

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年10月25日
【計算期間】	第3期（自 平成24年7月26日 至 平成25年7月25日）
【ファンド名】	インデックスコレクション（バランス株式30） インデックスコレクション（バランス株式50） インデックスコレクション（バランス株式70）
【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・レポーティング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【電話番号】	03-6737-0521
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

- ・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 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド ・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合 (株式、債券)資産配分固定 型))		中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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/>)にてご確認ください。

<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。

④ ファンドの特色

A. 資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

- 資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

インデックスコレクション（バランス株式30）（以下「バランス株式30」という場合があります。）

インデックスコレクション（バランス株式50）（以下「バランス株式50」という場合があります。）

インデックスコレクション（バランス株式70）（以下「バランス株式70」という場合があります。）

B. 国内外の株式・公社債へ分散投資します。

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、日本債券マザーファンド、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、国内外の株式及び公社債へ分散投資することにより、長期的な信託財産の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）

日本債券マザーファンド：「NOMURA-BPI総合」

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）」

※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。

※「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）について

「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」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。

- ①同指数の指数値及び同指数の商標は、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・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。
- ②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ⑤当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※NOMURA－BPPI 総合について

「NOMURA－BPPI 総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※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。

C. 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。

D. 基本配分比率は以下の通りとします。



（２）【ファンドの沿革】

平成22年10月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（バランス株式30）からインデックスコレクション（バランス株式30）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式50）からインデックスコレクション（バランス株式50）、中央三井インデックスコレクション（バランス株式70）からインデックスコレクション（バランス株式70）に変更

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

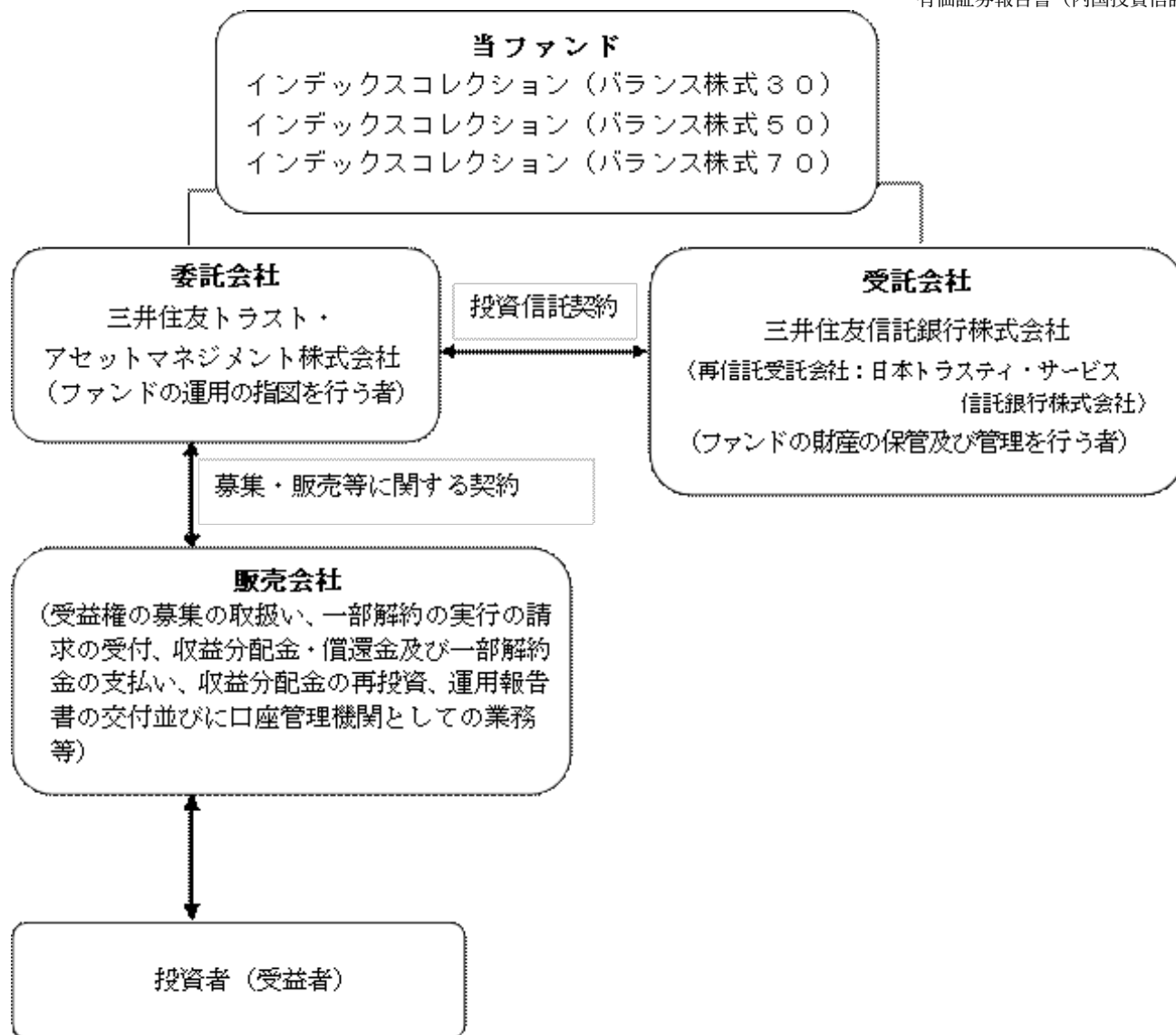
（３）【ファンドの仕組み】

① 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（インデックスコレクション（バランス株式30）、インデックスコレクション（バランス株式50）及びインデックスコレクション（バランス株式70））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、日本債券マザーファンド、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。



② 当ファンドの関係法人



③ 委託会社の概況

A. 資本金の額：3億円（平成25年8月30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8月30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】

① 運用方針

日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドを主要投資対象とし、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

② 投資態度

A. 主として、マザーファンド受益証券に投資し、実質的に国内外の株式・公社債へ分散投資を行うことにより、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

B. 各資産への基本配分比率は以下のとおりです。資産配分の異なる3つのファンドから、皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じてご選択いただけます。

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
バランス株式30	20%	60%	10%	10%
バランス株式50	30%	40%	20%	10%
バランス株式70	40%	25%	30%	5%

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

G. 国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

（2）【投資対象】

① 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）①J.、K. 及びL. に定めるものに限り。）

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

② 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」、
「日本債券マザーファンド」、「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
証書

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します。）

17. 預託証書（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書

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
証券に限りします。）

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。

③ 運用指図できる金融商品

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

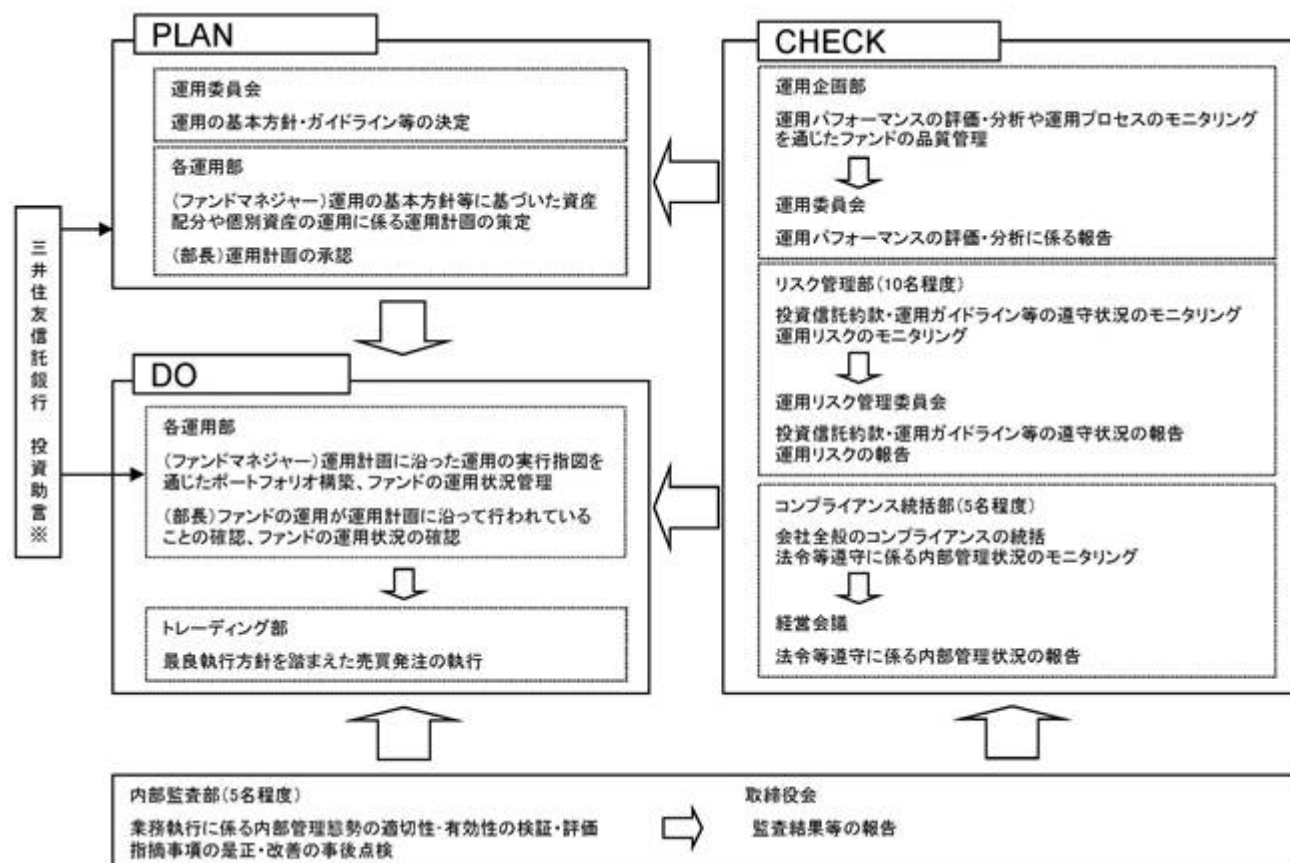
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、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10月25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各ファンドの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。

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●ファンド毎にあらかじめ定められた基本配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

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】

① 分配方針

年１回の毎決算時（決算日は７月２５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。

② 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 ①」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。

③ 収益分配金の再投資等

収益分配金は、自動的に当ファンドの受益権に再投資されます。

- A. 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。
- B. 販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、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（上記A. の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、上記A. の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します。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。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。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

A. 株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において以下のとおりとします。

- バランス株式 30 ……信託財産の純資産総額の40%以下
- バランス株式 50 ……信託財産の純資産総額の60%以下
- バランス株式 70 ……信託財産の純資産総額の80%以下

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、取得時において以下のとおりとします。

- バランス株式 30 ……信託財産の純資産総額の30%以下
- バランス株式 50 ……信託財産の純資産総額の40%以下
- バランス株式 70 ……信託財産の純資産総額の45%以下

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。）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（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）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）で所有権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号ロに規定する

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します。

J. 先物取引等の運用指図

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

ロ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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、信託財産の効率的な運用に資するため、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、金利先渡し取引及び為替先渡し取引の評価は、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。

二、委託会社は、金利先渡し取引及び為替先渡し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ますものとしてします。

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。

二、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、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。

ハ、収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

二、借入金の利息は信託財産中から支弁します。

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っ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I. からO. 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I. からO. 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。

② 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

ロ. 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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は、行いません。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取

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

- ⑥ 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。
- ⑦ 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

- ① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資は、行いません。
- ④ 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

- ① MSCIコクサイ指数に採用されている国の株式に投資を行い、同指数（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 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。
- ③ 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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

- ① 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ② 株式への投資割合には制限を設けません。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。
- ⑦ 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。
- ⑧ 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

- ① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ④ 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、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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＞

- ① 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。

- ② 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。

- ③ 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。
- ④ 確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ① 運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。
- ② 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込手数料はありません。

（２）【換金（解約）手数料】

当ファンドには、解約手数料はありません。また当ファンドには、信託財産留保額はありません。

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%
日本債券マザーファンド		0.1%
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%

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

- ① 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。

	総 額	配 分		
		委託会社	販売会社	受託会社
バランス株式30	年率 0.1785% (税抜0.17%)	年率 0.126% (税抜0.12%)	年率 0.0315% (税抜0.03%)	年率 0.021% (税抜0.02%)
バランス株式50	年率 0.189% (税抜0.18%)	年率 0.1365% (税抜0.13%)		
バランス株式70	年率 0.1995% (税抜0.19%)	年率 0.147% (税抜0.14%)		

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。また、消費税率が8%になった場合は、下記の通りとなります。

	総 額	配 分		
		委託会社	販売会社	受託会社
バランス株式30	年率 0.1836% (税抜0.17%)	年率 0.1296% (税抜0.12%)	年率 0.0324% (税抜0.03%)	年率 0.0216% (税抜0.02%)
バランス株式50	年率 0.1944% (税抜0.18%)	年率 0.1404% (税抜0.13%)		
バランス株式70	年率 0.2052% (税抜0.19%)	年率 0.1512% (税抜0.14%)		

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。

- ② 上記①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。
- ③ 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】

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、次のとおりとなります。

① 企業型年金

事業主は、企業型年金の年金資産を管理する資産管理機関と資産管理契約を締結しなければなりません。資産管理契約として信託契約を締結した場合には、当該信託財産について受領する利子等又は配当等には所得税及び地方税を課さないこととされています。従って、当ファンドが資産管理契約としての信託契約の信託財産に組入れられた場合、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。

② 個人型年金

個人型年金の年金資産は国民年金基金連合会のものとされていますので、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について所得税及び地方税が課されることはありません。

（注）企業型年金及び個人型年金の確定拠出年金資産は、特別法人税の課税対象とされていますが、平成26年３月までは課税が凍結されています。

上記は、平成25年８月30日現在のものですので、税法及び確定拠出年金法等が改正された場合等は、上記の内容が変更されることがあります。

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

5【運用状況】

以下の記載は、平成25年8月30日現在の状況について記載してあります。

インデックスコレクション(バランス株式30)

(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	3,133,791,365	99.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,398,321	0.55
合計(純資産総額)		3,151,189,686	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】

①【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	日本債券マザーファンド	1,545,245,462	1.2292	1,899,415,722	1.2361	1,910,077,915	60.61
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	582,689,506	1.1244	655,176,081	1.0388	605,297,858	19.21
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	213,558,745	1.5201	324,630,649	1.4706	314,059,490	9.97
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	156,449,112	1.9909	311,474,538	1.9454	304,356,102	9.66

(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、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	99.45
合計	99.45

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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23年 7月25日)	1,646,934,722	1,646,934,722	10,215	10,215
第2期計算期間末 (平成24年 7月25日)	1,826,441,025	1,826,441,025	10,014	10,014
第3期計算期間末 (平成25年 7月25日)	3,055,855,651	3,055,855,651	12,198	12,198
平成24年 8月末日	1,984,913,469	—	10,152	—
9月末日	2,068,741,629	—	10,241	—
10月末日	2,144,617,171	—	10,295	—
11月末日	2,255,190,752	—	10,504	—
12月末日	2,332,117,993	—	10,842	—
平成25年 1月末日	2,551,325,299	—	11,240	—
2月末日	2,637,268,694	—	11,393	—
3月末日	2,758,271,656	—	11,686	—
4月末日	2,868,555,113	—	12,101	—
5月末日	2,944,843,653	—	12,054	—
6月末日	2,993,482,612	—	11,932	—
7月末日	3,062,336,949	—	12,008	—
8月末日	3,151,189,686	—	11,966	—

②【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22年10月20日～平成23年 7月25日)	0
第2期計算期間(平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	0
第3期計算期間(平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	0

③【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成22年10月20日～平成23年 7月25日)	2.2
第2期計算期間(平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	△2.0
第3期計算期間(平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	21.8

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成22年10月20日～平成23年 7月25日)	1,616,687,950	4,495,116	1,612,192,834
第2期計算期間 (平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	297,421,058	85,659,240	1,823,954,652
第3期計算期間 (平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	946,841,759	265,501,127	2,505,295,284

(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。

インデックスコレクション(バランス株式50)

(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	3,200,143,241	99.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,927,338	0.56
合計(純資産総額)		3,218,070,579	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

①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	日本債券マザーファンド	1,055,855,508	1.2291	1,297,756,066	1.2361	1,305,142,993	40.56
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	889,834,749	1.1266	1,002,548,666	1.0388	924,360,337	28.72
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	443,822,890	1.5227	675,833,715	1.4706	652,685,942	20.28
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	163,438,866	1.9935	325,825,433	1.9454	317,953,969	9.88

(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	99.44
合計	99.44

(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。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③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

①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23年 7月25日)	2,376,072,910	2,376,072,910	10,376	10,376
第2期計算期間末 (平成24年 7月25日)	2,308,448,560	2,308,448,560	9,855	9,855
第3期計算期間末 (平成25年 7月25日)	3,298,797,421	3,298,797,421	13,348	13,348
平成24年 8月末日	2,390,387,887	—	10,104	—
9月末日	2,436,308,611	—	10,237	—
10月末日	2,453,821,318	—	10,314	—
11月末日	2,535,903,654	—	10,614	—
12月末日	2,657,617,977	—	11,142	—
平成25年 1月末日	2,840,254,094	—	11,771	—
2月末日	2,903,865,534	—	11,966	—
3月末日	3,019,131,539	—	12,384	—
4月末日	3,193,354,258	—	13,063	—
5月末日	3,211,882,406	—	13,089	—
6月末日	3,168,452,471	—	12,890	—
7月末日	3,224,786,811	—	13,033	—
8月末日	3,218,070,579	—	12,932	—

②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22年10月20日～平成23年 7月25日)	0
第2期計算期間(平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	0
第3期計算期間(平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	0

③収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成22年10月20日～平成23年 7月25日)	3.8
第2期計算期間(平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	△5.0
第3期計算期間(平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	35.4

(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22年10月20日～平成23年 7月25日)	2,297,761,646	7,893,955	2,289,867,691
第2期計算期間 (平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	190,420,353	137,880,635	2,342,407,409
第3期計算期間 (平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	416,815,707	287,930,717	2,471,292,399

(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。

インデックスコレクション(バランス株式70)

(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	2,287,312,893	99.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,245,716	0.40
合計(純資産総額)		2,296,558,609	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

①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	855,288,608	1.1274	964,337,547	1.0388	888,473,805	38.69
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	477,675,227	1.5222	727,136,076	1.4706	702,469,188	30.59
日本	親投資信託受益証券	日本債券マザーファンド	478,365,669	1.2291	587,966,936	1.2361	591,307,803	25.75
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	54,005,396	1.9930	107,635,396	1.9454	105,062,097	4.57

(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	99.60
合計	99.60

(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。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③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

①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23年 7月25日)	1,465,295,824	1,465,295,824	10,550	10,550

第2期計算期間末 (平成24年 7月25日)	1,392,591,169	1,392,591,169	9,716	9,716
第3期計算期間末 (平成25年 7月25日)	2,374,954,327	2,374,954,327	14,377	14,377
平成24年 8月末日	1,453,328,435	—	10,056	—
9月末日	1,490,178,101	—	10,230	—
10月末日	1,511,473,297	—	10,314	—
11月末日	1,574,538,229	—	10,685	—
12月末日	1,662,007,292	—	11,370	—
平成25年 1月末日	1,815,119,183	—	12,218	—
2月末日	1,922,146,586	—	12,462	—
3月末日	2,046,796,526	—	13,007	—
4月末日	2,187,937,969	—	13,938	—
5月末日	2,277,671,855	—	14,026	—
6月末日	2,210,419,339	—	13,733	—
7月末日	2,302,892,875	—	13,929	—
8月末日	2,296,558,609	—	13,767	—

②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22年10月20日～平成23年 7月25日)	0
第2期計算期間(平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	0
第3期計算期間(平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	0

③収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成22年10月20日～平成23年 7月25日)	5.5
第2期計算期間(平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	△7.9
第3期計算期間(平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	48.0

(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22年10月20日～平成23年 7月25日)	1,395,188,638	6,298,452	1,388,890,186
第2期計算期間 (平成23年 7月26日～平成24年 7月25日)	201,368,030	156,966,363	1,433,291,853
第3期計算期間 (平成24年 7月26日～平成25年 7月25日)	664,273,333	445,609,632	1,651,955,554

(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	268,674,472,020	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,713,500,586	1.00
合計(純資産総額)		271,387,972,606	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

① 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	2,246,100	4,254.04	9,554,999,244	5,940.00	13,341,834,000	4.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	13,071,000	473.08	6,183,628,680	576.00	7,528,896,000	2.77
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,305,000	3,265.33	4,261,255,650	4,350.00	5,676,750,000	2.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,475,000	3,342.85	4,930,703,750	3,545.00	5,228,875,000	1.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	835,700	2,989.49	2,498,316,793	6,190.00	5,172,983,000	1.91
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	22,327,800	169.30	3,780,096,540	200.00	4,465,560,000	1.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,088,600	2,742.56	2,985,550,816	3,335.00	3,630,481,000	1.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	726,500	3,755.88	2,728,646,820	4,995.00	3,628,867,500	1.34
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,208,000	2,138.53	2,583,344,240	2,560.00	3,092,480,000	1.14
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	685,900	4,446.14	3,049,607,426	4,470.00	3,065,973,000	1.13
日本	株式	キャノン	電気機器	1,013,700	3,275.10	3,319,968,870	2,948.00	2,988,387,600	1.10
日本	株式	ファナック	電気機器	182,000	14,201.03	2,584,587,460	15,010.00	2,731,820,000	1.01
日本	株式	三井不動産	不動産業	813,000	2,012.46	1,636,129,980	3,105.00	2,524,365,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,198,000	540.45	2,268,809,100	593.00	2,489,414,000	0.92
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,346,400	1,835.84	2,471,774,976	1,842.00	2,480,068,800	0.91
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	721,800	2,668.32	1,925,993,376	3,385.00	2,443,293,000	0.90
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	321,600	6,005.32	1,931,310,912	7,540.00	2,424,864,000	0.89
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	3,528,300	490.94	1,732,183,602	686.00	2,420,413,800	0.89
日本	株式	KDDI	情報・通信業	486,900	3,085.30	1,502,232,570	4,695.00	2,285,995,500	0.84
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	14,218	131,444.28	1,868,874,773	157,500.00	2,239,335,000	0.83
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	7,785,000	228.01	1,775,057,850	280.00	2,179,800,000	0.80
日本	株式	ソニー	電気機器	1,098,800	1,199.41	1,317,911,708	1,972.00	2,166,833,600	0.80

日本	株式	日産自動車	輸送用機器	2,208,700	867.01	1,914,964,987	977.00	2,157,899,900	0.80
日本	株式	三井物産	卸売業	1,489,400	1,336.26	1,990,225,644	1,369.00	2,038,988,600	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	668,400	2,636.59	1,762,296,756	3,035.00	2,028,594,000	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	396,900	4,446.51	1,764,819,819	5,030.00	1,996,407,000	0.74
日本	株式	信越化学工業	化学	328,400	5,459.33	1,792,843,972	5,930.00	1,947,412,000	0.72
日本	株式	デンソー	輸送用機器	431,900	3,285.83	1,419,149,977	4,500.00	1,943,550,000	0.72
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	573,800	2,359.71	1,354,001,598	3,230.00	1,853,374,000	0.68
日本	株式	小松製作所	機械	854,000	2,325.11	1,985,643,940	2,155.00	1,840,370,000	0.68

(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	99.00
合計	99.00

(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	0.47
		建設業	2.47
		食料品	4.04
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.25
		化学	5.40
		医薬品	4.45
		石油・石炭製品	0.66
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.95
		鉄鋼	1.74
		非鉄金属	1.03
		金属製品	0.64
		機械	5.10
		電気機器	11.22
		輸送用機器	11.81
		精密機器	1.28
		その他製品	1.36
		電気・ガス業	2.40
		陸運業	3.92
		海運業	0.36
		空運業	0.63
		倉庫・運輸関連業	0.22

	情報・通信業	6.87
	卸売業	4.56
	小売業	4.28
	銀行業	10.00
	証券、商品先物取引業	1.74
	保険業	2.37
	その他金融業	1.19
	不動産業	3.67
	サービス業	2.18
	合計	99.00

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	214	2,472,160,000	2,359,350,000	2,359,350,000	0.87

(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。

日本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	日本	303,770,456,140	77.22
地方債証券	日本	25,105,142,183	6.38
特殊債券	日本	35,123,968,208	8.93
	韓国	102,620,000	0.03
	小計	35,226,588,208	8.95
社債券	日本	23,093,225,570	5.87
	オーストラリア	1,221,186,000	0.31
	アメリカ	408,854,000	0.10
	スウェーデン	302,020,000	0.08
	オランダ	300,799,000	0.08
	フランス	201,960,000	0.05
	韓国	99,155,000	0.03
	小計	25,627,199,570	6.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,663,618,029	0.93
合計(純資産総額)		393,393,004,130	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

① 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			
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	6,140,000,000	100.24	6,155,265,300	99.97	6,138,710,600	0.2	2017/09/20	1.56
日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	5,300,000,000	100.85	5,345,050,000	101.10	5,358,724,000	0.8	2022/09/20	1.36
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	4,960,000,000	100.21	4,970,827,700	100.73	4,996,257,600	0.8	2023/06/20	1.27
日本	国債証券	第113回利付国債 (5年)	4,240,000,000	100.14	4,246,211,200	100.21	4,249,031,200	0.3	2018/06/20	1.08
日本	国債証券	第88回利付国債(5 年)	4,040,000,000	100.92	4,077,245,200	100.60	4,064,563,200	0.5	2015/03/20	1.03
日本	国債証券	第103回利付国債 (5年)	4,040,000,000	100.77	4,071,108,000	100.44	4,057,776,000	0.3	2017/03/20	1.03
日本	国債証券	第105回利付国債 (5年)	4,032,000,000	100.33	4,045,305,600	100.03	4,033,491,840	0.2	2017/06/20	1.03
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	3,810,000,000	106.60	4,061,664,800	105.75	4,029,227,400	1.3	2019/12/20	1.02
日本	国債証券	第87回利付国債(5 年)	3,900,000,000	100.81	3,931,863,000	100.51	3,919,929,000	0.5	2014/12/20	1.00
日本	国債証券	第312回利付国債 (10年)	3,727,000,000	105.51	3,932,431,600	104.89	3,909,250,300	1.2	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	3,550,000,000	100.93	3,583,159,500	100.96	3,584,080,000	0.8	2022/12/20	0.91
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	3,300,000,000	106.56	3,516,480,000	105.38	3,477,771,000	1.7	2017/03/20	0.88
日本	国債証券	第111回利付国債 (5年)	3,350,000,000	100.19	3,356,365,000	100.74	3,374,823,500	0.4	2018/03/20	0.86
日本	国債証券	第107回利付国債 (5年)	3,230,000,000	100.31	3,240,275,500	99.91	3,227,222,200	0.2	2017/12/20	0.82
日本	国債証券	第331回利付国債 (2年)	3,130,000,000	99.97	3,129,311,400	99.98	3,129,374,000	0.1	2015/08/15	0.80
日本	国債証券	第284回利付国債 (10年)	2,950,000,000	106.22	3,133,549,000	105.08	3,099,948,500	1.7	2016/12/20	0.79
日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	3,075,000,000	99.65	3,064,469,200	99.01	3,044,742,000	0.6	2023/03/20	0.77
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	2,850,000,000	106.61	3,038,435,600	105.49	3,006,522,000	1.5	2017/12/20	0.76
日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	2,750,000,000	103.51	2,846,525,000	103.12	2,835,800,000	1.0	2021/12/20	0.72
日本	国債証券	第102回利付国債 (5年)	2,765,000,000	100.79	2,786,843,500	100.47	2,778,133,750	0.3	2016/12/20	0.71

日本	国債証券	第97回利付国債（5年）	2,710,000,000	100.82	2,732,357,400	100.75	2,730,352,100	0.4	2016/06/20	0.69
日本	国債証券	第92回利付国債（5年）	2,640,000,000	100.60	2,656,077,600	100.38	2,650,216,800	0.3	2015/09/20	0.67
日本	国債証券	第99回利付国債（5年）	2,490,000,000	101.07	2,516,833,400	100.78	2,509,621,200	0.4	2016/09/20	0.64
日本	国債証券	第89回利付国債（5年）	2,390,000,000	100.80	2,409,179,700	100.52	2,402,619,200	0.4	2015/06/20	0.61
日本	国債証券	第324回利付国債（10年）	2,320,000,000	101.39	2,352,248,000	101.24	2,348,930,400	0.8	2022/06/20	0.60
日本	国債証券	第96回利付国債（5年）	2,320,000,000	101.33	2,351,080,200	100.96	2,342,341,600	0.5	2016/03/20	0.60
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	2,230,000,000	103.15	2,300,329,000	103.04	2,297,814,300	1.0	2022/03/20	0.58
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	107.40	2,309,156,000	106.20	2,283,364,500	1.5	2018/09/20	0.58
日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	2,200,000,000	103.50	2,277,066,000	103.18	2,270,158,000	1.0	2021/09/20	0.58
日本	国債証券	第287回利付国債（10年）	2,050,000,000	107.71	2,208,055,000	106.46	2,182,471,000	1.9	2017/06/20	0.55

