーディング	4,700	760.00	3,572,000	
伯東	11,400	917.00	10,453,800	
コンドーテック	15,200	591.00	8,983,200	
中山福	10,800	749.00	8,089,200	
ナガイレーベン	24,700	1,509.00	37,272,300	
三菱食品	20,500	2,344.00	48,052,000	
松田産業	13,600	1,175.00	15,980,000	
メディバルホールディングス	186,200	1,309.00	243,735,800	
アドヴァン	9,500	1,193.00	11,333,500	
S P K	4,400	1,663.00	7,317,200	
アズワン	12,200	2,166.00	26,425,200	
スズデン	6,200	499.00	3,093,800	
尾家産業	6,100	774.00	4,721,400	
シモジマ	11,500	931.00	10,706,500	
ドウシシャ	19,800	1,374.00	27,205,200	
高速	11,200	882.00	9,878,400	
黒田電気	24,900	1,214.00	30,228,600	
丸文	16,600	412.00	6,839,200	
ハビネット	11,400	738.00	8,413,200	
トーメンエレクトロニクス	9,500	1,182.00	11,229,000	
エクセル	8,100	1,090.00	8,829,000	
マルカキカイ	6,100	1,136.00	6,929,600	
ガリバーインターナショナル	62,800	587.00	36,863,600	
日本エム・ディ・エム	17,400	237.00	4,123,800	
進和	11,100	1,116.00	12,387,600	
エスケイジャパン	4,700	274.00	1,287,800	
ダイトエレクトロン	8,700	373.00	3,245,100	
シークス	11,900	1,135.00	13,506,500	
田中商事	6,400	539.00	3,449,600	
オーハシテクニカ	10,100	851.00	8,595,100	
マクニカ	9,600	2,113.00	20,284,800	
白銅	6,100	798.00	4,867,800	
伊藤忠商事	1,485,100	1,218.00	1,808,851,800	
丸紅	1,527,000	688.00	1,050,576,000	
高島	35,000	279.00	9,765,000	
F & A アクアホールディングス	14,200	1,557.00	22,109,400	
長瀬産業	105,400	1,268.00	133,647,200	
蝶理	11,900	1,005.00	11,959,500	
豊田通商	207,400	2,581.00	535,299,400	
三共生興	31,900	329.00	10,495,100	

兼松	396,000	112.00	44,352,000	
ツカモトコーポレーション	31,000	158.00	4,898,000	
三井物産	1,606,900	1,248.00	2,005,411,200	
日本紙パルプ商事	97,000	285.00	27,645,000	
日立ハイテクノロジーズ	56,500	2,362.00	133,453,000	
カメイ	22,100	744.00	16,442,400	
東都水産	34,000	137.00	4,658,000	
スターゼン	62,000	245.00	15,190,000	
山善	71,600	596.00	42,673,600	
橋本興業	21,000	264.00	5,544,000	
住友商事	1,098,700	1,255.00	1,378,868,500	
内田洋行	43,000	257.00	11,051,000	
三菱商事	1,452,600	1,744.00	2,533,334,400	
第一実業	42,000	411.00	17,262,000	
キヤノンマーケティングジャパン	62,000	1,289.00	79,918,000	
西華産業	65,000	246.00	15,990,000	
佐藤商事	16,800	549.00	9,223,200	
菱洋エレクトロ	22,000	832.00	18,304,000	
東京産業	19,000	303.00	5,757,000	
ユアサ商事	190,000	172.00	32,680,000	
神鋼商事	47,000	179.00	8,413,000	
阪和興業	186,000	359.00	66,774,000	
カナデン	19,000	573.00	10,887,000	
菱電商事	27,000	626.00	16,902,000	
フルサト工業	9,500	872.00	8,284,000	
岩谷産業	206,000	359.00	73,954,000	
すてきナイスグループ	74,000	200.00	14,800,000	
昭光通商	67,000	132.00	8,844,000	
ニチモウ	27,000	172.00	4,644,000	
極東貿易	22,000	224.00	4,928,000	
イワキ	28,000	188.00	5,264,000	
三愛石油	44,000	371.00	16,324,000	
稲畑産業	45,900	759.00	34,838,100	
G S I クレオス	50,000	150.00	7,500,000	
明和産業	14,900	332.00	4,946,800	
東邦ホールディングス	59,600	1,592.00	94,883,200	
サンゲツ	33,000	2,419.00	79,827,000	
ミツウロコグループホールディングス	30,100	475.00	14,297,500	
シナネン	40,000	360.00	14,400,000	
伊藤忠エネクス	41,200	482.00	19,858,400	
サンリオ	47,000	4,690.00	220,430,000	
サンワテクノス	9,200	1,013.00	9,319,600	
リョーサン	30,400	1,753.00	53,291,200	

新光商事	20,500	863.00	17,691,500	
トーヨー	39,000	325.00	12,675,000	
三信電気	26,700	599.00	15,993,300	
東陽テクニカ	25,600	1,249.00	31,974,400	
モスフードサービス	24,400	1,736.00	42,358,400	
加賀電子	18,600	790.00	14,694,000	
ソーダニッカ	19,000	386.00	7,334,000	
立花エレテック	11,400	885.00	10,089,000	
P a l t a c	22,100	1,207.00	26,674,700	
ヤマタネ	86,000	170.00	14,620,000	
丸紅建材リース	16,000	164.00	2,624,000	
日鐵商事	42,000	261.00	10,962,000	
トラスコ中山	21,300	2,029.00	43,217,700	
オートバックスセブン	68,900	1,488.00	102,523,200	
加藤産業	26,900	1,900.00	51,110,000	
イノテック	16,200	433.00	7,014,600	
イエローハット	17,600	1,830.00	32,208,000	
富士エレクトロニクス	9,600	1,219.00	11,702,400	
J Kホールディングス	15,700	526.00	8,258,200	
日伝	8,400	2,262.00	19,000,800	
北沢産業	14,500	171.00	2,479,500	
杉本商事	10,100	818.00	8,261,800	
因幡電機産業	23,700	2,581.00	61,169,700	
住金物産	97,000	276.00	26,772,000	
バイテック	4,400	707.00	3,110,800	
ミスミグループ本社	69,300	2,699.00	187,040,700	
江守商事	4,200	1,270.00	5,334,000	
アルテック	9,100	245.00	2,229,500	
タキヒヨー	28,000	417.00	11,676,000	
スズケン	71,600	3,115.00	223,034,000	
ジェコス	12,900	612.00	7,894,800	
ローソン	70,500	7,130.00	502,665,000	
サンエー	7,000	4,350.00	30,450,000	
麒麟堂	6,700	655.00	4,388,500	
ダイユーエイト	3,800	615.00	2,337,000	
カワチ薬品	13,000	2,004.00	26,052,000	
エービーシー・マート	22,100	3,650.00	80,665,000	
ハードオフコーポレーション	9,000	664.00	5,976,000	
アスクル	15,900	1,655.00	26,314,500	
ゲオホールディングス	319	87,400.00	27,880,600	
ポイント	17,150	4,450.00	76,317,500	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	24,000	88.00	2,112,000	
くらコーポレーション	10,900	1,543.00	16,818,700	

キャンドウ	9,800	1,524.00	14,935,200	
パル	10,800	2,933.00	31,676,400	
エディオン	80,500	446.00	35,903,000	
サーラコーポレーション	16,000	476.00	7,616,000	
あみやき亭	32	257,000.00	8,224,000	
ひらまつ	19,300	671.00	12,950,300	
ゲンキー	1,600	2,105.00	3,368,000	
大黒天物産	3,800	2,587.00	9,830,600	
ハニーズ	14,730	1,067.00	15,716,910	
アルペン	14,200	1,852.00	26,298,400	
クオール	6,200	565.00	3,503,000	
ビックカメラ	707	40,800.00	28,845,600	
D C Mホールディングス	91,900	723.00	66,443,700	
MonotaRO	25,100	2,637.00	66,188,700	
J.フロント リテイリング	440,000	733.00	322,520,000	
ドトール・日レスホールディングス	32,600	1,322.00	43,097,200	
マツモトキヨシホールディングス	31,400	2,443.00	76,710,200	
ブロンコビリー	1,200	3,360.00	4,032,000	
スタートトゥデイ	51,500	1,639.00	84,408,500	
物語コーポレーション	2,600	3,345.00	8,697,000	
ココカラファイン	19,400	3,000.00	58,200,000	
三越伊勢丹ホールディングス	370,000	1,243.00	459,910,000	
ウエルシアホールディングス	6,500	3,855.00	25,057,500	
クリエイトSDホールディングス	7,800	3,360.00	26,208,000	
丸善C H Iホールディングス	10,800	256.00	2,764,800	
ブックオフコーポレーション	10,300	693.00	7,137,900	
あさひ	10,800	1,443.00	15,584,400	
日本調剤	2,360	2,668.00	6,296,480	
コスモス薬品	9,400	9,790.00	92,026,000	
一六堂	2,300	585.00	1,345,500	
セブン&アイ・ホールディングス	778,800	3,420.00	2,663,496,000	
ツルハホールディングス	18,300	8,230.00	150,609,000	
サンマルクホールディングス	6,000	4,470.00	26,820,000	
フェリシモ	5,300	1,055.00	5,591,500	
トリドール	16,100	1,070.00	17,227,000	
クスリのアオキ	2,700	6,080.00	16,416,000	
メディカルシステムネットワーク	11,100	415.00	4,606,500	
総合メディカル	4,500	3,400.00	15,300,000	
はるやま商事	7,800	714.00	5,569,200	
カッパ・クリエイトホールディングス	13,650	1,742.00	23,778,300	
ライトオン	13,900	804.00	11,175,600	
良品計画	19,700	7,850.00	154,645,000	
三城ホールディングス	23,000	476.00	10,948,000	

コナカ	23,500	986.00	23,171,000	
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,305.00	2,740,500	
G - 7ホールディングス	5,500	720.00	3,960,000	
イオン北海道	11,700	486.00	5,686,200	
コジマ	27,500	291.00	8,002,500	
ヒマラヤ	4,400	990.00	4,356,000	
コーナン商事	24,400	1,094.00	26,693,600	
エコス	6,300	576.00	3,628,800	
ワタミ	22,000	1,770.00	38,940,000	
マルシェ	4,500	784.00	3,528,000	
ドン・キホーテ	54,500	4,810.00	262,145,000	
西松屋チェーン	36,700	955.00	35,048,500	
ゼンショーホールディングス	70,900	1,071.00	75,933,900	
幸楽苑	11,500	1,192.00	13,708,000	
ハークスレイ	5,200	724.00	3,764,800	
サイゼリヤ	27,600	1,262.00	34,831,200	
ポプラ	7,300	570.00	4,161,000	
ユナイテッドアローズ	19,900	3,595.00	71,540,500	
ハイデイ日高	9,800	1,964.00	19,247,200	
京都きもの友禅	12,300	1,012.00	12,447,600	
コロワイド	62,000	861.00	53,382,000	
壺番屋	7,500	3,340.00	25,050,000	
トップカルチャー	6,800	407.00	2,767,600	
スギホールディングス	29,700	3,265.00	96,970,500	
スクロール	24,200	262.00	6,340,400	
ファミリーマート	57,200	4,065.00	232,518,000	
木曽路	22,800	1,779.00	40,561,200	
千趣会	33,500	789.00	26,431,500	
タカキュー	14,500	360.00	5,220,000	
ケーヨー	31,500	479.00	15,088,500	
上新電機	40,000	756.00	30,240,000	
日本瓦斯	25,600	1,072.00	27,443,200	
ベスト電器	58,200	158.00	9,195,600	
マルエツ	43,000	300.00	12,900,000	
ロイヤルホールディングス	31,100	1,425.00	44,317,500	
東天紅	14,000	208.00	2,912,000	
いなげや	20,800	960.00	19,968,000	
島忠	42,100	2,296.00	96,661,600	
チヨダ	21,900	2,382.00	52,165,800	
ライフコーポレーション	12,000	1,250.00	15,000,000	
カスミ	38,200	599.00	22,881,800	
リンガーハット	16,800	1,286.00	21,604,800	
Mr Max	18,600	317.00	5,896,200	

テンアライド	14,000	292.00	4,088,000	
A O K Iホールディングス	16,000	2,798.00	44,768,000	
オークワ	29,000	973.00	28,217,000	
コメリ	28,700	2,476.00	71,061,200	
青山商事	51,300	2,715.00	139,279,500	
しまむら	21,600	11,370.00	245,592,000	
C F S コーポレーション	12,400	360.00	4,464,000	
はせがわ	5,600	595.00	3,332,000	
高島屋	253,000	964.00	243,892,000	
松屋	39,300	1,265.00	49,714,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	121,000	818.00	98,978,000	
ニッセンホールディングス	33,500	322.00	10,787,000	
パルコ	35,700	993.00	35,450,100	
丸井グループ	243,900	921.00	224,631,900	
原信ナルスホールディングス	10,300	1,595.00	16,428,500	
ダイエー	107,700	308.00	33,171,600	
イズミヤ	74,000	441.00	32,634,000	
イオン	656,400	1,192.00	782,428,800	
ユニグループ・ホールディングス	180,100	665.00	119,766,500	
イズミ	46,800	2,478.00	115,970,400	
東武ストア	24,000	261.00	6,264,000	
平和堂	38,600	1,511.00	58,324,600	
フジ	20,800	1,697.00	35,297,600	
ヤオコー	9,400	3,555.00	33,417,000	
ゼビオ	25,300	1,940.00	49,082,000	
ケーズホールディングス	46,500	2,824.00	131,316,000	
O l y m p i c グループ	11,000	685.00	7,535,000	
日産東京販売ホールディングス	27,000	302.00	8,154,000	
アインファーマシーズ	11,200	4,070.00	45,584,000	
元気寿司	5,700	1,156.00	6,589,200	
ヤマダ電機	84,910	3,800.00	322,658,000	
アークランドサカモト	12,100	1,659.00	20,073,900	
ニトリホールディングス	36,850	7,690.00	283,376,500	
グルメ杵屋	13,000	633.00	8,229,000	
愛眼	14,800	280.00	4,144,000	
吉野家ホールディングス	505	108,600.00	54,843,000	
松屋フーズ	9,000	1,484.00	13,356,000	
サガミチェーン	22,000	765.00	16,830,000	
プレナス	20,800	1,519.00	31,595,200	
ミニストップ	13,800	1,529.00	21,100,200	
アークス	31,800	1,756.00	55,840,800	
パロー	40,100	1,660.00	66,566,000	
ベルク	9,200	1,599.00	14,710,800	

大庄	8,700	1,162.00	10,109,400	
ファーストリテイリング	43,500	32,050.00	1,394,175,000	
サンドラッグ	35,400	3,805.00	134,697,000	
東京デリカ	6,600	1,489.00	9,827,400	
ヤマザワ	4,800	1,474.00	7,075,200	
やまや	3,800	1,321.00	5,019,800	
ペルーナ	23,250	1,010.00	23,482,500	
島根銀行	4,200	1,225.00	5,145,000	
じもとホールディングス	133,600	209.00	27,922,400	
新生銀行	1,611,000	233.00	375,363,000	
あおぞら銀行	677,000	290.00	196,330,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	14,096,700	603.00	8,500,310,100	
りそなホールディングス	1,914,800	455.00	871,234,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,656,000	434.00	1,586,704,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,407,900	4,240.00	5,969,496,000	
第四銀行	237,000	315.00	74,655,000	
北越銀行	188,000	187.00	35,156,000	
西日本シティ銀行	653,000	239.00	156,067,000	
千葉銀行	718,000	616.00	442,288,000	
横浜銀行	1,151,000	485.00	558,235,000	
常陽銀行	702,000	492.00	345,384,000	
群馬銀行	417,000	491.00	204,747,000	
武蔵野銀行	29,700	3,030.00	89,991,000	
千葉興業銀行	35,600	683.00	24,314,800	
筑波銀行	77,400	343.00	26,548,200	
東京都民銀行	35,200	1,082.00	38,086,400	
七十七銀行	292,000	421.00	122,932,000	
青森銀行	136,000	247.00	33,592,000	
秋田銀行	128,000	242.00	30,976,000	
山形銀行	113,000	377.00	42,601,000	
岩手銀行	13,400	3,700.00	49,580,000	
東邦銀行	157,000	292.00	45,844,000	
東北銀行	95,000	135.00	12,825,000	
みちのく銀行	93,000	184.00	17,112,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	755,000	397.00	299,735,000	
静岡銀行	545,000	1,007.00	548,815,000	
十六銀行	233,000	347.00	80,851,000	
スルガ銀行	181,000	1,668.00	301,908,000	
八十二銀行	343,000	523.00	179,389,000	
山梨中央銀行	111,000	390.00	43,290,000	
大垣共立銀行	248,000	288.00	71,424,000	
福井銀行	160,000	204.00	32,640,000	
北國銀行	209,000	326.00	68,134,000	

清水銀行	6,300	2,698.00	16,997,400	
滋賀銀行	175,000	514.00	89,950,000	
南都銀行	182,000	367.00	66,794,000	
百五銀行	167,000	389.00	64,963,000	
京都銀行	333,000	816.00	271,728,000	
三重銀行	77,000	207.00	15,939,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,267,000	186.00	235,662,000	
広島銀行	549,000	388.00	213,012,000	
山陰合同銀行	108,000	695.00	75,060,000	
中国銀行	139,000	1,313.00	182,507,000	
鳥取銀行	59,000	187.00	11,033,000	
伊予銀行	199,000	849.00	168,951,000	
百十四銀行	204,000	302.00	61,608,000	
四国銀行	134,000	245.00	32,830,000	
阿波銀行	152,000	514.00	78,128,000	
鹿児島銀行	129,000	591.00	76,239,000	
大分銀行	110,000	305.00	33,550,000	
宮崎銀行	124,000	296.00	36,704,000	
肥後銀行	153,000	549.00	83,997,000	
佐賀銀行	113,000	199.00	22,487,000	
十八銀行	116,000	227.00	26,332,000	
沖縄銀行	13,800	3,910.00	53,958,000	
琉球銀行	38,600	1,271.00	49,060,600	
八千代銀行	9,500	2,910.00	27,645,000	
セブン銀行	627,700	338.00	212,162,600	
みずほフィナンシャルグループ	24,067,800	196.00	4,717,288,800	
紀陽ホールディングス	742,000	132.00	97,944,000	
山口フィナンシャルグループ	186,000	896.00	166,656,000	
長野銀行	65,000	168.00	10,920,000	
名古屋銀行	168,000	355.00	59,640,000	
北洋銀行	280,500	326.00	91,443,000	
愛知銀行	6,700	4,330.00	29,011,000	
第三銀行	105,000	154.00	16,170,000	
中京銀行	76,000	173.00	13,148,000	
東日本銀行	81,000	208.00	16,848,000	
大光銀行	66,000	204.00	13,464,000	
愛媛銀行	109,000	240.00	26,160,000	
トマト銀行	72,000	171.00	12,312,000	
みなと銀行	168,000	158.00	26,544,000	
京葉銀行	153,000	467.00	71,451,000	
関西アーバン銀行	259,000	109.00	28,231,000	
栃木銀行	94,000	340.00	31,960,000	
北日本銀行	5,400	2,231.00	12,047,400	

東和銀行	205,000	93.00	19,065,000	
福島銀行	229,000	78.00	17,862,000	
大東銀行	119,000	78.00	9,282,000	
トモニホールディングス	142,800	356.00	50,836,800	
フィデアホールディングス	107,100	206.00	22,062,600	
池田泉州ホールディングス	153,600	482.00	74,035,200	
F P G	15,300	1,026.00	15,697,800	
S B I ホールディングス	239,800	1,414.00	339,077,200	
ジャフコ	26,300	3,615.00	95,074,500	
大和証券グループ本社	1,844,000	854.00	1,574,776,000	
野村ホールディングス	3,806,100	759.00	2,888,829,900	
岡三証券グループ	159,000	896.00	142,464,000	
丸三証券	57,800	683.00	39,477,400	
東洋証券	75,000	330.00	24,750,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	214,000	684.00	146,376,000	
水戸証券	61,000	443.00	27,023,000	
いちよし証券	43,300	1,191.00	51,570,300	
松井証券	110,700	997.00	110,367,900	
だいこう証券ビジネス	11,200	553.00	6,193,600	
マネックスグループ	2,121	38,250.00	81,128,250	
カブドットコム証券	72,700	562.00	40,857,400	
極東証券	25,200	1,776.00	44,755,200	
岩井コスモホールディングス	19,800	1,266.00	25,066,800	
N K S J ホールディングス	413,500	2,167.00	896,054,500	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	556,300	2,295.00	1,276,708,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	178,300	1,437.00	256,217,100	
第一生命保険	9,957	131,000.00	1,304,367,000	
東京海上ホールディングス	721,100	2,904.00	2,094,074,400	
T & D ホールディングス	638,600	1,190.00	759,934,000	
全国保証	21,900	3,570.00	78,183,000	
クレディセゾン	167,000	2,498.00	417,166,000	
芙蓉総合リース	19,600	3,785.00	74,186,000	
興銀リース	29,400	3,035.00	89,229,000	
東京センチュリーリース	47,000	2,510.00	117,970,000	
日本証券金融	84,300	749.00	63,140,700	
大阪証券金融	30,600	287.00	8,782,200	
ポケットカード	29,800	669.00	19,936,200	
リコーリース	13,700	2,650.00	36,305,000	
イオンフィナンシャルサービス	71,200	2,893.00	205,981,600	
アコム	40,370	3,400.00	137,258,000	
ジャックス	121,000	512.00	61,952,000	
オリエン트コーポレーション	412,500	292.00	120,450,000	

日立キャピタル	39,600	2,112.00	83,635,200	
オリックス	1,099,300	1,340.00	1,473,062,000	
三菱UFJリース	490,200	454.00	222,550,800	
日本取引所グループ	48,300	10,110.00	488,313,000	
イー・ギャランティ	8,100	2,473.00	20,031,300	
アサックス	32	153,700.00	4,918,400	
NECキャピタルソリューション	10,100	2,332.00	23,553,200	
日本駐車場開発	2,123	7,070.00	15,009,610	
ヒューリック	245,700	889.00	218,427,300	
東京建物不動産販売	9,600	520.00	4,992,000	
三栄建築設計	5,700	905.00	5,158,500	
野村不動産ホールディングス	89,700	2,169.00	194,559,300	
常和ホールディングス	5,900	2,309.00	13,623,100	
フージャースホールディングス	26,600	895.00	23,807,000	
パーク24	97,500	1,742.00	169,845,000	
三井不動産	878,000	2,930.00	2,572,540,000	
三菱地所	1,303,000	2,492.00	3,247,076,000	
平和不動産	38,100	1,780.00	67,818,000	
東京建物	362,000	829.00	300,098,000	
ダイビル	49,900	1,152.00	57,484,800	
東急不動産	411,000	976.00	401,136,000	
京阪神ビルディング	31,200	650.00	20,280,000	
住友不動産	447,000	3,925.00	1,754,475,000	
大京	290,000	299.00	86,710,000	
テーオーシー	65,300	662.00	43,228,600	
東京楽天地	32,000	434.00	13,888,000	
レオパレス21	178,200	461.00	82,150,200	
フジ住宅	24,900	638.00	15,886,200	
空港施設	23,800	583.00	13,875,400	
明和地所	9,100	444.00	4,040,400	
住友不動産販売	6,840	5,410.00	37,004,400	
ゴールドクレスト	15,100	2,290.00	34,579,000	
東栄住宅	13,100	1,795.00	23,514,500	
日本エスリード	8,900	1,063.00	9,460,700	
東急リバブル	20,100	2,038.00	40,963,800	
飯田産業	21,600	1,542.00	33,307,200	
日神不動産	12,100	700.00	8,470,000	
アーネストワン	31,200	1,800.00	56,160,000	
タカラレーベン	21,000	1,629.00	34,209,000	
サンヨーハウジング名古屋	10,300	1,170.00	12,051,000	
イオンモール	85,600	2,360.00	202,016,000	
タクトホーム	103	169,000.00	17,407,000	
トーセイ	287	79,700.00	22,873,900	

エヌ・ティ・ティ都市開発	1,201	120,100.00	144,240,100	
サンフロンティア不動産	210	89,000.00	18,690,000	
ランドビジネス	12,500	642.00	8,025,000	
グランディハウス	14,200	385.00	5,467,000	
日本空港ビルデング	64,900	1,393.00	90,405,700	
日本工営	66,000	361.00	23,826,000	
ネクスト	8,900	937.00	8,339,300	
日本M&Aセンター	10,200	5,080.00	51,816,000	
ノバレーゼ	51	64,000.00	3,264,000	
アコーディア・ゴルフ	869	101,900.00	88,551,100	
タケエイ	2,700	3,620.00	9,774,000	
パソナグループ	201	60,900.00	12,240,900	
リンクアンドモチベーション	167	28,850.00	4,817,950	
G C Aサヴィアン	9,500	983.00	9,338,500	
エス・エム・エス	11,100	1,296.00	14,385,600	
テンプホールディングス	26,900	2,271.00	61,089,900	
リニカル	5,400	1,446.00	7,808,400	
クックパッド	11,700	2,840.00	33,228,000	
エスクリ	6,400	1,012.00	6,476,800	
アイ・ケイ・ケイ	5,900	720.00	4,248,000	
学情	6,500	416.00	2,704,000	
スタジオアリス	9,100	1,414.00	12,867,400	
シミックホールディングス	7,500	2,068.00	15,510,000	
N E C フィールドディング	16,000	1,161.00	18,576,000	
総合警備保障	71,800	1,625.00	116,675,000	
カカクコム	53,600	2,782.00	149,115,200	
ルネサンス	8,900	677.00	6,025,300	
ツクイ	24,800	1,060.00	26,288,000	
エムスリー	466	200,600.00	93,479,600	
ベストプライダル	58	151,400.00	8,781,200	
アウトソーシング	9,200	826.00	7,599,200	
ディー・エヌ・エー	97,200	2,226.00	216,367,200	
博報堂D Yホールディングス	27,320	6,480.00	177,033,600	
ぐるなび	13,800	1,029.00	14,200,200	
一休	129	127,500.00	16,447,500	
ジャパンベストレスキューシステム	25	128,000.00	3,200,000	
ジェイコムホールディングス	3,500	765.00	2,677,500	
P G Mホールディングス	292	93,800.00	27,389,600	
バリューコマース	80	121,800.00	9,744,000	
J Pホールディングス	6,300	2,612.00	16,455,600	
イーピーエス	212	116,600.00	24,719,200	
アミューズ	6,000	2,024.00	12,144,000	
ドリームインキュベータ	76	144,000.00	10,944,000	

ケネディクス	1,879	50,000.00	93,950,000	
電通	179,200	3,520.00	630,784,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	875	20,700.00	18,112,500	
ぴあ	5,800	1,473.00	8,543,400	
イオンファンタジー	6,400	1,539.00	9,849,600	
ネクシィーズ	7,300	298.00	2,175,400	
みらかホールディングス	51,600	4,405.00	227,298,000	
アルプス技研	8,000	983.00	7,864,000	
サニックス	28,700	1,030.00	29,561,000	
ダイオーズ	3,600	660.00	2,376,000	
日本空調サービス	4,900	840.00	4,116,000	
オリエンタルランド	58,600	14,050.00	823,330,000	
ダスキン	53,300	1,759.00	93,754,700	
明光ネットワークジャパン	19,200	1,191.00	22,867,200	
ファルコSDホールディングス	10,100	1,250.00	12,625,000	
秀英予備校	7,000	353.00	2,471,000	
田谷	3,100	719.00	2,228,900	
ラウンドワン	64,400	607.00	39,090,800	
リゾートトラスト	34,000	2,579.00	87,686,000	
ピー・エム・エル	11,600	2,504.00	29,046,400	
ワタベウェディング	5,900	710.00	4,189,000	
もしもしホットライン	32,600	1,086.00	35,403,600	
東急コミュニティー	5,100	4,610.00	23,511,000	
リソー教育	2,006	9,400.00	18,856,400	
早稲田アカデミー	2,200	759.00	1,669,800	
ユー・エス・エス	22,020	11,590.00	255,211,800	
東京個別指導学院	9,800	210.00	2,058,000	
テー・オー・ダブリュー	6,600	639.00	4,217,400	
セントラルスポーツ	6,100	1,451.00	8,851,100	
フルキャストホールディングス	186	25,200.00	4,687,200	
リゾートソリューション	25,000	200.00	5,000,000	
リブセンス	1,600	7,190.00	11,504,000	
リロ・ホールディング	6,700	4,535.00	30,384,500	
エイチ・アイ・エス	16,100	4,145.00	66,734,500	
共立メンテナンス	10,000	3,265.00	32,650,000	
イチネンホールディングス	23,200	658.00	15,265,600	
建設技術研究所	10,900	735.00	8,011,500	
スペース	10,700	886.00	9,480,200	
燦ホールディングス	4,300	1,316.00	5,658,800	
スバル興業	14,000	313.00	4,382,000	
東京テアトル	75,000	146.00	10,950,000	
よみうりランド	42,000	738.00	30,996,000	
東京都競馬	153,000	350.00	53,550,000	

カナモト	24,000	2,263.00	54,312,000	
東京ドーム	150,000	611.00	91,650,000	
トランス・コスモス	25,800	1,398.00	36,068,400	
乃村工藝社	42,000	727.00	30,534,000	
藤田観光	50,000	392.00	19,600,000	
日本管財	7,300	1,437.00	10,490,100	
トーカイ	8,700	2,648.00	23,037,600	
白洋舎	26,000	213.00	5,538,000	
セコム	205,000	5,190.00	1,063,950,000	
セントラル警備保障	8,800	863.00	7,594,400	
丹青社	18,000	432.00	7,776,000	
メイテック	29,000	2,284.00	66,236,000	
アサツー ディ・ケイ	32,500	2,161.00	70,232,500	
応用地質	20,700	1,410.00	29,187,000	
船井総合研究所	20,200	698.00	14,099,600	
進学会	9,600	357.00	3,427,200	
ベネッセホールディングス	60,000	3,515.00	210,900,000	
イオンディライト	19,100	1,733.00	33,100,300	
ナック	8,800	1,829.00	16,095,200	
ニチイ学館	38,600	870.00	33,582,000	
ダイセキ	29,100	1,615.00	46,996,500	
ステップ	5,900	807.00	4,761,300	
合計	292,391,155	-	290,934,319,030	

(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。

[次へ](#)

「外国株式マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,196,154,788
コール・ローン	1,454,633,428
株式	289,530,906,420
投資信託受益証券	199,133,610
投資証券	6,447,611,351
派生商品評価勘定	122,461
未収入金	39,831,155
未収配当金	710,450,341
未収利息	2,254
差入委託証拠金	1,810,886,019
流動資産合計	305,389,731,827
資産合計	305,389,731,827
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	243,593,209
未払解約金	984,392,768
流動負債合計	1,227,985,977
負債合計	1,227,985,977
純資産の部	
元本等	
元本	210,171,706,543
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	93,990,039,307
元本等合計	304,161,745,850
純資産合計	304,161,745,850
負債純資産合計	305,389,731,827

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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>(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>
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 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25年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	270,920,058,283円
計算期間中の追加設定元本額	11,745,568,104円
計算期間中の一部解約元本額	72,493,919,844円
計算日の元本額	210,171,706,543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	3,840,823,905円

DC外国株式インデックスファンド	4,373,319,618円
DC外国株式インデックスファンドL	18,163,997,317円
DCバランスファンド30	175,409,027円
DCバランスファンド50	539,830,584円
DCバランスファンド70	352,002,912円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	133,663,246円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	81,840,699円
新生・4分散ファンド	116,931,059円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	564,829,949円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	23,045,697円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	91,721,632円
外国株式インデックスe	5,511,010,157円
インデックスコレクション(外国株式)	2,280,840,776円
インデックスコレクション(バランス株式30)	197,615,658円
インデックスコレクション(バランス株式50)	433,510,724円
インデックスコレクション(バランス株式70)	457,082,633円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	4,375,708,806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)	15,123,155,594円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	3,810,770,211円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	30,180,300,189円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	18,850,066,837円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	3,399,154,395円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	290,124,388円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	20,960,291,458円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,594,070,516円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,386,351,465円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	24,325,517,241円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,109,120,641円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	31,980,860,342円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	4,134,541,116円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	130,732,233円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,601,107,181円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,236,877,367円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	601,603,635円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,433,458,400円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	834,467,534円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,910,734,200円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	69,147,355円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	448,161,611円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,010,849,342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)	37,058,893円
2. 計算日における受益権総数	210,171,706,543口
3. 1口当たり純資産額	1.4472円
(1万口当たり純資産額)	(14,472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25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(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。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
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コンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25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)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。</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	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25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	15,477,046,627	
投資信託受益証券	4,735,926	
投資証券	99,629,931	
合計	15,571,940,632	

(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25年2月8日から平成25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25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	7,741,201,694	-	7,535,977,515	205,224,179
	合計	7,741,201,694	-	7,535,977,515	205,224,179

(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。
- 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。
- 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25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	726,292,614	-	696,379,170	29,913,444
	イギリスポンド	123,537,593	-	120,119,500	3,418,093
	ユーロ	157,903,117	-	154,417,900	3,485,217
	計	1,007,733,324	-	970,916,570	36,816,754
	売 建				
	アメリカドル	607,567,170	-	608,537,880	970,710
	カナダドル	43,089,018	-	43,373,920	284,902
	オーストラリアドル	21,596,747	-	21,537,280	59,467
	イギリスポンド	91,613,941	-	91,686,150	72,209
	スイスフラン	25,226,215	-	25,198,960	27,255
	スウェーデンクローナ	11,501,621	-	11,494,510	7,111
	ノルウェークローネ	10,179,377	-	10,186,950	7,573
	イスラエルシェケル	11,101,752	-	11,161,080	59,328
	ユーロ	108,286,654	-	108,415,580	128,926
	計	930,162,495	-	931,592,310	1,429,815
	合計	1,937,895,819	-	1,902,508,880	38,246,569

(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25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25年 6月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25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	58,464	87.98	5,143,662.72	
	APACHE CORP	45,662	84.73	3,868,941.26	
	BAKER HUGHES	52,629	46.49	2,446,722.21	
	CABOT OIL & GAS CORP	24,948	72.31	1,803,989.88	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	28,667	62.55	1,793,120.85	
	CHENIERE ENERGY INC	23,981	28.35	679,861.35	

CHESAPEAKE ENERGY CORP	61,900	22.00	1,361,800.00
CHEVRON CORP	227,911	121.70	27,736,768.70
CIMAREX ENERGY CO	10,613	75.15	797,566.95
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	33,675	26.35	887,336.25
CONCHO RESOURCES INC	12,697	89.40	1,135,111.80
CONOCOPHILLIPS	135,398	62.32	8,438,003.36
CONSOL ENERGY INC	26,541	33.63	892,573.83
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,254	84.59	444,435.86
CORE LABORATORIES N.V.	5,883	140.00	823,620.00
DENBURY RESOURCES INC	42,461	18.79	797,842.19
DEVON ENERGY CORPORATION	46,179	56.85	2,625,276.15
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	8,700	69.11	601,257.00
ENERGEN CORP	8,900	55.02	489,678.00
ENSCO PLC-CL A	26,570	60.26	1,601,108.20
EOG RESOURCES INC	31,700	132.68	4,205,956.00
EQT CORPORATION	17,300	81.42	1,408,566.00
EXXON MOBIL	525,597	91.45	48,065,845.65
FMC TECHNOLOGIES INC	27,946	56.22	1,571,124.12
HALLIBURTON CO	109,140	43.16	4,710,482.40
HELMERICH & PAYNE	13,515	64.12	866,581.80
HESS CORP	35,928	69.18	2,485,499.04
HOLLYFRONTIER CORP	22,400	47.26	1,058,624.00
KINDER MORGAN INC	78,186	39.54	3,091,474.44
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,528	83.04	957,285.12
MARATHON OIL CORP	82,182	34.73	2,854,180.86
MARATHON PETROLEUM CORP	38,614	83.63	3,229,288.82
MURPHY OIL CORP	20,816	65.74	1,368,443.84
NABORS INDUSTRIES LTD	35,300	16.69	589,157.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	49,840	70.20	3,498,768.00
NOBLE CORP	29,085	39.23	1,141,004.55
NOBLE ENERGY INC	41,196	58.61	2,414,497.56
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	94,219	93.12	8,773,673.28
OCEANEERING INTL INC	12,151	73.37	891,518.87
PEABODY ENERGY CORP	35,112	18.74	657,998.88
PHILLIPS 66	69,034	65.87	4,547,269.58
PIONEER NATURAL RESOURCES	16,199	144.29	2,337,353.71
QEP RESOURCES INC	22,162	30.00	664,860.00
RANGE RESOURCES CORP	19,022	76.16	1,448,715.52
ROWAN COMPANIES PLC	14,365	33.72	484,387.80
SCHLUMBERGER	156,118	73.93	11,541,803.74
SOUTHWESTERN ENERGY CO	43,570	38.29	1,668,295.30
SPECTRA ENERGY CORP	78,118	30.59	2,389,629.62
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	17,994	27.33	491,776.02

TESORO CORP	15,847	58.68	929,901.96
ULTRA PETROLEUM CORP	17,535	22.27	390,504.45
VALERO ENERGY CORP	64,581	39.57	2,555,470.17
WEATHERFORD INTL LTD	88,242	14.12	1,245,977.04
WHITING PETROLEUM CORP	14,671	46.94	688,656.74
WILLIAMS COS	81,157	35.23	2,859,161.11
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	23,909	95.09	2,273,506.81
AIRGAS INC	7,750	101.15	783,912.50
ALBEMARLE CORP	11,369	64.14	729,207.66
ALCOA	135,906	8.33	1,132,096.98
ASHLAND INC	8,599	86.82	746,565.18
BALL CORP	17,400	43.58	758,292.00
CELANESE CORP-SERIES A	20,362	49.01	997,941.62
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,298	194.42	1,418,877.16
CROWN HOLDINGS INC	17,400	43.08	749,592.00
DOW CHEMICAL CO	140,842	34.35	4,837,922.70
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	109,659	55.44	6,079,494.96
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	17,770	70.42	1,251,363.40
ECOLAB INC	30,550	84.75	2,589,112.50
FMC CORP	16,986	62.87	1,067,909.82
FREEPORT-MCMOR-B	119,474	30.92	3,694,136.08
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,164	79.68	809,867.52
INT'L PAPER CO	49,815	45.62	2,272,560.30
LYONDELLBASELL INDU-CL A	50,560	64.87	3,279,827.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,114	106.61	545,203.54
MEADWESTVACO CORP	21,463	35.67	765,585.21
MONSANTO CO	62,697	101.65	6,373,150.05
MOSAIC CO/THE	34,765	60.45	2,101,544.25
NEWMONT MINING CORP	58,935	34.11	2,010,272.85
NUCOR CORP	36,635	44.49	1,629,891.15
OWENS-ILLINOIS INC	17,600	27.75	488,400.00
PPG INDUSTRIES INC	16,583	154.92	2,569,038.36
PRAXAIR INC	34,486	114.21	3,938,646.06
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,841	101.35	896,035.35
SEALED AIR CORP	20,828	24.41	508,411.48
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,074	183.26	1,846,161.24
SIGMA-ALDRICH	13,444	82.87	1,114,104.28
VULCAN MATERIALS CO	16,412	52.19	856,542.28
3 M COMPANY	76,706	111.11	8,522,803.66
AGCO CORP	12,172	55.72	678,223.84
AMETEK INC	27,473	43.10	1,184,086.30
BOEING CO	84,143	102.49	8,623,816.07
CATERPILLAR	76,769	84.65	6,498,495.85

CUMMINS INC	21,059	118.54	2,496,333.86
DANAHER CORP	68,418	62.10	4,248,757.80
DEERE&CO	43,174	86.81	3,747,934.94
DOVER CORP	20,004	79.52	1,590,718.08
EATON CORP	55,043	65.62	3,611,921.66
EMERSON ELECTRIC CO	84,356	57.63	4,861,436.28
FASTENAL CO	34,637	48.41	1,676,777.17
FLOWSERVE CORP	5,414	168.07	909,930.98
FLUOR CORP	18,791	62.86	1,181,202.26
GENERAL DYNAMICS CORP	36,025	79.12	2,850,298.00
GENERAL ELECTRIC CO	1,216,677	23.86	29,029,913.22
GRAINGER (WW) INC	6,803	260.61	1,772,929.83
HONEYWELL INTL INC	87,119	79.08	6,889,370.52
ILLINOIS TOOL WORKS	49,918	70.70	3,529,202.60
INGERSOLL-RAND PLC	34,411	58.04	1,997,214.44
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15,692	56.93	893,345.56
JOY GLOBAL INC	13,515	53.67	725,350.05
KBR INC	18,203	34.53	628,549.59
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	11,700	86.81	1,015,677.00
LOCKHEED MARTIN CORP	31,530	107.36	3,385,060.80
MASCO CORP	41,806	20.21	844,899.26
NORTHROP GRUMMAN CORP	25,710	83.88	2,156,554.80
PACCAR INC	39,910	54.35	2,169,108.50
PALL CORP	12,564	67.89	852,969.96
PARKER HANNIFIN CORP	17,179	98.34	1,689,382.86
PENTAIR LTD	23,667	59.05	1,397,536.35
PRECISION CASTPARTS CORP	17,567	218.38	3,836,281.46
QUANTA SERVICES INC	25,602	27.66	708,151.32
RAYTHEON COMPANY	39,496	67.41	2,662,425.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,161	86.37	1,395,825.57
ROCKWELL COLLIN	14,438	65.51	945,833.38
ROPER INDUSTRIES INC	11,060	123.75	1,368,675.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,900	35.62	459,498.00
SPX CORP	4,641	79.15	367,335.15
STANLEY BLACK&DECKER	17,434	79.69	1,389,315.46
TEXTRON	31,371	26.92	844,507.32
TRANSDIGM GROUP INC	6,029	149.86	903,505.94
UNITED TECHNOLOGIES CORP	102,044	94.50	9,643,158.00
XYLEM INC	22,493	27.55	619,682.15
ADT CORPORATION	26,360	40.21	1,059,935.60
AVERY DENNISON CORP	12,393	43.39	537,732.27
CINTAS CORP	14,472	45.80	662,817.60
DUN & BRADSTREET CORP	5,786	99.24	574,202.64