(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	77.22
地方債証券	6.38
特殊債券	8.95
社債券	6.51
合計	99.07

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	9	1,295,912,835	1,299,150,000	1,299,150,000	0.33

(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	150,944,716,463	52.66
	イギリス	26,335,255,923	9.19
	カナダ	12,657,565,500	4.42
	スイス	12,297,462,036	4.29
	フランス	11,157,680,846	3.89
	ドイツ	10,695,765,664	3.73
	オーストラリア	8,941,598,069	3.12
	オランダ	4,349,245,147	1.52
	スウェーデン	3,982,805,166	1.39
	スペイン	3,694,314,933	1.29
	香港	2,939,584,529	1.03
	イタリア	2,546,435,177	0.89
	アイルランド	2,120,023,873	0.74
	シンガポール	1,811,648,681	0.63
	ベルギー	1,436,549,526	0.50
	ジャージー	1,417,333,334	0.49
	デンマーク	1,411,208,926	0.49
	アンティル	1,125,735,393	0.39
	バミューダ	1,118,139,799	0.39
	フィンランド	1,026,794,729	0.36
	ノルウェー	794,313,394	0.28
	イスラエル	568,948,871	0.20
	ルクセンブルク	455,656,707	0.16
	オーストリア	377,798,232	0.13
	ケイマン	352,929,440	0.12
	ポルトガル	227,750,734	0.08
	パナマ	149,878,720	0.05
	ニュージーランド	143,405,231	0.05
	英ヴァージン諸島	143,181,176	0.05
	ガーンジー	70,842,529	0.02
	リベリア	62,032,347	0.02
	ギリシャ	57,443,281	0.02
	マン島	57,194,846	0.02
	モーリシャス	31,858,130	0.01
	小計	265,503,097,352	92.62
投資信託受益証券	オーストラリア	95,364,868	0.03
	シンガポール	42,866,271	0.01
	香港	25,512,667	0.01
	小計	163,743,806	0.06
投資証券	アメリカ	3,767,768,932	1.31

	オーストラリア	681,782,678	0.24
	フランス	342,952,626	0.12
	イギリス	327,165,251	0.11
	香港	112,666,872	0.04
	シンガポール	101,914,290	0.04
	カナダ	59,410,062	0.02
	オランダ	27,163,324	0.01
	小計	5,420,824,035	1.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,559,680,375	5.43
合計(純資産総額)		286,647,345,568	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

① 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	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	99,716	44,984.94	4,485,718,875	48,366.56	4,822,920,176	1.68
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	472,260	8,831.74	4,170,879,610	8,583.87	4,053,821,846	1.41
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	842,748	2,689.16	2,266,286,234	3,299.97	2,781,049,859	0.97
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	299,242	7,415.36	2,218,987,276	8,515.02	2,548,053,170	0.89
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	1,097,614	2,207.19	2,422,651,864	2,273.09	2,494,985,944	0.87
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	205,617	11,400.90	2,344,220,417	11,839.59	2,434,421,635	0.85
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・ サービス	28,778	75,764.74	2,180,357,710	84,110.58	2,420,534,466	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソ ナル用品	292,112	7,490.11	2,187,952,180	7,604.21	2,221,281,458	0.77
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバ コ	343,281	6,782.57	2,328,330,673	6,407.23	2,199,483,067	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	536,006	3,439.64	1,843,672,609	4,057.34	2,174,763,944	0.76
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,979,675	1,087.89	2,153,679,325	1,048.68	2,076,050,210	0.72
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・ サービス	111,864	19,772.32	2,211,811,609	17,964.47	2,009,577,516	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	401,959	4,781.27	1,921,878,366	4,986.85	2,004,510,043	0.70
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	699,234	2,682.27	1,875,539,415	2,763.91	1,932,624,040	0.67
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	572,438	3,484.89	1,994,886,209	3,309.81	1,894,663,306	0.66

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	74,733	21,336.31	1,594,526,754	24,751.39	1,849,745,853	0.65
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	245,232	6,634.55	1,627,005,804	7,157.92	1,755,351,282	0.61
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	5,177,326	259.38	1,342,925,881	312.40	1,617,435,730	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	426,613	3,768.17	1,607,550,990	3,747.51	1,598,739,043	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	1,143,109	1,173.43	1,341,363,880	1,393.76	1,593,220,971	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	322,328	4,234.39	1,364,865,038	4,767.50	1,536,701,705	0.54
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	321,556	4,041.61	1,299,604,716	4,632.75	1,489,690,488	0.52
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	173,982	8,625.18	1,500,627,528	8,250.43	1,435,427,495	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	304,193	4,401.60	1,338,938,950	4,703.57	1,430,794,650	0.50
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	2,018,933	709.49	1,432,426,906	687.98	1,388,992,025	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	523,471	2,210.88	1,157,333,763	2,553.42	1,336,644,617	0.47
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	566,216	2,084.24	1,180,134,792	2,306.54	1,306,000,985	0.46
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	403,914	3,352.18	1,353,993,482	3,229.35	1,304,381,978	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	165,005	7,157.65	1,181,049,226	7,802.89	1,287,517,316	0.45
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	保険	114,282	9,685.50	1,106,879,362	11,015.33	1,258,854,674	0.44

(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	92.62
投資信託受益証券	0.06
投資証券	1.89
合計	94.57

(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	10.08
		素材	5.43
		資本財	7.11
		商業・専門サービス	0.88

	運輸	1.72
	自動車・自動車部品	1.58
	耐久消費財・アパレル	1.59
	消費者サービス	1.64
	メディア	2.77
	小売	2.97
	食品・生活必需品小売り	2.17
	食品・飲料・タバコ	6.15
	家庭用品・パーソナル用品	1.81
	ヘルスケア機器・サービス	2.82
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.33
	銀行	7.48
	各種金融	5.18
	保険	4.40
	不動産	0.64
	ソフトウェア・サービス	6.05
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.93
	電気通信サービス	3.36
	公益事業	3.16
	半導体・半導体製造装置	1.38
合計		92.62

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	224	93,026,883	91,655,200	9,015,205,472	3.15
	S&P/TSE 60	モントリオール取引 所	買建	カナダドル	61	8,796,278.50	8,920,640	832,920,156	0.29
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイ ツ 金融先物取引所	買建	スイスフラン	104	8,115,228	8,075,600	853,833,188	0.30
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイ ツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	451	12,439,839.50	12,438,580	1,620,000,659	0.57
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	85	10,713,795	10,786,500	947,270,430	0.33
	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	188	12,262,715	12,192,740	1,860,368,269	0.65

(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	154,130,767,352	39.97
	フランス	37,944,831,565	9.84
	イタリア	37,020,187,631	9.60
	ドイツ	32,902,715,662	8.53
	イギリス	28,670,141,755	7.44
	スペイン	18,957,457,528	4.92
	オランダ	10,253,933,802	2.66
	ベルギー	10,224,928,600	2.65
	カナダ	9,546,595,866	2.48
	オーストリア	6,448,667,208	1.67
	オーストラリア	5,326,111,980	1.38
	メキシコ	3,670,101,953	0.95
	デンマーク	3,173,246,529	0.82
	アイルランド	2,999,333,227	0.78
	ポーランド	2,835,642,940	0.74
	フィンランド	2,560,735,798	0.66
	スウェーデン	2,017,050,317	0.52
	南アフリカ	1,994,908,096	0.52
	マレーシア	1,858,153,482	0.48
	スイス	1,436,002,082	0.37
	シンガポール	1,408,112,534	0.37
	ノルウェー	1,212,739,083	0.31
	小計	376,592,364,990	97.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,983,238,032	2.33
合計(純資産総額)		385,575,603,022	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

① 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 3.625% 02/15/20	22,030,000	11,352.89	2,501,042,905	10,809.22	2,381,272,502	3.625	2020/02/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	22,000,000	10,183.14	2,240,291,163	10,091.31	2,220,088,936	1.750	2015/07/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/15	21,980,000	10,072.10	2,213,848,120	10,004.47	2,198,984,694	1.250	2015/09/30	0.57

アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	23,600,000	9,738.62	2,298,315,169	9,184.55	2,167,555,474	1.750	2022/05/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 4.75% 08/15/17	19,000,000	11,600.90	2,204,172,670	11,190.17	2,126,134,004	4.750	2017/08/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/15	20,090,000	9,825.43	1,973,929,684	9,821.59	1,973,157,798	0.250	2015/05/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	18,900,000	10,204.85	1,928,716,650	10,107.25	1,910,271,853	1.875	2015/06/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	20,000,000	9,647.14	1,929,429,760	9,451.39	1,890,279,411	0.625	2018/04/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 12/15/15	19,000,000	9,803.72	1,862,707,868	9,779.51	1,858,108,765	0.250	2015/12/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	18,400,000	10,170.86	1,871,438,700	10,072.87	1,853,408,235	2.125	2014/11/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/15/14	18,000,000	9,840.41	1,771,275,335	9,845.22	1,772,139,825	0.250	2014/09/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/15/15	18,000,000	9,814.29	1,766,572,497	9,802.38	1,764,428,552	0.250	2015/09/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	17,500,000	9,854.68	1,724,570,470	9,845.98	1,723,048,203	0.375	2015/04/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	15,530,000	11,423.97	1,774,143,483	11,048.01	1,715,757,207	4.500	2017/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.375% 02/15/16	17,350,000	9,845.24	1,708,150,153	9,790.85	1,698,713,226	0.375	2016/02/15	0.44
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	11,200,000	15,262.82	1,709,436,467	15,010.22	1,681,145,213	4.250	2023/10/25	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.25% 03/31/17	15,300,000	10,888.18	1,665,892,011	10,595.40	1,621,097,476	3.250	2017/03/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 10/31/14	15,950,000	10,198.70	1,626,693,048	10,086.89	1,608,859,722	2.375	2014/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	14,900,000	11,273.36	1,679,730,984	10,726.81	1,598,294,869	3.500	2020/05/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/31/17	16,500,000	9,785.09	1,614,540,019	9,597.97	1,583,666,117	0.625	2017/08/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	15,500,000	10,261.13	1,590,476,402	10,144.52	1,572,401,790	2.375	2015/02/28	0.41
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	10,650,000	14,820.00	1,578,331,022	14,691.52	1,564,647,714	3.750	2021/04/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	16,300,000	9,835.90	1,603,251,967	9,543.99	1,555,670,981	0.750	2018/02/28	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	15,000,000	10,632.48	1,594,872,816	10,096.69	1,514,503,868	2.625	2020/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/15	14,900,000	10,222.71	1,523,184,714	10,113.79	1,506,954,736	2.250	2015/01/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/15	15,300,000	9,856.55	1,508,053,016	9,849.06	1,506,906,712	0.375	2015/03/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3% 04/25/22	10,800,000	14,040.57	1,516,381,650	13,836.50	1,494,342,241	3.000	2022/04/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/41	16,700,000	9,828.13	1,641,297,910	8,845.48	1,477,195,846	3.125	2041/11/15	0.38

アメリカ	国債証券	T 0.25% 02/15/15	15,000,000	9,833.50	1,475,025,381	9,833.31	1,474,996,566	0.250	2015/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.125% 12/31/14	15,000,000	9,814.29	1,472,143,747	9,823.70	1,473,555,750	0.125	2014/12/31	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	97.67
合計	97.67

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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	46	5,502,277.98	5,505,625	541,533,275	0.14
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	24	2,980,174.23	2,985,000	293,604,600	0.08
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	15	1,967,841.25	1,975,312.50	194,291,737	0.05
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	29	3,199,926	3,200,585	416,844,190	0.11
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	29	3,623,036	3,626,160	472,271,078	0.12
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	41	5,752,334	5,764,600	750,781,504	0.19

(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

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2013年8月30日

インデックスコレクション（バランス株式30）

基準価額・純資産の推移



基準価額	11,966円
純資産総額	32億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額：0円

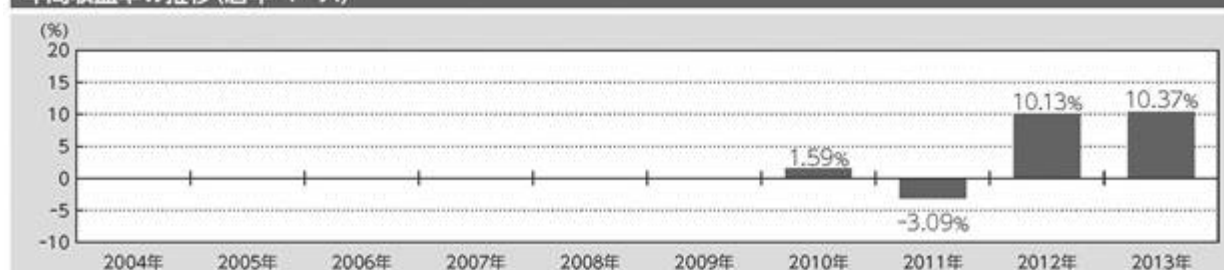
決算期	2011年7月	2012年7月	2013年7月	—	—
分配金	0円	0円	0円	—	—

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	60.6%	第106回利付国債（5年）	日本	国債証券	—	0.2%	2017/09/20	0.9%
		第325回利付国債（10年）	日本	国債証券	—	0.8%	2022/09/20	0.8%
		第329回利付国債（10年）	日本	国債証券	—	0.8%	2023/06/20	0.8%
日本株式 マザーファンド	19.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	0.9%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.5%
		三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.4%
外国株式 マザーファンド	10.0%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェア及び機器	—	—	0.2%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	0.1%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	0.1%
外国債券 マザーファンド	9.7%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債証券	—	3.625%	2020/02/15	0.1%
		T 1.75% 07/31/15	アメリカ	国債証券	—	1.750%	2015/07/31	0.1%
		T 1.25% 09/30/15	アメリカ	国債証券	—	1.250%	2015/09/30	0.1%

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

運用実績

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2013年8月30日

インデックスコレクション(バランス株式50)

基準価額・純資産の推移



基準価額	12,932円
純資産総額	32億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

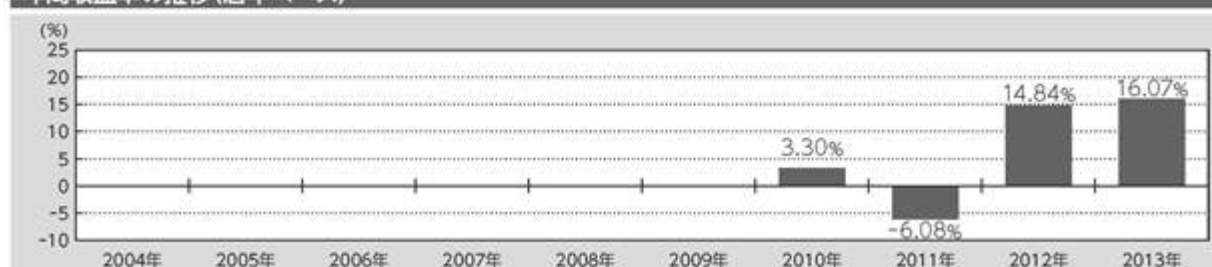
決算期	2011年7月	2012年7月	2013年7月	—	—
分配金	0円	0円	0円	—	—

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本債券 マザーファンド	40.6%	第106回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.2%	2017/09/20	0.6%
		第325回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.8%	2022/09/20	0.6%
		第329回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.8%	2023/06/20	0.5%
日本株式 マザーファンド	28.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	1.4%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.8%
		三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.6%
外国株式 マザーファンド	20.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア	—	—	0.3%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	0.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	0.2%
外国債券 マザーファンド	9.9%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債証券	—	3.625%	2020/02/15	0.1%
		T 1.75% 07/31/15	アメリカ	国債証券	—	1.750%	2015/07/31	0.1%
		T 1.25% 09/30/15	アメリカ	国債証券	—	1.250%	2015/09/30	0.1%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2010年10月20日
作成基準日：2013年8月30日

インデックスコレクション（バランス株式70）

基準価額・純資産の推移



基準価額	13,767円
純資産総額	23億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額：0円

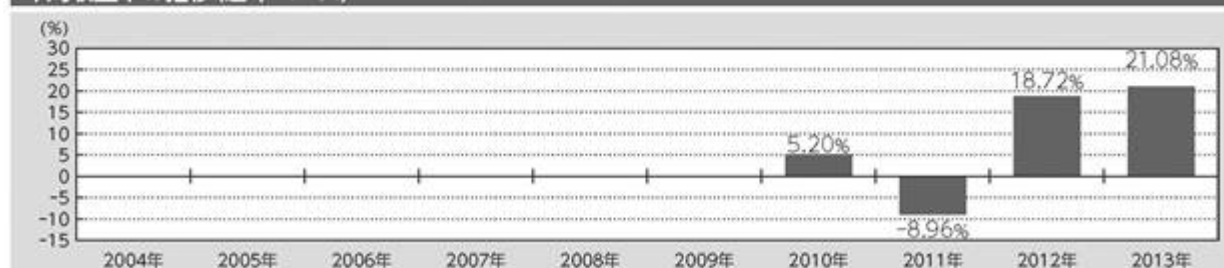
決算期	2011年7月	2012年7月	2013年7月	—	—
分配金	0円	0円	0円	—	—

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
日本株式マザーファンド	38.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	1.9%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	1.1%
		三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.8%
外国株式マザーファンド	30.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ソフトウェア・ハードウェア	—	—	0.5%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	0.4%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	0.3%
日本債券マザーファンド	25.7%	第106回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.2%	2017/09/20	0.4%
		第325回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.8%	2022/09/20	0.4%
		第329回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.8%	2023/06/20	0.3%
外国債券マザーファンド	4.6%	T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債証券	—	3.625%	2020/02/15	0.0%
		T 1.75% 07/31/15	アメリカ	国債証券	—	1.750%	2015/07/31	0.0%
		T 1.25% 09/30/15	アメリカ	国債証券	—	1.250%	2015/09/30	0.0%

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2010年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（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、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎた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（5）②をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、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）取得申込者

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、継続募集期間中は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方（※）及び同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）（以下「資産管理機関等」といいます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

- ※ 1. 信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金、企業年金基金
- 2. 生命保険会社
- 3. 農業協同組合連合会
- 4. 損害保険会社

（3）募集取扱いの単位

取得申込者は、販売会社において、1円以上1円単位をもって、受益権を購入することができます。

（4）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。

（5）その他

- ① 確定拠出年金制度の加入者等は、当ファンドの受益者に該当しておらず、確定拠出年金制度の運営管理機関（記録関連業務を行う事業主を含みます。）に対して資産配分の指図を行い、その指図の通知を受けた資産管理機関等が当ファンドの取得申込み及び後記「2 換金（解約）手続等」に記載する一部解約の実行の請求を行うこととなります。
- ② 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、自動的に無手数料で再投資がなされる「分配金再投資コース」専用ファンドです。このため受益権の取得申込者は、申込みの際に販売会社との間で、自動引き落とし約款に従い自動的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します。）を締結していただきます。
- ③ 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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行い

ます。受託会社は、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付は、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付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

- (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ます。

- (3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、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（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。

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付を中止すること、及びすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

- (6) 上記（5）により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付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、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

- (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】

① 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、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。

② 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、日本債券マザーファンド、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

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す。）

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

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22年10月20日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）①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】

① 当ファンドの計算期間は、毎年7月26日から翌年7月25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22年10月20日から平成23年7月25日までとします。

② 上記①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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

① 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30億口を下回った場合

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30億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発します。
- 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。以下本項において同じ。）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も適用しません。

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③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③の書面決議が否決された場合を除き、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。受託会社は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③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。

② 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。

③ 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③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。以下本項において同じ。）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. 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にあっても、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。

④ 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す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①A. ハ. b. 又は③B. に規定する書面に付記します。

⑤ 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。

⑥ 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⑨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. までの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. までの掲げる業務を、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. 委託会社のための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あります。
- 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。

⑦ 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。

⑧ 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別段の意思表示がないときは、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。

⑨ 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

- ① 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。
- ② 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、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します。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。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。

（２）償還金に対する請求権

- ① 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。
- ② 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します。）に対する支払いを開始します。
- ③ 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します。
- ④ 受益者が、信託終了による償還金については上記②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

- 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。
- ② 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。
- ③ 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 ④ 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

（参考）

確定拠出年金制度における当ファンドの受益者は、確定拠出年金法第８条（資産管理契約の締結）第１項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方又は同法第５５条（規約の承認）に規定する個人

型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）となります。従って確定拠出年金の加入者等は上記の権利を直接には保有していません。また、加入者等が収益分配金、償還金及び一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成24年7月26日から平成25年7月25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】

【インデックスコレクション(バランス株式30)】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,114,913	18,890,863
親投資信託受益証券	1,822,364,033	3,038,678,517
未収入金	1,524,878	1,197,186
未収利息	8	28
流動資産合計	1,828,003,832	3,058,766,594
資産合計	1,828,003,832	3,058,766,594
負債の部		
流動負債		
未払解約金	—	349,527
未払受託者報酬	178,621	292,749
未払委託者報酬	1,339,593	2,195,540
その他未払費用	44,593	73,127
流動負債合計	1,562,807	2,910,943
負債合計	1,562,807	2,910,943
純資産の部		
元本等		
元本	1,823,954,652	2,505,295,284
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,486,373	550,560,367
（分配準備積立金）	48,335,071	434,615,280
元本等合計	1,826,441,025	3,055,855,651
純資産合計	1,826,441,025	3,055,855,651
負債純資産合計	1,828,003,832	3,058,766,594

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 (自 平成23年 7月26日 至 平成24年 7月25日)	第3期 (自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日)
営業収益		
受取利息	98	7,184
有価証券売買等損益	△31,211,121	490,252,900
営業収益合計	△31,211,023	490,260,084
営業費用		
受託者報酬	348,456	518,287
委託者報酬	2,613,302	3,887,013
その他費用	86,993	129,450
営業費用合計	3,048,751	4,534,750
営業利益又は営業損失（△）	△34,259,774	485,725,334
経常利益又は経常損失（△）	△34,259,774	485,725,334
当期純利益又は当期純損失（△）	△34,259,774	485,725,334
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（△）	△1,903,997	39,195,404
期首剰余金又は期首欠損金（△）	34,741,888	2,486,373
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,844,820	107,619,134
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,844,820	107,619,134
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,744,558	6,075,070
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,744,558	6,075,070
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,486,373	550,560,367

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
1. 期首元本額	1,612,192,834円	1,823,954,652円
期中追加設定元本額	297,421,058円	946,841,759円
期中一部解約元本額	85,659,240円	265,501,127円
2. 当該計算期間の末日における受 益権総数	1,823,954,652口	2,505,295,284口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0014円 (10,014円)	1.2198円 (12,198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2期 自 平成23年 7月26日 至 平成24年 7月25日	第3期 自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日
費用控除後の配当等収益額	A	29,330,900円 (32,379,553円)	43,151,127円 (43,582,413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	348,331,134円
収益調整金額	C	6,329,350円	115,945,087円
分配準備積立金額	D	19,004,171円	43,133,019円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	54,664,421円	550,560,367円
当ファンドの期末残存口数	F	1,823,954,652口	2,505,295,284口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	299.70円	2,197.58円
1万口当たり分配金額	H	－円	－円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	－円	－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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
	計算期間(自 平成23年7月26日 至 平成24年 7月25日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△27,635,601	403,274,415
合計	△27,635,601	403,274,415

(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】

① 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	553,555,121	624,797,665	
	日本債券マザーファンド	1,471,226,613	1,808,284,630	
	外国株式マザーファンド	203,121,039	309,373,654	
	外国債券マザーファンド	148,556,955	296,222,568	
親投資信託受益証券 小計		2,376,459,728	3,038,678,517	
合計		2,376,459,728	3,038,678,517	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション(バランス株式50)】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,028,393	23,202,472
親投資信託受益証券	2,300,419,085	3,280,450,639
未収入金	2,295,825	3,801,134
未収利息	15	35
流動資産合計	2,310,743,318	3,307,454,280
資産合計	2,310,743,318	3,307,454,280
負債の部		
流動負債		
未払解約金	—	5,681,261
未払受託者報酬	248,097	321,698
未払委託者報酬	1,984,698	2,573,534
その他未払費用	61,963	80,366
流動負債合計	2,294,758	8,656,859
負債合計	2,294,758	8,656,859
純資産の部		
元本等		
元本	2,342,407,409	2,471,292,399
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△33,958,849	827,505,022
（分配準備積立金）	85,602,192	712,942,905
元本等合計	2,308,448,560	3,298,797,421
純資産合計	2,308,448,560	3,298,797,421
負債純資産合計	2,310,743,318	3,307,454,280

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 (自 平成23年 7月26日 至 平成24年 7月25日)	第3期 (自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日)
営業収益		
受取利息	198	8,629
有価証券売買等損益	△115,546,639	844,900,684
営業収益合計	△115,546,441	844,909,313
営業費用		
受託者報酬	485,614	585,888
委託者報酬	3,884,748	4,687,026
その他費用	121,279	146,349
営業費用合計	4,491,641	5,419,263
営業利益又は営業損失（△）	△120,038,082	839,490,050
経常利益又は経常損失（△）	△120,038,082	839,490,050
当期純利益又は当期純損失（△）	△120,038,082	839,490,050
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（△）	△5,234,671	60,004,583
期首剰余金又は期首欠損金（△）	86,205,219	△33,958,849
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	81,978,404
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	509,456
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	81,468,948
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,360,657	—
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,907,707	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	452,950	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△33,958,849	827,505,022

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
1. 期首元本額	2,289,867,691円	2,342,407,409円
期中追加設定元本額	190,420,353円	416,815,707円
期中一部解約元本額	137,880,635円	287,930,717円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	2,342,407,409口	2,471,292,399口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 33,958,849円	—
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9855円 (9,855円)	1.3348円 (13,348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2期 自 平成23年 7月26日 至 平成24年 7月25日	第3期 自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日
費用控除後の配当等収益額	A	45,758,421円 (50,249,864円)	54,375,328円 (54,745,417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	582,577,521円
収益調整金額	C	6,923,504円	114,562,117円
分配準備積立金額	D	39,843,771円	75,990,056円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	92,525,696円	827,505,022円
当ファンドの期末残存口数	F	2,342,407,409口	2,471,292,399口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	395.00円	3,348.47円
1万口当たり分配金額	H	—円	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	—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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
	計算期間(自 平成23年7月26日 至 平成24年 7月25日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△107,827,737	708,523,962
合計	△107,827,737	708,523,962

(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】

① 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	866,906,318	978,477,161	
	日本債券マザーファンド	1,056,903,346	1,299,039,902	
	外国株式マザーファンド	444,281,626	676,685,344	
	外国債券マザーファンド	163,614,961	326,248,232	
親投資信託受益証券 小計		2,531,706,251	3,280,450,639	
合計		2,531,706,251	3,280,450,639	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

【インデックスコレクション(バランス株式70)】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,106,482	12,755,525
親投資信託受益証券	1,386,986,250	2,365,409,156
未収入金	1,079,195	—
未収利息	11	19
流動資産合計	1,394,171,938	2,378,164,700
資産合計	1,394,171,938	2,378,164,700
負債の部		
流動負債		
未払解約金	112,209	1,065,191
未払受託者報酬	150,638	220,035
未払委託者報酬	1,280,331	1,870,200
その他未払費用	37,591	54,947
流動負債合計	1,580,769	3,210,373
負債合計	1,580,769	3,210,373
純資産の部		
元本等		
元本	1,433,291,853	1,651,955,554
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△40,700,684	722,998,773
（分配準備積立金）	61,181,087	520,677,887
元本等合計	1,392,591,169	2,374,954,327
純資産合計	1,392,591,169	2,374,954,327
負債純資産合計	1,394,171,938	2,378,164,700