EQUIFAX INC	15,546	60.35	938,201.10
IHS INC-CLASS A	6,868	106.94	734,463.92
IRON MOUNTAIN INC	15,509	28.95	448,985.55
MANPOWER GROUP	9,585	56.99	546,249.15
NIELSEN HOLDINGS NV	25,125	34.25	860,531.25
REPUBLIC SERVICES INC	32,153	33.92	1,090,629.76
ROBERT HALF INTL INC	16,300	34.12	556,156.00
STERICYCLE INC	10,500	108.45	1,138,725.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	57,582	34.28	1,973,910.96
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	17,118	59.18	1,013,043.24
WASTE MANAGEMENT INC	50,901	40.47	2,059,963.47
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	18,361	57.16	1,049,514.76
CSX CORP	118,438	25.02	2,963,318.76
DELTA AIR LINES INC	24,146	18.38	443,803.48
EXPEDITORS INTL WASH INC	23,320	38.62	900,618.40
FEDEX CORP	34,683	99.78	3,460,669.74
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	46,245	25.58	1,182,947.10
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	11,927	73.36	874,964.72
KANSAS CITY SOUTHERN	13,719	110.47	1,515,537.93
NORFOLK SOUTHERN CORP	36,433	77.41	2,820,278.53
SOUTHWEST AIRLINES CO	27,700	13.88	384,476.00
UNION PACIFIC CORP	54,875	158.13	8,677,383.75
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,700	32.94	385,398.00
UNITED PARCEL SERVICE B	85,272	86.37	7,364,942.64
AUTOLIV INC	10,686	79.38	848,254.68
BORGWARNER INC	14,382	82.62	1,188,240.84
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	34,252	50.40	1,726,300.80
FORD MOTOR COMPANY	433,587	15.73	6,820,323.51
GENERAL MOTORS CO	87,361	35.03	3,060,255.83
HARLEY-DAVIDSON	28,006	53.92	1,510,083.52
JOHNSON CONTROLS INC	82,240	37.62	3,093,868.80
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,292	64.25	854,011.00
COACH INC	33,666	58.75	1,977,877.50
DR HORTON INC	36,482	23.56	859,515.92
FOSSIL GROUP INC	6,501	105.80	687,805.80
GARMIN LTD	13,074	34.84	455,498.16
HASBRO INC	14,317	45.00	644,265.00
LEGGETT & PLATT INC	17,114	31.86	545,252.04
LENNAR CORP-CL A	19,768	38.60	763,044.80
LULULEMON ATHLETICA INC	11,737	81.43	955,743.91
MATTEL INC	38,991	45.18	1,761,613.38
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,290	111.64	813,855.60
NEWELL RUBBERMAID	36,110	27.28	985,080.80

NIKE B	83,771	62.75	5,256,630.25
POLARIS INDUSTRIES INC	8,060	96.13	774,807.80
PULTE GROUP INC	42,111	21.06	886,857.66
PVH CORP	9,540	113.70	1,084,698.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,545	175.94	1,327,467.30
TOLL BROTHERS INC	18,634	33.57	625,543.38
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	9,072	59.82	542,687.04
VF CORP	10,172	187.17	1,903,893.24
WHIRLPOOL CORP	9,054	124.55	1,127,675.70
BLOCK H & R INC	33,341	29.84	994,895.44
CARNIVAL CORPORATION	44,192	32.71	1,445,520.32
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,600	365.80	1,316,880.00
DARDEN RESTAURANTS INC	16,024	54.23	868,981.52
INT'L GAME TECHNOLOGY	34,330	17.45	599,058.50
LAS VEGAS SANDS CORP	48,273	57.27	2,764,594.71
MARRIOTT INTL A	28,466	41.66	1,185,893.56
MCDONALD'S CORP	117,160	98.28	11,514,484.80
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45,597	14.95	681,675.15
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,326	33.99	588,910.74
STARBUCKS CORP	87,493	65.04	5,690,544.72
STARWOOD HOTELS & RESORTS	22,437	69.17	1,551,967.29
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	17,168	58.32	1,001,237.76
WYNN RESORTS LTD	9,340	137.50	1,284,250.00
YUM BRANDS INC	52,413	73.52	3,853,403.76
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	22,464	14.65	329,097.60
CBS CORP-CL B	68,259	48.03	3,278,479.77
CHARTER COMMUNICATION-A	6,946	113.91	791,218.86
COMCAST CORP-CL A	248,866	41.18	10,248,301.88
COMCAST CORP-SPECIAL A	59,059	39.60	2,338,736.40
DIRECTV	63,248	62.20	3,934,025.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	18,247	76.39	1,393,888.33
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	11,391	68.02	774,815.82
DISH NETWORK CORPORATION-A	27,361	39.14	1,070,909.54
INTERPUBLIC GROUP OF COS	47,140	14.66	691,072.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,952	76.24	1,139,940.48
LIBERTY GLOBAL PLC-C	11,350	71.51	811,638.50
LIBERTY MEDIA CORP	10,797	127.68	1,378,560.96
NEWS CORP -CLASS A	177,545	32.17	5,711,622.65
NEWS CORP -CLASS B	54,500	32.29	1,759,805.00
OMNICOM GROUP	29,758	63.93	1,902,428.94
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	11,017	66.80	735,935.60
SIRIUS XM RADIO INC	379,025	3.46	1,313,321.62
THE WALT DISNEY CO	201,120	64.85	13,042,632.00

TIME WARNER CABLE-A	34,380	94.93	3,263,693.40
TIME WARNER INC	109,036	58.77	6,408,045.72
VIACOM INC-CLASS B	51,643	67.81	3,501,911.83
VIRGIN MEDIA INC	32,118	51.08	1,640,587.44
ADVANCE AUTO PARTS	9,165	84.32	772,792.80
AMAZON.COM	42,634	276.87	11,804,075.58
AUTOZONE INC	4,274	416.68	1,780,890.32
BED BATH & BEYOND INC	26,132	69.38	1,813,038.16
BEST BUY COMPANY INC	31,351	27.36	857,763.36
CARMAX INC	26,313	47.20	1,241,973.60
DICK'S SPORTING GOODS INC	11,745	52.18	612,854.10
DOLLAR GENERAL CORP	35,635	51.09	1,820,592.15
DOLLAR TREE INC	27,971	49.69	1,389,878.99
EXPEDIA INC	13,225	55.84	738,484.00
FAMILY DOLLAR STORES	12,930	62.01	801,789.30
GAMESTOP CORP-CLASS A	15,260	36.75	560,805.00
GAP	38,662	42.09	1,627,283.58
GENUINE PARTS CO	18,139	77.47	1,405,228.33
HOME DEPOT	175,133	78.74	13,789,972.42
J.C. PENNEY CO INC	23,000	18.73	430,790.00
KOHL'S CORP	25,058	51.96	1,302,013.68
L BRANDS INC	28,157	50.88	1,432,628.16
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	58,494	22.85	1,336,587.90
LKQ CORP	36,516	24.67	900,849.72
LOWES COMPANIES	129,489	41.60	5,386,742.40
MACY'S INC	45,624	48.61	2,217,782.64
NETFLIX INC	5,897	220.22	1,298,637.34
NORDSTROM INC	19,656	59.52	1,169,925.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,678	110.99	1,407,131.22
PETSMART INC	13,295	68.91	916,158.45
PRICELINE.COM INC	6,052	816.45	4,941,155.40
ROSS STORES INC	25,512	64.87	1,654,963.44
SEARS HOLDINGS CORPORATION	5,385	47.56	256,110.60
STAPLES INC	77,692	15.48	1,202,672.16
TARGET (DAYTON HUDSON)	71,095	70.36	5,002,244.20
TIFFANY & CO	14,585	79.30	1,156,590.50
TJX COMPANIES INC	84,414	50.45	4,258,686.30
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,863	113.52	892,607.76
TRIPADVISOR INC	13,513	64.05	865,507.65
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	7,410	85.65	634,666.50
URBAN OUTFITTERS INC	14,477	42.58	616,430.66
COSTCO WHOLESALE CORP	50,780	110.58	5,615,252.40
CVS CAREMARK CORPORATION	143,981	58.49	8,421,448.69

KROGER CO	55,907	34.56	1,932,145.92
SAFEWAY INC	29,408	22.71	667,855.68
SYSCO CORP	67,111	33.76	2,265,667.36
WALGREEN CO	104,954	49.42	5,186,826.68
WAL-MART STORES	195,999	76.33	14,960,603.67
WHOLE FOODS MKT INC	40,946	51.51	2,109,128.46
ALTRIA GROUP INC	234,508	36.15	8,477,464.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	76,363	32.91	2,513,106.33
BEAM INC	18,358	65.18	1,196,574.44
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,678	69.89	1,095,735.42
BUNGE LIMITED	18,126	69.49	1,259,575.74
CAMPBELL SOUP CO (US)	22,332	44.67	997,570.44
COCA-COLA CO	470,043	41.41	19,464,480.63
COCA-COLA ENTERPRISES	29,401	37.04	1,089,013.04
CONAGRA	51,138	33.75	1,725,907.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,646	53.34	994,577.64
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	24,303	46.33	1,125,957.99
GENERAL MILLS INC	75,055	48.08	3,608,644.40
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	14,751	76.09	1,122,403.59
HEINZ (H.J) CO	37,703	72.49	2,733,090.47
HERSHEY FOODS CORPORATION	17,641	89.48	1,578,516.68
HORMEL FOODS CORP	17,949	39.60	710,780.40
JM SMUCKER CO	11,909	101.39	1,207,453.51
KELLOGG CO	28,773	63.39	1,823,920.47
KRAFT FOODS GROUP INC	68,682	54.37	3,734,240.34
LORILLARD INC	43,613	43.61	1,901,962.93
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,132	70.92	1,073,161.44
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	23,486	82.63	1,940,648.18
MOLSON COORS BREWING CO -B	17,900	50.66	906,814.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	196,513	29.86	5,867,878.18
MONSTER BEVERAGE CORP	16,263	61.62	1,002,126.06
PEPSICO INC	180,505	82.51	14,893,467.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	193,089	92.09	17,781,566.01
REYNOLDS AMERICAN INC	37,628	47.82	1,799,370.96
TYSON FOODS INC	36,599	25.05	916,804.95
AVON PRODUCTS INC	50,440	23.70	1,195,428.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,300	61.09	1,056,857.00
CLOROX COMPANY	15,073	84.47	1,273,216.31
COLGATE-PALMOLIVE CO	108,995	59.10	6,441,604.50
ENERGIZER HOLDINGS INC	8,286	98.97	820,065.42
ESTEE LAUDER CO-CL A	27,665	68.12	1,884,539.80
HERBALIFE LTD	10,135	43.63	442,190.05
KIMBERLY-CLARK CORP	44,868	97.12	4,357,580.16

PROCTER & GAMBLE CO	320,315	77.75	24,904,491.25	
ABBOTT LABORATORIES	182,864	37.51	6,859,228.64	
AETNA INC	43,886	60.27	2,645,009.22	
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,808	52.94	1,366,275.52	
BARD C R INC	9,774	105.40	1,030,179.60	
BAXTER INTERNATIONAL	63,585	69.97	4,449,042.45	
BECTON DICKINSON & CO	23,516	98.69	2,320,794.04	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	169,218	9.30	1,573,727.40	
CARDINAL HEALTH	38,950	46.90	1,826,755.00	
CAREFUSION CORP	27,294	38.17	1,041,811.98	
CERNER CORP	18,255	99.35	1,813,634.25	
CIGNA CORP	34,822	68.45	2,383,565.90	
COVIDIEN PLC	54,793	64.76	3,548,394.68	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,102	126.42	1,277,094.84	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	17,969	41.41	744,096.29	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13,261	67.20	891,139.20	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	95,858	62.50	5,991,125.00	
HCA HOLDINGS INC	31,600	39.60	1,251,360.00	
HENRY SCHEIN INC	9,820	95.44	937,220.80	
HOLOGIC INC	33,302	21.63	720,322.26	
HUMANA INC	18,351	81.02	1,486,798.02	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,684	513.49	2,405,187.16	
LABORATORY CRP OF AMER	10,230	99.87	1,021,670.10	
MCKESSON CORP	26,793	113.96	3,053,330.28	
MEDTRONIC	117,837	52.08	6,136,950.96	
OMNICARE INC	13,706	47.24	647,471.44	
PATTERSON COMPANIES INC	9,995	38.98	389,605.10	
QUEST DIAGNOSTICS	17,773	62.22	1,105,836.06	
RESMED INC	16,164	45.74	739,341.36	
ST JUDE MEDICAL INC	32,660	43.99	1,436,713.40	
STRYKER CORP	36,438	67.15	2,446,811.70	
UNITEDHEALTH GROUP INC	119,929	62.57	7,503,957.53	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,348	69.55	858,803.40	
WELLPOINT INC	35,330	77.39	2,734,188.70	
ZIMMER HOLDINGS INC	19,182	78.73	1,510,198.86	
ABBVIE INC	185,018	44.00	8,140,792.00	
ACTAVIS INC	15,506	124.12	1,924,604.72	
AGILENT TECHNOLOGIES	40,488	45.15	1,828,033.20	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22,891	94.38	2,160,452.58	
ALLERGAN INC	34,593	99.75	3,450,651.75	
AMGEN	87,174	98.81	8,613,662.94	
BIOGEN IDEC INC	27,673	225.02	6,226,978.46	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,677	58.93	864,915.61	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	191,371	47.50	9,090,122.50	
CELGENE CORP	49,100	120.41	5,912,131.00	
FOREST LABORATORIES INC	27,158	40.45	1,098,541.10	
GILEAD SCIENCES INC	178,636	52.92	9,453,417.12	
HOSPIRA INC	20,480	35.83	733,798.40	
ILLUMINA INC	14,472	69.99	1,012,895.28	
JOHNSON & JOHNSON	327,731	84.91	27,827,639.21	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	19,756	74.10	1,463,919.60	
LILLY (ELI) & CO	119,160	52.49	6,254,708.40	
MERCK & CO	354,561	48.19	17,086,294.59	
MYLAN INC	44,664	30.59	1,366,271.76	
ONYX PHARMACEUTICALS INC	8,422	92.30	777,350.60	
PERRIGO CO	10,160	116.81	1,186,789.60	
PFIZER	843,046	28.26	23,824,479.96	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,934	257.50	2,300,505.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	41,644	84.58	3,522,249.52	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,077	82.81	2,076,626.37	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	25,600	19.52	499,712.00	
WATERS CORP	9,813	98.38	965,402.94	
ZOETIS INC	10,599	31.50	333,868.50	
BB&T CORP	84,072	33.23	2,793,712.56	
CIT GROUP INC	21,973	46.50	1,021,744.50	
COMERICA INC	24,408	38.86	948,494.88	
FIFTH THIRD BANCORP	100,933	18.42	1,859,185.86	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,149	38.37	427,787.13	
HUDSON CITY BANCORP INC	66,700	8.41	560,947.00	
KEY CORP	115,640	10.86	1,255,850.40	
M & T BANK CORP	13,155	103.74	1,364,699.70	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	52,900	13.22	699,338.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	43,500	13.92	605,520.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	61,840	71.10	4,396,824.00	
REGIONS FINL CORP	164,936	9.21	1,519,060.56	
SUNTRUST BANKS	62,946	32.25	2,030,008.50	
US BANCORP	218,658	35.87	7,843,262.46	
WELLS FARGO & CO	586,304	41.25	24,185,040.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	6,200	166.18	1,030,316.00	
AMERICAN EXPRESS	116,312	78.04	9,076,988.48	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	24,393	83.07	2,026,326.51	
BANK NEW YORK CO	136,192	29.85	4,065,331.20	
BANK OF AMERICA CORP	1,265,601	13.38	16,933,741.38	
BLACKROCK INC	15,958	280.23	4,471,910.34	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	68,237	62.33	4,253,212.21	
CITIGROUP	355,177	51.60	18,327,133.20	

CME GROUP INC	36,859	72.00	2,653,848.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	57,585	48.66	2,802,086.10
EATON VANCE CORP	13,707	40.95	561,301.65
FRANKLIN RESOURCES INC	15,858	150.46	2,385,994.68
GOLDMAN SACHS GROUP INC	51,729	166.01	8,587,531.29
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,360	174.70	1,460,492.00
INVESCO LTD	51,520	34.44	1,774,348.80
JPMORGAN CHASE & CO	448,064	54.27	24,316,433.28
LEGG MASON INC	14,708	34.06	500,954.48
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,151	29.52	1,067,177.52
MCGRAW-HILL FINANCIAL	31,789	54.74	1,740,129.86
MOODY'S CORP	23,535	65.74	1,547,190.90
MORGAN STANLEY	171,129	27.00	4,620,483.00
NASDAQ OMX GROUP	14,599	32.88	480,015.12
NORTHERN TRUST CORP	25,190	58.23	1,466,813.70
NYSE EURONEXT	29,216	40.97	1,196,979.52
PRICE T ROWE GROUP INC	30,093	75.68	2,277,438.24
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,240	43.15	614,456.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	139,030	20.12	2,797,283.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	15,373	30.13	463,188.49
SLM CORP	51,878	23.56	1,222,245.68
STATE STREET CORP	53,411	67.44	3,602,037.84
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,660	24.01	616,096.60
ACE LTD	39,380	89.88	3,539,474.40
AFLAC	56,633	57.03	3,229,779.99
ALLEGHANY CORP	1,808	388.13	701,739.04
ALLSTATE CORP	54,857	47.46	2,603,513.22
AMERICAN INT'L GROUP	163,814	45.28	7,417,497.92
AON PLC	34,207	65.55	2,242,268.85
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,652	52.19	869,067.88
ASSURANT INC	9,608	49.97	480,111.76
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	13,523	44.85	606,506.55
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	125,582	115.31	14,480,860.42
CHUBB CORPORATION	30,008	86.96	2,609,495.68
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,399	46.46	901,277.54
EVEREST RE GROUP LTD	6,439	127.79	822,839.81
FIDELITY NATIONAL FINL-A	28,165	25.76	725,530.40
HARTFORD FINANCIAL SVCS	48,302	30.50	1,473,211.00
LINCOLN NATIONAL CORP	31,440	35.89	1,128,381.60
LOEWS CORP	40,071	45.74	1,832,847.54
MARSH & MCLENNAN COS	65,212	40.45	2,637,825.40
METLIFE INC	108,302	45.06	4,880,088.12
PARTNERRE LTD	5,970	88.65	529,240.50

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	33,730	38.58	1,301,303.40
PROGRESSIVE CORP	65,709	24.79	1,628,926.11
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,211	71.72	3,888,012.92
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,963	85.76	511,386.88
TORCHMARK CORP	12,012	64.96	780,299.52
TRAVELERS COS INC/THE	43,781	83.44	3,653,086.64
UNUM GROUP	30,415	28.75	874,431.25
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20,960	39.66	831,273.60
WR BERKLEY CORP	13,884	41.52	576,463.68
XL GROUP PLC	32,769	31.31	1,025,997.39
CBRE GROUP INC-A	32,580	23.44	763,675.20
REALOGY HOLDINGS CORP	13,107	49.41	647,616.87
WEYERHAEUSER CO	63,388	29.03	1,840,153.64
ACCENTURE PLC-CL A	75,533	80.90	6,110,619.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	52,400	14.73	771,852.00
ADOBE SYSTEMS INC	55,074	44.12	2,429,864.88
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	20,830	45.26	942,765.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,229	178.37	1,111,066.73
ANSYS INC	11,726	74.43	872,766.18
AUTODESK INC	26,060	36.65	955,099.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	56,299	68.91	3,879,564.09
BMC SOFTWARE	14,266	45.35	646,963.10
CA INC	36,036	29.14	1,050,089.04
CITRIX SYSTEMS INC	21,758	63.61	1,384,026.38
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	35,881	66.58	2,388,956.98
COMPUTER SCIENCES CORP	17,746	46.74	829,448.04
EBAY	136,913	51.46	7,045,542.98
ELECTRONIC ARTS INC	37,433	23.61	883,793.13
EQUINIX INC	5,625	192.57	1,083,206.25
FACEBOOK INC-A	187,788	23.30	4,375,460.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	33,548	44.53	1,493,892.44
FISERV INC	16,610	86.52	1,437,097.20
GOOGLE INC-CL A	31,385	879.73	27,610,326.05
INTL BUSINESS MACHINES CORP	124,217	206.35	25,632,177.95
INTUIT INC	32,416	59.46	1,927,455.36
LINKEDIN CORP - A	10,615	170.70	1,811,980.50
MASTERCARD INC-CLASS A	12,429	566.25	7,037,921.25
MICROSOFT CORP	933,614	35.67	33,302,011.38
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,279	19.04	576,512.16
ORACLE CORP	442,994	33.82	14,982,057.08
PAYCHEX INC	36,616	37.15	1,360,284.40
RACKSPACE HOSTING INC	13,897	35.52	493,621.44

RED HAT INC	22,452	46.24	1,038,180.48	
SAIC INC	38,400	14.94	573,696.00	
SALESFORCE.COM INC	65,113	39.61	2,579,125.93	
SYMANTEC CORP	79,569	22.19	1,765,636.11	
SYNOPSYS INC	17,400	36.98	643,452.00	
TERADATA CORP	19,315	56.90	1,099,023.50	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	18,732	23.43	438,890.76	
VERISIGN INC	17,481	46.20	807,622.20	
VISA INC-CLASS A SHARES	62,027	179.94	11,161,138.38	
VMWARE INC-CLASS A	10,612	71.27	756,317.24	
WESTERN UNION CO	65,780	16.65	1,095,237.00	
YAHOO	115,605	27.04	3,125,959.20	
AMPHENOL CORPORATION	19,656	77.72	1,527,664.32	
APPLE INC	110,152	441.96	48,682,777.92	
ARROW ELECTRONICS INC	12,402	40.23	498,932.46	
AVNET INC	17,669	33.71	595,621.99	
CISCO SYSTEMS	625,516	24.49	15,318,886.84	
CORNING	177,260	15.38	2,726,258.80	
DELL INC	172,277	13.49	2,324,016.73	
EMC CORP	247,117	24.74	6,113,674.58	
F5 NETWORKS INC	10,215	78.07	797,485.05	
FLEXTRONICS INTL LTD	83,005	7.89	654,909.45	
FLIR SYSTEMS INC	17,750	24.41	433,277.50	
HARRIS CORP	14,375	50.35	723,781.25	
HEWLETT-PACKARD CO	228,959	24.81	5,680,472.79	
JUNIPER NETWORKS INC	64,297	19.06	1,225,500.82	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28,563	56.94	1,626,377.22	
NETAPP INC	42,048	37.97	1,596,562.56	
QUALCOMM	201,582	62.10	12,518,242.20	
SANDISK CORP	28,419	58.31	1,657,111.89	
SEAGATE TECHNOLOGY	37,685	44.01	1,658,516.85	
TE CONNECTIVITY LTD	50,442	45.53	2,296,624.26	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	32,016	27.00	864,432.00	
WESTERN DIGITAL CORP	25,252	64.15	1,619,915.80	
XEROX CORP	133,890	9.17	1,227,771.30	
AT&T INC	644,004	35.45	22,829,941.80	
CENTURYLINK INC	73,142	35.43	2,591,421.06	
CROWN CASTLE INTL CORP	35,507	70.28	2,495,431.96	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	123,098	4.16	512,087.68	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	21,320	21.57	459,872.40	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	14,573	76.18	1,110,171.14	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	362,002	7.24	2,620,894.48	
T-MOBILE US INC	16,559	21.31	352,872.29	

VERIZON COMMUNICATIONS	335,097	50.24	16,835,273.28
WINDSTREAM CORP	74,065	7.89	584,372.85
AES CORP	72,740	12.51	909,977.40
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,160	49.45	601,312.00
AMEREN CORPORATION	29,800	34.91	1,040,318.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	58,439	46.15	2,696,959.85
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,762	39.87	867,650.94
CALPINE CORP	38,723	20.84	806,987.32
CENTERPOINT ENERGY INC	50,476	23.39	1,180,633.64
CMS ENERGY CORP	32,700	27.04	884,208.00
CONSOLIDATED EDISON INC	33,294	57.43	1,912,074.42
DOMINION RESOURCES	66,972	55.64	3,726,322.08
DTE ENERGY COMPANY	21,567	67.51	1,455,988.17
DUKE ENERGY CORP	82,173	67.69	5,562,290.37
EDISON INTL	35,150	47.61	1,673,491.50
ENTERGY CORP	20,160	68.19	1,374,710.40
EXELON CORP	99,815	31.36	3,130,198.40
FIRSTENERGY CORP	50,511	38.94	1,966,898.34
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	9,779	57.04	557,794.16
MDU RESOURCES GROUP INC	19,763	25.49	503,758.87
NEXTERA ENERGY INC	48,974	78.80	3,859,151.20
NISOURCE INC	36,400	28.53	1,038,492.00
NORTHEAST UTILITIES	39,061	42.38	1,655,405.18
NRG ENERGY INC	37,000	27.10	1,002,700.00
OGE ENERGY CORP	11,744	67.90	797,417.60
ONEOK INC	24,080	44.72	1,076,857.60
PEPCO HOLDINGS INC	26,600	20.62	548,492.00
PG&E CORP	50,336	45.30	2,280,220.80
PINNACLE WEST CAPITAL	14,026	56.67	794,853.42
PPL CORPORATION	66,258	29.29	1,940,696.82
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	58,090	32.68	1,898,381.20
SCANA CORP	14,394	49.87	717,828.78
SEMPRA ENERGY	26,381	80.19	2,115,492.39
SOUTHERN CO	101,133	44.44	4,494,350.52
WISCONSIN ENERGY CORP	28,490	41.26	1,175,497.40
XCEL ENERGY INC	54,995	29.15	1,603,104.25
ALTERA CORPORATION	37,096	32.61	1,209,700.56
ANALOG DEVICES	35,504	46.21	1,640,639.84
APPLIED MATERIALS	139,703	15.49	2,163,999.47
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	28,422	37.29	1,059,856.38
BROADCOM CORP-CL A	60,312	35.39	2,134,441.68
CREE INC	13,003	62.84	817,108.52
INTEL CORP	580,308	24.59	14,269,773.72

	KLA-TENCOR CORP	19,025	56.77	1,080,049.25	
	LAM RESEARCH CORP	18,601	48.40	900,288.40	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	29,471	37.09	1,093,079.39	
	LSI CORP	66,758	7.36	491,338.88	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	58,279	11.24	655,055.96	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	33,069	28.48	941,805.12	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	24,324	36.70	892,690.80	
	MICRON TECHNOLOGY	126,656	12.65	1,602,198.40	
	NVIDIA CORP	72,459	14.45	1,047,032.55	
	TEXAS INSTRUMENTS	129,280	36.18	4,677,350.40	
	XILINX INC	32,497	40.60	1,319,378.20	
	アメリカドル小計	35,929,392		1,767,598,877.30 (172,729,762,289)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,705	38.51	450,759.55	
	ARC RESOURCES LTD	37,554	28.01	1,051,887.54	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	29,900	7.52	224,848.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	14,750	38.16	562,860.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	15.86	347,334.00	
	CAMECO CORP	45,841	22.06	1,011,252.46	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	127,850	29.75	3,803,537.50	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	55,304	20.02	1,107,186.08	
	CENOVUS ENERGY INC	90,254	30.59	2,760,869.86	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	44,515	36.45	1,622,571.75	
	ENBRIDGE	88,720	43.84	3,889,484.80	
	ENCANA CORP	85,814	18.86	1,618,452.04	
	ENERPLUS CORP	22,122	15.45	341,784.90	
	HUSKY ENERGY INC	38,520	28.90	1,113,228.00	
	IMPERIAL OIL	37,251	39.76	1,481,099.76	
	KEYERA CORP	8,289	59.15	490,294.35	
	MEG ENERGY CORP	18,100	30.84	558,204.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	37,078	21.78	807,558.84	
	PEMBINA PIPELINE CORP	36,549	32.53	1,188,938.97	
	PENGROWTH ENERGY CORP	57,412	5.27	302,561.24	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	59,504	10.40	618,841.60	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	15,238	32.05	488,377.90	
	SUNCOR ENERGY	179,052	31.66	5,668,786.32	
	TALISMAN ENERGY INC	119,391	11.85	1,414,783.35	
	TOURMALINE OIL CORP	17,463	41.15	718,602.45	
	TRANSCANADA CORP	81,791	45.74	3,741,120.34	
	VERMILION ENERGY INC	11,293	52.42	591,979.06	
	AGNICO EAGLE MINES	19,864	31.65	628,695.60	
	AGRIUM INC	18,640	93.00	1,733,520.00	
	BARRICK GOLD CORP	115,533	20.60	2,379,979.80	

ELDORADO GOLD CORP	87,440	7.99	698,645.60
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,266	17.83	1,163,692.78
FRANCO-NEVADA CORP	16,813	42.35	712,030.55
GOLDCORP INC	92,627	29.09	2,694,519.43
KINROSS GOLD CORP	119,699	6.37	762,482.63
NEW GOLD INC	49,800	6.97	347,106.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	101,535	42.50	4,315,237.50
SILVER WHEATON CORP	39,370	23.93	942,124.10
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,464	25.65	1,679,151.60
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	47,061	6.67	313,896.87
YAMANA GOLD INC	86,869	11.70	1,016,367.30
BOMBARDIER B	165,933	4.92	816,390.36
CAE INC	26,139	10.61	277,334.79
FINNING INTERNATIONAL INC	20,851	22.55	470,190.05
SNC-LAVALIN GROUP INC	17,225	44.44	765,479.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	49,687	101.86	5,061,117.82
CP RAILWAY LIMITED	20,819	129.16	2,688,982.04
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,181	69.46	1,818,532.26
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,200	41.86	510,692.00
TIM HORTONS INC	17,879	54.15	968,147.85
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	40,348	22.66	914,285.68
THOMSON REUTERS CORP	45,914	34.45	1,581,737.30
CANADIAN TIRE CORP -CL A	9,953	82.90	825,103.70
DOLLARAMA INC	7,474	74.42	556,215.08
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	15,557	57.22	890,171.54
EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	68.78	288,876.00
LOBLAW COMPANIES LTD	13,853	48.29	668,961.37
METRO INC	12,331	68.04	839,001.24
SHOPPERS DRUG MART CORP	25,544	45.37	1,158,931.28
WESTON (GEORGE) LTD	6,170	81.36	501,991.20
SAPUTO INC	16,627	48.45	805,578.15
CATAMARAN CORPORATION	23,723	51.25	1,215,803.75
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	33,949	87.21	2,960,692.29
BANK MONTREAL	76,211	60.12	4,581,805.32
BANK NOVA SCOTIA	138,643	57.24	7,935,925.32
CANADIAN IMPERIAL BANK	46,815	77.07	3,608,032.05
NATIONAL BANK OF CANADA	20,262	75.65	1,532,820.30
ROYAL BANK OF CANADA	169,899	59.99	10,192,241.01
TORONTO-DOMINION BANK	108,309	82.28	8,911,664.52
CI FINANCIAL CORP	17,444	30.15	525,936.60
IGM FINANCIAL INC	11,981	46.80	560,710.80
ONEX CORP	10,791	46.36	500,270.76

	GREAT-WEST LIFECO INC	33,503	28.42	952,155.26	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	13,200	39.99	527,868.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	16,753	61.92	1,037,345.76	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	213,769	16.31	3,486,572.39	
	POWER CORP OF CANADA	39,680	28.08	1,114,214.40	
	POWER FINANCIAL CORP	29,320	30.92	906,574.40	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	69,938	30.17	2,110,029.46	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	64,657	36.34	2,349,635.38	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	33,215	17.45	579,601.75	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	18.65	130,550.00	
	CGI GROUP INC - CL A	23,601	31.44	742,015.44	
	OPEN TEXT CORP	6,689	74.86	500,738.54	
	RESEARCH IN MOTION	52,849	14.10	745,170.90	
	BCE INC	30,595	45.49	1,391,766.55	
	BELL ALIANT INC	10,600	28.25	299,450.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	41,825	45.65	1,909,311.25	
	TELUS CORP	39,260	34.67	1,361,144.20	
	ATCO LTD -CLASS I	4,017	90.50	363,538.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	6,206	74.84	464,457.04	
	FORTIS INC	21,600	32.46	701,136.00	
	TRANSALTA CORP	32,000	14.07	450,240.00	
	カナダドル小計	4,322,330		144,421,791.07 (13,860,159,288)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,973	22.01	329,555.73	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	132,284	13.15	1,739,534.60	
	SANTOS	112,430	12.45	1,399,753.50	
	WHITEHAVEN COAL LTD	64,057	2.12	135,800.84	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,354	34.93	2,771,835.22	
	WORLEYPARSONS LTD	24,469	19.12	467,847.28	
	ALUMINA LIMITED	286,552	0.98	280,820.96	
	AMCOR	141,305	9.51	1,343,810.55	
	BHP BILLITON LTD	376,068	33.09	12,444,090.12	
	BORAL LIMITED	84,545	4.20	355,089.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	176,976	3.36	594,639.36	
	ILUKA RESOURCES LTD	50,747	10.34	524,723.98	
	INCITEC PIVOT LTD	205,854	2.72	559,922.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,784	9.69	453,336.96	
	NEWCREST MINING LIMITED	89,789	12.35	1,108,894.15	
	ORICA LTD	41,870	20.77	869,639.90	
	RIO TINTO LTD	50,483	53.20	2,685,695.60	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	21,263	16.32	347,012.16	
	ALS LTD	37,855	9.04	342,209.20	

BRAMBLES LTD	194,053	9.01	1,748,417.53	
SEEK LTD	34,820	9.07	315,817.40	
ASCIANO GROUP	119,058	4.80	571,478.40	
AURIZON HOLDINGS LTD	224,602	4.16	934,344.32	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	122,140	1.44	176,492.30	
TOLL HOLDINGS LIMITED	81,860	4.68	383,104.80	
TRANSURBAN GROUP	160,256	6.75	1,081,728.00	
CROWN LTD	48,477	12.15	588,995.55	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	72,016	2.85	205,245.60	
FLIGHT CENTRE LTD	5,590	37.93	212,028.70	
TABCORP HOLDINGS	70,012	3.24	226,838.88	
TATTS GROUP LTD	147,319	3.10	456,688.90	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,357	2.48	132,325.36	
METCASH LTD	116,059	3.74	434,060.66	
WESFARMERS LIMITED	117,535	37.81	4,443,998.35	
WOOLWORTHS LTD	144,736	32.00	4,631,552.00	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	75,149	12.45	935,605.05	
TREASURY WINE ESTATES LTD	70,309	6.01	422,557.09	
COCHLEAR LIMITED	7,010	55.65	390,106.50	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,731	34.05	535,640.55	
SONIC HEALTHCARE LTD	46,403	13.92	645,929.76	
CSL LIMITED	58,356	57.81	3,373,560.36	
AUST AND NZ BANKING GROUP	322,178	26.70	8,602,152.60	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	44,420	9.46	420,213.20	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	188,831	65.02	12,277,791.62	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	274,906	28.35	7,793,585.10	
WESTPAC BANKING	364,407	27.60	10,057,633.20	
ASX LTD	20,273	35.84	726,584.32	
MACQUARIE GROUP LIMITED	35,527	40.33	1,432,803.91	
AMP LTD	340,119	4.95	1,683,589.05	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	246,423	5.44	1,340,541.12	
QBE INSURANCE GROUP	140,094	14.69	2,057,980.86	
SUNCORP GROUP LIMITED	148,773	11.90	1,770,398.70	
COMPUTERSHARE LIMITED	54,947	10.10	554,964.70	
TELSTRA CORP	528,600	4.63	2,447,418.00	
AGL ENERGY LTD	68,541	14.24	976,023.84	
SP AUSNET	219,745	1.19	262,595.27	
オーストラリアドル小計	7,020,290		104,005,003.54 (9,615,262,577)	
イギリスポンド				
AMEC PLC	39,419	9.99	393,992.90	
BG GROUP	399,334	11.70	4,672,207.80	
BP PLC	2,241,867	4.61	10,335,006.87	
PETROFAC LTD	28,640	13.01	372,606.40	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	442,937	21.09	9,343,756.01
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	306,374	21.86	6,698,867.51
TULLOW OIL PLC	105,896	10.04	1,063,195.84
ANGLO AMERICAN PLC	163,015	14.63	2,384,909.45
ANTOFAGASTA PLC	47,777	9.22	440,503.94
BHP BILLITTON PLC	246,996	18.32	4,526,201.70
CRODA INTERNATIONAL PLC	16,367	24.65	403,446.55
FRESNILLO PLC	21,045	11.44	240,754.80
GLENCORE XSTRATA PLC	1,147,742	3.15	3,615,961.17
JOHNSON MATTHEY PLC	25,425	27.04	687,492.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	9,225	50.50	465,862.50
REXAM	101,147	5.09	515,343.96
RIO TINTO PLC REG	148,783	28.08	4,177,826.64
VEDANTA RESOURCES PLC	10,217	12.41	126,792.97
BAE SYSTEMS PLC	379,109	4.01	1,523,639.07
BUNZL PLC	41,997	12.53	526,222.41
COBHAM PLC	134,900	2.62	353,438.00
IMI PLC	38,008	12.56	477,380.48
INVENSYS PLC	94,148	3.91	368,871.86
MEGGITT PLC	99,766	5.19	518,284.37
MELROSE INDUSTRIES PLC	144,671	2.53	366,596.31
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	222,854	11.74	2,616,305.96
SMITHS GROUP PLC	50,869	13.09	665,875.21
TRAVIS PERKINS PLC	25,000	15.30	382,500.00
WEIR GROUP PLC/THE	24,478	22.35	547,083.30
WOLSELEY LTD	29,670	30.93	917,693.10
AGGREKO PLC	32,797	16.58	543,774.26
BABCOCK INTL GROUP PLC	45,075	11.21	505,290.75
CAPITA GROUP PLC	79,915	9.51	759,991.65
EXPERIAN PLC	112,153	11.94	1,339,106.82
G4S PLC	175,604	2.44	429,527.38
INTERTEK GROUP PLC	18,553	31.00	575,143.00
SERCO GROUP PLC	60,711	5.92	359,409.12
EASYJET PLC	15,000	11.94	179,100.00
NEW GKN	199,982	3.09	617,944.38
BURBERRY GROUP PLC	54,398	14.29	777,347.42
PERSIMMON PLC	30,000	12.05	361,500.00
CARNIVAL PLC	20,959	21.47	449,989.73
COMPASS GROUP PLC	221,159	8.50	1,879,851.50
INTERCONTINENTAL HOTELS	35,422	18.26	646,805.72
TUI TRAVEL PLC	64,426	3.43	221,303.31
WHITBREAD PLC	22,963	28.67	658,349.21
WILLIAM HILL	88,000	4.36	384,032.00