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 (自 平成23年 7月26日 至 平成24年 7月25日)	第3期 (自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日)
営業収益		
受取利息	138	6,486
有価証券売買等損益	△116,164,771	703,438,287
営業収益合計	△116,164,633	703,444,773
営業費用		
受託者報酬	292,475	382,941
委託者報酬	2,485,876	3,254,874
その他費用	72,987	95,612
営業費用合計	2,851,338	3,733,427
営業利益又は営業損失（△）	△119,015,971	699,711,346
経常利益又は経常損失（△）	△119,015,971	699,711,346
当期純利益又は当期純損失（△）	△119,015,971	699,711,346
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（△）	△8,539,145	120,354,083
期首剰余金又は期首欠損金（△）	76,405,638	△40,700,684
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,415,546	193,560,945
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,415,546	193,560,945
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,045,042	9,218,751
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,045,042	9,218,751
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△40,700,684	722,998,773

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
1. 期首元本額	1,388,890,186円	1,433,291,853円
期中追加設定元本額	201,368,030円	664,273,333円
期中一部解約元本額	156,966,363円	445,609,632円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	1,433,291,853口	1,651,955,554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 40,700,684円	—
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9716円 (9,716円)	1.4377円 (14,377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2期 自 平成23年 7月26日 至 平成24年 7月25日	第3期 自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日
費用控除後の配当等収益額	A	28,982,900円 (31,834,100円)	37,924,444円 (38,163,368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	436,890,749円
収益調整金額	C	7,224,289円	202,320,886円
分配準備積立金額	D	32,198,187円	45,862,694円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	68,405,376円	722,998,773円
当ファンドの期末残存口数	F	1,433,291,853口	1,651,955,554口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	477.26円	4,376.62円
1万口当たり分配金額	H	—円	—円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	—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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 (平成24年 7月25日現在)	第3期 (平成25年 7月25日現在)
	計算期間(自 平成23年7月26日 至 平成24年 7月25日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年 7月26日 至 平成25年 7月25日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△103,912,327	643,921,483
合計	△103,912,327	643,921,483

(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】

① 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	846,000,046	954,880,251	
	日本債券マザーファンド	474,193,635	582,831,396	
	外国株式マザーファンド	473,431,303	721,083,217	
	外国債券マザーファンド	53,467,549	106,614,292	
親投資信託受益証券 小計		1,847,092,533	2,365,409,156	
合計		1,847,092,533	2,365,409,156	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

＜参考＞

「インデックスコレクション(バランス株式30)」、「インデックスコレクション(バランス株式50)」、「インデックスコレクション(バランス株式70)」は、「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」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7月25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 7月25日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,413,162,161
株式	298,285,741,669
派生商品評価勘定	280,256,325
未収入金	5,067,316,856
未収配当金	244,574,100
未収利息	6,664
流動資産合計	308,291,057,775
資産合計	308,291,057,775
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,029,500
前受金	271,188,000
未払金	49,031,096
未払解約金	1,714,749,980
流動負債合計	2,075,998,576
負債合計	2,075,998,576
純資産の部	
元本等	
元本	271,304,830,439
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	34,910,228,760
元本等合計	306,215,059,199
純資産合計	306,215,059,199
負債純資産合計	308,291,057,775

(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 7月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 (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。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月25日現在
1. 計算期間の期首元本額	342,851,111,894円
計算期間中の追加設定元本額	35,008,438,660円
計算期間中の一部解約元本額	106,554,720,115円
計算日の元本額	271,304,830,439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	1,897,732,963円
DC日本株式インデックスファンド	371,985,053円
DC日本株式インデックスファンドL	49,557,691,711円
DC日本株式インデックスファンドA	1,524,162,342円
DCバランスファンド30	496,002,157円
DCバランスファンド50	1,095,521,168円
DCバランスファンド70	641,146,998円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	176,653,387円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	104,295,637円
新生・4分散ファンド	161,077,544円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	757,883,764円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	29,942,649円

4資産インデックスバランスオープン(成長型)	117,171,164円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	46,170,889円
日本株式インデックスe	1,627,179,971円
インデックスコレクション(国内株式)	4,385,851,788円
インデックスコレクション(バランス株式30)	553,555,121円
インデックスコレクション(バランス株式50)	866,906,318円
インデックスコレクション(バランス株式70)	846,000,046円
私募日本株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	9,533,740,617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)	21,777,704,969円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	4,400,534,255円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	36,106,213,710円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	24,563,539,694円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	4,472,623,658円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	771,269,284円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	5,855,147,946円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	5,038,812,173円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,018,691,128円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	31,627,498,319円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,418,355,074円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	15,184,233,249円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	5,449,174,455円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	179,301,563円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,120,914,137円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,619,065,837円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	6,328,270,336円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	284,977,398円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	227,296,552円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,060,392,094円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	2,606,858,356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)	90,057,805円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,392,562,304円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	17,340,928,278円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	464,165,996円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	151,021,443円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	53,880,630円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	481,945,809円
私募日本株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	10,086,486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 14,655,800,000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	271,304,830,439口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1287円 (11,287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 7月25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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月25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。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	(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。 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 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	73,897,003,369
合計	73,897,003,369

(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7月25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)

I. 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 7月25日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	6,873,923,175	—	7,113,150,000	239,226,825
合計		6,873,923,175	—	7,113,150,000	239,226,825

(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。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月25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 7月25日現在

該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月25日現在)

① 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	85,000	277.00	23,545,000	
日本水産	215,400	212.00	45,664,800	
マルハニチロホールディングス	385,000	200.00	77,000,000	
サカタのタネ	29,600	1,409.00	41,706,400	
ホクト	20,400	1,819.00	37,107,600	
住石ホールディングス	58,800	122.00	7,173,600	
日鉄鉱業	51,000	403.00	20,553,000	
三井松島産業	131,000	148.00	19,388,000	
国際石油開発帝石	2,435	458,000.00	1,115,230,000	
日本海洋掘削	5,000	7,140.00	35,700,000	
関東天然瓦斯開発	20,000	770.00	15,400,000	
石油資源開発	28,600	4,335.00	123,981,000	
ショーボンドホールディングス	17,800	4,035.00	71,823,000	
ミライト・ホールディングス	56,900	943.00	53,656,700	
タマホーム	9,900	1,105.00	10,939,500	
ダイセキ環境ソリューション	25	158,100.00	3,952,500	
安藤・間	114,400	217.00	24,824,800	
東急建設	76,860	243.00	18,676,980	
コムシスホールディングス	97,300	1,330.00	129,409,000	
ミサワホーム	25,300	1,687.00	42,681,100	
高松コンストラクショングループ	15,200	1,541.00	23,423,200	
東建コーポレーション	7,730	5,510.00	42,592,300	
ヤマウラ	14,000	285.00	3,990,000	
大成建設	1,016,000	384.00	390,144,000	
大林組	603,000	544.00	328,032,000	
清水建設	616,000	427.00	263,032,000	
長谷工コーポレーション	1,252,000	132.00	165,264,000	
松井建設	27,000	346.00	9,342,000	

鹿島建設	884,000	354.00	312,936,000	
不動テトラ	141,400	158.00	22,341,200	
鉄建建設	122,000	119.00	14,518,000	
太平工業	38,000	367.00	13,946,000	
西松建設	256,000	234.00	59,904,000	
三井住友建設	345,600	83.00	28,684,800	
前田建設工業	127,000	515.00	65,405,000	
ナカノフドー建設	26,000	222.00	5,772,000	
奥村組	179,000	407.00	72,853,000	
大和小田急建設	9,500	206.00	1,957,000	
東鉄工業	26,100	1,885.00	49,198,500	
イチケン	34,000	171.00	5,814,000	
戸田建設	233,000	291.00	67,803,000	
熊谷組	147,000	100.00	14,700,000	
青木あすなろ建設	13,000	560.00	7,280,000	
北野建設	52,000	216.00	11,232,000	
植木組	38,000	184.00	6,992,000	
三井ホーム	28,000	501.00	14,028,000	
矢作建設工業	28,800	450.00	12,960,000	
ピーエス三菱	16,800	414.00	6,955,200	
大東建託	76,100	8,780.00	668,158,000	
新日本建設	32,500	321.00	10,432,500	
N I P P O	46,000	1,720.00	79,120,000	
東亜道路工業	42,000	448.00	18,816,000	
前田道路	58,000	1,654.00	95,932,000	
日本道路	62,000	569.00	35,278,000	
東亜建設工業	175,000	141.00	24,675,000	
東洋建設	62,200	253.00	15,736,600	
五洋建設	238,500	240.00	57,240,000	
大林道路	27,000	433.00	11,691,000	
福田組	36,000	330.00	11,880,000	
住友林業	138,300	1,167.00	161,396,100	
日本基礎技術	24,100	316.00	7,615,600	
日成ビルド工業	73,000	177.00	12,921,000	
巴コーポレーション	27,200	346.00	9,411,200	
パナホーム	76,000	643.00	48,868,000	
大和ハウス工業	535,000	1,861.00	995,635,000	
ライト工業	47,000	756.00	35,532,000	
積水ハウス	601,000	1,382.00	830,582,000	

日特建設	21,600	340.00	7,344,000	
北陸電気工事	14,000	328.00	4,592,000	
ユアテック	32,000	314.00	10,048,000	
西部電気工業	17,000	429.00	7,293,000	
四電工	17,000	349.00	5,933,000	
中電工	29,000	1,213.00	35,177,000	
関電工	91,000	476.00	43,316,000	
きんでん	109,000	987.00	107,583,000	
東京エネシス	21,000	499.00	10,479,000	
トーエネック	28,000	521.00	14,588,000	
住友電設	14,700	1,310.00	19,257,000	
日本電設工業	36,000	1,018.00	36,648,000	
協和エクシオ	72,000	1,138.00	81,936,000	
新日本空調	15,900	603.00	9,587,700	
N D S	30,000	281.00	8,430,000	
九電工	32,000	432.00	13,824,000	
三機工業	45,000	588.00	26,460,000	
日揮	201,000	3,625.00	728,625,000	
中外炉工業	69,000	252.00	17,388,000	
ヤマト	21,000	363.00	7,623,000	
太平電業	25,000	729.00	18,225,000	
高砂熱学工業	57,200	887.00	50,736,400	
三晃金属工業	32,000	235.00	7,520,000	
朝日工業社	24,000	360.00	8,640,000	
大気社	28,600	2,495.00	71,357,000	
ダイダン	27,000	519.00	14,013,000	
日比谷総合設備	24,600	1,069.00	26,297,400	
東芝プラントシステム	33,000	1,670.00	55,110,000	
東洋エンジニアリング	110,000	477.00	52,470,000	
千代田化工建設	145,000	1,229.00	178,205,000	
新興プランテック	41,200	802.00	33,042,400	
日本製粉	123,000	527.00	64,821,000	
日清製粉グループ本社	181,500	1,222.00	221,793,000	
日東富士製粉	16,000	313.00	5,008,000	
昭和産業	83,000	314.00	26,062,000	
鳥越製粉	16,100	629.00	10,126,900	
協同飼料	69,000	113.00	7,797,000	
中部飼料	17,900	540.00	9,666,000	
日本配合飼料	56,000	124.00	6,944,000	

東洋精糖	32,000	97.00	3,104,000	
日本甜菜製糖	103,000	180.00	18,540,000	
三井製糖	79,000	324.00	25,596,000	
森永製菓	196,000	208.00	40,768,000	
中村屋	47,000	403.00	18,941,000	
江崎グリコ	72,000	1,005.00	72,360,000	
名糖産業	9,000	1,025.00	9,225,000	
不二家	115,000	193.00	22,195,000	
山崎製パン	147,000	1,193.00	175,371,000	
モロゾフ	31,000	316.00	9,796,000	
亀田製菓	11,200	2,983.00	33,409,600	
カルビー	18,300	9,700.00	177,510,000	
森永乳業	170,000	297.00	50,490,000	
ヤクルト本社	117,200	4,345.00	509,234,000	
明治ホールディングス	59,300	4,955.00	293,831,500	
雪印メグミルク	39,400	1,493.00	58,824,200	
プリマハム	113,000	195.00	22,035,000	
日本ハム	152,000	1,588.00	241,376,000	
伊藤ハム	110,000	433.00	47,630,000	
丸大食品	96,000	315.00	30,240,000	
米久	8,200	778.00	6,379,600	
S Foods	12,500	895.00	11,187,500	
サッポロホールディングス	328,000	386.00	126,608,000	
アサヒグループホールディングス	402,700	2,615.00	1,053,060,500	
キリンホールディングス	857,000	1,607.00	1,377,199,000	
宝ホールディングス	157,000	972.00	152,604,000	
オエノンホールディングス	52,000	241.00	12,532,000	
養命酒製造	15,000	815.00	12,225,000	
コカ・コーラウエスト	67,900	1,863.00	126,497,700	
コカ・コーライーストジャパン	41,500	1,400.00	58,100,000	
ダイドードリンコ	10,100	4,050.00	40,905,000	
伊藤園	54,500	2,327.00	126,821,500	
キーコーヒー	17,500	1,536.00	26,880,000	
ユニカフェ	5,600	524.00	2,934,400	
ジャパンフーズ	2,600	1,381.00	3,590,600	
日清オイリオグループ	87,000	369.00	32,103,000	
不二製油	48,700	1,700.00	82,790,000	
かどや製油	1,600	2,778.00	4,444,800	
J-オイルミルズ	84,000	310.00	26,040,000	

キッコーマン	164,000	1,783.00	292,412,000	
味の素	494,000	1,427.00	704,938,000	
キューピー	102,000	1,533.00	156,366,000	
ハウス食品	70,500	1,682.00	118,581,000	
カゴメ	72,000	1,710.00	123,120,000	
焼津水産化学工業	9,500	847.00	8,046,500	
アリアケジャパン	18,300	2,237.00	40,937,100	
ニチレイ	214,000	546.00	116,844,000	
東洋水産	92,000	3,245.00	298,540,000	
日清食品ホールディングス	78,300	4,080.00	319,464,000	
永谷園	19,000	895.00	17,005,000	
フジッコ	21,000	1,163.00	24,423,000	
ロック・フィールド	10,500	1,908.00	20,034,000	
日本たばこ産業	1,113,100	3,680.00	4,096,208,000	
ケンコーマヨネーズ	6,100	855.00	5,215,500	
わらべや日洋	12,100	1,577.00	19,081,700	
なとり	9,300	952.00	8,853,600	
ミヨシ油脂	64,000	150.00	9,600,000	
片倉工業	23,600	1,286.00	30,349,600	
グンゼ	140,000	250.00	35,000,000	
東洋紡	792,000	166.00	131,472,000	
ユニチカ	513,000	54.00	27,702,000	
富士紡ホールディングス	90,000	246.00	22,140,000	
日清紡ホールディングス	119,000	812.00	96,628,000	
倉敷紡績	193,000	168.00	32,424,000	
シキボウ	114,000	115.00	13,110,000	
日本毛織	59,000	763.00	45,017,000	
トーア紡コーポレーション	84,000	69.00	5,796,000	
ダイドーリミテッド	21,100	679.00	14,326,900	
帝国繊維	20,000	804.00	16,080,000	
帝人	711,000	222.00	157,842,000	
東レ	1,449,000	673.00	975,177,000	
サカイオーベックス	50,000	143.00	7,150,000	
住江織物	57,000	245.00	13,965,000	
日本フェルト	10,700	440.00	4,708,000	
イチカワ	13,000	307.00	3,991,000	
日本バイリーン	24,000	504.00	12,096,000	
芦森工業	51,000	145.00	7,395,000	
アツギ	158,000	110.00	17,380,000	

ダイニック	35,000	178.00	6,230,000	
セーレン	50,400	704.00	35,481,600	
東海染工	26,000	115.00	2,990,000	
小松精練	31,000	513.00	15,903,000	
ワコールホールディングス	112,000	1,025.00	114,800,000	
ホギメディカル	11,800	5,950.00	70,210,000	
レナウン	40,400	139.00	5,615,600	
クラウドシア	3,000	1,158.00	3,474,000	
T S I ホールディングス	96,600	744.00	71,870,400	
三陽商会	99,000	256.00	25,344,000	
オンワードホールディングス	125,000	939.00	117,375,000	
ルック	35,000	335.00	11,725,000	
ゴールドウイン	44,000	482.00	21,208,000	
デサント	47,000	738.00	34,686,000	
ヤマトインターナショナル	11,400	460.00	5,244,000	
特種東海製紙	109,000	208.00	22,672,000	
王子ホールディングス	827,000	441.00	364,707,000	
日本製紙	90,300	1,499.00	135,359,700	
三菱製紙	266,000	97.00	25,802,000	
北越紀州製紙	116,000	452.00	52,432,000	
中越パルプ工業	71,000	150.00	10,650,000	
巴川製紙所	29,000	187.00	5,423,000	
大王製紙	79,000	655.00	51,745,000	
レンゴー	150,000	514.00	77,100,000	
トーモク	59,000	305.00	17,995,000	
ザ・パックス	13,300	1,710.00	22,743,000	
クラレ	318,800	1,403.00	447,276,400	
旭化成	1,168,000	659.00	769,712,000	
共和レザー	10,900	298.00	3,248,200	
コープケミカル	28,000	139.00	3,892,000	
昭和電工	1,163,000	136.00	158,168,000	
住友化学	1,286,000	335.00	430,810,000	
日本化成	35,000	137.00	4,795,000	
住友精化	35,000	389.00	13,615,000	
日産化学工業	128,200	1,480.00	189,736,000	
ラサ工業	66,000	120.00	7,920,000	
クレハ	131,000	334.00	43,754,000	
テイカ	31,000	283.00	8,773,000	
石原産業	336,000	75.00	25,200,000	

片倉チッカリン	12,000	269.00	3,228,000	
日本曹達	111,000	583.00	64,713,000	
東ソー	501,000	371.00	185,871,000	
トクヤマ	272,000	353.00	96,016,000	
セントラル硝子	167,000	315.00	52,605,000	
東亜合成	220,000	441.00	97,020,000	
ダイソー	74,000	300.00	22,200,000	
関東電化工業	45,000	256.00	11,520,000	
電気化学工業	374,000	376.00	140,624,000	
信越化学工業	335,800	6,640.00	2,229,712,000	
日本カーバイド工業	55,000	517.00	28,435,000	
堺化学工業	70,000	305.00	21,350,000	
エア・ウォーター	154,000	1,495.00	230,230,000	
大陽日酸	246,000	729.00	179,334,000	
日本化学工業	69,000	132.00	9,108,000	
日本パーカライジング	44,000	2,110.00	92,840,000	
高压ガス工業	28,000	574.00	16,072,000	
チタン工業	22,000	223.00	4,906,000	
四国化成工業	27,000	692.00	18,684,000	
戸田工業	27,000	260.00	7,020,000	
ステラ ケミファ	8,200	1,642.00	13,464,400	
保土谷化学工業	42,000	190.00	7,980,000	
日本触媒	136,000	1,065.00	144,840,000	
大日精化工業	67,000	434.00	29,078,000	
カネカ	233,000	695.00	161,935,000	
三菱瓦斯化学	295,000	750.00	221,250,000	
三井化学	794,000	242.00	192,148,000	
J S R	171,700	1,959.00	336,360,300	
東京応化工業	36,200	2,232.00	80,798,400	
大阪有機化学工業	12,400	460.00	5,704,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,170,500	491.00	574,715,500	
日本合成化学工業	38,000	1,095.00	41,610,000	
ダイセル	223,000	882.00	196,686,000	
住友ベークライト	146,000	375.00	54,750,000	
積水化学工業	384,000	1,069.00	410,496,000	
日本ゼオン	161,000	1,158.00	186,438,000	
アイカ工業	52,500	2,036.00	106,890,000	
宇部興産	908,000	192.00	174,336,000	
積水樹脂	26,000	1,320.00	34,320,000	

タキロン	44,000	429.00	18,876,000	
旭有機材工業	66,000	231.00	15,246,000	
日立化成	81,000	1,713.00	138,753,000	
ニチバン	18,000	400.00	7,200,000	
リケンテクノス	30,000	329.00	9,870,000	
大倉工業	45,000	352.00	15,840,000	
積水化成成品工業	48,000	266.00	12,768,000	
群栄化学工業	50,000	575.00	28,750,000	
タイガースポリマー	9,200	424.00	3,900,800	
ミライアル	4,600	1,611.00	7,410,600	
日本カーリット	14,900	580.00	8,642,000	
日本化薬	132,000	1,339.00	176,748,000	
日本精化	15,500	657.00	10,183,500	
A D E K A	80,600	1,083.00	87,289,800	
日油	145,000	620.00	89,900,000	
ハリマ化成グループ	15,900	507.00	8,061,300	
花王	496,500	3,120.00	1,549,080,000	
第一工業製薬	34,000	242.00	8,228,000	
三洋化成工業	59,000	629.00	37,111,000	
大日本塗料	107,000	159.00	17,013,000	
日本ペイント	162,000	1,340.00	217,080,000	
関西ペイント	212,000	1,360.00	288,320,000	
中国塗料	58,000	534.00	30,972,000	
日本特殊塗料	14,400	409.00	5,889,600	
藤倉化成	21,800	461.00	10,049,800	
太陽ホールディングス	15,200	3,170.00	48,184,000	
D I C	663,000	261.00	173,043,000	
サカタインクス	38,000	940.00	35,720,000	
東洋インキＳＣホールディングス	168,000	518.00	87,024,000	
T & K T O K A	6,200	2,121.00	13,150,200	
富士フイルムホールディングス	399,900	2,321.00	928,167,900	
資生堂	333,000	1,570.00	522,810,000	
ライオン	216,000	575.00	124,200,000	
高砂香料工業	62,000	524.00	32,488,000	
マンダム	20,100	3,460.00	69,546,000	
ミルボン	9,200	3,555.00	32,706,000	
ファンケル	47,000	1,252.00	58,844,000	
コーセー	33,600	2,872.00	96,499,200	
ドクターシーラボ	127	277,600.00	35,255,200	

シーボン	1,400	2,100.00	2,940,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	22,300	3,385.00	75,485,500	
ノエビアホールディングス	12,500	1,642.00	20,525,000	
エスター	11,500	1,015.00	11,672,500	
コニシ	13,600	1,965.00	26,724,000	
長谷川香料	23,700	1,392.00	32,990,400	
星光PMC	7,700	403.00	3,103,100	
小林製薬	28,300	5,250.00	148,575,000	
荒川化学工業	14,600	847.00	12,366,200	
メック	13,400	464.00	6,217,600	
日本高純度化学	49	208,800.00	10,231,200	
J C U	2,700	4,540.00	12,258,000	
新田ゼラチン	9,700	1,250.00	12,125,000	
アース製薬	13,500	3,570.00	48,195,000	
イハラケミカル工業	32,000	651.00	20,832,000	
北興化学工業	18,000	316.00	5,688,000	
大成ラミック	5,200	2,467.00	12,828,400	
クミアイ化学工業	39,000	622.00	24,258,000	
日本農薬	43,000	1,038.00	44,634,000	
アキレス	148,000	134.00	19,832,000	
有沢製作所	29,200	421.00	12,293,200	
日東電工	154,300	5,950.00	918,085,000	
レック	5,800	1,157.00	6,710,600	
きもと	16,700	781.00	13,042,700	
藤森工業	15,800	3,170.00	50,086,000	
前澤化成工業	13,100	1,021.00	13,375,100	
J S P	12,200	1,522.00	18,568,400	
エフピコ	9,200	7,030.00	64,676,000	
天馬	14,900	1,300.00	19,370,000	
信越ポリマー	36,700	337.00	12,367,900	
東リ	48,000	199.00	9,552,000	
ニフコ	41,800	2,438.00	101,908,400	
日本バルカー工業	78,000	259.00	20,202,000	
ユニ・チャーム	103,400	5,630.00	582,142,000	
協和発酵キリン	224,000	1,116.00	249,984,000	
武田薬品工業	701,300	4,645.00	3,257,538,500	代用有価証券で 600,000株 担保差入
アステラス製薬	405,800	5,720.00	2,321,176,000	
大日本住友製薬	132,500	1,442.00	191,065,000	

塩野義製薬	272,900	2,126.00	580,185,400	
田辺三菱製薬	155,800	1,392.00	216,873,600	
わかもと製薬	21,000	298.00	6,258,000	
あすか製薬	22,000	728.00	16,016,000	
日本新薬	39,000	1,814.00	70,746,000	
中外製薬	217,500	2,152.00	468,060,000	
科研製薬	74,000	1,606.00	118,844,000	
エーザイ	230,500	4,340.00	1,000,370,000	
ロート製薬	79,000	1,421.00	112,259,000	
小野薬品工業	91,600	6,810.00	623,796,000	
久光製薬	58,100	5,770.00	335,237,000	
有機合成薬品工業	13,000	298.00	3,874,000	
持田製薬	69,000	1,337.00	92,253,000	
参天製薬	64,100	4,745.00	304,154,500	
扶桑薬品工業	63,000	335.00	21,105,000	
日本ケミファ	26,000	546.00	14,196,000	
ツムラ	51,100	2,927.00	149,569,700	
日医工	27,100	2,259.00	61,218,900	
キッセイ薬品工業	34,700	2,078.00	72,106,600	
生化学工業	35,800	1,369.00	49,010,200	
栄研化学	13,300	1,814.00	24,126,200	
日水製薬	7,500	1,140.00	8,550,000	
鳥居薬品	11,200	2,552.00	28,582,400	
東和薬品	9,500	4,345.00	41,277,500	
富士製薬工業	5,300	1,935.00	10,255,500	
沢井製薬	12,300	12,550.00	154,365,000	
ゼリア新薬工業	27,000	1,555.00	41,985,000	
第一三共	590,300	1,756.00	1,036,566,800	
キョーリン製薬ホールディングス	49,900	2,338.00	116,666,200	
大幸薬品	8,800	1,342.00	11,809,600	
ダイト	6,100	1,418.00	8,649,800	
大塚ホールディングス	371,500	3,430.00	1,274,245,000	
大正製薬ホールディングス	45,000	7,560.00	340,200,000	
日本コークス工業	151,000	113.00	17,063,000	
昭和シェル石油	167,300	897.00	150,068,100	
コスモ石油	518,000	188.00	97,384,000	
ニチレキ	23,000	685.00	15,755,000	
東燃ゼネラル石油	282,000	947.00	267,054,000	
ユシロ化学工業	10,100	984.00	9,938,400	

ビーピー・カストロール	7,700	418.00	3,218,600	
AOCホールディングス	43,400	338.00	14,669,200	
MORESCO	3,500	1,236.00	4,326,000	
出光興産	22,200	8,320.00	184,704,000	
JXホールディングス	2,077,700	523.00	1,086,637,100	
横浜ゴム	209,000	1,032.00	215,688,000	
東洋ゴム工業	155,000	610.00	94,550,000	
ブリヂストン	586,700	3,700.00	2,170,790,000	
住友ゴム工業	146,000	1,739.00	253,894,000	
藤倉ゴム工業	10,400	363.00	3,775,200	
オカモト	65,000	312.00	20,280,000	
フコク	7,800	835.00	6,513,000	
ニッタ	18,500	2,052.00	37,962,000	
東海ゴム工業	34,600	923.00	31,935,800	
三ツ星ベルト	47,000	480.00	22,560,000	
バンドー化学	63,000	376.00	23,688,000	
日東紡績	138,000	377.00	52,026,000	
旭硝子	922,000	663.00	611,286,000	
日本板硝子	853,000	108.00	92,124,000	
石塚硝子	24,000	251.00	6,024,000	
日本山村硝子	75,000	173.00	12,975,000	
日本電気硝子	332,000	561.00	186,252,000	
オハラ	7,200	675.00	4,860,000	
住友大阪セメント	332,000	324.00	107,568,000	
太平洋セメント	1,033,000	338.00	349,154,000	
デイ・シイ	22,000	298.00	6,556,000	
日本ヒューム	18,000	618.00	11,124,000	
日本コンクリート工業	32,000	269.00	8,608,000	
ジャパンパイル	14,700	617.00	9,069,900	
東海カーボン	163,000	295.00	48,085,000	
日本カーボン	99,000	189.00	18,711,000	
東洋炭素	10,400	1,674.00	17,409,600	
ノリタケカンパニーリミテド	97,000	277.00	26,869,000	
TOTO	289,000	1,076.00	310,964,000	
日本碍子	244,000	1,354.00	330,376,000	
日本特殊陶業	161,000	2,082.00	335,202,000	
MARUWA	4,200	3,310.00	13,902,000	
品川リフラクトリーズ	49,000	194.00	9,506,000	
黒崎播磨	48,000	211.00	10,128,000	