BRITISH SKY BROADCASTING	121,748	7.77	945,981.96	
ITV PLC	469,551	1.29	607,598.99	
PEARSON	94,370	11.79	1,112,622.30	
REED ELSEVIER PLC	137,458	7.36	1,012,378.17	
WPP PLC	143,296	11.13	1,594,884.48	
KINGFISHER PLC	300,122	3.46	1,040,522.97	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	196,923	4.52	890,879.65	
NEXT PLC	18,453	46.01	849,022.53	
MORRISON SUPERMARKETS	275,203	2.63	723,783.89	
SAINSBURY (J) PLC	151,619	3.60	546,889.73	
TESCO	940,792	3.46	3,258,433.09	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	44,144	18.44	814,015.36	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	226,449	35.27	7,987,988.47	
COCA-COLA HBC AG-CDI	25,438	17.25	438,805.50	
DIAGEO	293,896	19.56	5,750,075.24	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	114,304	23.46	2,681,571.84	
SABMILLER PLC	111,916	32.59	3,647,342.44	
TATE & LYLE	59,590	8.10	482,679.00	
UNILEVER PLC	149,985	26.87	4,030,096.95	
RECKITT BENCKISER PLC	75,343	45.46	3,425,092.78	
SMITH & NEPHEW PLC	111,398	7.58	844,953.83	
ASTRAZENECA	145,894	33.01	4,816,690.41	
GLAXOSMITHKLINE	574,971	16.62	9,558,892.87	
SHIRE PLC	64,961	21.07	1,368,728.27	
BARCLAYS	1,428,547	3.07	4,397,067.66	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	2,170,518	7.08	15,367,267.44	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,238,416	0.62	3,264,580.85	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	257,207	3.27	842,095.71	
STANDARD CHARTERED PLC	285,521	14.73	4,207,151.93	
3I GROUP PLC	110,446	3.37	372,865.69	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	107,828	4.15	448,240.99	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	24,746	9.09	224,941.14	
ICAP PLC	76,978	3.77	290,437.99	
INVESTEC PLC	76,017	4.49	342,000.48	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,415	13.82	295,955.30	
SCHRODERS PLC	11,796	22.26	262,578.96	
ADMIRAL GROUP PLC	23,455	13.04	305,853.20	
AVIVA PIC	368,652	3.34	1,233,878.24	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	70,000	2.12	148,540.00	
LEGAL & GENERAL GROUP	685,281	1.78	1,219,800.18	
OLD MUTUAL PLC	565,435	1.93	1,094,116.72	
PRUDENTIAL	303,069	11.18	3,388,311.42	
RESOLUTION LTD	144,641	2.79	404,850.15	

	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	404,014	1.15	464,616.10	
	STANDARD LIFE PLC	274,584	3.75	1,030,513.75	
	SAGE GROUP PLC	136,633	3.48	475,482.84	
	BT GROUP PLC	919,925	3.12	2,877,525.40	
	INMARSAT PLC	50,921	6.35	323,348.35	
	VODAFONE GROUP PLC	5,738,272	1.91	11,008,874.83	
	CENTRICA PLC	606,744	3.62	2,200,660.48	
	NATIONAL GRID PLC	426,558	7.47	3,188,521.05	
	SEVERN TRENT PLC	29,121	20.70	602,804.70	
	SSE PLC	112,171	15.16	1,700,512.36	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	77,338	7.49	579,261.62	
	ARM HOLDINGS PLC	163,137	8.64	1,410,319.36	
	イギリス債券小計	33,822,003		192,819,990.94 (29,320,207,822)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	42,934	47.51	2,039,794.34	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	952	268.00	255,136.00	
	GIVAUDAN-REG	1,013	1,185.00	1,200,405.00	
	HOLCIM LTD	26,224	73.00	1,914,352.00	
	SIKA AG-BR	262	2,384.00	624,608.00	
	SYNGENTA AG	10,777	370.50	3,992,878.50	
	ABB LTD	256,584	20.52	5,265,103.68	
	GEBERIT AG-REG	4,852	232.10	1,126,149.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,264	131.90	298,621.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,682	134.70	765,365.40	
	SULZER AG-REG	3,362	158.20	531,868.40	
	ADECCO	14,937	52.95	790,914.15	
	SGS SA	599	2,152.00	1,289,048.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,982	104.20	727,524.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	61,007	84.70	5,167,292.90	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	3,578	550.00	1,967,900.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	4,988	94.60	471,864.80	
	ARYZTA AG	10,587	54.05	572,227.35	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	254	877.00	222,758.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	126	3,407.00	429,282.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	12	39,900.00	478,800.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	377,537	63.25	23,879,215.25	
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,042	104.10	628,972.20	
	ACTELION LTD-REG	12,517	55.85	699,074.45	
	LONZA GROUP AG-REG	5,909	72.90	430,766.10	
	NOVARTIS	269,340	67.20	18,099,648.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	82,271	231.50	19,045,736.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	441	474.50	209,254.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	175,383	27.32	4,791,463.56	

	JULIUS BAER GROUP LTD	25,570	37.01	946,345.70	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,789	65.05	246,474.45	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,924	239.70	461,182.80	
	UBS AG-REG	427,437	16.95	7,245,057.15	
	BALOISE HOLDING AG	5,703	93.10	530,949.30	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,651	160.00	584,160.00	
	SWISS RE LTD	40,372	69.10	2,789,705.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,184	246.80	4,241,011.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,859	72.50	497,277.50	
	SWISSCOM	2,965	402.40	1,193,116.00	
	スイスフラン小計	1,922,870		116,651,303.58 (12,197,060,302)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	58,500	26.80	1,567,800.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	251,000	79.75	20,017,250.00	
	NWS HOLDINGS LTD	157,500	12.30	1,937,250.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	140,000	13.66	1,912,400.00	
	MTR CORP	184,500	28.90	5,332,050.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	23,000	47.60	1,094,800.00	
	LI & FUNG	684,400	11.10	7,596,840.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	81,000	20.10	1,628,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	245,000	40.55	9,934,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	108,000	20.05	2,165,400.00	
	SANDS CHINA LTD	281,200	39.40	11,079,280.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	182,000	13.70	2,493,400.00	
	SJM HOLDINGS LTD	243,000	20.00	4,860,000.00	
	WYNN MACAU LTD	188,400	21.95	4,135,380.00	
	BANK EAST ASIA	137,964	28.50	3,931,974.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	433,500	24.95	10,815,825.00	
	HANG SENG BANK	94,900	119.10	11,302,590.00	
	FIRST PACIFIC CO	238,000	9.48	2,256,240.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	125,000	126.40	15,800,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,415,400	32.70	46,283,580.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	163,000	103.90	16,935,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	262,000	26.55	6,956,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	123,843	46.35	5,740,123.05	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	73,000	32.90	2,401,700.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	72,000	30.35	2,185,200.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	422,000	11.76	4,962,720.00	
	SINO LAND CO	370,600	11.18	4,143,308.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	188,000	99.10	18,630,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	78,500	91.65	7,194,525.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	157,000	23.35	3,665,950.00	
	WHARF HOLDINGS	178,000	68.60	12,210,800.00	

	WHEELLOCK & CO LTD	112,000	40.30	4,513,600.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	85,500	44.00	3,762,000.00	
	PCCW LTD	429,000	3.53	1,514,370.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	50.95	3,617,450.00	
	CLP HOLDINGS	208,500	63.70	13,281,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	673,607	18.98	12,785,060.86	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	162,500	66.95	10,879,375.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,700	89.55	1,943,235.00	
	香港ドル小計	9,124,014		303,468,375.91 (3,820,666,852)	
シンガポールド ドル	KEPPEL CORP LTD	170,500	10.45	1,781,725.00	
	NOBLE GROUP LTD	457,145	1.00	457,145.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	121,000	4.84	585,640.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	101,400	4.25	430,950.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	185,000	3.82	706,700.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	272,000	0.84	228,480.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	184,000	1.85	341,320.00	
	SINGAPORE AIRLINES	66,600	10.35	689,310.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	721,400	1.41	1,017,174.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	177,250	4.31	763,947.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	12,000	44.50	534,000.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	162,800	1.69	275,132.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	936,720	0.56	524,563.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	241,000	3.15	759,150.00	
	DBS GROUP	205,000	15.97	3,273,850.00	
	OCBC BANK	308,000	10.13	3,120,040.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	152,000	20.11	3,056,720.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	105,000	7.16	751,800.00	
	CAPITALAND LTD	302,000	3.28	990,560.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	142,000	1.90	270,510.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	10.19	499,310.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	345,000	2.72	938,400.00		
KEPPEL LAND LTD	77,000	3.63	279,510.00		
UOL GROUP LIMITED	47,400	6.46	306,204.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	926,880	3.70	3,429,456.00		
STARHUB LTD	64,000	4.09	261,760.00		
	シンガポールドドル小計	6,532,095		26,273,356.70 (2,055,364,694)	
ニュージーラン ドドル	FLETCHER BUILDING LTD	83,334	8.29	690,838.86	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	89,179	3.00	267,537.00	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	4.15	362,178.80	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	225,967	2.24	506,166.08	
	CONTACT ENERGY LTD	34,237	5.10	174,608.70	

	ニュージーランドドル小計	519,989		2,001,329.44 (154,002,300)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	23,681	138.90	3,289,290.90	
	BOLIDEN AB	33,839	94.50	3,197,785.50	
	ALFA LAVAL AB	35,219	135.70	4,779,218.30	
	ASSA ABLOY B	39,292	263.80	10,365,229.60	
	ATLAS COPCO A	79,930	168.50	13,468,205.00	
	ATLAS COPCO B	47,013	148.60	6,986,131.80	
	SANDVIK AB	128,312	89.40	11,471,092.80	
	SCANIA AB-B SHS	41,389	145.50	6,022,099.50	
	SKANSKA B	47,290	116.50	5,509,285.00	
	SKF AB-B	43,539	159.00	6,922,701.00	
	VOLVO B	172,621	96.95	16,735,605.95	
	SECURITAS B	34,345	59.95	2,058,982.75	
	ELECTROLUX AB-SER B	24,949	178.10	4,443,416.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,160	38.25	1,344,870.00	
	HENNES & MAURITZ B	109,074	224.60	24,498,020.40	
	SWEDISH MATCH AB	24,876	237.30	5,903,074.80	
	SCA SV CELLULOZA B	65,337	168.30	10,996,217.10	
	ELEKTA AB-B SHS	42,496	102.80	4,368,588.80	
	GETINGE AB-B SHS	25,919	204.10	5,290,067.90	
	NORDEA BANK AB	302,466	80.40	24,318,266.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	166,626	68.10	11,347,230.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	59,614	284.90	16,984,028.60	
	SWEDBANK AB-A	104,581	153.30	16,032,267.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	115.30	1,917,554.30	
	INVESTOR AB-B SHS	55,612	191.20	10,633,014.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	23,015	172.00	3,958,580.00	
	RATOS AB-B SHS	29,254	55.50	1,623,597.00	
ERICSSON (LM) B	351,814	77.30	27,195,222.20		
HEXAGON AB-B SHS	25,860	194.10	5,019,426.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7,779	510.00	3,967,290.00		
TELE2 AB-B -REDEMPTION SHS	40,306	28.00	1,128,568.00		
TELE2 AB-B SHS	40,306	80.55	3,246,648.30		
TELIASONERA AB	275,719	44.15	12,172,993.85		
	スウェーデンクローナ小計	2,553,864		287,194,570.95 (4,273,455,215)	
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	18,420	84.70	1,560,174.00	
	SEADRILL LTD	42,769	229.70	9,824,039.30	
	STATOIL ASA	130,207	129.30	16,835,765.10	
	SUBSEA 7 SA	29,340	130.40	3,825,936.00	
	NORSK HYDRO	130,509	26.80	3,497,641.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,369	248.50	5,310,196.50	

	ORKLA	99,079	49.82	4,936,115.78	
	DNB ASA	115,875	92.55	10,724,231.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20,723	88.20	1,827,768.60	
	TELENOR ASA	81,174	121.50	9,862,641.00	
	ノルウェークローネ小計	689,465		68,204,508.73 (1,156,748,468)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	66	39,200.00	2,587,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	163	41,320.00	6,735,160.00	
	DSV A/S	22,493	139.00	3,126,527.00	
	CARLSBERG AS-B	12,388	533.00	6,602,804.00	
	COLOPLAST-B	14,553	320.00	4,656,960.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,714	455.80	1,237,041.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	47,810	917.00	43,841,770.00	
	NOVOZYMES A/S	26,435	191.20	5,054,372.00	
	DANSKE BANK A/S	76,547	112.00	8,573,264.00	
	TRYG A/S	2,274	474.00	1,077,876.00	
	TDC A/S	74,134	44.34	3,287,101.56	
	デンマーククローネ小計	279,577		86,780,075.76 (1,504,766,513)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	434	1,006.00	436,604.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	55,951	40.27	2,253,146.77	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	327	2,360.00	771,720.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	99,501	142.20	14,149,042.20	
	BANK HAPOLIM BM	129,544	17.58	2,277,383.52	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	141,968	12.86	1,825,708.48	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,694	38.97	455,715.18	
	NICE SYSTEMS LTD	6,530	136.80	893,304.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	211,981	4.70	996,310.70	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,752	181.80	500,313.60	
	イスラエルシェケル小計	660,682		24,559,248.45 (665,555,632)	
ユーロ	CGG	19,704	18.01	354,967.56	
	ENI	298,625	17.30	5,166,212.50	
	FUGRO NV-CVA	7,183	44.31	318,278.73	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,226	12.49	415,158.87	
	NESTE OIL OYJ	14,446	10.91	157,605.86	
	OMV AG	18,602	35.89	667,625.78	
	REPSOL SA	98,513	17.37	1,711,663.37	
	SAIPEM	31,106	20.17	627,408.02	
	TECHNIP S.A.	11,603	84.69	982,658.07	
	TENARIS SA	57,059	16.01	913,514.59	
	TOTAL SA	248,961	37.90	9,435,621.90	
	AIR LIQUIDE	36,133	97.08	3,507,791.64	

AKZO NOBEL	27,734	46.19	1,281,033.46
ARCELORMITTAL	116,697	9.50	1,108,621.50
ARKEMA	7,576	78.00	590,928.00
BASF SE	107,784	72.83	7,849,908.72
CRH	89,816	15.91	1,429,421.64
FUCHS PETROLUB AG -PREF	3,672	63.11	231,739.92
HEIDELBERGCEMENT AG	16,233	57.93	940,377.69
IMERYS SA	3,585	47.56	170,502.60
K+S AG	22,113	30.51	674,778.19
KONINKLIJKE DSM NV	17,571	51.00	896,121.00
LAFARGE (FRANCE)	21,545	53.60	1,154,812.00
LANXESS	9,584	55.89	535,649.76
LINDE AG	21,529	145.05	3,122,781.45
SOLVAY SA	6,783	110.45	749,182.35
STORA ENSO OYJ R	55,401	5.28	292,794.28
THYSSEN KRUPP	44,818	15.54	696,695.81
UMICORE	14,302	36.81	526,456.62
UPM KYMMENE CORP	60,353	7.88	475,883.40
VOESTALPINE AG	13,096	28.35	371,271.60
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	13,736	21.09	289,692.24
ALSTOM RGPT	26,532	27.86	739,181.52
ANDRITZ AG	8,740	40.17	351,085.80
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	30.10	313,393.05
BOUYGUES ORD	23,944	19.79	473,971.48
BRENNTAG AG	5,676	121.40	689,066.40
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	67,823	43.42	2,945,213.77
FERROVIAL SA	50,209	12.29	617,068.61
FIAT INDUSTRIAL	99,776	8.88	886,010.88
FINMECCANICA SPA	46,367	4.09	189,826.49
GEA GROUP AG	22,145	27.41	607,105.17
HOCHTIEF AG	3,383	50.58	171,112.14
KONE OYJ-B	19,342	66.15	1,279,473.30
KONINKLIJKE PHILIPS	110,494	21.62	2,389,432.75
LEGRAND SA	28,968	37.25	1,079,058.00
MAN SE	3,991	83.95	335,044.45
METSO OYJ	14,851	28.81	427,857.31
PRYSMIAN SPA	22,963	15.88	364,652.44
REXEL SA	15,749	17.57	276,709.93
SAFRAN SA	29,932	39.68	1,187,851.42
SAINT-GOBAIN	46,267	32.80	1,517,788.93
SCHNEIDER ELECTRIC	61,711	59.97	3,700,808.67
SIEMENS	92,892	80.33	7,462,014.36
THALES SA	9,836	37.88	372,636.86

VALLOUREC	12,975	39.52	512,772.00
VINCI S.A.	53,556	39.79	2,130,993.24
WARTSILA OYJ	21,786	34.06	742,031.16
ZARDOYA OTIS SA	15,873	10.26	162,856.98
ZODIAC AEROSPACE	4,111	100.65	413,772.15
BUREAU VERITAS SA	6,527	85.74	559,624.98
EDENRED	20,699	24.31	503,296.18
RANDSTAD HOLDING NV	14,649	31.83	466,350.91
SOCIETE BIC SA	4,132	81.75	337,791.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	44,713	13.81	617,710.09
ADP	2,976	70.13	208,706.88
ATLANTIA SPA	41,062	13.00	533,806.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,122	16.34	459,654.09
DEUTSCHE POST AG-REG	108,771	19.49	2,120,490.64
FRAPORT AG	5,277	44.37	234,140.49
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	69,589	6.05	421,222.21
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	104,852	3.17	332,905.10
TNT EXPRESS	39,960	5.74	229,730.04
VOPAK	8,861	46.39	411,106.09
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	38,491	72.20	2,779,050.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,041	53.90	325,609.90
CONTINENTAL AG	13,620	101.40	1,381,068.00
DAIMLER AG	112,137	48.61	5,451,540.25
FIAT ORD	100,566	6.10	613,452.60
MICHELIN	20,836	68.40	1,425,182.40
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,639	31.80	433,720.20
PIRELLI & CO	25,902	8.98	232,599.96
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	19,118	63.15	1,207,301.70
RENAULT SA	22,606	59.57	1,346,639.42
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,688	166.25	2,774,380.00
VOLKSWAGEN STAMM	3,661	162.15	593,631.15
ADIDAS AG	24,127	81.58	1,968,280.66
CHRISTIAN DIOR	6,542	136.95	895,926.90
HUGO BOSS AG	3,036	84.09	255,297.24
LUXOTTICA GROUP SPA	20,942	38.77	811,921.34
LVMH	29,649	132.65	3,932,939.85
ACCOR	18,216	26.87	489,463.92
OPAP SA	31,301	7.01	219,420.01
SODEXO	11,095	65.36	725,169.20
AXEL SPRINGER AG	3,824	33.29	127,320.08
EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,513	23.25	430,519.81
JC DECAUX SA	6,530	19.86	129,685.80
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	10,484	74.62	782,316.08

LAGADERE S.C.A	14,181	20.53	291,135.93
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	12,819	31.87	408,605.62
PUBLICIS GROUPE	20,945	52.64	1,102,544.80
REED ELSEVIER NV	86,083	12.62	1,086,367.46
SES	32,208	22.45	723,069.60
TELENET GROUP HOLDING NV	5,928	34.51	204,575.28
WOLTERS KLUWER	38,268	16.35	625,681.80
INDITEX	25,729	100.05	2,574,186.45
KERING	8,733	161.55	1,410,816.15
AHOLD (KON.)	115,609	11.80	1,364,186.20
CARREFOUR	71,775	21.53	1,545,674.62
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,355	76.54	486,411.70
COLRUYT SA	8,963	38.26	342,969.19
DELHAIZE GROUP	12,368	48.77	603,249.20
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	63,188	5.88	371,545.44
JERONIMO MARTINS	27,071	16.29	441,121.94
KESKO OYJ-B SHS	6,822	22.40	152,812.80
METRO STAMM	14,863	26.01	386,660.94
ANHEUSER-BUSCH INBEV	93,398	71.59	6,686,362.82
DANONE (GROUPE)	66,408	57.34	3,807,834.72
DE MASTER BLENDEERS1753 NV	58,290	12.27	715,509.75
HEINEKEN HOLDING NV	12,432	45.12	560,994.00
HEINEKEN NV	27,810	52.87	1,470,314.70
KERRY GROUP PLC-A	19,726	43.28	853,741.28
PERNOD-RICARD	25,578	90.93	2,325,807.54
REMY COINTREAU	3,268	86.79	283,629.72
SUEDZUCKER AG	9,463	25.95	245,564.85
UNILEVER NV-CVA	189,931	30.81	5,851,774.11
BEIERSDORF AG	11,231	68.16	765,504.96
HENKEL AG & CO KGAA	15,384	62.96	968,576.64
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	20,448	74.47	1,522,762.56
LOREAL	28,190	127.00	3,580,130.00
CELESIO AG	12,054	15.99	192,803.73
ESSILOR INTERNATIONAL	24,413	83.39	2,035,800.07
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	24,248	52.27	1,267,442.96
FRESENIUS SE&CO KGAA	15,436	91.72	1,415,789.92
BAYER	96,930	83.27	8,071,361.10
ELAN CORPORATION PLC	62,373	9.97	622,045.92
GRIFOLS SA	17,680	28.20	498,576.00
MERCK KGAA	7,419	122.25	906,972.75
ORION OYJ-CLASS B	10,739	18.50	198,671.50
QIAGEN N.V.	28,612	14.05	401,998.60