東京窯業	23,000	175.00	4,025,000	
ニッカトー	6,300	477.00	3,005,100	
フジミインコーポレーテッド	17,100	1,162.00	19,870,200	
ニチアス	83,000	660.00	54,780,000	
ニチハ	20,800	1,535.00	31,928,000	
新日鐵住金	7,912,000	303.00	2,397,336,000	
神戸製鋼所	2,599,000	154.00	400,246,000	
合同製鐵	105,000	187.00	19,635,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	477,500	2,577.00	1,230,517,500	
日新製鋼ホールディングス	80,100	891.00	71,369,100	
東京製鐵	104,300	497.00	51,837,100	
共英製鋼	17,500	1,762.00	30,835,000	
大和工業	38,700	3,295.00	127,516,500	
東京鐵鋼	37,000	390.00	14,430,000	
大阪製鐵	9,400	1,786.00	16,788,400	
淀川製鋼所	133,000	407.00	54,131,000	
東洋鋼鈑	39,000	366.00	14,274,000	
住友鋼管	12,800	1,134.00	14,515,200	
丸一鋼管	62,600	2,373.00	148,549,800	
モリ工業	28,000	339.00	9,492,000	
大同特殊鋼	289,000	588.00	169,932,000	
日本高周波鋼業	74,000	90.00	6,660,000	
日本冶金工業	144,000	121.00	17,424,000	
山陽特殊製鋼	93,000	517.00	48,081,000	
愛知製鋼	99,000	490.00	48,510,000	
日立金属	158,000	1,142.00	180,436,000	
日本金属	48,000	125.00	6,000,000	
大平洋金属	120,000	465.00	55,800,000	
日本電工	74,000	307.00	22,718,000	
栗本鐵工所	82,000	271.00	22,222,000	
日本鑄鉄管	20,000	224.00	4,480,000	
三菱製鋼	117,000	221.00	25,857,000	
日垂鋼業	26,000	341.00	8,866,000	
日本精線	13,000	459.00	5,967,000	
シンニッタン	14,600	402.00	5,869,200	
新家工業	46,000	152.00	6,992,000	
大紀アルミニウム工業所	32,000	309.00	9,888,000	
日本輕金属ホールディングス	394,500	134.00	52,863,000	
三井金属鉱業	478,000	235.00	112,330,000	

東邦亜鉛	106,000	309.00	32,754,000	
三菱マテリアル	1,095,000	367.00	401,865,000	
住友金属鉱山	484,000	1,294.00	626,296,000	
DOWAホールディングス	207,000	954.00	197,478,000	
古河機械金属	315,000	197.00	62,055,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,500	1,783.00	32,985,500	
東邦チタニウム	31,600	765.00	24,174,000	
住友軽金属工業	453,000	93.00	42,129,000	
古河スカイ	64,000	274.00	17,536,000	
古河電気工業	589,000	244.00	143,716,000	
住友電気工業	661,100	1,312.00	867,363,200	
フジクラ	301,000	357.00	107,457,000	
昭和電線ホールディングス	240,000	81.00	19,440,000	
タツタ電線	35,200	867.00	30,518,400	
沖電線	21,000	147.00	3,087,000	
カナレ電気	2,700	1,477.00	3,987,900	
平河ヒューテック	4,500	757.00	3,406,500	
リョービ	105,000	303.00	31,815,000	
アサヒホールディングス	28,300	1,583.00	44,798,900	
稲葉製作所	8,500	1,631.00	13,863,500	
トーカロ	10,600	1,397.00	14,808,200	
アルファC o	8,300	1,038.00	8,615,400	
SUMCO	116,800	958.00	111,894,400	
川田テクノロジーズ	5,200	2,918.00	15,173,600	
東洋製罐グループホールディングス	132,900	1,754.00	233,106,600	
ホッカンホールディングス	53,000	318.00	16,854,000	
コロナ	8,600	1,097.00	9,434,200	
横河ブリッジホールディングス	37,000	1,147.00	42,439,000	
日本橋梁	27,200	176.00	4,787,200	
駒井ハルテック	49,000	213.00	10,437,000	
高田機工	23,000	207.00	4,761,000	
三和ホールディングス	174,000	546.00	95,004,000	
文化シャッター	52,000	589.00	30,628,000	
三協立山	25,800	2,168.00	55,934,400	
東洋シャッター	9,400	589.00	5,536,600	
L I X I Lグループ	260,700	2,430.00	633,501,000	
日本ファイルコン	19,200	414.00	7,948,800	
ノーリツ	36,700	1,749.00	64,188,300	
長府製作所	18,000	2,204.00	39,672,000	

リンナイ	30,100	7,330.00	220,633,000	
ダイニチ工業	9,600	771.00	7,401,600	
日東精工	30,000	343.00	10,290,000	
三洋工業	34,000	196.00	6,664,000	
岡部	37,900	1,106.00	41,917,400	
東プレ	36,100	940.00	33,934,000	
高周波熱錬	25,300	782.00	19,784,600	
パイオラックス	8,000	2,763.00	22,104,000	
日本発條	135,500	1,229.00	166,529,500	
中央発條	24,000	318.00	7,632,000	
三益半導体工業	16,000	951.00	15,216,000	
アタカ大機	12,000	377.00	4,524,000	
日本製鋼所	289,000	609.00	176,001,000	
三浦工業	27,900	2,751.00	76,752,900	
タクマ	63,000	777.00	48,951,000	
ツガミ	50,000	550.00	27,500,000	
オークマ	122,000	779.00	95,038,000	
東芝機械	93,000	492.00	45,756,000	
アマダ	286,000	731.00	209,066,000	
アイダエンジニアリング	44,000	793.00	34,892,000	
滝澤鉄工所	51,000	158.00	8,058,000	
牧野フライス製作所	87,000	621.00	54,027,000	
オーエスジー	77,000	1,611.00	124,047,000	
ダイジェット工業	29,000	158.00	4,582,000	
旭ダイヤモンド工業	44,900	1,006.00	45,169,400	
森精機製作所	98,700	1,265.00	124,855,500	
ディスコ	20,800	5,980.00	124,384,000	
日東工器	10,900	1,843.00	20,088,700	
豊和工業	119,000	100.00	11,900,000	
大阪機工	72,000	154.00	11,088,000	
東洋機械金属	16,000	258.00	4,128,000	
津田駒工業	45,000	167.00	7,515,000	
島精機製作所	24,400	1,865.00	45,506,000	
日阪製作所	24,000	877.00	21,048,000	
やまびこ	7,800	2,928.00	22,838,400	
ペガサスミシン製造	19,700	350.00	6,895,000	
ナブテスコ	92,600	2,163.00	200,293,800	
三井海洋開発	15,600	3,035.00	47,346,000	
レオン自動機	20,000	239.00	4,780,000	

SMC	53,500	21,210.00	1,134,735,000	
新川	17,000	711.00	12,087,000	
ホソカワミクロン	32,000	716.00	22,912,000	
ユニオンツール	10,400	1,926.00	20,030,400	
オイレス工業	19,500	2,166.00	42,237,000	
サトーホールディングス	19,700	1,892.00	37,272,400	
日本エアータック	6,600	500.00	3,300,000	
日精樹脂工業	15,200	774.00	11,764,800	
ワイエイシイ	9,100	565.00	5,141,500	
小松製作所	873,100	2,330.00	2,034,323,000	
住友重機械工業	512,000	479.00	245,248,000	
日立建機	95,600	2,137.00	204,297,200	
日工	26,000	377.00	9,802,000	
巴工業	7,200	1,588.00	11,433,600	
井関農機	181,000	364.00	65,884,000	
TOWA	18,400	651.00	11,978,400	
丸山製作所	45,000	283.00	12,735,000	
北川鉄工所	81,000	161.00	13,041,000	
クボタ	976,000	1,560.00	1,522,560,000	
荏原実業	4,500	1,309.00	5,890,500	
三菱化工機	59,000	184.00	10,856,000	
月島機械	30,000	1,049.00	31,470,000	
帝国電機製作所	6,000	2,519.00	15,114,000	
新東工業	37,800	809.00	30,580,200	
澁谷工業	11,800	850.00	10,030,000	
アイチ コーポレーション	31,000	547.00	16,957,000	
小森コーポレーション	45,600	1,251.00	57,045,600	
鶴見製作所	14,000	940.00	13,160,000	
住友精密工業	31,000	442.00	13,702,000	
酒井重工業	36,000	281.00	10,116,000	
荏原製作所	385,000	564.00	217,140,000	
石井鐵工所	35,000	245.00	8,575,000	
西島製作所	21,700	940.00	20,398,000	
ダイキン工業	244,200	4,395.00	1,073,259,000	
オルガノ	32,000	528.00	16,896,000	
トーヨーカネツ	100,000	265.00	26,500,000	
栗田工業	103,200	2,184.00	225,388,800	
椿本チエイン	96,000	648.00	62,208,000	
大同工業	46,000	254.00	11,684,000	

日本コンベヤ	57,000	79.00	4,503,000	
木村化工機	20,600	603.00	12,421,800	
アネスト岩田	29,000	478.00	13,862,000	
ダイフク	82,000	930.00	76,260,000	
加藤製作所	45,000	453.00	20,385,000	
油研工業	42,000	237.00	9,954,000	
タダノ	86,000	1,474.00	126,764,000	
フジテック	53,000	956.00	50,668,000	
C K D	50,800	792.00	40,233,600	
キトー	12,000	1,573.00	18,876,000	
平和	39,100	1,730.00	67,643,000	
理想科学工業	12,000	2,259.00	27,108,000	
S A N K Y O	54,200	4,635.00	251,217,000	
日本金銭機械	17,300	1,427.00	24,687,100	
マースエンジニアリング	10,100	1,909.00	19,280,900	
福島工業	10,200	1,492.00	15,218,400	
オーイズミ	6,800	1,135.00	7,718,000	
ダイコク電機	7,700	1,995.00	15,361,500	
アマノ	51,300	1,080.00	55,404,000	
サンデン	105,000	387.00	40,635,000	
マックス	28,000	1,154.00	32,312,000	
グローリー	53,400	2,405.00	128,427,000	
大和冷機工業	29,000	578.00	16,762,000	
セガサミーホールディングス	192,100	2,485.00	477,368,500	
日本ピストンリング	65,000	178.00	11,570,000	
リケン	66,000	425.00	28,050,000	
T P R	20,400	1,765.00	36,006,000	
ホシザキ電機	39,100	3,435.00	134,308,500	
大豊工業	13,100	1,401.00	18,353,100	
日本精工	398,000	994.00	395,612,000	
N T N	388,000	339.00	131,532,000	
ジェイテクト	190,400	1,273.00	242,379,200	
不二越	167,000	463.00	77,321,000	
日本トムソン	62,000	501.00	31,062,000	
T H K	119,000	2,192.00	260,848,000	
ユースン精機	9,000	1,871.00	16,839,000	
前澤給装工業	7,000	1,283.00	8,981,000	
イーグル工業	23,000	1,417.00	32,591,000	
前澤工業	15,600	379.00	5,912,400	

日本ピラー工業	19,000	682.00	12,958,000	
キッツ	74,600	508.00	37,896,800	
日立工機	47,900	798.00	38,224,200	
マキタ	108,800	5,480.00	596,224,000	
日立造船	707,500	158.00	111,785,000	
三菱重工業	2,996,000	572.00	1,713,712,000	
I H I	1,222,000	418.00	510,796,000	
イビデン	108,900	1,579.00	171,953,100	
コニカミノルタ	472,000	789.00	372,408,000	
ブラザー工業	231,100	1,178.00	272,235,800	
ミネベア	244,000	404.00	98,576,000	
日立製作所	4,293,000	683.00	2,932,119,000	
東芝	3,528,000	481.00	1,696,968,000	
三菱電機	1,788,000	1,048.00	1,873,824,000	
富士電機	539,000	372.00	200,508,000	
東洋電機製造	35,000	312.00	10,920,000	
安川電機	196,000	1,237.00	242,452,000	
シンフォニアテクノロジー	108,000	163.00	17,604,000	
明電舎	177,000	363.00	64,251,000	
オリジン電気	26,000	324.00	8,424,000	
山洋電気	27,000	802.00	21,654,000	
デンヨー	17,600	1,475.00	25,960,000	
東芝テック	112,000	578.00	64,736,000	
芝浦メカトロニクス	36,000	290.00	10,440,000	
マブチモーター	25,200	5,450.00	137,340,000	
日本電産	96,600	8,460.00	817,236,000	
東光高岳ホールディングス	9,000	1,807.00	16,263,000	
ダイヘン	98,000	442.00	43,316,000	
ヤーマン	2,300	1,285.00	2,955,500	
J V C ケンウッド	108,000	235.00	25,380,000	
第一精工	5,600	1,301.00	7,285,600	
日新電機	36,000	707.00	25,452,000	
大崎電気工業	24,000	558.00	13,392,000	
オムロン	189,100	3,105.00	587,155,500	
日東工業	26,300	1,808.00	47,550,400	
I D E C	23,400	928.00	21,715,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	344,000	428.00	147,232,000	
サクサホールディングス	46,000	178.00	8,188,000	
メルコホールディングス	11,100	1,386.00	15,384,600	

テクノメディカ	13	621,000.00	8,073,000	
日本電気	2,314,000	243.00	562,302,000	
富士通	1,724,000	400.00	689,600,000	
沖電気工業	650,000	209.00	135,850,000	
岩崎通信機	78,000	92.00	7,176,000	
電気興業	47,000	565.00	26,555,000	
サンケン電気	91,000	447.00	40,677,000	
ナカヨ通信機	18,000	317.00	5,706,000	
アイホン	10,400	1,642.00	17,076,800	
ルネサスエレクトロニクス	46,300	424.00	19,631,200	
セイコーエプソン	122,100	1,318.00	160,927,800	
ワコム	131,400	997.00	131,005,800	
アルバック	30,100	828.00	24,922,800	
アクセル	8,900	1,845.00	16,420,500	
E I Z O	15,200	2,326.00	35,355,200	
日本信号	45,200	736.00	33,267,200	
京三製作所	39,000	349.00	13,611,000	
能美防災	24,000	821.00	19,704,000	
ホーチキ	16,000	477.00	7,632,000	
エレコム	5,600	1,231.00	6,893,600	
日本無線	39,000	348.00	13,572,000	
パナソニック	2,042,400	872.00	1,780,972,800	
シャープ	925,000	447.00	413,475,000	
アンリツ	96,000	1,215.00	116,640,000	
富士通ゼネラル	43,000	1,088.00	46,784,000	
日立国際電気	41,000	1,109.00	45,469,000	
ソニー	1,123,400	2,207.00	2,479,343,800	
T D K	100,700	3,710.00	373,597,000	
帝国通信工業	42,000	168.00	7,056,000	
ミツミ電機	68,000	774.00	52,632,000	
タムラ製作所	69,000	237.00	16,353,000	
アルプス電気	131,000	805.00	105,455,000	
パイオニア	217,600	197.00	42,867,200	
日本電波工業	15,600	926.00	14,445,600	
日本トリム	2,400	8,150.00	19,560,000	
ローランド ディー. ジー.	8,100	2,987.00	24,194,700	
フォスター電機	18,300	1,805.00	33,031,500	
クラリオン	94,000	128.00	12,032,000	
SMK	53,000	340.00	18,020,000	

ヨコオ	13,900	515.00	7,158,500	
東光	110,000	306.00	33,660,000	
ホシデン	48,400	587.00	28,410,800	
ヒロセ電機	31,100	13,660.00	424,826,000	
日本航空電子工業	41,000	1,058.00	43,378,000	
TOA	19,000	825.00	15,675,000	
ユニデン	53,000	231.00	12,243,000	
アルパイン	34,900	1,068.00	37,273,200	
スミダコーポレーション	14,900	492.00	7,330,800	
アイコム	9,900	2,462.00	24,373,800	
リオン	4,600	1,032.00	4,747,200	
船井電機	18,100	1,001.00	18,118,100	
横河電機	179,000	1,343.00	240,397,000	
新電元工業	58,000	448.00	25,984,000	
アズビル	50,100	2,256.00	113,025,600	
日本光電工業	35,600	4,370.00	155,572,000	
チノー	32,000	222.00	7,104,000	
共和電業	20,000	318.00	6,360,000	
日本電子材料	7,900	398.00	3,144,200	
堀場製作所	35,400	3,860.00	136,644,000	
アドバンテスト	121,900	1,539.00	187,604,100	
小野測器	20,000	423.00	8,460,000	
エスベック	18,500	805.00	14,892,500	
パナソニック デバイスSUNX	15,700	416.00	6,531,200	
キーエンス	43,900	34,500.00	1,514,550,000	
日置電機	9,300	1,406.00	13,075,800	
シスメックス	63,200	6,700.00	423,440,000	
メガチップス	14,700	1,447.00	21,270,900	
OBARA GROUP	11,600	2,945.00	34,162,000	
日本電産コバル電子	18,400	502.00	9,236,800	
東京電波	5,200	742.00	3,858,400	
澤藤電機	12,000	250.00	3,000,000	
コーセル	26,000	1,198.00	31,148,000	
日立メディコ	13,000	1,310.00	17,030,000	
新日本無線	13,000	548.00	7,124,000	
オプテックス	11,300	1,581.00	17,865,300	
千代田インテグレ	7,800	1,424.00	11,107,200	
レーザーテック	12,800	1,199.00	15,347,200	
スタンレー電気	139,100	2,055.00	285,850,500	

岩崎電気	72,000	205.00	14,760,000	
ウシオ電機	108,500	1,327.00	143,979,500	
岡谷電機産業	9,500	339.00	3,220,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	15,200	226.00	3,435,200	
日本セラミック	11,700	1,341.00	15,689,700	
日本デジタル研究所	15,200	1,046.00	15,899,200	
古河電池	14,000	566.00	7,924,000	
双信電機	8,700	353.00	3,071,100	
図研	10,300	941.00	9,692,300	
日本電子	67,000	530.00	35,510,000	
カシオ計算機	170,500	919.00	156,689,500	
ファナック	186,100	14,930.00	2,778,473,000	
日本シイエムケイ	38,500	332.00	12,782,000	
エンプラス	7,900	7,500.00	59,250,000	
ローム	94,400	4,165.00	393,176,000	
浜松ホトニクス	69,700	3,605.00	251,268,500	
三井ハイテック	25,900	630.00	16,317,000	
新光電気工業	60,000	1,050.00	63,000,000	
京セラ	148,700	10,950.00	1,628,265,000	
太陽誘電	86,900	1,415.00	122,963,500	
村田製作所	187,500	7,440.00	1,395,000,000	
ユーシン	26,900	742.00	19,959,800	
双葉電子工業	33,100	1,202.00	39,786,200	
北陸電気工業	72,000	148.00	10,656,000	
ニチコン	56,300	1,080.00	60,804,000	
日本ケミコン	105,000	421.00	44,205,000	
K O A	22,500	1,046.00	23,535,000	
市光工業	47,000	167.00	7,849,000	
小糸製作所	89,000	1,975.00	175,775,000	
ミツバ	33,000	1,720.00	56,760,000	
スター精密	31,300	1,007.00	31,519,100	
大日本スクリーン製造	183,000	572.00	104,676,000	
キヤノン電子	16,400	1,892.00	31,028,800	
キヤノン	1,110,500	3,245.00	3,603,572,500	
リコー	538,000	1,199.00	645,062,000	
M U T O Hホールディングス	25,000	463.00	11,575,000	
東京エレクトロン	150,400	4,770.00	717,408,000	
トヨタ紡織	62,500	1,534.00	95,875,000	
鬼怒川ゴム工業	34,000	558.00	18,972,000	

ユニプレス	31,500	1,924.00	60,606,000	
豊田自動織機	162,800	4,430.00	721,204,000	
モリタホールディングス	31,000	848.00	26,288,000	
三桜工業	22,700	735.00	16,684,500	
デンソー	441,600	4,900.00	2,163,840,000	
東海理化電機製作所	41,800	2,186.00	91,374,800	
三井造船	692,000	177.00	122,484,000	
佐世保重工業	117,000	97.00	11,349,000	
川崎重工業	1,392,000	346.00	481,632,000	
日本車輛製造	65,000	577.00	37,505,000	
ニチユ三菱フォークリフト	23,000	459.00	10,557,000	
近畿車輛	31,000	327.00	10,137,000	
日産自動車	2,258,300	1,112.00	2,511,229,600	
いすゞ自動車	1,036,000	795.00	823,620,000	
トヨタ自動車	2,296,600	6,380.00	14,652,308,000	代用有価証券で 1,500,000株 担保差 入
日野自動車	223,000	1,654.00	368,842,000	
三菱自動車工業	4,458,000	153.00	682,074,000	
エフテック	6,200	1,618.00	10,031,600	
武蔵精密工業	19,000	2,655.00	50,445,000	
日産車体	61,000	1,287.00	78,507,000	
新明和工業	72,000	863.00	62,136,000	
極東開発工業	33,200	1,105.00	36,686,000	
日信工業	36,300	1,950.00	70,785,000	
トピー工業	134,000	210.00	28,140,000	
ティラド	60,000	374.00	22,440,000	
曙ブレーキ工業	83,000	535.00	44,405,000	
タチエス	24,000	1,447.00	34,728,000	
NOK	86,500	1,714.00	148,261,000	
フタバ産業	54,400	471.00	25,622,400	
カヤバ工業	136,000	529.00	71,944,000	
シロキ工業	40,000	218.00	8,720,000	
大同メタル工業	25,000	663.00	16,575,000	
プレス工業	76,000	445.00	33,820,000	
カルソニックカンセイ	121,000	489.00	59,169,000	
太平洋工業	36,400	778.00	28,319,200	
ケーヒン	37,000	1,571.00	58,127,000	
河西工業	22,000	571.00	12,562,000	

アイシン精機	163,600	4,170.00	682,212,000	
富士機工	21,000	316.00	6,636,000	
マツダ	2,830,000	444.00	1,256,520,000	
ダイハツ工業	190,000	2,237.00	425,030,000	
今仙電機製作所	13,100	1,526.00	19,990,600	
本田技研工業	1,508,100	3,895.00	5,874,049,500	
スズキ	373,700	2,496.00	932,755,200	
富士重工業	565,000	2,775.00	1,567,875,000	
ヤマハ発動機	271,800	1,505.00	409,059,000	
ショーワ	42,200	1,325.00	55,915,000	
T B K	18,000	480.00	8,640,000	
エクセディ	24,300	2,676.00	65,026,800	
豊田合成	50,500	2,722.00	137,461,000	
愛三工業	18,500	1,095.00	20,257,500	
ヨロズ	13,100	1,750.00	22,925,000	
エフ・シー・シー	29,200	2,543.00	74,255,600	
シマノ	72,000	9,180.00	660,960,000	
タカタ	32,300	2,155.00	69,606,500	
ティ・エス テック	37,700	3,435.00	129,499,500	
日本電産トーソク	8,500	1,044.00	8,874,000	
テルモ	137,000	5,390.00	738,430,000	
クリエートメディック	5,400	861.00	4,649,400	
日機装	62,000	1,299.00	80,538,000	
島津製作所	214,000	822.00	175,908,000	
J M S	30,000	342.00	10,260,000	
ショットモリテックス	3,900	303.00	1,181,700	
長野計器	12,600	762.00	9,601,200	
ブイ・テクノロジー	37	248,000.00	9,176,000	
東京計器	57,000	230.00	13,110,000	
愛知時計電機	21,000	291.00	6,111,000	
東京精密	32,100	2,079.00	66,735,900	
マニー	5,500	3,655.00	20,102,500	
ニコン	333,800	2,161.00	721,341,800	
トプコン	41,300	1,140.00	47,082,000	
オリンパス	236,400	2,990.00	706,836,000	
理研計器	14,500	739.00	10,715,500	
タムロン	13,800	2,075.00	28,635,000	
HOYA	434,600	2,244.00	975,242,400	
ノーリツ銅機	16,100	714.00	11,495,400	

エー・アンド・デイ	16,300	719.00	11,719,700	
日本電産コパル	14,000	1,021.00	14,294,000	
シチズンホールディングス	201,800	592.00	119,465,600	
リズム時計工業	81,000	148.00	11,988,000	
大研医器	4,400	2,106.00	9,266,400	
松風	8,800	891.00	7,840,800	
セイコーホールディングス	114,000	454.00	51,756,000	
ニプロ	95,200	1,027.00	97,770,400	
パラマウントベッドホールディングス	15,400	3,360.00	51,744,000	
SHO-BI	5,600	430.00	2,408,000	
前田工繊	14,200	971.00	13,788,200	
永大産業	24,000	422.00	10,128,000	
ダンロップスポーツ	9,700	1,153.00	11,184,100	
バンダイナムコホールディングス	184,900	1,664.00	307,673,600	
共立印刷	27,300	249.00	6,797,700	
フランスベッドホールディングス	113,000	208.00	23,504,000	
パイロットコーポレーション	15,900	3,500.00	55,650,000	
トッパン・フォームズ	32,000	804.00	25,728,000	
フジシールインターナショナル	21,800	2,991.00	65,203,800	
タカラトミー	60,500	491.00	29,705,500	
廣済堂	15,200	546.00	8,299,200	
タカノ	8,200	467.00	3,829,400	
プロネクサス	21,000	635.00	13,335,000	
ホクシン	13,200	177.00	2,336,400	
ウッドワン	33,000	308.00	10,164,000	
大建工業	74,000	277.00	20,498,000	
凸版印刷	505,000	704.00	355,520,000	
大日本印刷	544,000	923.00	502,112,000	
図書印刷	33,000	258.00	8,514,000	
共同印刷	59,000	285.00	16,815,000	
日本写真印刷	27,800	2,005.00	55,739,000	
光村印刷	17,000	260.00	4,420,000	
宝印刷	10,400	716.00	7,446,400	
アシックス	166,500	1,741.00	289,876,500	
ツツミ	9,000	2,424.00	21,816,000	
ローランド	16,200	946.00	15,325,200	
小松ウオール工業	6,900	1,983.00	13,682,700	
ヤマハ	131,500	1,304.00	171,476,000	
河合楽器製作所	66,000	215.00	14,190,000	

クリナップ	18,800	805.00	15,134,000	
ピジョン	13,500	9,160.00	123,660,000	
兼松日産農林	28,000	158.00	4,424,000	
キングジム	15,000	730.00	10,950,000	
リンテック	38,300	1,934.00	74,072,200	
イトーキ	38,400	511.00	19,622,400	
任天堂	102,200	13,470.00	1,376,634,000	
三菱鉛筆	14,800	2,046.00	30,280,800	
タカラスタANDARD	82,000	740.00	60,680,000	
コクヨ	93,000	724.00	67,332,000	
ナカバヤシ	39,000	203.00	7,917,000	
グローブライト	87,000	117.00	10,179,000	
岡村製作所	69,000	672.00	46,368,000	
美津濃	89,000	648.00	57,672,000	
アデランス	22,600	1,416.00	32,001,600	
東京電力	1,516,300	636.00	964,366,800	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	546,900	1,412.00	772,222,800	
関西電力	729,500	1,321.00	963,669,500	
中国電力	247,100	1,538.00	380,039,800	
北陸電力	175,100	1,537.00	269,128,700	
東北電力	446,600	1,216.00	543,065,600	
四国電力	161,000	1,812.00	291,732,000	
九州電力	394,800	1,410.00	556,668,000	
北海道電力	167,300	1,310.00	219,163,000	
沖縄電力	10,700	3,765.00	40,285,500	
電源開発	110,900	3,460.00	383,714,000	
東京瓦斯	2,146,000	574.00	1,231,804,000	
大阪瓦斯	1,735,000	434.00	752,990,000	
東邦瓦斯	455,000	519.00	236,145,000	
北海道瓦斯	32,000	253.00	8,096,000	
西部瓦斯	201,000	245.00	49,245,000	
静岡瓦斯	46,500	739.00	34,363,500	
東武鉄道	1,015,000	536.00	544,040,000	
相鉄ホールディングス	286,000	368.00	105,248,000	
東京急行電鉄	1,052,000	685.00	720,620,000	
京浜急行電鉄	459,000	879.00	403,461,000	
小田急電鉄	573,000	998.00	571,854,000	
京王電鉄	499,000	719.00	358,781,000	

京成電鉄	268,000	970.00	259,960,000	
富士急行	49,000	1,035.00	50,715,000	
新京成電鉄	23,000	386.00	8,878,000	
東日本旅客鉄道	329,700	8,130.00	2,680,461,000	
西日本旅客鉄道	154,100	4,325.00	666,482,500	
東海旅客鉄道	148,600	12,730.00	1,891,678,000	
鴻池運輸	7,100	1,336.00	9,485,600	
西日本鉄道	231,000	389.00	89,859,000	
ハマキョウレックス	5,100	3,330.00	16,983,000	
サカイ引越センター	3,300	2,700.00	8,910,000	
近畿日本鉄道	1,615,000	443.00	715,445,000	
阪急阪神ホールディングス	1,129,000	584.00	659,336,000	
南海電気鉄道	373,000	380.00	141,740,000	
京阪電気鉄道	400,000	412.00	164,800,000	
名糖運輸	7,300	637.00	4,650,100	
名古屋鉄道	624,000	289.00	180,336,000	
日本通運	708,000	517.00	366,036,000	
ヤマトホールディングス	332,900	2,264.00	753,685,600	
山九	217,000	381.00	82,677,000	
丸運	9,600	246.00	2,361,600	
丸全昭和運輸	60,000	358.00	21,480,000	
センコー	72,000	519.00	37,368,000	
トナミホールディングス	37,000	219.00	8,103,000	
日本梱包運輸倉庫	54,600	1,640.00	89,544,000	
日本石油輸送	20,000	218.00	4,360,000	
福山通運	108,000	616.00	66,528,000	
セイノーホールディングス	138,000	923.00	127,374,000	
神奈川中央交通	21,000	512.00	10,752,000	
日立物流	31,000	1,504.00	46,624,000	
日本郵船	1,417,000	291.00	412,347,000	
商船三井	875,000	405.00	354,375,000	
川崎汽船	792,000	206.00	163,152,000	
NSユナイテッド海運	77,000	151.00	11,627,000	
乾汽船	32,300	345.00	11,143,500	
飯野海運	85,600	547.00	46,823,200	
共栄タンカー	33,000	228.00	7,524,000	
日本航空	201,300	5,460.00	1,099,098,000	
ANAホールディングス	3,513,000	218.00	765,834,000	
パスコ	16,000	360.00	5,760,000	

トランコム	4,700	2,951.00	13,869,700	
日新	68,000	296.00	20,128,000	
三菱倉庫	127,000	1,572.00	199,644,000	
三井倉庫	83,000	523.00	43,409,000	
住友倉庫	120,000	605.00	72,600,000	
澁澤倉庫	46,000	464.00	21,344,000	
東陽倉庫	28,000	264.00	7,392,000	
日本トランスシティ	41,000	341.00	13,981,000	
ケイヒン	33,000	172.00	5,676,000	
安田倉庫	13,900	948.00	13,177,200	
東洋埠頭	52,000	189.00	9,828,000	
宇徳	14,500	345.00	5,002,500	
上組	198,000	847.00	167,706,000	
サンリツ	4,700	535.00	2,514,500	
キムラユニティー	4,000	982.00	3,928,000	
キューソー流通システム	4,900	959.00	4,699,100	
郵船ロジスティクス	14,100	932.00	13,141,200	
近鉄エクスプレス	16,000	3,910.00	62,560,000	
東海運	9,600	248.00	2,380,800	
エーアイテイー	2,900	1,268.00	3,677,200	
NEC ネットエスアイ	16,600	2,318.00	38,478,800	
システナ	18,900	740.00	13,986,000	
デジタルアーツ	6,500	1,151.00	7,481,500	
新日鉄住金ソリューションズ	11,800	2,000.00	23,600,000	
コア	6,700	784.00	5,252,800	
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	718.00	4,164,400	
デジタルハーツ	3,300	2,383.00	7,863,900	
ITホールディングス	58,500	1,237.00	72,364,500	
ネオス	35	135,900.00	4,756,500	
電算システム	4,000	1,147.00	4,588,000	
グリー	91,400	812.00	74,216,800	
コーエーテクモホールディングス	34,900	950.00	33,155,000	
三菱総合研究所	6,900	2,210.00	15,249,000	
ボルテージ	2,600	885.00	2,301,000	
電算	1,000	1,792.00	1,792,000	
K L a b	11,700	1,210.00	14,157,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,700	2,639.00	9,764,300	
ネクソン	145,900	1,298.00	189,378,200	

アイスタイル	4,900	729.00	3,572,100	
エイチーム	1,600	3,540.00	5,664,000	
ブロードリーフ	16,600	1,603.00	26,609,800	
ドワンゴ	79	429,000.00	33,891,000	
ベリサーブ	10	196,700.00	1,967,000	
マクロミル	28,100	632.00	17,759,200	
ティーガイア	22,000	942.00	20,724,000	
テクマトリックス	5,300	599.00	3,174,700	
GMOペイメントゲートウェイ	6,700	2,112.00	14,150,400	
ザッパラス	98	78,500.00	7,693,000	
インターネットイニシアティブ	23,000	3,395.00	78,085,000	
SRAホールディングス	8,500	1,167.00	9,919,500	
朝日ネット	15,000	428.00	6,420,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	4,200	2,407.00	10,109,400	
フェイス	604	10,330.00	6,239,320	
野村総合研究所	99,900	3,405.00	340,159,500	
サイバネットシステム	146	33,900.00	4,949,400	
インテージ	5,200	2,500.00	13,000,000	
シンプレクス・ホールディングス	345	44,900.00	15,490,500	
ソースネクスト	4,400	1,157.00	5,090,800	
クレスコ	4,100	746.00	3,058,600	
フジ・メディア・ホールディングス	1,706	193,800.00	330,622,800	
オービック	6,080	28,800.00	175,104,000	
TDCソフトウェアエンジニアリング	3,600	807.00	2,905,200	
ヤフー	12,770	56,300.00	718,951,000	
トレンドマイクロ	70,100	3,315.00	232,381,500	
日本オラクル	35,300	3,895.00	137,493,500	
アルファシステムズ	5,800	1,225.00	7,105,000	
フューチャーアーキテクト	21,300	503.00	10,713,900	
シーエーシー	10,800	895.00	9,666,000	
ソフトバンク・テクノロジー	4,200	1,671.00	7,018,200	
トーセ	4,400	715.00	3,146,000	
オービックビジネスコンサルタント	5,600	6,540.00	36,624,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	20,800	4,055.00	84,344,000	
アイティフォー	19,800	418.00	8,276,400	
東計電算	3,200	1,369.00	4,380,800	
エックスネット	17	137,800.00	2,342,600	
大塚商会	15,800	11,800.00	186,440,000	

サイボウズ	295	28,360.00	8,366,200	
ソフトブレーン	26,200	140.00	3,668,000	
アグレックス	4,700	857.00	4,027,900	
電通国際情報サービス	10,900	1,134.00	12,360,600	
EMシステムズ	2,700	2,006.00	5,416,200	
ウェザーニューズ	4,600	2,344.00	10,782,400	
C I J	16,400	400.00	6,560,000	
WOWOW	54	385,000.00	20,790,000	
ネットワンシステムズ	64,300	813.00	52,275,900	
アルゴグラフィックス	6,500	1,766.00	11,479,000	
マーベラスAQL	269	56,300.00	15,144,700	
エイベックス・グループ・ホールディングス	33,300	3,320.00	110,556,000	
日本ユニシス	48,800	756.00	36,892,800	
兼松エレクトロニクス	11,200	1,307.00	14,638,400	
東京放送ホールディングス	95,200	1,344.00	127,948,800	
日本テレビホールディングス	161,100	1,850.00	298,035,000	
テレビ朝日	44,700	2,188.00	97,803,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,531	52,000.00	79,612,000	
テレビ東京ホールディングス	12,800	1,749.00	22,387,200	
アイ・ティー・シーネットワーク	15,600	872.00	13,603,200	
日本電信電話	742,800	5,270.00	3,914,556,000	代用有価証券で 400,000株 担保差入
K D D I	497,900	5,260.00	2,618,954,000	
光通信	17,800	6,260.00	111,428,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	14,537	152,600.00	2,218,346,200	
GMOインターネット	58,900	1,011.00	59,547,900	
学研ホールディングス	59,000	310.00	18,290,000	
ゼンリン	23,400	1,160.00	27,144,000	
昭文社	10,700	598.00	6,398,600	
KADOKAWA	15,100	3,625.00	54,737,500	
インプレスホールディングス	15,000	137.00	2,055,000	
アイネット	7,700	792.00	6,098,400	
松竹	116,000	987.00	114,492,000	
東宝	125,900	2,133.00	268,544,700	
東映	74,000	643.00	47,582,000	
A O I P r o .	8,200	642.00	5,264,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,090	386,000.00	420,740,000	
D T S	16,800	1,474.00	24,763,200	

スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,100	1,340.00	85,894,000	
シーイーシー	11,600	658.00	7,632,800	
カプコン	33,900	1,742.00	59,053,800	
ジャステック	10,200	702.00	7,160,400	
S C S K	42,000	2,120.00	89,040,000	
日本システムウエア	6,800	445.00	3,026,000	
アイネス	24,100	641.00	15,448,100	
T K C	14,900	1,733.00	25,821,700	
富士ソフト	24,300	2,001.00	48,624,300	
N S D	34,800	1,120.00	38,976,000	
コナミ	79,700	2,287.00	182,273,900	
福井コンピュータホールディングス	2,500	689.00	1,722,500	
J B C Cホールディングス	14,800	1,229.00	18,189,200	
ミロク情報サービス	12,000	377.00	4,524,000	
ソフトバンク	854,500	6,700.00	5,725,150,000	
ハウスイ	15,000	121.00	1,815,000	
高千穂交易	7,400	913.00	6,756,200	
伊藤忠食品	4,400	3,430.00	15,092,000	
エレマテック	8,300	1,312.00	10,889,600	
J A L U X	5,100	1,024.00	5,222,400	
あらた	40,000	357.00	14,280,000	
トーメンデバイス	2,700	1,684.00	4,546,800	
東京エレクトロン デバイス	36	154,500.00	5,562,000	
双日	1,111,400	179.00	198,940,600	
アルフレッサ ホールディングス	45,700	5,350.00	244,495,000	
横浜冷凍	43,800	800.00	35,040,000	
山下医科器械	1,500	1,715.00	2,572,500	
ラサ商事	7,800	451.00	3,517,800	
アルコニックス	5,000	2,021.00	10,105,000	
あい ホールディングス	31,500	900.00	28,350,000	
ダイワボウホールディングス	160,000	164.00	26,240,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	33,300	799.00	26,606,700	
八洲電機	12,900	432.00	5,572,800	
U K Cホールディングス	10,500	1,718.00	18,039,000	
T O K A Iホールディングス	69,200	341.00	23,597,200	
ミタチ産業	4,300	406.00	1,745,800	
シップヘルスケアホールディングス	25,200	3,855.00	97,146,000	
富士興産	6,500	591.00	3,841,500	

協栄産業	22,000	204.00	4,488,000	
小野建	15,400	993.00	15,292,200	
佐島電機	13,100	553.00	7,244,300	
エコートレーディング	4,500	790.00	3,555,000	
伯東	10,800	939.00	10,141,200	
コンドーテック	14,400	607.00	8,740,800	
中山福	10,200	764.00	7,792,800	
ナガイレーベン	23,400	1,569.00	36,714,600	
三菱食品	19,400	2,620.00	50,828,000	
松田産業	12,900	1,346.00	17,363,400	
メディパルホールディングス	176,500	1,296.00	228,744,000	
アドヴァン	9,000	1,193.00	10,737,000	
S P K	4,100	1,741.00	7,138,100	
アズワン	11,500	2,436.00	28,014,000	
スズデン	5,900	515.00	3,038,500	
尾家産業	5,800	815.00	4,727,000	
シモジマ	10,900	993.00	10,823,700	
ドウシシャ	18,700	1,398.00	26,142,600	
高速	10,600	920.00	9,752,000	
黒田電気	23,600	1,417.00	33,441,200	
丸文	15,800	441.00	6,967,800	
ハピネット	10,800	742.00	8,013,600	
トーメンエレクトロニクス	9,100	1,247.00	11,347,700	
エクセル	7,700	1,168.00	8,993,600	
マルカキカイ	5,800	1,232.00	7,145,600	
ガリバーインターナショナル	59,500	642.00	38,199,000	
日本エム・ディ・エム	16,600	258.00	4,282,800	
進和	10,500	1,207.00	12,673,500	
エスケイジャパン	4,500	300.00	1,350,000	
ダイトエレクトロン	8,300	412.00	3,419,600	
シークス	11,300	1,214.00	13,718,200	
田中商事	6,100	571.00	3,483,100	
オーハシテクニカ	9,500	860.00	8,170,000	
マクニカ	9,100	2,700.00	24,570,000	
白銅	5,800	800.00	4,640,000	
伊藤忠商事	1,407,500	1,246.00	1,753,745,000	
丸紅	1,447,000	724.00	1,047,628,000	
高島	33,000	298.00	9,834,000	
F & A アクアホールディングス	13,500	1,587.00	21,424,500	

長瀬産業	99,900	1,403.00	140,159,700	
蝶理	11,300	1,050.00	11,865,000	
豊田通商	196,600	2,968.00	583,508,800	
三共生興	30,200	362.00	10,932,400	
兼松	375,000	116.00	43,500,000	
ツカモトコーポレーション	29,000	156.00	4,524,000	
三井物産	1,522,900	1,371.00	2,087,895,900	
日本紙パルプ商事	92,000	326.00	29,992,000	
日立ハイテクノロジーズ	53,600	2,299.00	123,226,400	
カメイ	21,000	788.00	16,548,000	
東都水産	32,000	149.00	4,768,000	
スターゼン	59,000	267.00	15,753,000	
山善	67,900	646.00	43,863,400	
椿本興業	20,000	270.00	5,400,000	
住友商事	1,041,200	1,361.00	1,417,073,200	
内田洋行	41,000	277.00	11,357,000	
三菱商事	1,376,700	1,866.00	2,568,922,200	
第一実業	40,000	432.00	17,280,000	
キャノンマーケティングジャパン	58,800	1,302.00	76,557,600	
西華産業	61,000	249.00	15,189,000	
佐藤商事	15,900	596.00	9,476,400	
菱洋エレクトロ	20,900	834.00	17,430,600	
東京産業	18,000	318.00	5,724,000	
ユアサ商事	180,000	185.00	33,300,000	
神鋼商事	45,000	195.00	8,775,000	
阪和興業	176,000	401.00	70,576,000	
カナデン	18,000	654.00	11,772,000	
菱電商事	25,000	689.00	17,225,000	
フルサト工業	9,000	985.00	8,865,000	
岩谷産業	196,000	387.00	75,852,000	
すてきナイスグループ	70,000	215.00	15,050,000	
昭光通商	63,000	140.00	8,820,000	
ニチモウ	26,000	187.00	4,862,000	
極東貿易	21,000	206.00	4,326,000	
イワキ	27,000	199.00	5,373,000	
三菱石油	41,000	396.00	16,236,000	
稲畑産業	43,500	848.00	36,888,000	
G S I クレオス	47,000	164.00	7,708,000	
明和産業	14,200	357.00	5,069,400	

東邦ホールディングス	56,500	1,863.00	105,259,500	
サンゲツ	31,300	2,607.00	81,599,100	
ミツウロコグループホールディングス	28,600	494.00	14,128,400	
シナネン	38,000	371.00	14,098,000	
伊藤忠エネクス	39,100	522.00	20,410,200	
サンリオ	44,500	5,030.00	223,835,000	
サンワテクノス	8,700	1,005.00	8,743,500	
リョーサン	28,800	1,765.00	50,832,000	
新光商事	19,400	867.00	16,819,800	
トーホー	37,000	360.00	13,320,000	
三信電気	25,400	611.00	15,519,400	
東陽テクニカ	24,300	1,190.00	28,917,000	
モスフードサービス	23,100	1,920.00	44,352,000	
加賀電子	17,600	803.00	14,132,800	
ソーダニッカ	18,000	414.00	7,452,000	
立花エレテック	10,800	1,027.00	11,091,600	
P a l t a c	20,900	1,326.00	27,713,400	
ヤマタネ	82,000	187.00	15,334,000	
丸紅建材リース	15,000	176.00	2,640,000	
日鐵商事	40,000	292.00	11,680,000	
トラスコ中山	20,200	2,077.00	41,955,400	
オートバックスセブン	62,000	1,503.00	93,186,000	
加藤産業	25,500	2,077.00	52,963,500	
イノテック	15,400	465.00	7,161,000	
イエローハット	16,700	1,977.00	33,015,900	
富士エレクトロニクス	9,100	1,307.00	11,893,700	
J Kホールディングス	14,900	552.00	8,224,800	
日伝	8,000	2,374.00	18,992,000	
北沢産業	14,000	186.00	2,604,000	
杉本商事	9,600	879.00	8,438,400	
因幡電機産業	23,700	2,758.00	65,364,600	
住金物産	92,000	305.00	28,060,000	
バイテック	4,100	825.00	3,382,500	
ミスミグループ本社	65,600	2,702.00	177,251,200	
江守商事	4,000	1,314.00	5,256,000	
アルテック	8,600	352.00	3,027,200	
タキヒヨー	27,000	438.00	11,826,000	
スズケン	67,800	3,310.00	224,418,000	
ジェコス	12,300	615.00	7,564,500	

ローソン	66,800	8,020.00	535,736,000	
サンエー	6,700	4,970.00	33,299,000	
キリン堂	6,300	697.00	4,391,100	
ダイユーエイト	3,600	646.00	2,325,600	
カワチ薬品	12,300	2,042.00	25,116,600	
エービーシー・マート	20,900	4,550.00	95,095,000	
ハードオフコーポレーション	8,600	765.00	6,579,000	
アスクル	15,100	1,870.00	28,237,000	
ゲオホールディングス	302	90,800.00	27,421,600	
ポイント	16,260	5,050.00	82,113,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	23,000	100.00	2,300,000	
くらコーポレーション	10,400	1,737.00	18,064,800	
キャンドゥ	9,300	1,510.00	14,043,000	
パル	10,300	2,960.00	30,488,000	
エディオン	76,300	583.00	44,482,900	
サーラコーポレーション	15,200	504.00	7,660,800	
あみやき亭	30	310,000.00	9,300,000	
ひらまつ	18,200	758.00	13,795,600	
ゲンキー	1,500	2,120.00	3,180,000	
大黒天物産	3,600	2,961.00	10,659,600	
ハニーズ	13,960	1,127.00	15,732,920	
アルペン	13,500	2,008.00	27,108,000	
クオール	8,900	552.00	4,912,800	
ジェイアイエヌ	9,000	4,310.00	38,790,000	
ビックカメラ	670	48,850.00	32,729,500	
DCMホールディングス	87,100	755.00	65,760,500	
Monotaro	23,800	2,516.00	59,880,800	
J. フロント リテイリング	417,000	869.00	362,373,000	
ドトール・日レスホールディングス	30,900	1,584.00	48,945,600	
マツモトキヨシホールディングス	29,700	3,145.00	93,406,500	
ブロンコビリー	2,200	1,891.00	4,160,200	
スタートトゥデイ	48,800	2,173.00	106,042,400	
物語コーポレーション	2,500	3,860.00	9,650,000	
ココカラファイン	18,400	3,245.00	59,708,000	
三越伊勢丹ホールディングス	350,600	1,471.00	515,732,600	
ウエルシアホールディングス	6,200	5,420.00	33,604,000	
クリエイトSDホールディングス	7,400	3,885.00	28,749,000	
丸善CH I ホールディングス	10,300	293.00	3,017,900	
ブックオフコーポレーション	9,800	688.00	6,742,400	

あさひ	10,200	1,595.00	16,269,000	
日本調剤	2,230	2,902.00	6,471,460	
コスモス薬品	8,900	10,500.00	93,450,000	
一六堂	2,200	545.00	1,199,000	
セブン&アイ・ホールディングス	738,000	3,850.00	2,841,300,000	
ツルハホールディングス	17,300	9,500.00	164,350,000	
サンマルクホールディングス	5,700	4,845.00	27,616,500	
フェリシモ	5,000	1,187.00	5,935,000	
トリドール	15,300	1,071.00	16,386,300	
クスリのアオキ	2,600	7,470.00	19,422,000	
メディカルシステムネットワーク	13,000	424.00	5,512,000	
総合メディカル	4,300	4,060.00	17,458,000	
はるやま商事	7,400	707.00	5,231,800	
カップ・クリエイトホールディングス	12,950	1,836.00	23,776,200	
ライトオン	13,200	986.00	13,015,200	
良品計画	18,700	8,830.00	165,121,000	
三城ホールディングス	21,800	496.00	10,812,800	
コナカ	22,500	1,055.00	23,737,500	
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,329.00	2,658,000	
G-7ホールディングス	5,200	806.00	4,191,200	
イオン北海道	11,600	539.00	6,252,400	
コジマ	26,000	310.00	8,060,000	
ヒマラヤ	4,100	1,308.00	5,362,800	
コーナン商事	23,100	1,180.00	27,258,000	
エコス	6,000	621.00	3,726,000	
ワタミ	20,800	1,717.00	35,713,600	
マルシェ	4,300	845.00	3,633,500	
ドン・キホーテ	51,800	5,540.00	286,972,000	
西松屋チェーン	34,800	904.00	31,459,200	
ゼンショーホールディングス	67,200	1,194.00	80,236,800	
幸楽苑	10,900	1,213.00	13,221,700	
ハークスレイ	4,900	774.00	3,792,600	
サイゼリヤ	26,100	1,396.00	36,435,600	
ポプラ	7,300	636.00	4,642,800	
ユナイテッドアローズ	18,900	4,640.00	87,696,000	
ハイデイ日高	9,300	2,158.00	20,069,400	
京都きもの友禅	11,700	1,080.00	12,636,000	
コロワイド	58,500	994.00	58,149,000	
壺番屋	7,100	3,565.00	25,311,500	

トップカルチャー	6,400	434.00	2,777,600	
スギホールディングス	28,100	3,960.00	111,276,000	
スクロール	22,900	279.00	6,389,100	
ファミリーマート	54,200	4,435.00	240,377,000	
木曽路	21,600	1,880.00	40,608,000	
千趣会	31,800	866.00	27,538,800	
タカキュー	13,500	395.00	5,332,500	
ケーヨー	29,800	485.00	14,453,000	
上新電機	38,000	841.00	31,958,000	
日本瓦斯	24,300	1,247.00	30,302,100	
ベスト電器	55,100	180.00	9,918,000	
マルエツ	41,000	320.00	13,120,000	
ロイヤルホールディングス	29,500	1,535.00	45,282,500	
東天紅	13,000	188.00	2,444,000	
いなげや	19,700	985.00	19,404,500	
島忠	39,900	2,581.00	102,981,900	
チヨダ	20,800	2,457.00	51,105,600	
ライフコーポレーション	11,100	1,236.00	13,719,600	
カスミ	36,100	631.00	22,779,100	
リンガーハット	15,900	1,474.00	23,436,600	
MrMax	17,700	345.00	6,106,500	
テンアライド	13,300	308.00	4,096,400	
AOKIホールディングス	15,200	3,050.00	46,360,000	
オークワ	28,000	957.00	26,796,000	
コメリ	27,200	2,602.00	70,774,400	
青山商事	48,600	2,596.00	126,165,600	
しまむら	20,500	11,730.00	240,465,000	
CFSコーポレーション	12,000	393.00	4,716,000	
はせがわ	5,300	801.00	4,245,300	
高島屋	239,000	1,038.00	248,082,000	
松屋	37,400	1,258.00	47,049,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	115,000	927.00	106,605,000	
ニッセンホールディングス	31,800	321.00	10,207,800	
パルコ	33,800	1,044.00	35,287,200	
丸井グループ	231,000	1,033.00	238,623,000	
原信ナルスホールディングス	9,800	1,680.00	16,464,000	
ダイエー	107,700	342.00	36,833,400	
イズミヤ	70,000	452.00	31,640,000	
イオン	628,000	1,391.00	873,548,000	

ユニグループ・ホールディングス	170,800	659.00	112,557,200	
イズミ	44,300	3,085.00	136,665,500	
東武ストア	23,000	271.00	6,233,000	
平和堂	36,600	1,710.00	62,586,000	
フジ	19,900	1,814.00	36,098,600	
ヤオコー	8,900	3,705.00	32,974,500	
ゼビオ	23,900	2,182.00	52,149,800	
ケーズホールディングス	44,000	3,540.00	155,760,000	
O l y m p i c グループ	10,400	693.00	7,207,200	
日産東京販売ホールディングス	26,000	334.00	8,684,000	
アインファーマシーズ	10,600	4,535.00	48,071,000	
元気寿司	5,400	1,246.00	6,728,400	
ヤマダ電機	80,470	4,370.00	351,653,900	
アークランドサカモト	11,500	1,664.00	19,136,000	
ニトリホールディングス	34,950	8,800.00	307,560,000	
グルメ杵屋	13,000	708.00	9,204,000	
愛眼	14,000	277.00	3,878,000	
吉野家ホールディングス	478	116,400.00	55,639,200	
松屋フーズ	8,500	1,562.00	13,277,000	
サガミチェーン	21,000	826.00	17,346,000	
プレナス	19,700	1,722.00	33,923,400	
ミニストップ	13,100	1,652.00	21,641,200	
アークス	30,100	1,830.00	55,083,000	
バロー	38,000	1,686.00	64,068,000	
藤久	1,400	1,685.00	2,359,000	
ベルク	8,700	1,771.00	15,407,700	
大庄	8,300	1,376.00	11,420,800	
ファーストリテイリング	41,200	36,650.00	1,509,980,000	
サンドラッグ	33,600	4,335.00	145,656,000	
東京デリカ	7,700	1,717.00	13,220,900	
ヤマザワ	4,600	1,622.00	7,461,200	
やまや	3,600	1,550.00	5,580,000	
ベルーナ	22,000	1,064.00	23,408,000	
島根銀行	3,900	1,298.00	5,062,200	
じもとホールディングス	126,600	222.00	28,105,200	
新生銀行	1,527,000	238.00	363,426,000	
あおぞら銀行	641,000	311.00	199,351,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,359,900	659.00	8,804,174,100	
りそなホールディングス	1,814,700	515.00	934,570,500	

三井住友トラスト・ホールディングス	3,467,000	499.00	1,730,033,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,334,300	4,785.00	6,384,625,500	
第四銀行	225,000	343.00	77,175,000	
北越銀行	178,000	210.00	37,380,000	
西日本シティ銀行	619,000	280.00	173,320,000	
千葉銀行	680,000	739.00	502,520,000	
横浜銀行	1,091,000	587.00	640,417,000	
常陽銀行	665,000	568.00	377,720,000	
群馬銀行	395,000	600.00	237,000,000	
武蔵野銀行	28,100	3,690.00	103,689,000	
千葉興業銀行	33,800	791.00	26,735,800	
筑波銀行	73,300	360.00	26,388,000	
東京都民銀行	33,300	1,126.00	37,495,800	
七十七銀行	277,000	497.00	137,669,000	
青森銀行	129,000	261.00	33,669,000	
秋田銀行	121,000	275.00	33,275,000	
山形銀行	107,000	438.00	46,866,000	
岩手銀行	12,700	4,470.00	56,769,000	
東邦銀行	149,000	304.00	45,296,000	
東北銀行	90,000	149.00	13,410,000	
みちのく銀行	88,000	197.00	17,336,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	716,000	451.00	322,916,000	
静岡銀行	517,000	1,154.00	596,618,000	
十六銀行	221,000	394.00	87,074,000	
スルガ銀行	172,000	1,774.00	305,128,000	
八十二銀行	325,000	621.00	201,825,000	
山梨中央銀行	105,000	427.00	44,835,000	
大垣共立銀行	235,000	305.00	71,675,000	
福井銀行	152,000	231.00	35,112,000	
北國銀行	198,000	364.00	72,072,000	
清水銀行	6,000	2,871.00	17,226,000	
滋賀銀行	166,000	545.00	90,470,000	
南都銀行	172,000	399.00	68,628,000	
百五銀行	159,000	421.00	66,939,000	
京都銀行	316,000	866.00	273,656,000	
三重銀行	73,000	215.00	15,695,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,200,000	202.00	242,400,000	
広島銀行	521,000	447.00	232,887,000	
山陰合同銀行	102,000	786.00	80,172,000	