SANOFI	139,755	80.89	11,304,781.95
UCB (GROUPE)	13,683	40.65	556,282.36
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	765,531	0.23	181,966.71
BANCO BILBAO VIZCAYA	650,629	7.05	4,592,139.48
BANCO DE SABADELL SA	319,539	1.40	447,674.13
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	229,337	0.74	171,544.07
BANCO POPULAR ESPANOL	652,089	0.62	408,207.71
BANCO SANTANDER SA	1,274,334	5.46	6,966,783.97
BANK OF IRELAND	2,300,000	0.18	414,000.00
BANKIA SA	401,244	0.69	276,858.36
BNP PARIBAS	116,699	44.44	5,186,103.56
CAIXABANK	124,827	2.71	339,030.13
COMMERZBANK AG	111,413	7.65	853,200.75
CREDIT AGRICOLE SA	117,071	7.11	832,726.02
ERSTE GROUP BANK AG	27,377	24.41	668,409.45
INTESA SANPAOLO	1,372,064	1.40	1,923,633.72
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	126,938	-	-
KBC GROEP NV	25,136	31.55	793,166.48
NATIXIS	107,265	3.51	377,465.53
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,024	25.65	180,200.72
SOCIETE GENERALE	82,396	30.14	2,483,827.42
UNICREDIT SPA	500,456	4.07	2,036,855.92
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	99,300	3.28	326,101.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	117,756	36.34	4,279,253.04
DEUTSCHE BOERSE	22,405	48.74	1,092,019.70
EURAZEO	4,741	41.90	198,647.90
EXOR SPA	9,213	24.18	222,770.34
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,407	59.20	616,094.40
ING GROEP	443,783	6.96	3,091,836.16
MEDIOBANCA	60,604	5.03	305,141.14
OKO BANK-A	15,865	12.30	195,139.50
WENDEL	3,623	84.50	306,143.50
AEGON	207,650	5.17	1,073,758.15
AGEAS	27,738	28.48	790,116.93
ALLIANZ SE-REG	53,522	116.90	6,256,721.80
ASSICURAZIONI GENERALI	139,949	14.17	1,983,077.33
AXA	209,896	15.70	3,295,367.20
CNP ASSURANCES	21,876	11.61	254,089.74
DELTA LLOYD NV	18,951	15.29	289,855.54
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	7,059	55.85	394,245.15
MAPFRE SA	107,919	2.79	302,065.28
MUENCHENER RUECKVERSICH.	20,823	143.10	2,979,771.30
SAMPO OYJ-A SHS	49,432	31.07	1,535,852.24

SCOR SE	19,882	23.25	462,256.50
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	3,668	37.90	139,035.54
IMMOFINANZ AG	96,001	3.15	303,075.15
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	43,482	23.55	1,024,218.51
ATOS	6,456	55.25	356,694.00
CAP GEMINI SA	16,298	36.94	602,129.61
DASSAULT SYSTEMES SA	6,958	96.95	674,578.10
SAP AG	107,912	58.02	6,261,054.24
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	13,939	22.71	316,624.38
GEMALTO	10,009	66.07	661,294.63
NOKIA CORP	433,986	2.67	1,158,742.62
BELGACOM	17,758	17.43	309,610.73
DEUTSCHE TELEKOM	327,458	8.84	2,896,038.55
ELISA A	15,145	14.71	222,782.95
FRANCE TELECOM	215,865	7.63	1,647,049.95
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	31,076	6.70	208,209.20
ILIAD SA	2,797	158.00	441,926.00
KPN (KON.)	354,638	1.54	548,270.34
PORTUGAL TELECOM	73,469	3.29	241,713.01
TELECOM ITALIA ORD	1,220,302	0.58	708,385.31
TELECOM ITALIA RNC	656,704	0.46	304,710.65
TELEFONICA	482,807	10.43	5,038,091.04
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,607	5.67	167,990.11
TELEKOM AUSTRIA AG	31,911	5.21	166,479.68
VIVENDI	138,352	14.96	2,069,745.92
ZIGGO NV	17,750	28.20	500,550.00
ACCIONA SA	3,118	45.75	142,648.50
E.ON SE	211,400	12.92	2,731,288.00
ELECTRICITE DE FRANCE	29,375	17.92	526,546.87
ENAGAS	25,715	18.77	482,670.55
ENEL	776,145	2.77	2,151,473.94
ENEL GREEN POWER SPA	205,628	1.64	338,874.94
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	243,138	2.52	612,707.76
FORTUM OYJ	52,272	14.48	756,898.56
GAS NATURAL SDG SA	44,595	16.09	717,533.55
GDF SUEZ	155,664	15.35	2,390,220.72
IBERDROLA SA	554,644	4.22	2,340,597.68
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,695	42.03	575,669.32
RWE AG-NON VTG PFD	2,644	24.90	65,835.60
RWE STAMM	58,896	26.39	1,554,265.44
SNAM SPA	235,961	3.48	822,560.04
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	31,516	9.85	310,432.60

TERNA SPA	159,265	3.34	532,263.63	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	37,760	9.43	356,416.64	
VERBUND AG	5,427	15.91	86,370.70	
ASML HOLDING NV	36,585	61.04	2,233,148.40	
INFINEON TECHNOLOGIES	125,655	6.44	809,343.85	
STMICROELECTRONICS	78,205	7.29	570,349.06	
ユーロ小計	23,589,366		295,448,804.12 (38,177,894,468)	
合計	126,965,937		289,530,906,420 (289,530,906,420)	

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	597,000.00	471,630.00	
	アメリカドル小計		597,000.00	471,630.00 (46,087,683)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	110,865.00	691,797.60	
		LEND LEASE GROUP	67,981.00	632,903.11	
		SYDNEY AIRPORT	16,013.00	56,365.76	
	オーストラリアドル小計		194,859.00	1,381,066.47 (127,679,595)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	276,000.00	2,014,800.00	
香港ドル小計		276,000.00	2,014,800.00 (25,366,332)		
投資信託受益証券合計				199,133,610 (199,133,610)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	42,300.00	1,081,188.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	45,702.00	3,599,946.54	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	116,511.00	1,571,733.39	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,158.00	1,903,967.84	
		BOSTON PROPERTIES	17,441.00	1,915,196.21	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,317.00	698,357.73	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,700.00	948,280.00	
		DUKE REALTY CORP	37,800.00	611,226.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	40,205.00	2,279,221.45	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,266.00	887,768.40	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	54,376.00	1,129,933.28	
		HCP INC	54,375.00	2,586,075.00	
		HEALTH CARE REIT INC	32,523.00	2,220,995.67	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	85,238.00	1,484,845.96	
		KIMCO REALTY CORP	51,812.00	1,146,599.56	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	14,105.00	555,454.90	
MACERICH CO/THE	17,326.00	1,087,206.50			

	PLUM CREEK TIMBER COMMON	18,073.00	873,287.36	
	PROLOGIS INC	59,426.00	2,319,396.78	
	PUBLIC STORAGE	17,549.00	2,698,685.22	
	RAYONIER INC	15,000.00	821,850.00	
	REALTY INCOME CORP	21,200.00	950,396.00	
	REGENCY CENTERS CORP	10,977.00	562,571.25	
	SIMON PROPERTY GROUP	36,201.00	6,054,979.26	
	SL GREEN REALTY CORP	11,317.00	983,560.47	
	UDR INC	32,900.00	805,721.00	
	VENTAS INC	35,530.00	2,531,512.50	
	VORNADO REALTY TRUST	19,403.00	1,581,150.47	
アメリカドル小計		935,731.00	45,891,106.74 (4,484,478,950)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	12,000.00	275,400.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,297.00	437,085.54	
カナダドル小計		28,297.00	712,485.54 (68,377,237)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	229,816.00	455,035.68	
	DEXUS PROPERTY GROUP	571,015.00	608,130.97	
	FEDERATION CENTRES	186,565.00	447,756.00	
	GOODMAN GROUP	216,673.00	1,055,197.51	
	GPT GROUP	188,654.00	701,792.88	
	MIRVAC GROUP	429,658.00	702,490.83	
	STOCKLAND	248,547.00	897,254.67	
	WESTFIELD GROUP	244,115.00	2,758,499.50	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	376,772.00	1,126,548.28	
オーストラリアドル小計		2,691,815.00	8,752,706.32 (809,187,699)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	106,377.00	629,219.95	
	HAMMERSON PLC	78,494.00	393,254.94	
	INTU PROPERTIES PLC	78,831.00	264,005.01	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	96,136.00	895,026.16	
	SEGRO PLC	106,565.00	295,824.44	
イギリスポンド小計		466,403.00	2,477,330.50 (376,702,875)	
香港ドル	LINK REIT	268,000.00	10,371,600.00	
香港ドル小計		268,000.00	10,371,600.00 (130,578,444)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	226,000.00	519,800.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	212,000.00	326,480.00	
	CAPITAMALL TRUST	286,600.00	601,860.00	
シンガポールドル小計		724,600.00	1,448,140.00 (113,287,992)	

ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584.00	0.00	
	CORIO NV	9,339.00	308,887.42	
	FONCIERE DES REGIONS	3,754.00	236,126.60	
	GECINA SA	3,161.00	293,973.00	
	ICADE	3,280.00	220,678.40	
	KLEPIERRE	10,981.00	354,796.11	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	11,873.00	2,184,038.35	
ユーロ小計		1,647,972.00	3,598,499.88 (464,998,154)	
投資証券合計			6,447,611,351 (6,447,611,351)	
合計			6,646,744,961 (6,646,744,961)	

(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 575銘柄	97.4%	58.3%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券 28銘柄	2.5%	1.5%
カナダドル	株式 93銘柄	99.5%	4.7%
	投資証券 2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	91.1%	3.2%
	投資信託受益証券 3銘柄	1.2%	0.0%
	投資証券 9銘柄	7.7%	0.3%
イギリスポンド	株式 102銘柄	98.7%	9.9%
	投資証券 5銘柄	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式 39銘柄	96.1%	1.3%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.6%	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	94.8%	0.7%
	投資証券 3銘柄	5.2%	0.0%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 33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 11銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式 231銘柄	98.8%	12.9%
	投資証券 7銘柄	1.2%	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。

[次へ](#)

「外国債券マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	423,191,606
コール・ローン	3,847,408,960
国債証券	421,538,650,801
派生商品評価勘定	295,352
未収入金	3,955,574,092
未収利息	4,188,458,906
前払費用	118,619,368
差入委託証拠金	179,007,270
流動資産合計	434,251,206,355
資産合計	434,251,206,355
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,551,042
未払金	145,649,750
未払解約金	1,992,662,540
流動負債合計	2,173,863,332
負債合計	2,173,863,332
純資産の部	
元本等	
元本	219,933,320,446
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	212,144,022,577
元本等合計	432,077,343,023
純資産合計	432,077,343,023
負債純資産合計	434,251,206,355

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25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。</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>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25年 6月10日現在
1. 計算期間の期首元本額 計算期間中の追加設定元本額 計算期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	261,445,732,569円 12,375,965,752円 53,888,377,875円 219,933,320,446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 DC外国債券インデックスファンド DC外国債券インデックスファンドL 物価連動債組入世界債券ファンド DCバランスファンド30 DCバランスファンド50 DCバランスファンド70 ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型) ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型) 新生・4分散ファンド グローバル・インデックス・バランス・ファンド 4資産インデックスバランスオープン(分配型)	4,697,724,850円 1,865,527,664円 9,139,123,296円 66,759,476円 130,901,855円 196,117,317円 41,991,582円 97,613,437円 60,032,763円 87,037,760円 412,606,296円 16,485,547円

4資産インデックスバランスオープン(成長型)	67,111,387円
外国債券インデックスe	989,331,536円
インデックスコレクション(外国債券)	1,108,860,720円
インデックスコレクション(バランス株式30)	144,585,689円
インデックスコレクション(バランス株式50)	157,856,647円
インデックスコレクション(バランス株式70)	51,412,544円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	2,696,820,290円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	338,212,749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)	12,887,561,201円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	6,251,095,791円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	21,602,834,107円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	68,405,248,531円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	4,110,096,030円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	101,538,749円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	7,914,396,772円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,489,725,624円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,840,166,996円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	17,523,759,909円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	757,271,536円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	28,189,006,057円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	4,685,573,178円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	395,175,794円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,720,404,044円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,772,578,307円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	303,081,441円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	120,324,336円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,320,186,928円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	5,774,796,828円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	38,534,231円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	760,607,541円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	251,371,156円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	3,311,163,739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)	39,345,185円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,363,030円
2. 計算日における受益権総数	219,933,320,446口
3. 1口当たり純資産額	1.9646円
(1万口当たり純資産額)	(19,646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25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(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。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した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コンプライアンス会議に報告します。 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25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 「(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。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25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	503,042,132	
合計	503,042,132	

(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25年2月8日から平成25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25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	3,178,382,156	-	3,176,050,152	2,332,004
	合計	3,178,382,156	-	3,176,050,152	2,332,004

(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25年 6月10日現在		
		契約額等(円)		時価 (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	1,937,934,840	-	1,915,116,000	22,818,840
	カナダドル	212,490,340	-	211,090,000	1,400,340
	イギリスポンド	540,577,200	-	539,777,500	799,700
	ユーロ	1,972,291,220	-	1,964,144,000	8,147,220
	計	4,663,293,600	-	4,630,127,500	33,166,100
	売 建				
	アメリカドル	1,504,872,600	-	1,504,734,000	138,600
	カナダドル	105,560,620	-	105,556,000	4,620
	オーストラリアドル	53,198,405	-	53,194,549	3,856
	イギリスポンド	471,373,600	-	471,355,000	18,600
	シンガポールドル	15,645,880	-	15,644,000	1,880
	マレーシアリングgit	20,008,604	-	20,002,246	6,358
	スウェーデンクローナ	31,246,320	-	31,227,000	19,320
	ノルウェークローネ	10,175,100	-	10,170,000	5,100
	デンマーククローネ	29,478,000	-	29,478,000	-
	メキシコペソ	39,769,600	-	39,780,000	10,400
	ポーランドズロチ	24,419,360	-	24,376,000	43,360
	南アフリカランド	19,433,600	-	19,420,000	13,600
	ユーロ	1,602,325,520	-	1,602,328,000	2,480
	計	3,927,507,209	-	3,927,264,795	242,414
	合計	8,590,800,809	-	8,557,392,295	32,923,686

(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25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25年 6月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25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 0.125% 07/31/14	1,000,000.00	999,414.06	
		T 0.125% 12/31/14	15,000,000.00	14,973,339.90	
		T 0.25% 01/15/15	9,000,000.00	8,999,648.46	
		T 0.25% 01/31/15	10,000,000.00	9,999,023.40	
		T 0.25% 02/15/15	15,000,000.00	14,994,726.60	
		T 0.25% 02/28/15	9,550,000.00	9,545,896.46	
		T 0.25% 05/15/15	20,090,000.00	20,070,380.90	
		T 0.25% 05/15/16	9,000,000.00	8,932,148.46	
		T 0.25% 05/31/14	9,000,000.00	9,008,789.04	
		T 0.25% 06/30/14	1,000,000.00	1,000,957.03	
		T 0.25% 07/15/15	10,000,000.00	9,982,226.60	
		T 0.25% 08/15/15	5,000,000.00	4,988,964.85	
		T 0.25% 08/31/14	1,000,000.00	1,000,781.25	
		T 0.25% 09/15/14	18,000,000.00	18,012,656.34	
		T 0.25% 09/15/15	18,000,000.00	17,951,835.96	
		T 0.25% 09/30/14	9,000,000.00	9,006,328.17	
		T 0.25% 10/15/15	5,000,000.00	4,983,203.15	
		T 0.25% 10/31/14	5,000,000.00	5,003,125.00	
		T 0.25% 11/30/14	4,000,000.00	4,001,484.36	
		T 0.25% 12/15/14	6,100,000.00	6,101,667.98	
		T 0.25% 12/15/15	19,000,000.00	18,916,132.86	
		T 0.375% 02/15/16	17,350,000.00	17,307,980.55	
		T 0.375% 03/15/15	15,300,000.00	15,324,503.86	
		T 0.375% 03/15/16	15,000,000.00	14,956,640.70	
		T 0.375% 04/15/15	17,500,000.00	17,524,609.37	
		T 0.375% 06/15/15	6,000,000.00	6,007,031.28	
		T 0.375% 11/15/14	10,000,000.00	10,021,875.00	
		T 0.375% 11/15/15	6,000,000.00	5,994,843.78	
		T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,899,099.62	
		T 0.5% 08/15/14	10,150,000.00	10,188,260.72	
		T 0.5% 10/15/14	5,100,000.00	5,120,121.08	
		T 0.625% 04/30/18	20,000,000.00	19,565,234.40	
		T 0.625% 05/31/17	14,000,000.00	13,883,242.24	
		T 0.625% 07/15/14	2,000,000.00	2,009,921.88	
		T 0.625% 08/31/17	16,500,000.00	16,301,806.62	
		T 0.625% 09/30/17	12,000,000.00	11,839,687.56	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,921,484.40	
		T 0.75% 02/28/18	16,300,000.00	16,075,875.00	
		T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,924,804.70	
		T 0.75% 06/15/14	10,000,000.00	10,059,375.00	
T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,981,875.00			
T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,585,468.75			

T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,941,796.90	
T 0.875% 01/31/17	13,000,000.00	13,061,953.19	
T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,986,015.62	
T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,024,492.18	
T 0.875% 04/30/17	7,000,000.00	7,015,996.12	
T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,847,558.60	
T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,012,890.62	
T 0.875% 12/31/16	9,500,000.00	9,551,582.05	
T 1% 03/31/17	10,000,000.00	10,078,710.90	
T 1% 06/30/19	5,000,000.00	4,892,382.80	
T 1% 08/31/16	13,900,000.00	14,072,664.13	
T 1% 08/31/19	6,000,000.00	5,851,289.04	
T 1% 09/30/16	10,000,000.00	10,118,554.70	
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,870,898.45	
T 1% 10/31/16	9,000,000.00	9,103,183.56	
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,926,412.11	
T 1.125% 05/31/19	12,000,000.00	11,846,484.36	
T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,081,882.83	
T 1.25% 01/31/19	24,000,000.00	23,993,906.16	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,991,718.76	
T 1.25% 08/31/15	11,990,000.00	12,227,926.56	
T 1.25% 09/30/15	21,980,000.00	22,422,605.10	
T 1.25% 10/31/15	10,000,000.00	10,202,929.70	
T 1.375% 02/28/19	15,000,000.00	15,077,343.75	
T 1.375% 09/30/18	8,520,000.00	8,607,862.50	
T 1.375% 11/30/15	4,550,000.00	4,657,884.77	
T 1.375% 11/30/18	9,000,000.00	9,077,519.52	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,727,171.87	
T 1.5% 06/30/16	7,450,000.00	7,662,004.87	
T 1.5% 07/31/16	9,950,000.00	10,232,175.83	
T 1.5% 08/31/18	6,500,000.00	6,616,162.08	
T 1.625% 08/15/22	10,000,000.00	9,632,812.50	
T 1.625% 11/15/22	9,600,000.00	9,204,374.97	
T 1.75% 05/15/22	29,800,000.00	29,155,109.52	
T 1.75% 05/15/23	9,800,000.00	9,431,542.93	
T 1.75% 05/31/16	10,960,000.00	11,351,948.45	
T 1.75% 07/31/15	22,000,000.00	22,660,429.66	
T 1.75% 10/31/18	8,130,000.00	8,369,771.50	
T 1.875% 06/30/15	18,900,000.00	19,500,961.03	
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,081,640.62	
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,258,470.89	
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,095,138.67	
T 11.25% 02/15/15	2,550,000.00	3,019,409.17	

T 2% 01/31/16	3,000,000.00	3,121,933.59	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	6,020,625.00	
T 2% 02/15/23	12,500,000.00	12,352,783.24	
T 2% 04/30/16	6,090,000.00	6,348,706.06	
T 2% 11/15/21	17,500,000.00	17,627,832.07	
T 2.125% 05/31/15	6,950,000.00	7,197,322.28	
T 2.125% 08/15/21	14,300,000.00	14,592,423.84	
T 2.125% 11/30/14	18,400,000.00	18,911,031.29	
T 2.125% 12/31/15	11,000,000.00	11,472,871.08	
T 2.25% 01/31/15	14,900,000.00	15,384,250.00	
T 2.25% 03/31/16	9,150,000.00	9,599,457.97	
T 2.25% 05/31/14	7,930,000.00	8,091,232.99	
T 2.25% 07/31/18	4,500,000.00	4,752,773.46	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,113,242.18	
T 2.375% 02/28/15	15,500,000.00	16,058,544.98	
T 2.375% 03/31/16	7,900,000.00	8,317,373.03	
T 2.375% 05/31/18	3,800,000.00	4,036,609.39	
T 2.375% 06/30/18	4,960,000.00	5,270,387.52	
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,122,968.76	
T 2.375% 08/31/14	26,000,000.00	26,694,687.50	
T 2.375% 09/30/14	22,150,000.00	22,777,727.45	
T 2.375% 10/31/14	15,950,000.00	16,427,565.48	
T 2.5% 03/31/15	12,820,000.00	13,331,047.24	
T 2.5% 04/30/15	4,930,000.00	5,133,940.24	
T 2.5% 06/30/17	8,200,000.00	8,744,851.54	
T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,616,789.08	
T 2.625% 02/29/16	12,850,000.00	13,601,423.79	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,407,693.35	
T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,868,312.50	
T 2.625% 06/30/14	13,000,000.00	13,337,187.50	
T 2.625% 07/31/14	13,350,000.00	13,722,600.63	
T 2.625% 08/15/20	15,000,000.00	16,017,773.40	
T 2.625% 11/15/20	15,000,000.00	15,988,769.55	
T 2.625% 12/31/14	3,480,000.00	3,608,596.89	
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,164,023.44	
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	313,177.34	
T 2.75% 05/31/17	9,900,000.00	10,651,201.20	
T 2.75% 08/15/42	12,150,000.00	10,817,534.16	
T 2.75% 11/15/42	1,900,000.00	1,689,998.05	
T 2.75% 11/30/16	12,500,000.00	13,388,427.75	
T 2.75% 12/31/17	11,000,000.00	11,863,671.93	
T 2.875% 03/31/18	4,800,000.00	5,212,218.76	
T 2.875% 05/15/43	1,300,000.00	1,186,884.76	