中国銀行	131,000	1,394.00	182,614,000	
鳥取銀行	56,000	191.00	10,696,000	
伊予銀行	189,000	998.00	188,622,000	
百十四銀行	194,000	328.00	63,632,000	
四国銀行	127,000	239.00	30,353,000	
阿波銀行	144,000	548.00	78,912,000	
鹿児島銀行	123,000	690.00	84,870,000	
大分銀行	104,000	321.00	33,384,000	
宮崎銀行	117,000	297.00	34,749,000	
肥後銀行	145,000	618.00	89,610,000	
佐賀銀行	107,000	212.00	22,684,000	
十八銀行	110,000	240.00	26,400,000	
沖縄銀行	13,100	4,320.00	56,592,000	
琉球銀行	36,600	1,328.00	48,604,800	
八千代銀行	9,000	3,010.00	27,090,000	
セブン銀行	594,900	386.00	229,631,400	
みずほフィナンシャルグループ	22,821,500	214.00	4,883,801,000	
紀陽ホールディングス	703,000	146.00	102,638,000	
山口フィナンシャルグループ	176,000	994.00	174,944,000	
長野銀行	62,000	182.00	11,284,000	
名古屋銀行	159,000	378.00	60,102,000	
北洋銀行	265,800	397.00	105,522,600	
愛知銀行	6,400	4,830.00	30,912,000	
第三銀行	100,000	161.00	16,100,000	
中京銀行	72,000	190.00	13,680,000	
東日本銀行	77,000	213.00	16,401,000	
大光銀行	62,000	236.00	14,632,000	
愛媛銀行	104,000	253.00	26,312,000	
トマト銀行	68,000	176.00	11,968,000	
みなと銀行	160,000	178.00	28,480,000	
京葉銀行	145,000	547.00	79,315,000	
関西アーバン銀行	246,000	112.00	27,552,000	
栃木銀行	89,000	387.00	34,443,000	
北日本銀行	5,100	2,381.00	12,143,100	
東和銀行	198,000	94.00	18,612,000	
福島銀行	217,000	81.00	17,577,000	
大東銀行	113,000	90.00	10,170,000	
トモニホールディングス	135,400	388.00	52,535,200	
フィデアホールディングス	101,500	228.00	23,142,000	

池田泉州ホールディングス	145,600	537.00	78,187,200	
F P G	14,000	1,393.00	19,502,000	
S B I ホールディングス	227,700	1,200.00	273,240,000	
ジャフコ	25,100	3,870.00	97,137,000	
大和証券グループ本社	1,748,000	890.00	1,555,720,000	
野村ホールディングス	3,606,900	809.00	2,917,982,100	
岡三証券グループ	150,000	929.00	139,350,000	
丸三証券	56,000	718.00	40,208,000	
東洋証券	70,000	349.00	24,430,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	202,500	803.00	162,607,500	
水戸証券	54,000	499.00	26,946,000	
いちよし証券	40,600	1,344.00	54,566,400	
松井証券	104,800	987.00	103,437,600	
だいがう証券ビジネス	10,600	696.00	7,377,600	
マネックスグループ	1,920	44,300.00	85,056,000	
カブドットコム証券	70,900	581.00	41,192,900	
極東証券	23,900	1,790.00	42,781,000	
岩井コスモホールディングス	18,900	1,440.00	27,216,000	
マネーパートナーズグループ	207	30,150.00	6,241,050	
N K S J ホールディングス	391,900	2,591.00	1,015,412,900	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	527,300	2,746.00	1,447,965,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	169,000	1,724.00	291,356,000	
第一生命保険	9,436	145,000.00	1,368,220,000	
東京海上ホールディングス	683,400	3,380.00	2,309,892,000	
T & D ホールディングス	605,200	1,331.00	805,521,200	
全国保証	20,600	3,810.00	78,486,000	
クレディセゾン	158,600	2,409.00	382,067,400	
芙蓉総合リース	17,900	3,710.00	66,409,000	
興銀リース	27,900	3,125.00	87,187,500	
東京センチュリーリース	43,900	2,797.00	122,788,300	
日本証券金融	89,027	787.00	70,064,249	
ポケットカード	31,800	757.00	24,072,600	
リコーリース	13,100	2,745.00	35,959,500	
イオンフィナンシャルサービス	67,400	3,065.00	206,581,000	
アコム	39,380	3,285.00	129,363,300	
ジャックス	112,000	580.00	64,960,000	
オリエントコーポレーション	403,000	273.00	110,019,000	

日立キャピタル	38,200	2,406.00	91,909,200	
オリックス	1,053,900	1,490.00	1,570,311,000	
三菱UFJリース	464,000	509.00	236,176,000	
日本取引所グループ	45,600	10,260.00	467,856,000	
イー・ギャランティ	9,000	2,865.00	25,785,000	
アサックス	31	152,900.00	4,739,900	
NECキャピタルソリューション	11,600	2,715.00	31,494,000	
日本駐車場開発	1,923	8,400.00	16,153,200	
ヒューリック	229,000	1,224.00	280,296,000	
東京建物不動産販売	9,100	459.00	4,176,900	
三栄建築設計	5,400	858.00	4,633,200	
野村不動産ホールディングス	84,700	2,380.00	201,586,000	
常和ホールディングス	4,100	2,605.00	10,680,500	
フージャースホールディングス	23,600	819.00	19,328,400	
パーク24	92,100	1,810.00	166,701,000	
三井不動産	832,000	3,125.00	2,600,000,000	
三菱地所	1,235,000	2,732.00	3,374,020,000	
平和不動産	33,400	1,744.00	58,249,600	
東京建物	337,000	862.00	290,494,000	
ダイビル	45,500	1,134.00	51,597,000	
東急不動産	385,000	1,022.00	393,470,000	
京阪神ビルディング	24,200	557.00	13,479,400	
住友不動産	423,000	4,415.00	1,867,545,000	
大京	272,000	311.00	84,592,000	
テーオーシー	60,900	735.00	44,761,500	
東京楽天地	29,000	526.00	15,254,000	
レオパレス21	169,000	492.00	83,148,000	
フジ住宅	22,600	697.00	15,752,200	
空港施設	21,500	637.00	13,695,500	
明和地所	8,700	414.00	3,601,800	
住友不動産販売	6,370	5,560.00	35,417,200	
ゴールドクレスト	13,900	2,607.00	36,237,300	
東栄住宅	12,000	2,014.00	24,168,000	
日本エスリード	7,800	1,118.00	8,720,400	
東急リバブル	18,700	2,142.00	40,055,400	
飯田産業	20,000	1,736.00	34,720,000	
日神不動産	10,600	694.00	7,356,400	
アーネストワン	29,200	2,010.00	58,692,000	
タカラレーベン	73,500	404.00	29,694,000	

サンヨーハウジング名古屋	9,200	1,253.00	11,527,600	
イオンモール	90,900	2,769.00	251,702,100	
タクトホーム	94	187,300.00	17,606,200	
トーセイ	23,200	732.00	16,982,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,097	131,900.00	144,694,300	
サンフロンティア不動産	164	98,600.00	16,170,400	
ランドビジネス	11,900	584.00	6,949,600	
グランディハウス	11,800	373.00	4,401,400	
日本空港ビルデング	61,000	1,875.00	114,375,000	
日本工営	63,000	374.00	23,562,000	
ネクスト	8,400	1,758.00	14,767,200	
日本M&Aセンター	9,600	6,240.00	59,904,000	
ノバレーゼ	4,800	660.00	3,168,000	
アコーディア・ゴルフ	825	107,000.00	88,275,000	
タケエイ	8,200	1,523.00	12,488,600	
パソナグループ	192	69,000.00	13,248,000	
リンクアンドモチベーション	189	34,000.00	6,426,000	
G C Aサヴィアン	11,200	1,031.00	11,547,200	
エス・エム・エス	10,500	1,639.00	17,209,500	
テンプホールディングス	25,500	2,609.00	66,529,500	
リニカル	5,600	1,528.00	8,556,800	
クックパッド	11,000	2,757.00	30,327,000	
エスクリ	7,000	911.00	6,377,000	
アイ・ケイ・ケイ	5,600	726.00	4,065,600	
学情	6,300	710.00	4,473,000	
スタジオアリス	8,600	1,384.00	11,902,400	
シミックホールディングス	7,100	1,900.00	13,490,000	
NECフィールドینگ	15,200	1,145.00	17,404,000	
総合警備保障	68,000	1,818.00	123,624,000	
カカコム	50,400	3,505.00	176,652,000	
ルネサンス	8,300	741.00	6,150,300	
ツクイ	23,600	1,055.00	24,898,000	
エムスリー	441	252,100.00	111,176,100	
ベストブライダル	11,300	811.00	9,164,300	
日本E R I	3,600	1,277.00	4,597,200	
アウトソーシング	9,200	940.00	8,648,000	
ディー・エヌ・エー	92,100	1,934.00	178,121,400	
博報堂D Yホールディングス	25,880	7,040.00	182,195,200	
ぐるなび	13,000	1,101.00	14,313,000	

一休	123	151,400.00	18,622,200	
ジャパンベストレスキューシステム	29	264,900.00	7,682,100	
ジェイコムホールディングス	3,300	843.00	2,781,900	
P G Mホールディングス	27,800	911.00	25,325,800	
バリューコマース	8,300	1,533.00	12,723,900	
J Pホールディングス	29,900	659.00	19,704,100	
イーピーエス	201	122,000.00	24,522,000	
アミューズ	5,700	2,450.00	13,965,000	
ドリームインキュベータ	70	157,800.00	11,046,000	
ケネディクス	178,000	511.00	90,958,000	
電通	175,100	3,170.00	555,067,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	827	23,450.00	19,393,150	
ぴあ	5,500	1,649.00	9,069,500	
イオンファンタジー	6,100	1,662.00	10,138,200	
ネクシィーズ	8,700	315.00	2,740,500	
みらかホールディングス	48,900	4,840.00	236,676,000	
アルプス技研	7,500	1,019.00	7,642,500	
サニックス	27,200	1,345.00	36,584,000	
ダイオーズ	3,400	725.00	2,465,000	
日本空調サービス	4,600	899.00	4,135,400	
オリエンタルランド	55,500	15,880.00	881,340,000	
ダスキン	50,500	1,875.00	94,687,500	
明光ネットワークジャパン	18,500	1,281.00	23,698,500	
ファルコ S Dホールディングス	9,600	1,445.00	13,872,000	
秀英予備校	7,100	357.00	2,534,700	
田谷	2,900	755.00	2,189,500	
ラウンドワン	61,000	620.00	37,820,000	
リゾートトラスト	32,100	3,215.00	103,201,500	
ビー・エム・エル	11,000	2,586.00	28,446,000	
ワタベウェディング	5,500	764.00	4,202,000	
もしもしホットライン	30,900	1,257.00	38,841,300	
東急コミュニティー	4,800	4,855.00	23,304,000	
リソー教育	2,003	7,780.00	15,583,340	
早稲田アカデミー	2,100	766.00	1,608,600	
ユー・エス・エス	20,870	12,420.00	259,205,400	
東京個別指導学院	9,100	204.00	1,856,400	
テー・オー・ダブリュー	6,200	550.00	3,410,000	
セントラルスポーツ	5,700	1,572.00	8,960,400	
フルキャストホールディングス	17,600	310.00	5,456,000	

リゾートソリューション	22,000	216.00	4,752,000	
リブセンス	4,000	4,885.00	19,540,000	
リロ・ホールディング	6,400	5,180.00	33,152,000	
エイチ・アイ・エス	15,200	4,945.00	75,164,000	
共立メンテナンス	9,500	3,760.00	35,720,000	
イチネンホールディングス	21,900	708.00	15,505,200	
建設技術研究所	10,200	789.00	8,047,800	
スペース	10,100	1,092.00	11,029,200	
燦ホールディングス	4,100	1,398.00	5,731,800	
スバル興業	13,000	341.00	4,433,000	
東京テアトル	71,000	164.00	11,644,000	
よみうりランド	39,000	852.00	33,228,000	
東京都競馬	144,000	393.00	56,592,000	
カナモト	23,000	2,183.00	50,209,000	
東京ドーム	142,000	665.00	94,430,000	
トランス・コスモス	24,400	1,630.00	39,772,000	
乃村工藝社	40,000	939.00	37,560,000	
藤田観光	47,000	403.00	18,941,000	
日本管財	6,900	1,490.00	10,281,000	
トーカイ	8,300	2,792.00	23,173,600	
白洋舎	24,000	247.00	5,928,000	
セコム	194,200	5,720.00	1,110,824,000	
セントラル警備保障	8,200	918.00	7,527,600	
丹青社	18,000	642.00	11,556,000	
メイテック	27,500	2,669.00	73,397,500	
アサツー ディ・ケイ	30,800	2,645.00	81,466,000	
応用地質	19,600	1,589.00	31,144,400	
船井総合研究所	19,100	721.00	13,771,100	
進学会	9,000	386.00	3,474,000	
ベネッセホールディングス	56,900	3,560.00	202,564,000	
イオンディライト	18,100	1,883.00	34,082,300	
ナック	8,300	1,761.00	14,616,300	
ニチイ学館	36,500	914.00	33,361,000	
ダイセキ	27,600	1,789.00	49,376,400	
ステップ	5,600	907.00	5,079,200	
合計	277,605,377	—	298,285,741,669	

(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。

- ② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。
- ③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。
- ④ 不動産等明細表
該当事項はありません。
- ⑤ 商品明細表
該当事項はありません。
- ⑥ 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。
- ⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。
- ⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

[次へ](#)

「日本債券マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月25日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,919,399,909
国債証券	308,848,997,250
地方債証券	25,544,759,555
特殊債券	36,377,987,506
社債券	25,521,913,380
派生商品評価勘定	149,055
未収入金	999,234,310
未収利息	1,194,800,343
前払費用	26,933,723
流動資産合計	400,434,175,031
資産合計	400,434,175,031
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	520,630
前受金	2,730,000
未払解約金	1,091,335,202
流動負債合計	1,094,585,832
負債合計	1,094,585,832
純資産の部	
元本等	
元本	324,910,672,427
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	74,428,916,772
元本等合計	399,339,589,199
純資産合計	399,339,589,199
負債純資産合計	400,434,175,031

(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 7月25日現在
--	---------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月25日現在
1. 計算期間の期首元本額	289,405,233,640円
計算期間中の追加設定元本額	107,100,625,012円
計算期間中の一部解約元本額	71,595,186,225円
計算日の元本額	324,910,672,427円
計算日の元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	4,490,849,941円
DC日本債券インデックスファンド	2,160,465,638円
DC日本債券インデックスファンドL	24,262,836,612円
DCバランスファンド30	1,290,244,793円
DCバランスファンド50	1,300,531,325円
DCバランスファンド70	351,292,604円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	148,195,983円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	93,557,841円
日本債券インデックスファンド(SMA専用)	255,011,132円
新生・4分散ファンド	138,139,549円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	26,774,047円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	104,979,581円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	172,567,336円
日本債券インデックスe	841,033,682円
インデックスコレクション(国内債券)	2,375,688,125円
インデックスコレクション(バランス株式30)	1,471,226,613円

インデックスコレクション(バランス株式50)	1,056,903,346円
インデックスコレクション(バランス株式70)	474,193,635円
私募日本債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	42,351,540,602円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	9,082,233,999円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	31,367,576,891円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	24,127,935,478円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,465,398,853円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	7,198,509,236円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	11,801,367,274円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,651,860,227円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	27,469,155,756円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	285,154,054円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	31,112,556,979円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	7,126,920,124円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	597,240,611円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,762,244,755円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,374,286,832円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	5,562,313,935円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	933,963,277円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,675,719,986円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	3,610,478,050円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	4,494,751,101円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	7,053,717,647円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	608,068,070円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	3,975,083,953円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	52,218,317,730円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,317,012,085円
国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	307,013,037円
国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	147,992,283円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,185,064,672円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	8,973,380円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	23,729,767円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券 104,396,000円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
3. 計算日における受益権総数	324,910,672,427口

4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2291円 (12,291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 7月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,352,184,360
地方債証券	△221,858,326
特殊債券	△213,943,730
社債券	△58,442,110
合計	△1,846,428,526

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年1月23日から平成25年7月25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)

I. 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 7月25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	718,021,575	—	717,650,000	△371,575
合計		718,021,575	—	717,650,000	△371,575

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月25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 7月25日現在

該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月25日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第 3 1 9 回利付国債（2 年）	1,571,000,000	1,570,905,740	
	第 3 2 0 回利付国債（2 年）	2,960,000,000	2,959,822,400	
	第 3 2 1 回利付国債（2 年）	1,660,000,000	1,659,883,800	
	第 3 2 2 回利付国債（2 年）	1,370,000,000	1,369,821,900	
	第 3 2 3 回利付国債（2 年）	2,180,000,000	2,179,542,200	
	第 3 2 4 回利付国債（2 年）	2,260,000,000	2,259,502,800	
	第 3 2 5 回利付国債（2 年）	900,000,000	899,784,000	
	第 3 2 6 回利付国債（2 年）	680,000,000	679,830,000	
	第 3 2 7 回利付国債（2 年）	1,040,000,000	1,039,729,600	
	第 3 2 8 回利付国債（2 年）	1,700,000,000	1,699,541,000	
	第 3 2 9 回利付国債（2 年）	1,920,000,000	1,922,880,000	
	第 8 5 回利付国債（5 年）	2,100,000,000	2,114,154,000	
	第 8 6 回利付国債（5 年）	2,100,000,000	2,111,760,000	
	第 8 7 回利付国債（5 年）	3,900,000,000	3,920,904,000	
	第 8 8 回利付国債（5 年）	4,040,000,000	4,065,128,800	
	第 8 9 回利付国債（5 年）	2,390,000,000	2,402,404,100	
	第 9 0 回利付国債（5 年）	1,300,000,000	1,304,290,000	
	第 9 1 回利付国債（5 年）	1,000,000,000	1,005,880,000	
	第 9 2 回利付国債（5 年）	2,640,000,000	2,649,873,600	
	第 9 3 回利付国債（5 年）	2,100,000,000	2,118,543,000	
	第 9 4 回利付国債（5 年）	1,830,000,000	1,850,514,300	
	第 9 5 回利付国債（5 年）	1,330,000,000	1,346,093,000	
	第 9 6 回利付国債（5 年）	2,320,000,000	2,341,970,400	
	第 9 7 回利付国債（5 年）	2,710,000,000	2,729,512,000	
	第 9 8 回利付国債（5 年）	1,750,000,000	1,757,560,000	
	第 9 9 回利付国債（5 年）	2,810,000,000	2,830,653,500	
	第 1 0 0 回利付国債（5 年）	1,400,000,000	1,405,908,000	
	第 1 0 1 回利付国債（5 年）	1,600,000,000	1,611,600,000	
	第 1 0 2 回利付国債（5 年）	3,465,000,000	3,478,409,550	
	第 1 0 3 回利付国債（5 年）	4,140,000,000	4,154,945,400	

第104回利付国債（5年）	200,000,000	200,000,000	
第105回利付国債（5年）	4,412,000,000	4,409,441,040	
第106回利付国債（5年）	6,490,000,000	6,480,654,400	
第107回利付国債（5年）	3,230,000,000	3,222,248,000	
第108回利付国債（5年）	1,180,000,000	1,172,046,800	
第109回利付国債（5年）	1,230,000,000	1,220,135,400	
第110回利付国債（5年）	370,000,000	370,421,800	
第111回利付国債（5年）	3,350,000,000	3,369,162,000	
第112回利付国債（5年）	460,000,000	462,438,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	452,172,000	
第2回利付国債（40年）	500,000,000	539,325,000	
第3回利付国債（40年）	600,000,000	647,268,000	
第4回利付国債（40年）	920,000,000	990,343,200	
第5回利付国債（40年）	870,000,000	888,391,800	
第6回利付国債（40年）	330,000,000	327,406,200	
第263回利付国債（10年）	750,000,000	762,780,000	
第264回利付国債（10年）	1,330,000,000	1,351,133,700	
第265回利付国債（10年）	730,000,000	744,074,400	
第266回利付国債（10年）	560,000,000	570,018,400	
第267回利付国債（10年）	410,000,000	416,760,900	
第268回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,533,900,000	
第269回利付国債（10年）	840,000,000	856,228,800	
第270回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,146,599,000	
第271回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,316,187,000	
第272回利付国債（10年）	1,740,000,000	1,787,449,800	
第273回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,441,174,000	
第274回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,342,666,000	
第275回利付国債（10年）	1,010,000,000	1,040,734,300	
第276回利付国債（10年）	800,000,000	828,168,000	
第277回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,349,933,000	
第278回利付国債（10年）	800,000,000	834,944,000	
第279回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,416,069,000	
第280回利付国債（10年）	1,150,000,000	1,207,971,500	
第281回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,053,290,000	
第282回利付国債（10年）	1,900,000,000	1,991,238,000	
第283回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,471,610,000	
第284回利付国債（10年）	2,950,000,000	3,100,745,000	
第285回利付国債（10年）	3,400,000,000	3,584,348,000	
第286回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,485,946,000	

第 2 8 7 回利付国債（１０年）	2,050,000,000	2,183,783,000	
第 2 8 8 回利付国債（１０年）	1,100,000,000	1,166,385,000	
第 2 8 9 回利付国債（１０年）	2,850,000,000	3,004,840,500	
第 2 9 0 回利付国債（１０年）	900,000,000	946,827,000	
第 2 9 1 回利付国債（１０年）	1,200,000,000	1,256,940,000	
第 2 9 2 回利付国債（１０年）	1,200,000,000	1,279,236,000	
第 2 9 3 回利付国債（１０年）	1,200,000,000	1,288,044,000	
第 2 9 4 回利付国債（１０年）	900,000,000	961,686,000	
第 2 9 5 回利付国債（１０年）	1,260,000,000	1,334,188,800	
第 2 9 6 回利付国債（１０年）	2,770,000,000	2,941,407,600	
第 2 9 7 回利付国債（１０年）	1,150,000,000	1,217,470,500	
第 2 9 8 回利付国債（１０年）	1,360,000,000	1,432,569,600	
第 2 9 9 回利付国債（１０年）	1,900,000,000	2,003,721,000	
第 3 0 0 回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,118,953,500	
第 3 0 1 回利付国債（１０年）	2,310,000,000	2,464,793,100	
第 3 0 2 回利付国債（１０年）	1,150,000,000	1,220,426,000	
第 3 0 3 回利付国債（１０年）	1,200,000,000	1,273,872,000	
第 3 0 4 回利付国債（１０年）	1,400,000,000	1,477,784,000	
第 3 0 5 回利付国債（１０年）	3,810,000,000	4,021,264,500	
第 3 0 6 回利付国債（１０年）	1,400,000,000	1,486,240,000	
第 3 0 7 回利付国債（１０年）	1,350,000,000	1,424,452,500	
第 3 0 8 回利付国債（１０年）	1,100,000,000	1,160,181,000	
第 3 0 9 回利付国債（１０年）	1,670,000,000	1,738,503,400	
第 3 1 0 回利付国債（１０年）	1,770,000,000	1,826,002,800	
第 3 1 1 回利付国債（１０年）	1,420,000,000	1,445,389,600	
第 3 1 2 回利付国債（１０年）	3,427,000,000	3,577,650,920	(注)
第 3 1 3 回利付国債（１０年）	2,380,000,000	2,499,880,600	
第 3 1 4 回利付国債（１０年）	1,400,000,000	1,449,546,000	
第 3 1 5 回利付国債（１０年）	1,730,000,000	1,803,455,800	
第 3 1 6 回利付国債（１０年）	950,000,000	983,202,500	
第 3 1 7 回利付国債（１０年）	1,030,000,000	1,065,030,300	
第 3 1 8 回利付国債（１０年）	2,200,000,000	2,257,816,000	
第 3 1 9 回利付国債（１０年）	1,250,000,000	1,291,687,500	
第 3 2 0 回利付国債（１０年）	3,110,000,000	3,187,750,000	
第 3 2 1 回利付国債（１０年）	2,400,000,000	2,457,648,000	
第 3 2 2 回利付国債（１０年）	1,600,000,000	1,624,736,000	
第 3 2 3 回利付国債（１０年）	1,380,000,000	1,399,582,200	
第 3 2 4 回利付国債（１０年）	2,320,000,000	2,332,574,400	
第 3 2 5 回利付国債（１０年）	5,400,000,000	5,420,736,000	

第326回利付国債（10年）	900,000,000	894,087,000	
第327回利付国債（10年）	3,550,000,000	3,557,739,000	
第328回利付国債（10年）	3,075,000,000	3,021,279,750	
第329回利付国債（10年）	1,470,000,000	1,470,661,500	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	59,848,500	
第2回利付国債（30年）	100,000,000	113,598,000	
第3回利付国債（30年）	330,000,000	368,903,700	
第4回利付国債（30年）	190,000,000	228,758,100	
第5回利付国債（30年）	180,000,000	196,876,800	
第6回利付国債（30年）	270,000,000	302,518,800	
第7回利付国債（30年）	390,000,000	429,468,000	
第8回利付国債（30年）	270,000,000	274,924,800	
第9回利付国債（30年）	180,000,000	171,124,200	
第10回利付国債（30年）	170,000,000	152,841,900	
第11回利付国債（30年）	280,000,000	278,961,200	
第12回利付国債（30年）	370,000,000	393,091,700	
第13回利付国債（30年）	350,000,000	365,900,500	
第14回利付国債（30年）	350,000,000	389,816,000	
第15回利付国債（30年）	640,000,000	723,955,200	
第16回利付国債（30年）	250,000,000	282,867,500	
第17回利付国債（30年）	570,000,000	635,082,600	
第18回利付国債（30年）	660,000,000	723,789,000	
第19回利付国債（30年）	370,000,000	405,742,000	
第20回利付国債（30年）	140,000,000	158,656,400	
第21回利付国債（30年）	770,000,000	844,243,400	
第22回利付国債（30年）	400,000,000	453,424,000	
第23回利付国債（30年）	530,000,000	600,861,000	
第24回利付国債（30年）	830,000,000	941,062,300	
第25回利付国債（30年）	400,000,000	438,336,000	
第26回利付国債（30年）	860,000,000	959,089,200	
第27回利付国債（30年）	900,000,000	1,022,373,000	
第28回利付国債（30年）	820,000,000	932,299,000	
第29回利付国債（30年）	1,140,000,000	1,274,953,200	
第30回利付国債（30年）	890,000,000	977,495,900	
第31回利付国債（30年）	1,100,000,000	1,185,602,000	
第32回利付国債（30年）	1,390,000,000	1,527,512,700	
第33回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,344,954,000	
第34回利付国債（30年）	1,760,000,000	1,895,185,600	
第35回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,343,550,000	

第 3 6 回利付国債（3 0 年）	1,680,000,000	1,735,288,800	
第 3 7 回利付国債（3 0 年）	1,660,000,000	1,677,297,200	
第 3 8 回利付国債（3 0 年）	985,000,000	971,850,250	
第 3 9 回利付国債（3 0 年）	250,000,000	251,920,000	
第 2 6 回利付国債（2 0 年）	50,000,000	52,519,500	
第 2 7 回利付国債（2 0 年）	410,000,000	433,013,300	
第 2 8 回利付国債（2 0 年）	110,000,000	118,791,200	
第 2 9 回利付国債（2 0 年）	100,000,000	108,741,000	
第 3 0 回利付国債（2 0 年）	200,000,000	215,338,000	
第 3 1 回利付国債（2 0 年）	280,000,000	304,819,200	
第 3 2 回利付国債（2 0 年）	80,000,000	87,512,800	
第 3 3 回利付国債（2 0 年）	430,000,000	478,981,300	
第 3 4 回利付国債（2 0 年）	70,000,000	78,349,600	
第 3 5 回利付国債（2 0 年）	270,000,000	300,253,500	
第 3 7 回利付国債（2 0 年）	410,000,000	458,220,100	
第 3 9 回利付国債（2 0 年）	640,000,000	708,672,000	
第 4 0 回利付国債（2 0 年）	450,000,000	496,102,500	
第 4 1 回利付国債（2 0 年）	620,000,000	660,715,400	
第 4 2 回利付国債（2 0 年）	380,000,000	428,244,800	
第 4 3 回利付国債（2 0 年）	340,000,000	391,802,400	
第 4 4 回利付国債（2 0 年）	370,000,000	419,313,600	
第 4 5 回利付国債（2 0 年）	270,000,000	304,341,300	
第 4 6 回利付国債（2 0 年）	290,000,000	323,413,800	
第 4 7 回利付国債（2 0 年）	470,000,000	524,778,500	
第 4 8 回利付国債（2 0 年）	230,000,000	261,691,700	
第 4 9 回利付国債（2 0 年）	280,000,000	310,819,600	
第 5 0 回利付国債（2 0 年）	590,000,000	646,073,600	
第 5 1 回利付国債（2 0 年）	240,000,000	264,729,600	
第 5 2 回利付国債（2 0 年）	430,000,000	478,800,700	
第 5 3 回利付国債（2 0 年）	350,000,000	390,239,500	
第 5 4 回利付国債（2 0 年）	280,000,000	314,546,400	
第 5 5 回利付国債（2 0 年）	490,000,000	542,581,900	
第 5 6 回利付国債（2 0 年）	410,000,000	454,050,400	
第 5 7 回利付国債（2 0 年）	360,000,000	395,834,400	
第 5 8 回利付国債（2 0 年）	250,000,000	275,310,000	
第 5 9 回利付国債（2 0 年）	440,000,000	477,100,800	
第 6 0 回利付国債（2 0 年）	570,000,000	602,512,800	
第 6 1 回利付国債（2 0 年）	390,000,000	397,870,200	
第 6 2 回利付国債（2 0 年）	250,000,000	250,227,500	

第 6 3 回利付国債（20年）	570,000,000	624,543,300	
第 6 4 回利付国債（20年）	410,000,000	453,595,300	
第 6 5 回利付国債（20年）	530,000,000	586,508,600	
第 6 6 回利付国債（20年）	500,000,000	548,245,000	
第 6 7 回利付国債（20年）	510,000,000	564,733,200	
第 6 8 回利付国債（20年）	230,000,000	261,703,200	
第 6 9 回利付国債（20年）	800,000,000	901,984,000	
第 7 0 回利付国債（20年）	700,000,000	811,405,000	
第 7 1 回利付国債（20年）	400,000,000	455,424,000	
第 7 2 回利付国債（20年）	920,000,000	1,038,128,000	
第 7 3 回利付国債（20年）	540,000,000	603,255,600	
第 7 4 回利付国債（20年）	310,000,000	349,707,900	
第 7 5 回利付国債（20年）	360,000,000	406,159,200	
第 7 6 回利付国債（20年）	530,000,000	586,153,500	
第 7 7 回利付国債（20年）	410,000,000	458,002,800	
第 7 8 回利付国債（20年）	200,000,000	221,010,000	
第 7 9 回利付国債（20年）	570,000,000	636,330,900	
第 8 0 回利付国債（20年）	250,000,000	281,925,000	
第 8 1 回利付国債（20年）	640,000,000	713,945,600	
第 8 2 回利付国債（20年）	680,000,000	766,400,800	
第 8 3 回利付国債（20年）	530,000,000	596,923,100	
第 8 4 回利付国債（20年）	850,000,000	947,384,500	
第 8 5 回利付国債（20年）	550,000,000	618,585,000	
第 8 6 回利付国債（20年）	270,000,000	310,084,200	
第 8 7 回利付国債（20年）	500,000,000	568,290,000	
第 8 8 回利付国債（20年）	530,000,000	608,339,300	
第 8 9 回利付国債（20年）	800,000,000	908,600,000	
第 9 0 回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,134,800,000	
第 9 1 回利付国債（20年）	570,000,000	653,807,100	
第 9 2 回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,647,370,200	
第 9 3 回利付国債（20年）	600,000,000	663,654,000	
第 9 4 回利付国債（20年）	800,000,000	894,888,000	
第 9 5 回利付国債（20年）	640,000,000	731,232,000	
第 9 6 回利付国債（20年）	500,000,000	558,570,000	
第 9 7 回利付国債（20年）	730,000,000	823,753,900	
第 9 8 回利付国債（20年）	600,000,000	669,342,000	
第 9 9 回利付国債（20年）	1,380,000,000	1,536,216,000	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,147,734,600	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	500,000,000	575,790,000	

第102回利付国債（20年）	800,000,000	920,128,000	
第103回利付国債（20年）	300,000,000	341,049,000	
第104回利付国債（20年）	600,000,000	665,700,000	
第105回利付国債（20年）	900,000,000	996,777,000	
第106回利付国債（20年）	500,000,000	560,485,000	
第107回利付国債（20年）	700,000,000	773,318,000	
第108回利付国債（20年）	810,000,000	872,337,600	
第109回利付国債（20年）	700,000,000	751,660,000	
第110回利付国債（20年）	800,000,000	881,464,000	
第111回利付国債（20年）	320,000,000	356,524,800	
第112回利付国債（20年）	1,580,000,000	1,737,336,400	
第113回利付国債（20年）	1,830,000,000	2,006,613,300	
第114回利付国債（20年）	800,000,000	875,248,000	
第115回利付国債（20年）	700,000,000	775,698,000	
第116回利付国債（20年）	600,000,000	663,438,000	
第117回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,308,948,000	
第118回利付国債（20年）	800,000,000	858,536,000	
第119回利付国債（20年）	400,000,000	417,296,000	
第120回利付国債（20年）	500,000,000	506,735,000	
第121回利付国債（20年）	1,370,000,000	1,445,719,900	
第122回利付国債（20年）	660,000,000	686,532,000	
第123回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,429,256,400	
第124回利付国債（20年）	600,000,000	640,500,000	
第125回利付国債（20年）	300,000,000	328,605,000	
第126回利付国債（20年）	800,000,000	851,640,000	
第127回利付国債（20年）	760,000,000	797,399,600	
第128回利付国債（20年）	980,000,000	1,025,168,200	
第129回利付国債（20年）	800,000,000	824,544,000	
第130回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,561,648,000	
第131回利付国債（20年）	500,000,000	505,960,000	
第133回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,731,878,200	
第134回利付国債（20年）	500,000,000	511,420,000	
第135回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,127,974,400	
第136回利付国債（20年）	400,000,000	396,300,000	
第137回利付国債（20年）	500,000,000	502,150,000	
第138回利付国債（20年）	600,000,000	583,254,000	
第139回利付国債（20年）	650,000,000	642,538,000	
第140回利付国債（20年）	2,090,000,000	2,093,009,600	
第141回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,349,014,500	

	第 1 4 2 回利付国債（20年）	850,000,000	863,651,000	
	第 1 4 3 回利付国債（20年）	1,170,000,000	1,147,699,800	
	第 1 4 4 回利付国債（20年）	440,000,000	424,230,400	
	第 1 4 5 回利付国債（20年）	460,000,000	457,957,600	
	国債証券 小計	296,205,000,000	308,848,997,250	
地方債証券	第 3 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,553,000	
	第 3 回東京都公募公債（7年）	100,000,000	101,241,000	
	第 4 回東京都公募公債（7年）	100,000,000	100,743,000	
	第 7 回東京都公募公債（30年）	200,000,000	220,384,000	
	第 1 1 回東京都公募公債（20年）	200,000,000	224,710,000	
	第 1 8 回東京都公募公債（20年）	200,000,000	221,478,000	
	第 2 0 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,302,000	
	第 2 1 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,441,000	
	第 2 7 回東京都公募公債（20年）	100,000,000	98,338,000	
	第 6 1 6 回東京都公募公債	100,000,000	101,736,000	
	第 6 1 7 回東京都公募公債	100,000,000	101,722,000	
	第 6 1 9 回東京都公募公債	100,000,000	102,232,000	
	第 6 2 4 回東京都公募公債	100,000,000	102,500,000	
	第 6 2 8 回東京都公募公債	100,000,000	103,357,000	
	第 6 3 7 回東京都公募公債	180,000,000	189,000,000	
	第 6 4 2 回東京都公募公債	100,000,000	105,401,000	
	第 6 4 6 回東京都公募公債	100,000,000	106,708,000	
	第 6 4 7 回東京都公募公債	100,000,000	106,631,000	
	第 6 5 6 回東京都公募公債	100,000,000	105,501,000	
	第 6 5 7 回東京都公募公債	100,000,000	106,878,000	
	第 6 5 9 回東京都公募公債	100,000,000	106,249,000	
	第 6 7 3 回東京都公募公債	100,000,000	105,757,000	
	第 6 8 1 回東京都公募公債	100,000,000	105,858,000	
	第 6 8 2 回東京都公募公債	100,000,000	105,343,000	
	第 6 8 6 回東京都公募公債	100,000,000	103,648,000	
	第 6 9 2 回東京都公募公債	100,000,000	105,091,000	
	第 6 9 6 回東京都公募公債	100,000,000	103,783,000	
	第 7 0 0 回東京都公募公債	100,000,000	102,349,000	
	第 7 0 3 回東京都公募公債	100,000,000	102,019,000	
	平成 1 7 年度第 1 回北海道公募公債	100,000,000	102,040,000	
	平成 1 7 年度第 1 2 回北海道公募公債	200,000,000	206,964,000	
	平成 1 9 年度第 1 4 回北海道公募公債（10年）	100,000,000	105,921,000	
	平成 2 0 年度第 1 4 回北海道公募公債	100,000,000	107,215,000	

平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	106,658,000	
平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,855,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	101,970,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,403,000	
第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	106,620,000	
第21回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	99,373,000	
第130回神奈川県公募公債	100,000,000	101,848,000	
第134回神奈川県公募公債	100,000,000	102,526,000	
第135回神奈川県公募公債	100,000,000	103,184,000	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	107,064,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	105,595,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	105,079,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	104,213,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	103,680,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	102,431,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	100,793,000	
第63回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,579,000	
第275回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,710,000	
第285回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,055,000	
第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,162,000	
第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,656,000	
第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,597,000	
第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,490,000	
第309回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,665,000	
第324回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,764,000	
第331回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,586,000	
第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,947,000	
第335回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,012,000	
第339回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,212,000	
第356回大阪府公募公債（10年）	130,000,000	132,772,900	
第363回大阪府公募公債（10年）	114,000,000	113,278,380	
平成17年度第3回京都府公募公債	100,000,000	103,156,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	106,130,000	
平成21年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,584,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	105,509,000	
平成22年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,719,000	
平成16年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	101,733,000	
平成17年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	101,983,000	
平成17年度第8回兵庫県公募公債	103,500,000	106,158,915	

平成18年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	105,717,000	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	110,000,000	115,451,600	
平成18年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	105,658,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	106,730,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	105,936,000	
平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	104,074,000	
平成22年度第20回兵庫県公募公債（5年）	300,000,000	302,637,000	
平成17年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,988,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,737,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	106,506,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,516,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	105,658,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	105,225,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,477,000	
平成17年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,126,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債（10年）	129,000,000	135,508,050	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,135,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,200,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,937,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,924,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	106,691,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,782,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,657,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,884,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,740,000	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,758,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,569,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	106,100,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	282,006,880	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,470,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	106,509,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	106,069,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	107,301,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,733,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,091,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,920,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	101,073,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,881,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	111,921,000	

平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	210,770,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,897,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	105,661,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	107,574,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	111,043,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,737,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	175,000,000	183,638,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	105,495,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	107,196,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	104,085,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,593,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,110,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	102,212,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,274,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	142,888,707	
第2回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	103,280,000	
平成18年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	105,050,000	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	139,631,396	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,770,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,669,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,782,000	
第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,767,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,824,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,774,000	
第24回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,192,000	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,036,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,129,000	
第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,523,000	
第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	165,769,600	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,060,000	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,245,000	
第53回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,158,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,827,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,105,000	
第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,866,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,500,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,449,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,003,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,749,000	

第 7 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,019,000	
第 7 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,724,000	
第 7 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,793,000	
第 7 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,667,000	
第 7 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,766,000	
第 7 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,471,000	
第 8 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,712,000	
第 8 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,956,000	
第 8 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,095,000	
第 8 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,674,000	
第 8 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,061,000	
第 8 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,022,000	
第 8 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,085,000	
第 9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,322,000	
第 9 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,200,000	
第 9 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,473,000	
第 9 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,524,000	
第 9 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,191,000	
第 9 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,679,000	
第 9 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,563,000	
第 1 0 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,861,000	
第 1 0 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,600,000	
第 1 0 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,392,000	
第 1 0 3 回共同発行市場公募地方債	377,400,000	385,332,948	
第 1 0 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,615,000	
第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,730,000	
第 1 1 1 回共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,508,000	
第 1 1 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,784,000	
第 1 1 7 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,200,000	
平成 2 3 年度第 1 回熊本県公募公債（5 年）	100,000,000	100,762,000	
平成 1 8 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	105,526,000	
平成 2 3 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	102,355,000	
平成 1 6 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	101,759,000	
平成 1 7 年度第 1 回大阪市公募公債	100,000,000	102,065,000	
平成 1 8 年度第 3 回大阪市公募公債	200,000,000	211,068,000	
平成 2 1 年度第 3 回大阪市公募公債	200,000,000	212,072,000	
平成 2 1 年度第 7 回大阪市公募公債	100,000,000	106,011,000	
第 1 回名古屋市長公募公債（2 0 年）	100,000,000	110,636,000	
第 1 2 回す号名古屋市長公募公債	100,000,000	103,940,000	

	第 1 2 回せ号名古屋市政公募債	100,000,000	102,635,000	
	第 1 2 回し号名古屋市政公募債	100,000,000	102,185,000	
	第 4 5 5 回名古屋市政公募債（10年）	186,700,000	195,835,231	
	第 4 6 4 回名古屋市政公募債（10年）	100,000,000	106,491,000	
	第 2 回京都市公募債（20年）	100,000,000	111,653,000	
	平成 1 9 年度第 2 回京都市公募債	100,000,000	106,196,000	
	平成 2 1 年度第 5 回京都市公募債	100,000,000	106,024,000	
	平成 2 2 年度第 3 回京都市公募債	100,000,000	100,369,000	
	第 5 回横浜市公募債（20年）	100,000,000	112,500,000	
	平成 1 7 年度第 3 回横浜市公募債	100,000,000	103,046,000	
	平成 2 0 年度第 1 回横浜市公募債	100,000,000	107,303,000	
	平成 2 0 年度第 6 回横浜市公募債	100,000,000	106,270,000	
	平成 2 2 年度第 1 回横浜市公募債	100,000,000	105,498,000	
	平成 2 2 年度第 3 回横浜市公募債	100,000,000	103,930,000	
	平成 2 2 年度第 4 回横浜市公募債	100,000,000	102,305,000	
	平成 2 3 年度第 1 回横浜市公募債	100,000,000	103,745,000	
	平成 2 3 年度第 4 回横浜市公募債	100,000,000	102,466,000	
	第 2 6 回横浜市公募債（20年）	100,000,000	99,868,000	
	平成 1 8 年度第 4 回札幌市公募債	100,000,000	104,936,000	
	平成 2 3 年度第 4 回札幌市公募債（10年）	100,000,000	102,392,000	
	第 7 9 回川崎市公募債	100,000,000	106,466,000	
	平成 1 9 年度第 3 回福岡市公募債	100,000,000	106,578,000	
	平成 1 9 年度第 5 回福岡市公募債	100,000,000	105,313,000	
	平成 2 0 年度第 5 回福岡市公募債	100,000,000	106,279,000	
	平成 1 7 年度第 1 回広島市公募債	100,000,000	103,106,000	
	平成 2 3 年度第 5 回広島市公募債	151,900,000	154,773,948	
	平成 2 3 年度第 1 回千葉市公募債	100,000,000	104,998,000	
	平成 2 3 年度第 2 回岡山県公募債（10年）	100,000,000	101,911,000	
	地方債証券 小計	24,463,030,000	25,544,759,555	
特殊債券	第 3 6 回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	102,824,000	
	第 8 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,796,000	
	第 1 5 回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	231,611,100	
	第 1 6 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,568,000	
	第 1 6 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,483,000	
	第 1 7 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,258,000	
	第 1 9 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,908,000	
	第 2 1 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,887,000	
	第 2 4 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,994,000	

第 2 9 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,238,000	
第 4 1 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,650,000	
第 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,204,000	
第 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,124,000	
第 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,634,000	
第 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,291,000	
第 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,315,000	
第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	171,816,000	
第 1 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	164,791,910	
第 1 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	106,468,140	
第 2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,872,000	
第 2 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,257,000	
第 2 1 回道路債券	100,000,000	113,193,000	
第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,020,000	
第 2 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	131,841,250	
第 2 7 回道路債券	100,000,000	114,114,000	
第 2 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,362,000	
第 3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	193,000,000	203,263,740	
第 3 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,114,000	
第 3 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,548,000	
第 3 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,447,000	
第 3 3 回道路債券	100,000,000	115,111,000	
第 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,550,000	
第 3 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,731,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,642,000	
第 3 8 回道路債券	100,000,000	112,592,000	
第 3 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,746,000	
第 4 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,350,000	
第 4 1 回道路債券	100,000,000	102,089,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	112,088,000	
第 4 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,264,000	
第 4 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,218,000	
第 4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,258,000	
第 4 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,695,000	
第 4 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,915,000	
第 4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,399,000	
第 4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,421,000	
第 5 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,156,000	
第 5 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,054,000	

第 5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,136,000	
第 5 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,440,000	
第 5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,322,000	
第 6 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,055,000	
第 6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,866,000	
第 6 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,037,000	
第 6 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,296,000	
第 6 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,706,000	
第 7 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,675,000	
第 7 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,240,000	
第 7 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,262,000	
第 7 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,682,000	
第 8 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,467,000	
第 8 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,564,000	
第 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,363,000	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,456,000	
第 9 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,727,000	
第 9 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,957,000	
第 9 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,711,000	
第 9 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,628,000	
第 9 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	219,548,000	
第 1 0 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,949,000	
第 1 0 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,115,000	
第 1 0 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,316,000	
第 1 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,917,000	
第 1 0 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,249,000	
第 1 0 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,988,000	
第 1 1 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,203,000	
第 1 1 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,344,000	
第 1 2 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	173,403,400	
第 1 2 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,872,000	
第 1 3 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,729,000	
第 1 3 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,152,000	
第 1 4 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,264,000	
第 1 4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	127,807,500	
第 1 5 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,608,000	
第 1 5 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,879,000	
第 1 6 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,867,000	
第 1 6 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,171,000	

第 1 6 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,142,000	
第 1 6 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,541,000	
第 1 7 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,848,000	
第 1 8 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,360,000	
第 1 8 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	109,000,000	107,470,730	
第 3 3 3 回政府保証道路債券	100,000,000	101,817,000	
第 3 3 4 回政府保証道路債券	100,000,000	101,806,000	
第 3 3 5 回政府保証道路債券	100,000,000	101,767,000	
第 3 3 6 回政府保証道路債券	131,000,000	133,461,490	
第 3 4 3 回政府保証道路債券	100,000,000	102,184,000	
第 3 4 6 回政府保証道路債券	215,000,000	220,523,350	
第 1 回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,102,000	
第 2 回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	110,715,000	
第 2 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	213,394,000	
第 2 回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	111,088,000	
第 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,536,000	
第 4 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,207,000	
第 4 回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,880,000	
第 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,733,000	
第 5 回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,522,000	
第 5 回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	218,470,000	
第 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,962,000	
第 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,322,000	
第 7 回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,677,000	
第 9 回公営企業債券（20年）	100,000,000	113,995,000	
第 1 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,303,000	
第 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,923,000	
第 1 1 回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,590,000	
第 1 2 回公営企業債券	200,000,000	203,130,000	
第 1 2 回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,334,000	
第 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,241,000	
第 1 3 回公営企業債券	100,000,000	102,254,000	
第 1 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,780,000	
第 1 5 回公営企業債券（20年）	100,000,000	111,928,000	
第 1 5 回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	314,454,000	
第 1 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,660,000	
第 1 6 回公営企業債券	200,000,000	204,864,000	
第 1 7 回公営企業債券（20年）	200,000,000	228,928,000	
第 1 7 回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	101,998,000	

第 1 9 回公営企業債券	100,000,000	104,765,000	
第 2 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,091,000	
第 2 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,763,000	
第 2 3 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年）	300,000,000	295,077,000	
第 2 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	181,000,000	186,790,190	
第 2 4 回公営企業債券（ 2 0 年）	100,000,000	112,042,000	
第 2 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,176,000	
第 2 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,364,000	
第 3 0 回公営企業債券	100,000,000	107,758,000	
第 3 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,514,000	
第 3 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	219,356,620	
第 8 4 3 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,584,000	
第 8 4 7 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,875,000	
第 8 4 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,812,000	
第 8 5 0 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,142,000	
第 8 5 1 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,073,000	
第 8 5 2 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,171,000	
第 8 5 5 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,421,000	
第 8 5 6 回政府保証公営企業債券	101,000,000	104,006,770	
第 8 5 7 回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,348,000	
第 8 5 9 回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,303,000	
第 8 6 0 回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,649,000	
第 8 6 2 回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,407,000	
第 8 6 3 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,128,000	
第 8 6 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,948,000	
第 8 7 1 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,467,000	
第 8 7 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,424,000	
第 8 7 7 回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,006,000	
第 8 7 9 回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,784,000	
第 8 8 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,127,000	
第 8 8 5 回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,631,000	
第 8 8 6 回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,192,000	
第 5 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,552,000	
第 1 9 7 回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,210,000	
第 6 回阪神高速道路債券	100,000,000	102,006,000	
第 1 4 4 回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	102,188,000	
第 1 4 8 回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	102,447,000	
第 1 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,574,000	
第 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,337,000	

第7回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,550,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,760,000	
第187回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,155,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	211,754,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	109,440,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	107,115,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	102,845,000	
第25回国際協力銀行債券	100,000,000	104,678,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	105,600,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	105,090,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	104,053,000	
第49回都市再生債券	100,000,000	105,017,000	
第27回政府保証本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,564,000	
第323回東京交通債券	100,000,000	109,689,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	110,828,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	107,027,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	28,316,000	29,446,657	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,445,000	248,457,847	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	68,418,000	72,771,437	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,296,000	37,871,196	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,294,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	86,802,000	91,519,688	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,915,000	31,423,912	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,027,000	33,310,897	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,190,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,147,000	22,067,951	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	125,852,000	135,081,985	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,552,000	34,798,739	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,910,000	102,388,322	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,267,000	34,531,820	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,384,000	49,912,450	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,227,000	35,497,400	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,511,000	26,727,859	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,547,000	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,689,000	29,847,748	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	51,931,000	55,294,051	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,691,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	167,997,000	176,279,252	
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,414,000	

第 1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,215,000	33,836,703	
第 1 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	55,991,000	58,398,053	
第 2 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,266,000	73,494,689	
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,308,000	
第 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,120,000	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,687,000	65,242,773	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,207,000	39,896,895	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,249,000	64,517,641	
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,578,000	
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,840,000	124,255,834	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,369,000	44,357,800	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	134,643,000	141,228,389	
第 2 9 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,558,000	
第 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,941,000	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,666,000	49,676,551	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	151,386,000	157,639,755	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,038,000	54,539,466	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,586,000	77,121,807	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,935,000	82,779,923	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,103,000	50,588,482	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,198,000	83,816,533	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,864,000	51,380,007	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	142,422,000	149,443,404	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,280,000	171,612,552	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	94,180,000	99,280,788	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,055,000	51,081,023	
第 4 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,939,000	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,098,000	48,572,349	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,609,000	89,585,459	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,290,000	90,991,674	
第 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,390,000	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,368,000	277,917,252	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	351,712,000	367,282,290	
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,744,000	46,732,152	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,384,000	93,063,939	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,617,000	92,600,349	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	136,614,000	146,075,885	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,475,000	93,319,534	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,217,000	49,105,562	

第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,877,000	94,093,992	
第 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,264,000	94,439,585	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,177,000	94,562,541	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,497,000	95,026,610	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,550,000	96,209,663	
第 6 7 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,362,000	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,187,000	98,295,005	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,208,000	296,222,810	
第 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,954,000	97,425,160	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,264,000	97,719,452	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,746,000	99,999,354	
第 8 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,762,000	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,001,000	
第 1 5 回政府保証国民生活債券	100,000,000	102,192,000	
第 1 9 回政府保証国民生活債券	125,000,000	131,222,500	
第 2 0 回政府保証国民生活債券	100,000,000	101,429,000	
第 1 1 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	105,260,000	
い第 7 1 3 号商工債	100,000,000	100,752,000	
い第 7 1 4 号商工債	100,000,000	100,937,000	
い第 7 1 5 号商工債	100,000,000	100,702,000	
い第 7 1 6 号商工債	100,000,000	100,745,000	
い第 7 1 7 号商工債	100,000,000	100,778,000	
い第 7 2 6 号商工債	100,000,000	100,536,000	
い第 7 3 1 号商工債	100,000,000	101,267,000	
い第 7 3 4 号商工債	200,000,000	201,788,000	
い第 7 4 0 号商工債	200,000,000	201,126,000	
い第 7 4 1 号商工債	200,000,000	201,108,000	
い第 7 1 7 号農林債	100,000,000	100,818,000	
い第 7 1 8 号農林債	100,000,000	100,765,000	
い第 7 2 0 号農林債	100,000,000	100,749,000	
い第 7 2 1 号農林債	100,000,000	100,677,000	
い第 7 2 4 号農林債	100,000,000	100,550,000	
い第 7 2 5 号農林債	100,000,000	100,347,000	
い第 7 2 8 号農林債	200,000,000	201,496,000	
い第 7 2 9 号農林債	100,000,000	101,274,000	
い第 7 3 0 号農林債	100,000,000	101,164,000	
い第 7 3 2 号農林債	200,000,000	201,866,000	
い第 7 3 6 号農林債	100,000,000	100,675,000	
い第 7 4 5 号農林債	120,000,000	120,068,400	

	い第749号農林債	100,000,000	99,757,000	
	い第751号農林債	100,000,000	99,694,000	
	第237回信金中金債（5年）	100,000,000	100,881,000	
	第238回信金中金債（5年）	100,000,000	100,765,000	
	第243回信金中金債（5年）	100,000,000	100,786,000	
	第246回信金中金債（5年）	100,000,000	100,805,000	
	第248回信金中金債（5年）	100,000,000	100,668,000	
	第251回信金中金債（5年）	100,000,000	100,303,000	
	第257回信金中金債（5年）	100,000,000	101,281,000	
	第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,899,000	
	第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,758,000	
	第266回信金中金債（5年）	100,000,000	100,581,000	
	第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,572,000	
	第278回信金中金債（5年）	100,000,000	99,842,000	
	第280回信金中金債（5年）	100,000,000	99,329,000	
	第159号商工債（3年）	100,000,000	100,035,000	
	第5回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	105,519,000	
	第21回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,668,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	107,080,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	106,642,000	
	第8回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	105,455,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	172,000,000	180,928,520	
	第14回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,539,000	
	第20回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	105,033,000	
	第3回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,231,000	
	第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,897,000	
	第21回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,264,000	
	特殊債券 小計	34,818,718,000	36,377,987,506	
社債券	第4回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,163,000	
	第5回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,611,000	
	第1回フランス電力円貨社債	100,000,000	101,176,000	
	第1回ジーディーエフ・スエズ円貨社債	100,000,000	100,922,000	
	第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券	100,000,000	101,166,000	
	第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	103,024,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	104,120,000	

第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,812,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	203,172,000	
第6回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,678,000	
第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	200,000,000	205,604,000	
第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	202,626,000	
第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,462,000	
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,524,000	
第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,334,000	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,415,000	
第20回第ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	99,952,000	
第21回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,160,000	
第3回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	101,290,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	101,287,000	
第1回エイチエスビーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	101,219,000	
第3回株式会社ケーティー円貨社債	100,000,000	99,226,000	
第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	97,871,000	
第20回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,019,000	
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,612,000	
第3回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,887,000	
第8回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,600,000	
第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,963,000	
第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	97,857,000	
第29回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,562,000	
第29回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	99,815,000	
第23回北越紀州製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,499,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,626,000	
第37回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	107,625,000	
第38回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	108,413,000	
第7回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,778,000	
第9回宇部興産株式会社無担保社債	100,000,000	100,583,000	
第13回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,679,000	
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	102,827,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	102,840,000	

第3回テルモ株式会社無担保社債	100,000,000	100,112,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,745,000	
第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,765,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	105,542,000	
第3回出光興産株式会社無担保社債	100,000,000	100,328,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	99,335,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,451,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,317,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,281,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	102,950,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,712,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	99,507,000	
第55回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,416,000	
第1回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	99,897,000	
第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	99,957,000	
第17回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	102,023,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	106,126,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,605,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,378,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,769,000	
第56回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,137,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	107,569,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	101,671,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	102,209,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,523,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,562,000	
第69回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,725,000	
第92回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,654,000	
第58回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	105,294,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,357,000	
第46回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,441,000	
第53回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,107,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,978,000	
第75回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,508,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,080,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,714,000	
第19回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,378,000	

第20回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,775,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,359,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,272,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,588,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,235,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	211,286,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,818,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	223,734,000	
第83回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,967,000	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,861,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,514,000	
第109回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,716,000	
第139回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	99,863,000	
第1回みずほ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	207,108,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,374,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	210,996,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	210,614,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	110,393,000	
第48回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,702,000	
第50回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,557,000	
第51回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,282,000	
第52回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,817,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,509,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,819,000	
第14回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,693,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,933,000	
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,850,000	
第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,660,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,187,000	
第63回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,477,000	
第42回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,605,000	
第43回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,605,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,730,000	
第159回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,795,000	
第163回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,921,000	