T 3% 02/28/17	16,800,000.00	18,189,281.20	
T 3% 05/15/42	16,080,000.00	15,113,315.58	
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,108,919.72	
T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,311,406.24	
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,346,015.64	
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	3,666,554.67	
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,501,992.19	
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,338,703.12	
T 3.125% 05/15/19	15,520,000.00	17,138,081.21	
T 3.125% 05/15/21	9,190,000.00	10,098,589.47	
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,516,320.31	
T 3.125% 11/15/41	16,700,000.00	16,130,177.79	
T 3.25% 03/31/17	15,300,000.00	16,728,697.32	
T 3.25% 05/31/16	7,650,000.00	8,264,241.22	
T 3.25% 06/30/16	7,000,000.00	7,572,167.96	
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,856,689.83	
T 3.25% 12/31/16	9,800,000.00	10,677,597.64	
T 3.375% 11/15/19	10,390,000.00	11,650,599.27	
T 3.5% 02/15/18	6,850,000.00	7,632,933.62	
T 3.5% 02/15/39	10,650,000.00	11,134,866.17	
T 3.5% 05/15/20	14,900,000.00	16,827,396.50	
T 3.625% 02/15/20	22,030,000.00	25,065,579.12	
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	5,946,877.72	
T 3.625% 08/15/19	1,400,000.00	1,588,097.65	
T 3.75% 08/15/41	8,840,000.00	9,606,766.39	
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,723,353.13	
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,305,497.06	
T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	5,458,059.55	
T 4.0% 02/15/15	10,020,000.00	10,645,858.61	
T 4.0% 08/15/18	6,000,000.00	6,874,101.54	
T 4.125% 05/15/15	4,040,000.00	4,336,292.95	
T 4.25% 05/15/39	3,250,000.00	3,842,617.18	
T 4.25% 08/15/14	12,550,000.00	13,152,743.11	
T 4.25% 08/15/15	10,500,000.00	11,390,039.11	
T 4.25% 11/15/14	9,230,000.00	9,759,282.81	
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,544,194.34	
T 4.25% 11/15/40	9,220,000.00	10,899,048.48	
T 4.375% 02/15/38	3,150,000.00	3,792,304.68	
T 4.375% 05/15/40	9,800,000.00	11,814,167.93	
T 4.375% 05/15/41	3,350,000.00	4,041,460.93	
T 4.375% 11/15/39	5,800,000.00	6,992,171.90	
T 4.5% 02/15/16	2,420,000.00	2,680,244.52	
T 4.5% 02/15/36	4,620,000.00	5,660,763.29	

T 4.5% 05/15/17	15,530,000.00	17,754,551.21	
T 4.5% 05/15/38	3,500,000.00	4,292,900.39	
T 4.5% 08/15/39	5,750,000.00	7,065,537.09	
T 4.5% 11/15/15	2,160,000.00	2,373,848.44	
T 4.625% 02/15/17	5,500,000.00	6,275,908.21	
T 4.625% 02/15/40	9,900,000.00	12,398,396.47	
T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,779,553.71	
T 4.75% 02/15/37	2,500,000.00	3,171,093.75	
T 4.75% 02/15/41	7,900,000.00	10,092,404.28	
T 4.75% 08/15/17	19,000,000.00	22,037,773.39	
T 4.875% 08/15/16	750,000.00	851,235.35	
T 5.0% 05/15/37	1,250,000.00	1,640,087.88	
T 5.125% 05/15/16	2,000,000.00	2,267,773.44	
T 5.25% 02/15/29	1,600,000.00	2,094,187.50	
T 5.25% 11/15/28	3,350,000.00	4,380,386.73	
T 5.375% 02/15/31	4,380,000.00	5,871,338.66	
T 5.5% 08/15/28	2,250,000.00	3,011,308.60	
T 6.0% 02/15/26	1,440,000.00	1,988,353.12	
T 6.125% 11/15/27	3,700,000.00	5,218,445.33	
T 6.25% 05/15/30	2,520,000.00	3,670,586.71	
T 6.25% 08/15/23	4,100,000.00	5,649,111.32	
T 6.5% 11/15/26	1,150,000.00	1,662,468.75	
T 7.125% 02/15/23	1,450,000.00	2,100,829.10	
T 7.25% 05/15/16	1,670,000.00	1,996,726.36	
T 7.25% 08/15/22	1,000,000.00	1,446,542.97	
T 7.5% 11/15/16	8,250,000.00	10,164,902.38	
T 7.5% 11/15/24	2,690,000.00	4,098,257.04	
T 8.0% 11/15/21	6,100,000.00	9,053,138.64	
T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,533,203.12	
T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,682,914.05	
アメリカドル小計		1,665,050,000.00	1,743,016,346.80 (170,327,557,409)
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	3,850,000.00	3,842,184.50
	CAN 1% 05/01/15	1,000,000.00	997,660.00
	CAN 1% 11/01/14	2,100,000.00	2,096,388.00
	CAN 1.25% 02/01/16	2,400,000.00	2,401,344.00
	CAN 1.25% 03/01/18	2,350,000.00	2,316,594.75
	CAN 1.5% 03/01/17	3,930,000.00	3,937,918.95
	CAN 1.5% 06/01/23	3,350,000.00	3,158,095.25
	CAN 1.5% 08/01/15	1,400,000.00	1,410,815.00
	CAN 1.5% 09/01/17	2,000,000.00	1,997,190.00
	CAN 2% 06/01/16	1,200,000.00	1,224,918.00
	CAN 2% 12/01/14	8,360,000.00	8,466,464.60

	CAN 2.25% 08/01/14	3,800,000.00	3,848,754.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	4,080,000.00	4,188,936.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	4,100,000.00	4,333,659.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,410,000.00	3,560,500.35	
	CAN 3% 12/01/15	2,310,000.00	2,411,108.70	
	CAN 3.0% 06/01/14	7,400,000.00	7,534,569.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	3,400,000.00	3,721,691.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	3,750,000.00	4,149,412.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,450,000.00	4,036,983.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	5,850,000.00	6,515,466.75	
	CAN 4% 06/01/16	5,050,000.00	5,449,227.75	
	CAN 4% 06/01/17	4,200,000.00	4,605,993.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	5,150,000.00	6,442,263.75	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,500,000.00	2,816,775.00	
	CAN 4.5% 06/01/15	3,100,000.00	3,303,515.00	
	CAN 5% 06/01/14	790,000.00	819,625.00	
	CAN 5% 06/01/37	4,050,000.00	5,676,419.25	
	CAN 5.75% 06/01/29	3,700,000.00	5,275,515.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	3,800,000.00	5,620,542.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,690,000.00	2,815,759.70	
	カナダドル小計	107,520,000.00	118,976,289.30 (11,418,154,484)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,900,000.00	1,790,218.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,850,000.00	1,808,217.75	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,050,000.00	981,015.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	4,250,000.00	4,520,533.75	
	ACGB 4.5% 04/15/20	5,500,000.00	6,002,452.50	
	ACGB 4.5% 10/21/14	3,800,000.00	3,905,640.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	2,690,628.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	4,100,000.00	4,368,796.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,600,000.00	2,735,889.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	4,500,000.00	5,069,227.50	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,490,000.00	3,911,138.30	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,500,000.00	5,330,880.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	5,050,000.00	5,970,286.75	
	ACGB 5.75% 07/15/22	4,700,000.00	5,621,905.00	
	ACGB 6% 02/15/17	5,970,000.00	6,692,071.50	
	ACGB 6.25% 04/15/15	4,850,000.00	5,182,006.75	
ACGB 6.25% 06/15/14	3,700,000.00	3,841,377.00		
	オーストラリアドル小計	64,210,000.00	70,422,282.80 (6,510,540,044)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	5,650,000.00	5,665,848.25	
	UKT 1.25% 07/22/18	600,000.00	603,141.00	

	UKT 1.75% 01/22/17	9,070,000.00	9,392,483.85	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,950,000.00	3,840,446.75	
	UKT 2% 01/22/16	6,060,000.00	6,287,098.50	
	UKT 2.75% 01/22/15	7,040,000.00	7,305,724.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	850,000.00	827,751.25	
	UKT 3.75% 07/22/52	3,970,000.00	4,246,788.40	
	UKT 3.75% 09/07/19	6,630,000.00	7,580,543.10	
	UKT 3.75% 09/07/20	7,150,000.00	8,200,120.50	
	UKT 3.75% 09/07/21	8,140,000.00	9,328,317.90	
	UKT 4% 01/22/60	2,750,000.00	3,136,842.50	
	UKT 4% 03/07/22	5,100,000.00	5,946,421.50	
	UKT 4% 09/07/16	4,400,000.00	4,878,126.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	5,750,000.00	6,769,820.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	5,450,000.00	6,448,739.75	
	UKT 4.25% 09/07/39	4,800,000.00	5,635,032.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	4,000,000.00	4,748,760.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	5,650,000.00	6,627,902.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	6,050,000.00	7,112,924.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	4,500,000.00	5,305,590.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	5,270,000.00	6,273,908.65	
	UKT 4.5% 03/07/19	5,090,000.00	6,008,974.05	
	UKT 4.5% 09/07/34	3,980,000.00	4,848,873.80	
	UKT 4.5% 12/07/42	4,700,000.00	5,756,654.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	5,220,000.00	6,314,581.80	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,090,000.00	5,584,595.30	
	UKT 4.75% 12/07/30	4,980,000.00	6,260,109.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	5,360,000.00	6,792,245.60	
	UKT 5% 03/07/18	6,150,000.00	7,287,688.50	
	UKT 5% 03/07/25	4,950,000.00	6,282,886.50	
	UKT 5.0% 09/07/14	7,650,000.00	8,089,339.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	3,500,000.00	4,965,047.50	
	UKT 8% 06/07/21	4,100,000.00	6,012,875.50	
	UKT 8% 12/07/15	3,080,000.00	3,661,196.00	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,920,000.00	2,545,776.00	
	イギリスポンド小計	178,600,000.00	206,573,174.25 (31,411,516,876)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	1,050,000.00	1,178,094.75	
	SWISS 2.5% 03/12/16	2,200,000.00	2,351,668.00	
	SWISS 3% 01/08/18	2,110,000.00	2,381,061.15	
	SWISS 3% 05/12/19	1,750,000.00	2,025,371.25	
	SWISS 3.75% 06/10/15	1,100,000.00	1,183,875.00	
	SWISS 4% 02/11/23	1,460,000.00	1,897,759.10	
	SWISS 4% 04/08/28	1,650,000.00	2,299,728.75	

	SWISS 4.25% 06/05/17	1,720,000.00	2,001,495.20	
スイスフラン小計		13,040,000.00	15,319,053.20 (1,601,760,202)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	850,000.00	850,765.00	
	SIGB 0.5% 04/01/18	150,000.00	147,630.75	
	SIGB 1.125% 04/01/16	780,000.00	798,712.20	
	SIGB 1.375% 10/01/14	1,490,000.00	1,512,521.35	
	SIGB 2.25% 06/01/21	670,000.00	700,706.10	
	SIGB 2.375% 04/01/17	1,510,000.00	1,611,170.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,240,000.00	1,334,946.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	873,738.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,800,000.00	1,898,424.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	900,000.00	938,970.00	
	SIGB 3% 09/01/24	1,100,000.00	1,191,338.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,500,000.00	1,666,477.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,410,000.00	1,579,136.55	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,500,000.00	1,692,030.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,850,000.00	1,917,210.50	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,390,000.00	1,539,487.55	
SIGB 4% 09/01/18	1,150,000.00	1,328,813.50		
シンガポールドル小計		20,190,000.00	21,582,078.30 (1,688,365,985)	
マレーシアリン ギット	MGS 3.172% 07/15/16	650,000.00	652,931.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	2,960,000.00	2,973,897.20	
	MGS 3.26% 03/01/18	2,050,000.00	2,060,403.75	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,800,000.00	1,796,967.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	2,280,000.00	2,294,193.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,613,984.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	4,750,000.00	4,803,176.25	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,680,000.00	1,657,488.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	3,350,000.00	3,399,446.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	2,830,000.00	2,868,459.70	
	MGS 3.814% 02/15/17	3,530,000.00	3,603,441.65	
	MGS 3.835% 08/12/15	4,800,000.00	4,885,944.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,590,000.00	1,647,136.65	
	MGS 4.127% 04/15/32	250,000.00	262,768.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	4,610,000.00	4,841,859.95	
	MGS 4.24% 02/07/18	9,470,000.00	9,878,583.15	
	MGS 4.262% 09/15/16	7,610,000.00	7,869,957.60	
	MGS 4.378% 11/29/19	6,400,000.00	6,779,104.00	
MGS 4.392% 04/15/26	3,660,000.00	3,968,794.20		
MGS 5.248% 09/15/28	2,050,000.00	2,438,065.00		

マレーシアリングット小計		67,920,000.00	70,296,601.35 (2,211,531,078)
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	15,000,000.00	14,396,325.00
	SGB 3% 07/12/16	13,850,000.00	14,661,125.25
	SGB 3.5% 03/30/39	13,800,000.00	15,720,960.00
	SGB 3.5% 06/01/22	20,120,000.00	22,893,441.40
	SGB 3.75% 08/12/17	18,820,000.00	20,758,648.20
	SGB 4.25% 03/12/19	21,100,000.00	24,338,639.00
	SGB 4.5% 08/12/15	20,750,000.00	22,325,236.25
	SGB 5% 12/01/20	14,750,000.00	18,166,100.00
スウェーデンクローナ小計		138,190,000.00	153,260,475.10 (2,280,515,869)
ノルウェークローネ	NGB 2% 05/24/23	7,600,000.00	7,457,348.00
	NGB 3.75% 05/25/21	15,000,000.00	16,931,550.00
	NGB 4.25% 05/19/17	15,850,000.00	17,433,177.25
	NGB 4.5% 05/22/19	14,250,000.00	16,417,995.00
	NGB 5% 05/15/15	21,850,000.00	23,358,196.25
ノルウェークローネ小計		74,550,000.00	81,598,266.50 (1,383,906,599)
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,100,000.00	8,989,162.00
	DGB 2% 11/15/14	12,170,000.00	12,509,968.95
	DGB 2.5% 11/15/16	9,000,000.00	9,673,695.00
	DGB 3% 11/15/21	28,220,000.00	32,199,161.10
	DGB 4% 11/15/15	30,820,000.00	33,706,755.30
	DGB 4% 11/15/17	15,500,000.00	17,894,362.50
	DGB 4% 11/15/19	25,950,000.00	31,074,606.00
	DGB 4.5% 11/15/39	34,450,000.00	49,770,431.75
	DGB 7% 11/10/24	7,350,000.00	11,515,649.25
デンマーククローネ小計		172,560,000.00	207,333,791.85 (3,595,167,950)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	17,950,000.00	25,610,970.25
	MBONO 10% 12/05/24	28,700,000.00	40,071,370.50
	MBONO 5% 06/15/17	19,250,000.00	19,529,991.25
	MBONO 6% 06/18/15	33,800,000.00	34,981,648.00
	MBONO 6.25% 06/16/16	32,550,000.00	34,204,191.00
	MBONO 6.5% 06/09/22	20,550,000.00	22,177,560.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	30,530,000.00	33,076,354.65
	MBONO 7% 06/19/14	18,400,000.00	18,954,484.00
	MBONO 7.25% 12/15/16	22,500,000.00	24,525,225.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	24,600,000.00	28,716,810.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	20,100,000.00	23,428,258.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	12,750,000.00	14,830,353.75
	MBONO 7.75% 12/14/17	28,200,000.00	31,722,180.00

	MBONO 8% 06/11/20	38,260,000.00	44,877,832.20	
	MBONO 8% 12/07/23	13,150,000.00	15,885,528.75	
	MBONO 8% 12/17/15	27,050,000.00	29,453,933.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,540,000.00	47,335,312.20	
	MBONO 8.5% 11/18/38	34,300,000.00	43,140,310.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	13,000,000.00	15,312,245.00	
	MBONO 9.5% 12/18/14	36,650,000.00	39,567,889.75	
	メキシコペソ小計	509,830,000.00	587,402,448.80 (4,499,502,757)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 07/25/14	1,950,000.00	1,893,537.75	
	POLGB 0% 07/25/15	1,150,000.00	1,083,852.00	
	POLGB 2.5% 07/25/18	4,600,000.00	4,433,549.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	6,500,000.00	6,640,887.50	
	POLGB 4% 10/25/23	3,500,000.00	3,582,565.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	6,700,000.00	7,100,861.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,540,000.00	5,847,137.60	
	POLGB 5% 04/25/16	7,860,000.00	8,301,221.10	
	POLGB 5.25% 10/25/17	9,170,000.00	9,943,856.30	
	POLGB 5.25% 10/25/20	7,150,000.00	7,956,806.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	9,600,000.00	10,061,856.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	8,200,000.00	9,193,184.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	3,370,000.00	4,082,081.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,900,000.00	9,188,134.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	6,220,000.00	7,177,071.40	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,800,000.00	9,473,508.00	
	ポーランドズロチ小計	98,210,000.00	105,960,108.15 (3,229,664,096)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	37,000,000.00	44,839,745.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	19,400,000.00	22,360,731.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	21,150,000.00	15,872,229.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	16,250,000.00	12,294,181.25	
	SAGB 6.75% 03/31/21	27,600,000.00	26,705,070.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,800,000.00	14,439,432.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	27,600,000.00	27,696,324.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,150,000.00	6,222,939.00	
	SAGB 8% 12/21/18	23,000,000.00	24,092,040.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	24,000,000.00	25,304,040.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	8,050,000.00	7,911,942.50	
	SAGB 8.75% 12/21/14	6,950,000.00	7,251,838.50	
	南アフリカランド小計	233,950,000.00	234,990,512.25 (2,284,107,779)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	2,050,000.00	2,055,688.75	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,400,000.00	1,390,151.00	

BGB 2.75% 03/28/16	1,740,000.00	1,845,644.10	
BGB 3% 09/28/19	1,890,000.00	2,063,020.05	
BGB 3.25% 09/28/16	4,350,000.00	4,715,247.75	
BGB 3.5% 03/28/15	2,100,000.00	2,219,196.00	
BGB 3.5% 06/28/17	3,670,000.00	4,042,706.85	
BGB 3.75% 09/28/15	4,650,000.00	5,004,330.00	
BGB 3.75% 09/28/20	6,200,000.00	7,069,922.00	
BGB 4% 03/28/18	3,550,000.00	4,035,196.25	
BGB 4% 03/28/22	5,340,000.00	6,173,387.10	
BGB 4% 03/28/32	1,950,000.00	2,216,058.00	
BGB 4.0% 03/28/17	3,350,000.00	3,743,725.50	
BGB 4.0% 03/28/19	3,150,000.00	3,617,633.25	
BGB 4.25% 03/28/41	3,400,000.00	4,001,953.00	
BGB 4.25% 09/28/14	3,800,000.00	3,999,120.00	
BGB 4.25% 09/28/21	3,100,000.00	3,648,886.00	
BGB 4.25% 09/28/22	3,500,000.00	4,110,400.00	
BGB 4.5% 03/28/26	2,500,000.00	3,001,225.00	
BGB 5% 03/28/35	5,200,000.00	6,726,252.00	
BGB 5.5% 03/28/28	4,970,000.00	6,606,471.90	
BGB 5.5% 09/28/17	2,380,000.00	2,832,985.40	
BGB 8.0% 03/28/15	2,010,000.00	2,285,430.30	
BKO 0% 06/13/14	3,100,000.00	3,097,551.00	
BKO 0% 12/12/14	7,200,000.00	7,185,924.00	
BTNS 0.75% 09/25/14	470,000.00	473,496.80	
BTNS 1% 07/25/17	3,890,000.00	3,914,915.45	
BTNS 1.75% 02/25/17	6,000,000.00	6,224,490.00	
BTNS 2% 07/12/15	8,590,000.00	8,888,631.35	
BTNS 2.25% 02/25/16	7,740,000.00	8,107,727.40	
BTNS 2.5% 01/15/15	9,250,000.00	9,583,277.50	
BTNS 2.5% 07/25/16	7,010,000.00	7,423,344.65	
BTNS 3% 07/12/14	12,730,000.00	13,121,765.75	
BTPS 2.25% 05/15/16	750,000.00	750,851.25	
BTPS 2.5% 03/01/15	3,200,000.00	3,253,344.00	
BTPS 3% 04/15/15	8,100,000.00	8,303,998.50	
BTPS 3% 06/15/15	8,510,000.00	8,719,728.95	
BTPS 3% 11/01/15	8,200,000.00	8,399,178.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	7,220,000.00	7,401,185.90	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	2,971,992.50	
BTPS 3.75% 03/01/21	5,240,000.00	5,298,976.20	
BTPS 3.75% 04/15/16	5,330,000.00	5,566,731.95	
BTPS 3.75% 08/01/15	9,130,000.00	9,479,313.80	
BTPS 3.75% 08/01/16	8,430,000.00	8,792,110.65	
BTPS 3.75% 08/01/21	13,100,000.00	13,257,658.50	

BTPS 4% 02/01/17	8,150,000.00	8,554,362.25	
BTPS 4% 02/01/37	7,270,000.00	6,673,605.55	
BTPS 4% 09/01/20	6,250,000.00	6,429,812.50	
BTPS 4.25% 02/01/15	8,800,000.00	9,202,644.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	9,520,000.00	10,020,228.40	
BTPS 4.25% 03/01/20	7,700,000.00	8,037,298.50	
BTPS 4.25% 07/01/14	5,490,000.00	5,678,471.70	
BTPS 4.25% 08/01/14	4,170,000.00	4,320,495.30	
BTPS 4.25% 09/01/19	8,050,000.00	8,448,636.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	9,100,000.00	9,712,566.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	5,620,000.00	5,948,264.20	
BTPS 4.5% 03/01/19	8,050,000.00	8,562,382.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,600,000.00	4,706,628.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,108,199.50	
BTPS 4.5% 07/15/15	1,410,000.00	1,485,590.10	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,130,000.00	6,539,851.80	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,160,000.00	3,390,806.40	
BTPS 4.75% 06/01/17	1,000,000.00	1,072,865.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	6,130,000.00	6,460,437.65	
BTPS 4.75% 09/01/21	8,350,000.00	8,922,142.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	900,000.00	925,555.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,469,475.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	5,450,000.00	5,843,953.25	
BTPS 5% 03/01/22	8,340,000.00	8,998,734.90	
BTPS 5% 03/01/25	7,200,000.00	7,681,428.00	
BTPS 5% 08/01/34	6,350,000.00	6,580,727.25	
BTPS 5% 09/01/40	6,140,000.00	6,288,649.40	
BTPS 5.0% 08/01/39	6,030,000.00	6,212,618.55	
BTPS 5.25% 08/01/17	11,070,000.00	12,113,126.10	
BTPS 5.25% 11/01/29	9,300,000.00	10,013,728.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,950,000.00	4,378,180.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,350,000.00	4,818,190.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,900,000.00	4,420,864.50	
BTPS 6% 05/01/31	10,070,000.00	11,707,835.15	
BTPS 6% 11/15/14	2,700,000.00	2,880,400.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	8,310,000.00	10,028,840.40	
BTPS 7.25% 11/01/26	2,600,000.00	3,333,109.00	
BTPS 9% 11/01/23	3,920,000.00	5,497,408.00	
DBR 1.5% 02/15/23	900,000.00	899,653.50	
DBR 1.5% 05/15/23	3,050,000.00	3,037,723.75	
DBR 1.5% 09/04/22	4,000,000.00	4,024,980.00	
DBR 1.75% 07/04/22	8,740,000.00	9,006,963.30	
DBR 2% 01/04/22	5,690,000.00	6,022,153.75	

DBR 2.25% 09/04/20	10,630,000.00	11,563,898.65	
DBR 2.25% 09/04/21	3,820,000.00	4,133,507.40	
DBR 2.5% 01/04/21	5,000,000.00	5,521,975.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,100,000.00	2,156,962.50	
DBR 3% 07/04/20	6,720,000.00	7,661,808.00	
DBR 3.25% 01/04/20	6,500,000.00	7,487,610.00	
DBR 3.25% 07/04/15	9,300,000.00	9,889,573.50	
DBR 3.25% 07/04/21	4,250,000.00	4,932,698.75	
DBR 3.25% 07/04/42	4,900,000.00	5,832,641.50	
DBR 3.5% 01/04/16	9,050,000.00	9,809,838.00	
DBR 3.5% 07/04/19	6,060,000.00	7,033,054.20	
DBR 3.75% 01/04/15	6,140,000.00	6,487,616.10	
DBR 3.75% 01/04/17	6,400,000.00	7,174,304.00	
DBR 3.75% 01/04/19	8,000,000.00	9,330,440.00	
DBR 4% 07/04/16	5,600,000.00	6,234,676.00	
DBR 4.0% 01/04/18	5,820,000.00	6,735,456.90	
DBR 4.0% 01/04/37	6,700,000.00	8,729,128.50	
DBR 4.25% 07/04/14	4,610,000.00	4,813,393.20	
DBR 4.25% 07/04/17	7,010,000.00	8,090,100.80	
DBR 4.25% 07/04/18	6,530,000.00	7,714,378.75	
DBR 4.25% 07/04/39	4,390,000.00	6,026,877.35	
DBR 4.75% 07/04/28	2,950,000.00	3,988,001.75	
DBR 4.75% 07/04/34	6,050,000.00	8,548,105.50	
DBR 4.75% 07/04/40	5,270,000.00	7,808,690.75	
DBR 5.5% 01/04/31	5,330,000.00	7,898,420.40	
DBR 5.625% 01/04/28	3,860,000.00	5,628,150.20	
DBR 6% 06/20/16	900,000.00	1,054,494.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,650,000.00	3,857,220.75	
DBR 6.25% 01/04/30	2,600,000.00	4,091,542.00	
DBR 6.5% 07/04/27	3,850,000.00	6,025,057.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,100,000.00	2,091,190.50	
FRTR 1% 05/25/18	2,000,000.00	1,999,130.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,350,000.00	7,493,876.25	
FRTR 2.5% 10/25/20	10,490,000.00	11,200,068.10	
FRTR 3% 04/25/22	9,800,000.00	10,677,786.00	
FRTR 3% 10/25/15	10,200,000.00	10,830,156.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	9,300,000.00	10,023,447.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,100,000.00	1,103,883.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,150,000.00	5,742,662.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	9,200,000.00	9,750,022.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	9,960,000.00	11,324,221.20	
FRTR 3.5% 04/25/26	10,100,000.00	11,185,851.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	10,190,000.00	11,348,042.55	

FRTR 3.75% 04/25/21	12,220,000.00	14,111,411.60	
FRTR 3.75% 10/25/19	11,050,000.00	12,710,262.50	
FRTR 4% 04/25/18	8,410,000.00	9,627,347.50	
FRTR 4% 04/25/55	4,500,000.00	5,195,565.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,700,000.00	3,120,714.00	
FRTR 4% 10/25/14	2,410,000.00	2,535,573.05	
FRTR 4% 10/25/38	6,950,000.00	8,032,080.25	
FRTR 4.25% 04/25/19	10,400,000.00	12,207,832.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	8,230,000.00	9,419,070.40	
FRTR 4.25% 10/25/18	8,470,000.00	9,868,100.55	
FRTR 4.25% 10/25/23	11,650,000.00	13,876,256.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	7,430,000.00	9,297,493.35	
FRTR 4.75% 04/25/35	6,300,000.00	8,043,210.00	
FRTR 5% 10/25/16	9,810,000.00	11,236,619.25	
FRTR 5.5% 04/25/29	7,450,000.00	10,104,397.75	
FRTR 5.75% 10/25/32	7,030,000.00	10,019,648.10	
FRTR 6.0% 10/25/25	5,040,000.00	6,972,789.60	
FRTR 8.5% 04/25/23	4,090,000.00	6,441,688.65	
FRTR 8.5% 10/25/19	3,060,000.00	4,415,182.20	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,300,000.00	1,294,260.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,200,000.00	2,336,477.00	
IRISH 4.5% 02/18/15	950,000.00	1,007,603.25	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,750,000.00	3,969,525.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	2,840,000.00	3,064,345.80	
IRISH 4.6% 04/18/16	3,590,000.00	3,877,720.55	
IRISH 5% 10/18/20	2,930,000.00	3,184,748.85	
IRISH 5.4% 03/13/25	3,500,000.00	3,861,882.50	
IRISH 5.5% 10/18/17	1,200,000.00	1,344,000.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,750,000.00	1,997,695.00	
NETHER 0% 04/15/16	1,600,000.00	1,579,816.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	3,320,000.00	3,350,876.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	3,200,000.00	3,260,560.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,800,000.00	1,777,599.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	4,480,000.00	4,686,483.20	
NETHER 2.5% 01/15/17	4,140,000.00	4,416,531.30	
NETHER 2.5% 01/15/33	3,110,000.00	3,116,904.20	
NETHER 2.75% 01/15/15	5,300,000.00	5,514,544.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	5,040,000.00	5,351,446.80	
NETHER 3.25% 07/15/21	4,560,000.00	5,161,350.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	4,350,000.00	4,991,559.75	
NETHER 3.75% 01/15/23	3,050,000.00	3,582,087.75	
NETHER 3.75% 01/15/42	4,050,000.00	5,041,743.75	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,900,000.00	5,093,329.50	

NETHER 4% 01/15/37	3,850,000.00	4,865,206.50	
NETHER 4% 07/15/16	4,300,000.00	4,762,508.00	
NETHER 4% 07/15/19	4,000,000.00	4,676,020.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	4,700,000.00	5,418,888.50	
NETHER 4.5% 07/15/17	5,310,000.00	6,122,536.20	
NETHER 5.5% 01/15/28	3,850,000.00	5,404,995.75	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,120,000.00	1,688,680.00	
OBL 0.25% 04/13/18	2,500,000.00	2,459,912.50	
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,041,963.25	
OBL 0.5% 04/07/17	4,860,000.00	4,879,585.80	
OBL 0.5% 10/13/17	2,800,000.00	2,803,094.00	
OBL 0.75% 02/24/17	6,570,000.00	6,662,702.70	
OBL 1.25% 10/14/16	5,620,000.00	5,797,704.40	
OBL 1.75% 10/09/15	4,980,000.00	5,161,247.10	
OBL 2% 02/26/16	3,800,000.00	3,982,305.00	
OBL 2.25% 04/10/15	9,650,000.00	10,018,871.25	
OBL 2.5% 02/27/15	6,970,000.00	7,250,681.90	
OBL 2.5% 10/10/14	6,700,000.00	6,912,323.00	
OBL 2.75% 04/08/16	2,450,000.00	2,622,859.75	
RAGB 1.95% 06/18/19	1,150,000.00	1,205,251.75	
RAGB 3.15% 06/20/44	950,000.00	1,044,064.25	
RAGB 3.2% 02/20/17	2,700,000.00	2,955,528.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	2,650,000.00	2,766,679.50	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,450,000.00	1,652,441.75	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,980,000.00	4,247,595.30	
RAGB 3.5% 09/15/21	5,190,000.00	5,959,287.75	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,200,000.00	2,549,338.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	900,000.00	1,154,358.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	4,410,000.00	5,167,638.00	
RAGB 4% 09/15/16	3,500,000.00	3,896,497.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	3,600,000.00	4,590,198.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	3,100,000.00	3,241,298.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,950,000.00	2,240,745.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	3,810,000.00	4,505,801.25	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,500,000.00	4,103,295.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,700,000.00	3,517,128.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,540,000.00	3,764,559.40	
RFGB 1.5% 04/15/23	1,150,000.00	1,119,542.25	
RFGB 1.625% 09/15/22	1,200,000.00	1,193,802.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	1,860,000.00	1,933,191.00	
RFGB 1.875% 04/15/17	1,550,000.00	1,624,702.25	
RFGB 2.75% 07/04/28	1,200,000.00	1,274,112.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,950,000.00	2,023,661.25	

RFGB 3.375% 04/15/20	2,200,000.00	2,508,671.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,920,000.00	2,213,020.80	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,750,000.00	1,983,231.25	
RFGB 4% 07/04/25	1,850,000.00	2,239,785.75	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,500,000.00	1,623,750.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,100,000.00	1,313,141.50	
SPGB 3% 04/30/15	5,360,000.00	5,445,358.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	8,300,000.00	8,418,150.50	
SPGB 3.25% 04/30/16	5,860,000.00	5,953,818.60	
SPGB 3.3% 07/30/16	3,000,000.00	3,040,950.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	9,250,000.00	9,457,385.00	
SPGB 3.75% 10/31/15	3,150,000.00	3,239,523.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	6,490,000.00	6,659,032.05	
SPGB 4% 04/30/20	5,700,000.00	5,701,197.00	
SPGB 4% 07/30/15	5,250,000.00	5,431,413.75	
SPGB 4.1% 07/30/18	5,200,000.00	5,375,006.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	4,900,000.00	4,263,392.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	6,770,000.00	7,046,182.15	
SPGB 4.3% 10/31/19	5,850,000.00	6,006,955.50	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,420,000.00	7,728,301.00	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,500,000.00	2,460,587.50	
SPGB 4.5% 01/31/18	4,800,000.00	5,037,888.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	5,750,000.00	6,022,952.50	
SPGB 4.65% 07/30/25	4,550,000.00	4,506,502.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	3,590,000.00	3,350,493.15	
SPGB 4.75% 07/30/14	3,920,000.00	4,065,490.80	
SPGB 4.8% 01/31/24	4,730,000.00	4,783,472.65	
SPGB 4.85% 10/31/20	6,850,000.00	7,170,991.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	3,800,000.00	3,661,224.00	
SPGB 5.4% 01/31/23	4,400,000.00	4,690,686.00	
SPGB 5.5% 04/30/21	8,330,000.00	9,068,287.90	
SPGB 5.5% 07/30/17	5,390,000.00	5,871,569.55	
SPGB 5.75% 07/30/32	4,600,000.00	4,999,786.00	
SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,271,732.40	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,900,000.00	2,089,810.00	
SPGB 6.0% 01/31/29	5,220,000.00	5,808,946.50	
ユーロ小計	1,254,220,000.00	1,385,980,186.30 (179,096,359,673)	
国債証券合計		421,538,650,801 (421,538,650,801)	
合計		421,538,650,801 (421,538,650,801)	

(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 201銘柄	100.0%	40.4%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.7%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.5%
イギリスポンド	国債証券 36銘柄	100.0%	7.5%
スイスフラン	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 20銘柄	100.0%	1.1%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
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 253銘柄	100.0%	42.5%

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成25年6月28日現在)

資産総額	2,448,185,671 円
負債総額	1,074,861 円
純資産総額(-)	2,447,110,810 円
発行済口数	2,309,290,872 口
1口当たり純資産額(/)	1.0597 円
1万口当たり純資産額	10,597 円

(参考情報)

日本株式マザーファンド

資産総額	303,213,421,385 円
負債総額	3,302,991,409 円
純資産総額(-)	299,910,429,976 円
発行済口数	281,766,665,157 口
1口当たり純資産額(/)	1.0644 円
1万口当たり純資産額	10,644 円

外国株式マザーファンド

資産総額	298,521,898,233 円
負債総額	894,265,429 円
純資産総額(-)	297,627,632,804 円
発行済口数	209,323,633,174 口
1口当たり純資産額(/)	1.4219 円
1万口当たり純資産額	14,219 円

外国債券マザーファンド

資産総額	416,275,860,808 円
負債総額	1,285,698,256 円
純資産総額(-)	414,990,162,552 円
発行済口数	213,946,626,792 口
1口当たり純資産額(/)	1.9397 円
1万口当たり純資産額	19,397 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）投資信託受益証券の名義書換等

委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、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）振替受益権に関する記載

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。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

受益権の譲渡

A．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。

B．上記A．の申請のある場合には、上記A．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A．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。

C．上記A．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て）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け、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25年6月28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年間にお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発送します。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）]

運用部門において各運用部から独立した運用企画部は、ファンド品質の維持・向上の観点から、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）にパフォーマンス等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）及びコンプライアンス会議（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25年9月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成25年6月28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	317	4,352,908
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	180
単位型公社債投資信託	0	0
合計	319	4,353,089

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。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25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。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	4,826,115	8,192,444
前払費用	30,184	81,751
未収委託者報酬	944,716	2,210,605
未収運用受託報酬	26,998	31,051
未収入金	75,514	676
一年以内返還予定保証金	187,128	-
繰延税金資産	69,857	61,743
その他	31,325	19,263
流動資産合計	6,191,840	10,597,535
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 3,525	1 79,281
器具備品	1 14,970	1 103,209
建設仮勘定	62,454	-
有形固定資産合計	80,949	182,491
無形固定資産		
ソフトウェア	60,130	168,561
ソフトウェア仮勘定	12,151	-
その他無形固定資産	928	1,770
無形固定資産合計	73,209	170,332
投資その他の資産		
投資有価証券	43,194	47,112
長期前払費用	357	-
長期貸付金	-	31,838
会員権	-	25,000
その他の投資	165	633
貸倒引当金	-	31,838
投資その他の資産合計	43,717	72,746
固定資産合計	197,876	425,570
資産合計	6,389,717	11,023,105

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		

預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
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
資本剰余金合計	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
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	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410
負債・純資産合計	6,389,717	11,023,105

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

前事業年度	当事業年度
(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

営業収益			
委託者報酬	7,821,113	19,128,296	
運用受託報酬	98,179	94,659	
営業収益合計	7,919,292	19,222,955	
営業費用			
支払手数料	3,715,816	9,030,246	
広告宣伝費	61,165	73,287	
公告費	2,451	2,244	
調査費	1,023,870	4,132,154	
調査費	86,225	207,030	
委託調査費	936,024	3,922,394	
図書費	1,620	2,729	
営業雑経費	610,455	1,294,879	
通信費	10,764	21,905	
印刷費	121,287	330,735	
協会費	10,136	21,939	
諸会費	803	757	
情報機器関連費	436,328	874,151	
その他営業雑経費	31,135	45,391	
営業費用合計	5,413,759	14,532,812	
一般管理費			
給料	1,276,685	2,259,238	
役員報酬	35,160	78,205	
給料・手当	1,048,061	1,967,177	
賞与	193,464	213,855	
退職給付費用	66,790	64,787	
福利費	152,149	190,716	
交際費	1,012	879	
旅費交通費	25,687	45,160	
租税公課	16,148	25,420	
不動産賃借料	238,033	129,096	
寄付金	2,832	-	
減価償却費	55,540	129,966	
敷金償却	2,804	-	
諸経費	81,858	1	257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213	
営業利益	585,991	1,586,929	

(単位：千円)

前事業年度

(自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日)

当事業年度

(自 平成24年4月1日
至 平成25年3月31日)

営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000

利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		

剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
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）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

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。

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

(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、当期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、当期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24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
建 物	84,592	千円	23,594	千円
器具備品	127,549	"	235,212	"
計	212,142	"	258,807	"

(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23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
諸経費		千円	97,199	千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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	-

(注) (1) 普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（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

平成25年6月28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通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

(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24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	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(*)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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(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

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) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24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	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（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	-	-	-

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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23年4月1日 至 平成24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
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（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

（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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
(1) 退職給付債務	199,976	268,531
(2) 退職給付引当金	199,976	268,531

(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。

(注) 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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
(1) 退職給付費用	66,790	64,787

(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。

(注) 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12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

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

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
法定実効税率	40.69 %	- %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

当事業年度は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。

（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

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。

（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23年4月1日 至 平成24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	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-
-----	----------------------	---------	---------	------	----------	-------	-----------	--------	---	---

(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

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（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。

(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23年4月1日 至 平成24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	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	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	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

(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。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（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。

3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(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24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）

(企業結合等関係)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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

当社を吸収合併継続会社、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。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の実取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社は、平成25年4月1日に取締役の役位としての会長を削除しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成25年9月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成25年3月末日現在）

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年3月末日現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付け、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25年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に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25年8月9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」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成24年6月12日から平成25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、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成25年6月10日現在の信託財産の状況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．財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7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	高波博之 印
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24年4月1日から平成25年3月31日までの第27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25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

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。