第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,741,000	
第6回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,478,000	
第12回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,727,000	
第16回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,175,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,661,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,045,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,512,000	
第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,434,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	201,536,000	
第2回大和証券キャピタル・マーケット株式会社無担保社債	100,000,000	100,555,000	
第5回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	100,720,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,745,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,013,000	
第48回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	112,430,000	
第78回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,309,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,272,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	112,319,000	
第72回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,302,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,294,000	
第10回エス・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,133,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,159,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,628,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,173,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	223,986,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,870,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,138,000	
第37回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,769,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,317,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,892,000	
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,226,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,768,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,202,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,663,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,355,000	
第5回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	113,103,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,422,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	211,714,000	
第25回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,015,000	

第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,373,000	
第62回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,696,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,084,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	112,192,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	108,705,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	98,269,000	
第27回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	105,442,000	
第12回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,610,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,645,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,592,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,867,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	210,376,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,262,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,118,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	107,097,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,918,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	107,472,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,798,000	
第511回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,008,000	
第513回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,143,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,568,000	
第515回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,263,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,133,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,468,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,491,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,190,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,376,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,686,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,649,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,185,000	
第405回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,462,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	212,588,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	111,072,000	
第466回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,390,000	
第478回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,313,000	
第480回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,343,000	
第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	108,257,000	
第484回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,157,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,068,000	

第444回関西電力株式会社社債	200,000,000	204,210,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,494,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,062,000	
第490回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,008,000	
第306回中国電力株式会社社債	100,000,000	110,018,000	
第311回中国電力株式会社社債	100,000,000	109,823,000	
第354回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,177,000	
第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,213,000	
第283回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,907,000	
第288回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,469,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,395,000	
第383回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,919,000	
第414回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,458,000	
第416回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,712,000	
第435回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,794,000	
第459回東北電力株式会社社債	173,000,000	173,875,380	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,921,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,789,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,680,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,996,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,932,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,886,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,981,000	
第396回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,415,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,728,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,086,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,748,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	101,724,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,344,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,575,000	
第29回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,530,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,239,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,736,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,592,000	
第7回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	111,100,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	111,244,000	
第25回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,679,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,644,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	105,502,000	

第24回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	100,765,000	
第42回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	100,935,000	
社債券 小計	24,773,000,000	25,521,913,380	
合計	380,259,748,000	396,293,657,691	

（注）代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 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 7月25日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,650,713,320
コール・ローン	2,456,456,513
株式	292,674,170,175
投資信託受益証券	170,808,709
投資証券	6,229,906,651
派生商品評価勘定	107,564,874
未収入金	3,403,657
未収配当金	380,590,285
未収利息	3,709
差入委託証拠金	1,609,727,122
流動資産合計	311,283,345,015
資産合計	311,283,345,015
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,045,079
未払解約金	1,613,989,519
流動負債合計	1,625,034,598
負債合計	1,625,034,598
純資産の部	
元本等	
元本	203,308,188,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	106,350,121,650
元本等合計	309,658,310,417
純資産合計	309,658,310,417
負債純資産合計	311,283,345,015

(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 7月25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)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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)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。 (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。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月25日現在
1. 計算期間の期首元本額	268,965,242,696円
計算期間中の追加設定元本額	14,638,313,685円
計算期間中の一部解約元本額	80,295,367,614円
計算日の元本額	203,308,188,767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	3,765,863,937円
DC外国株式インデックスファンド	4,370,273,316円
DC外国株式インデックスファンドL	17,869,110,979円
DCバランスファンド30	174,278,663円
DCバランスファンド50	557,764,877円
DCバランスファンド70	355,468,898円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	131,955,286円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	79,011,332円
新生・4分散ファンド	116,477,943円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	550,543,229円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	22,550,910円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	88,901,297円
外国株式インデックスe	5,621,091,494円
インデックスコレクション(外国株式)	2,298,243,424円
インデックスコレクション(バランス株式30)	203,121,039円
インデックスコレクション(バランス株式50)	444,281,626円
インデックスコレクション(バランス株式70)	473,431,303円
私募外国株式パッシブファンド(適格機関投資家専用)	4,902,811,795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)	12,879,423,486円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	3,346,328,744円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	26,637,802,108円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	17,703,227,469円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	3,222,826,651円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	289,158,986円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	21,133,734,707円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	2,555,161,508円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,330,916,488円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	23,747,879,100円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,064,193,302円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	32,887,985,672円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	4,124,682,817円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	129,257,159円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,580,339,454円

VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,212,250,405円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	617,255,228円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,477,023,546円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	779,280,103円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	1,976,496,447円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	68,710,658円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	440,503,005円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,044,124,156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)	34,446,220円
2. 計算日における受益権総数	203,308,188,767口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5231円 (15,231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 7月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月25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、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	23,138,641,382
投資信託受益証券	△8,788,148
投資証券	69,700,707
合計	23,199,553,941

(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7月25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)

I. 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 7月25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	9,772,468,295	—	9,869,307,451	96,839,156
合計		9,772,468,295	—	9,869,307,451	96,839,156

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月25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	730,200,517	—	724,194,090	△6,006,427
	イギリスポンド	117,698,784	—	120,367,520	2,668,736
	ユーロ	151,262,519	—	154,970,140	3,707,621
	計	999,161,820	—	999,531,750	369,930
	売 建				
	アメリカドル	476,498,255	—	477,026,800	△528,545
	カナダドル	46,480,050	—	46,475,940	4,110
	オーストラリアドル	29,828,955	—	29,828,500	455
	イギリスポンド	80,932,022	—	80,931,390	632
	スイスフラン	31,984,059	—	31,984,030	29
	香港ドル	9,494,126	—	9,568,200	△74,074
	シンガポールドル	11,939,298	—	11,938,060	1,238
	スウェーデンクローナ	12,126,253	—	12,119,800	6,453
	ノルウェークローネ	9,918,656	—	9,914,430	4,226
	ユーロ	104,320,335	—	104,424,150	△103,815
	計	813,522,009	—	814,211,300	△689,291
	合計	1,812,683,829	—	1,813,743,050	△319,361

(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。

①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。

②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。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月25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 7月25日現在

該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月25日現在)

① 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	56,835	89.53	5,088,437.55	
	APACHE CORP	44,172	82.51	3,644,631.72	
	BAKER HUGHES	49,532	47.76	2,365,648.32	
	CABOT OIL & GAS CORP	24,948	71.71	1,789,021.08	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	28,667	63.57	1,822,361.19	
	CHENIERE ENERGY INC	23,981	28.47	682,739.07	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	61,900	22.20	1,374,180.00	
	CHEVRON CORP	219,717	126.37	27,765,637.29	
	CIMAREX ENERGY CO	9,227	74.44	686,857.88	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	33,675	28.28	952,329.00	
	CONCHO RESOURCES INC	12,697	88.13	1,118,986.61	
	CONOCOPHILLIPS	132,053	65.59	8,661,356.27	
	CONSOL ENERGY INC	26,541	28.30	751,110.30	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,254	91.65	481,529.10	
	CORE LABORATORIES N.V.	5,086	149.50	760,357.00	
	DENBURY RESOURCES INC	42,461	17.35	736,698.35	
	DEVON ENERGY CORPORATION	43,080	56.34	2,427,127.20	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	7,184	71.50	513,656.00	
	ENERGEN CORP	7,206	56.29	405,625.74	
	ENSCO PLC-CL A	26,570	60.05	1,595,528.50	
	EOG RESOURCES INC	30,699	144.07	4,422,804.93	
	EQT CORPORATION	17,300	81.49	1,409,777.00	
	EXXON MOBIL	506,517	94.99	48,114,049.83	
	FMC TECHNOLOGIES INC	26,258	56.11	1,473,336.38	
	HALLIBURTON CO	105,183	44.82	4,714,302.06	
	HELMERICH & PAYNE	11,070	65.94	729,955.80	
	HESS CORP	34,193	72.63	2,483,437.59	

HOLLYFRONTIER CORP	22,400	43.06	964,544.00	
KINDER MORGAN INC	78,186	38.76	3,030,489.36	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,528	83.05	957,400.40	
MARATHON OIL CORP	79,241	36.81	2,916,861.21	
MARATHON PETROLEUM CORP	37,003	70.39	2,604,641.17	
MURPHY OIL CORP	20,816	67.71	1,409,451.36	
NABORS INDUSTRIES LTD	29,772	15.09	449,259.48	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	48,063	72.37	3,478,319.31	
NOBLE CORP	29,085	39.67	1,153,801.95	
NOBLE ENERGY INC	41,196	64.54	2,658,789.84	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	90,952	91.00	8,276,632.00	
OCEANEERING INTL INC	12,151	76.76	932,710.76	
PEABODY ENERGY CORP	28,376	16.38	464,798.88	
PHILLIPS 66	66,384	58.84	3,906,034.56	
PIONEER NATURAL RESOURCES	14,813	153.00	2,266,389.00	
QEP RESOURCES INC	19,116	30.26	578,450.16	
RANGE RESOURCES CORP	19,022	76.05	1,446,623.10	
ROWAN COMPANIES PLC	14,365	35.12	504,498.80	
SCHLUMBERGER	151,203	82.85	12,527,168.55	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	38,838	37.58	1,459,532.04	
SPECTRA ENERGY CORP	74,939	35.71	2,676,071.69	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	17,994	26.85	483,138.90	
TESORO CORP	15,847	53.36	845,595.92	
ULTRA PETROLEUM CORP	17,535	21.22	372,092.70	
VALERO ENERGY CORP	61,492	34.60	2,127,623.20	
WEATHERFORD INTL LTD	88,242	13.84	1,221,269.28	
WHITING PETROLEUM CORP	12,430	49.77	618,641.10	
WILLIAMS COS	76,650	33.44	2,563,176.00	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	22,985	100.56	2,311,371.60	
AIRGAS INC	7,750	101.08	783,370.00	
ALBEMARLE CORP	9,369	62.64	586,874.16	
ALCOA	114,476	8.05	921,531.80	
ASHLAND INC	8,599	86.43	743,211.57	
BALL CORP	15,233	45.49	692,949.17	
CELANESE CORP-SERIES A	17,072	48.34	825,260.48	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,298	179.76	1,311,888.48	
CROWN HOLDINGS INC	15,342	44.27	679,190.34	
DOW CHEMICAL CO	135,949	34.37	4,672,567.13	

DU PONT (E.I) DE NEMOURS	105,911	57.38	6,077,173.18	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	16,561	75.04	1,242,737.44	
ECOLAB INC	30,550	93.68	2,861,924.00	
FMC CORP	14,586	63.55	926,940.30	
FREEPORT-MCMOR-B	116,409	28.88	3,361,891.92	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,464	78.75	666,540.00	
INT'L PAPER CO	47,467	47.21	2,240,917.07	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	48,489	67.42	3,269,128.38	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,114	104.76	535,742.64	
MEADWESTVACO CORP	18,463	36.28	669,837.64	
MONSANTO CO	60,582	101.74	6,163,612.68	
MOSAIC CO/THE	32,878	52.38	1,722,149.64	
NEWMONT MINING CORP	56,109	29.61	1,661,387.49	
NUCOR CORP	36,635	45.84	1,679,348.40	
OWENS-ILLINOIS INC	17,600	29.25	514,800.00	
PPG INDUSTRIES INC	15,855	157.08	2,490,503.40	
PRAXAIR INC	33,751	118.06	3,984,643.06	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	7,789	114.27	890,049.03	
SEALED AIR CORP	20,828	26.73	556,732.44	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,074	172.06	1,733,332.44	
SIGMA-ALDRICH	13,444	83.02	1,116,120.88	
VULCAN MATERIALS CO	14,111	48.93	690,451.23	
3 M COMPANY	74,706	116.33	8,690,548.98	
AGCO CORP	10,061	55.07	554,059.27	
AMETEK INC	27,473	45.78	1,257,713.94	
BOEING CO	81,843	106.95	8,753,108.85	
CATERPILLAR	74,804	83.44	6,241,645.76	
CUMMINS INC	20,128	116.24	2,339,678.72	
DANAHER CORP	67,081	67.63	4,536,688.03	
DEERE&CO	42,132	82.59	3,479,681.88	
DOVER CORP	20,004	85.22	1,704,740.88	
EATON CORP	53,260	68.08	3,625,940.80	
EMERSON ELECTRIC CO	82,227	60.00	4,933,620.00	
FASTENAL CO	31,440	45.45	1,428,948.00	
FLOWERVE CORP	16,242	56.05	910,364.10	
FLUOR CORP	18,791	62.29	1,170,491.39	
GENERAL DYNAMICS CORP	33,908	85.31	2,892,691.48	
GENERAL ELECTRIC CO	1,175,584	24.62	28,942,878.08	

GRAINGER (WW) INC	6,803	255.15	1,735,785.45	
HONEYWELL INTL INC	85,036	83.01	7,058,838.36	
ILLINOIS TOOL WORKS	49,918	71.41	3,564,644.38	
INGERSOLL-RAND PLC	34,411	60.55	2,083,586.05	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,677	59.39	812,277.03	
JOY GLOBAL INC	11,301	48.37	546,629.37	
KBR INC	15,325	33.26	509,709.50	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	9,600	92.59	888,864.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,530	119.12	3,755,853.60	
MASCO CORP	41,806	20.57	859,949.42	
NORTHROP GRUMMAN CORP	25,710	90.30	2,321,613.00	
PACCAR INC	39,910	56.20	2,242,942.00	
PALL CORP	12,564	70.36	884,003.04	
PARKER HANNIFIN CORP	17,179	101.31	1,740,404.49	
PENTAIR LTD	23,667	59.88	1,417,179.96	
PRECISION CASTPARTS CORP	16,670	233.26	3,888,444.20	
QUANTA SERVICES INC	22,102	27.85	615,540.70	
RAYTHEON COMPANY	36,972	69.75	2,578,797.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,161	92.02	1,487,135.22	
ROCKWELL COLLIN	14,438	71.11	1,026,686.18	
ROPER INDUSTRIES INC	11,060	131.76	1,457,265.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,900	36.95	476,655.00	
SPX CORP	4,641	75.01	348,121.41	
STANLEY BLACK&DECKER	17,434	82.51	1,438,479.34	
TEXTRON	31,371	27.92	875,878.32	
TRANSDIGM GROUP INC	5,331	141.81	755,989.11	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	99,044	104.99	10,398,629.56	
XYLEM INC	19,215	28.59	549,356.85	
ADT CORPORATION	26,360	42.09	1,109,492.40	
AVERY DENNISON CORP	12,393	43.93	544,424.49	
CINTAS CORP	10,920	47.55	519,246.00	
DUN & BRADSTREET CORP	4,469	106.48	475,859.12	
EQUIFAX INC	13,095	60.73	795,259.35	
IHS INC-CLASS A	6,868	108.59	745,796.12	
IRON MOUNTAIN INC	15,509	28.16	436,733.44	
MANPOWER GROUP	7,831	66.61	521,622.91	
NIELSEN HOLDINGS NV	25,125	33.31	836,913.75	
REPUBLIC SERVICES INC	32,153	35.11	1,128,891.83	

ROBERT HALF INTL INC	16,300	36.83	600,329.00	
STERICYCLE INC	10,500	117.37	1,232,385.00	
TYCO INTERNATIONAL LTD	52,583	34.94	1,837,250.02	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	17,118	61.57	1,053,955.26	
WASTE MANAGEMENT INC	50,901	42.31	2,153,621.31	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	18,361	59.28	1,088,440.08	
CSX CORP	114,789	24.94	2,862,837.66	
DELTA AIR LINES INC	24,146	20.80	502,236.80	
EXPEDITORS INTL WASH INC	23,320	40.06	934,199.20	
FEDEX CORP	34,683	105.88	3,672,236.04	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	46,245	26.76	1,237,516.20	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	10,149	74.04	751,431.96	
KANSAS CITY SOUTHERN	12,068	110.81	1,337,255.08	
NORFOLK SOUTHERN CORP	36,433	74.66	2,720,087.78	
SOUTHWEST AIRLINES CO	27,700	13.76	381,152.00	
UNION PACIFIC CORP	53,475	159.40	8,523,915.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,700	34.97	409,149.00	
UNITED PARCEL SERVICE B	83,272	86.98	7,242,998.56	
AUTOLIV INC	10,686	80.88	864,283.68	
BORGWARNER INC	12,410	92.17	1,143,829.70	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	34,252	55.49	1,900,643.48	
FORD MOTOR COMPANY	415,452	17.37	7,216,401.24	
GENERAL MOTORS CO	84,820	37.14	3,150,214.80	
HARLEY-DAVIDSON	24,903	55.86	1,391,081.58	
JOHNSON CONTROLS INC	76,342	41.07	3,135,365.94	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	12,018	69.51	835,371.18	
COACH INC	31,312	59.36	1,858,680.32	
DR HORTON INC	31,082	21.20	658,938.40	
FOSSIL GROUP INC	6,501	112.12	728,892.12	
GARMIN LTD	13,074	36.91	482,561.34	
HASBRO INC	12,174	47.12	573,638.88	
LEGGETT & PLATT INC	17,114	31.53	539,604.42	
LENNAR CORP-CL A	17,251	33.92	585,153.92	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,737	67.72	794,829.64	
MATTEL INC	38,991	42.12	1,642,300.92	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,366	116.50	741,639.00	
NEWELL RUBBERMAID	30,366	27.21	826,258.86	
NIKE B	81,227	62.63	5,087,247.01	

POLARIS INDUSTRIES INC	6,835	107.61	735,514.35	
PULTE GROUP INC	42,111	18.45	776,947.95	
PVH CORP	8,863	131.20	1,162,825.60	
RALPH LAUREN CORPORATION	6,684	179.13	1,197,304.92	
TOLL BROTHERS INC	18,634	32.31	602,064.54	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	9,072	61.83	560,921.76	
VF CORP	10,172	196.71	2,000,934.12	
WHIRLPOOL CORP	9,054	129.82	1,175,390.28	
BLOCK H & R INC	28,819	30.63	882,725.97	
CARNIVAL CORPORATION	44,192	36.92	1,631,568.64	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,600	400.12	1,440,432.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,804	48.38	667,837.52	
INT'L GAME TECHNOLOGY	28,378	18.83	534,357.74	
LAS VEGAS SANDS CORP	48,273	54.95	2,652,601.35	
MARRIOTT INTL A	28,466	40.37	1,149,172.42	
MCDONALD'S CORP	114,060	96.66	11,025,039.60	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45,597	16.07	732,743.79	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,326	36.37	630,146.62	
STARBUCKS CORP	85,127	66.61	5,670,309.47	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	21,044	63.32	1,332,506.08	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	15,136	61.24	926,928.64	
WYNN RESORTS LTD	9,340	131.13	1,224,754.20	
YUM BRANDS INC	51,193	71.45	3,657,739.85	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	22,464	18.70	420,076.80	
CBS CORP-CL B	66,128	52.48	3,470,397.44	
CHARTER COMMUNICATION-A	6,946	127.66	886,726.36	
COMCAST CORP-CL A	240,703	44.96	10,822,006.88	
COMCAST CORP-SPECIAL A	59,059	42.92	2,534,812.28	
DIRECTV	63,248	63.68	4,027,632.64	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	15,752	84.63	1,333,091.76	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	11,391	76.96	876,651.36	
DISH NETWORK CORPORATION-A	24,258	44.79	1,086,515.82	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	47,140	15.76	742,926.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,244	80.44	1,869,747.36	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	17,542	76.11	1,335,121.62	
LIBERTY MEDIA CORP	10,797	139.89	1,510,392.33	
NEWS CORP-CLASS A	44,386	15.71	697,304.06	
OMNICOM GROUP	29,758	64.62	1,922,961.96	

SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	9,265	71.70	664,300.50	
SIRIUS XM RADIO INC	379,025	3.68	1,394,812.00	
THE WALT DISNEY CO	194,920	64.64	12,599,628.80	
TIME WARNER CABLE-A	33,628	117.29	3,944,228.12	
TIME WARNER INC	106,761	62.30	6,651,210.30	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	173,411	30.48	5,285,567.28	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	50,594	30.47	1,541,599.18	
VIACOM INC-CLASS B	50,399	72.61	3,659,471.39	
ADVANCE AUTO PARTS	8,012	81.53	653,218.36	
AMAZON.COM	41,228	298.94	12,324,698.32	
AUTOZONE INC	4,274	436.35	1,864,959.90	
BED BATH & BEYOND INC	26,132	75.94	1,984,464.08	
BEST BUY COMPANY INC	31,351	29.33	919,524.83	
CARMAX INC	26,313	47.17	1,241,184.21	
DICK'S SPORTING GOODS INC	11,745	50.60	594,297.00	
DOLLAR GENERAL CORP	35,635	54.23	1,932,486.05	
DOLLAR TREE INC	25,355	52.88	1,340,772.40	
EXPEDIA INC	13,225	63.78	843,490.50	
FAMILY DOLLAR STORES	11,399	68.11	776,385.89	
GAMESTOP CORP-CLASS A	13,080	43.24	565,579.20	
GAP	34,779	44.81	1,558,446.99	
GENUINE PARTS CO	16,939	81.29	1,376,971.31	
HOME DEPOT	169,643	80.27	13,617,243.61	
J.C. PENNEY CO INC	17,647	15.92	280,940.24	
KOHL'S CORP	25,058	53.59	1,342,858.22	
L BRANDS INC	28,157	52.64	1,482,184.48	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	58,494	24.33	1,423,159.02	
LKQ CORP	32,632	25.96	847,289.88	
LOWES COMPANIES	125,978	44.75	5,637,515.50	
MACY'S INC	45,624	48.30	2,203,639.20	
NETFLIX INC	5,897	241.30	1,422,946.10	
NORDSTROM INC	17,390	61.46	1,068,789.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,678	117.83	1,493,848.74	
PETSMART INC	11,011	71.15	783,432.65	
PRICELINE.COM INC	5,834	894.02	5,215,712.68	
ROSS STORES INC	25,512	66.63	1,699,864.56	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	5,385	42.12	226,816.20	
STAPLES INC	77,692	16.12	1,252,395.04	

TARGET (DAYTON HUDSON)	69,866	73.32	5,122,575.12	
TIFFANY & CO	14,585	78.46	1,144,339.10	
TJX COMPANIES INC	84,414	51.60	4,355,762.40	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,863	121.27	953,546.01	
TRIPADVISOR INC	13,513	61.14	826,184.82	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	7,410	94.06	696,984.60	
URBAN OUTFITTERS INC	14,477	42.04	608,613.08	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,313	117.90	5,814,002.70	
CVS CAREMARK CORPORATION	139,632	61.66	8,609,709.12	
KROGER CO	55,907	39.13	2,187,640.91	
SAFEGWAY INC	25,831	25.51	658,948.81	
SYSCO CORP	64,711	34.43	2,227,999.73	
WALGREEN CO	101,356	51.08	5,177,264.48	
WAL-MART STORES	190,067	78.23	14,868,941.41	
WHOLE FOODS MKT INC	40,946	54.49	2,231,147.54	
ALTRIA GROUP INC	229,008	35.57	8,145,814.56	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	73,391	36.07	2,647,213.37	
BEAM INC	15,558	64.19	998,668.02	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	13,078	71.96	941,092.88	
BUNGE LIMITED	15,913	74.22	1,181,062.86	
CAMPBELL SOUP CO (US)	22,332	46.41	1,036,428.12	
COCA-COLA CO	455,042	40.86	18,593,016.12	
COCA-COLA ENTERPRISES	29,401	37.50	1,102,537.50	
CONAGRA	45,043	36.73	1,654,429.39	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,646	50.90	949,081.40	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	21,903	46.32	1,014,546.96	
GENERAL MILLS INC	73,311	51.06	3,743,259.66	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	14,751	74.56	1,099,834.56	
HERSHEY FOODS CORPORATION	17,641	92.87	1,638,319.67	
HORMEL FOODS CORP	14,849	41.16	611,184.84	
JM SMUCKER CO	11,909	109.51	1,304,154.59	
KELLOGG CO	28,773	66.87	1,924,050.51	
KRAFT FOODS GROUP INC	66,876	56.44	3,774,481.44	
LORILLARD INC	43,613	44.41	1,936,853.33	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,132	71.60	940,251.20	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	23,486	70.67	1,659,755.62	
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,900	49.89	793,251.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	191,903	30.80	5,910,612.40	

MONSTER BEVERAGE CORP	16,263	63.23	1,028,309.49	
PEPSICO INC	175,205	85.64	15,004,556.20	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	187,015	88.54	16,558,308.10	
REYNOLDS AMERICAN INC	37,628	50.35	1,894,569.80	
TYSON FOODS INC	30,099	27.07	814,779.93	
AVON PRODUCTS INC	50,440	23.07	1,163,650.80	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,800	63.39	938,172.00	
CLOROX COMPANY	14,073	85.12	1,197,893.76	
COLGATE-PALMOLIVE CO	106,411	58.47	6,221,851.17	
ENERGIZER HOLDINGS INC	6,424	105.80	679,659.20	
ESTEE LAUDER CO-CL A	27,665	64.71	1,790,202.15	
HERBALIFE LTD	10,135	58.06	588,438.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	43,720	97.85	4,278,002.00	
PROCTER & GAMBLE CO	309,034	80.27	24,806,159.18	
ABBOTT LABORATORIES	179,232	36.45	6,533,006.40	
AETNA INC	42,415	65.61	2,782,848.15	
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,808	56.77	1,465,120.16	
BARD C R INC	8,253	112.54	928,792.62	
BAXTER INTERNATIONAL	61,759	73.62	4,546,697.58	
BECTON DICKINSON & CO	21,551	103.73	2,235,485.23	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	148,627	9.61	1,428,305.47	
CARDINAL HEALTH	38,950	49.86	1,942,047.00	
CAREFUSION CORP	23,494	38.78	911,097.32	
CERNER CORP	34,768	49.39	1,717,191.52	
CIGNA CORP	31,842	78.11	2,487,178.62	
COVIDIEN PLC	53,074	60.65	3,218,938.10	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,102	117.59	1,187,894.18	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	14,669	42.32	620,792.08	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13,261	70.18	930,656.98	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	92,701	66.82	6,194,280.82	
HCA HOLDINGS INC	31,600	38.76	1,224,816.00	
HENRY SCHEIN INC	9,820	102.96	1,011,067.20	
HOLOGIC INC	28,839	22.54	650,031.06	
HUMANA INC	18,351	91.57	1,680,401.07	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,684	383.96	1,798,468.64	
LABORATORY CRP OF AMER	10,230	97.78	1,000,289.40	
MCKESSON CORP	26,793	118.46	3,173,898.78	
MEDTRONIC	114,779	55.09	6,323,175.11	

OMNICARE INC	10,669	53.13	566,843.97	
PATTERSON COMPANIES INC	9,995	40.13	401,099.35	
QUEST DIAGNOSTICS	17,773	58.72	1,043,630.56	
RESMED INC	16,164	44.61	721,076.04	
ST JUDE MEDICAL INC	32,660	51.93	1,696,033.80	
STRYKER CORP	33,788	70.83	2,393,204.04	
UNITEDHEALTH GROUP INC	116,206	72.53	8,428,421.18	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,348	72.11	890,414.28	
WELLPOINT INC	34,239	87.44	2,993,858.16	
ZIMMER HOLDINGS INC	19,182	84.04	1,612,055.28	
ABBVIE INC	178,821	43.64	7,803,748.44	
ACTAVIS INC	14,324	126.75	1,815,567.00	
AGILENT TECHNOLOGIES	38,165	46.76	1,784,595.40	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,714	109.76	2,383,328.64	
ALLERGAN INC	33,406	90.42	3,020,570.52	
AMGEN	84,459	106.60	9,003,329.40	
BIOGEN IDEC INC	26,565	226.61	6,019,894.65	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,677	63.26	928,467.02	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	185,461	44.59	8,269,705.99	
CELGENE CORP	47,169	135.99	6,414,512.31	
FOREST LABORATORIES INC	27,158	44.19	1,200,112.02	
GILEAD SCIENCES INC	171,754	59.88	10,284,629.52	
HOSPIRA INC	17,791	39.52	703,100.32	
ILLUMINA INC	14,472	81.57	1,180,481.04	
JOHNSON & JOHNSON	316,531	92.36	29,234,803.16	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	19,756	74.52	1,472,217.12	
LILLY (ELI) & CO	115,392	52.55	6,063,849.60	
MERCK & CO	342,223	47.77	16,347,992.71	
MYLAN INC	44,664	32.38	1,446,220.32	
ONYX PHARMACEUTICALS INC	8,422	130.74	1,101,092.28	
PERRIGO CO	10,160	130.01	1,320,901.60	
PFIZER	753,963	29.28	22,076,036.64	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,555	267.93	2,292,141.15	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	40,109	90.61	3,634,276.49	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,077	85.26	2,138,065.02	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	25,600	20.08	514,048.00	
WATERS CORP	9,813	100.31	984,342.03	
ZOETIS INC	56,399	29.90	1,686,330.10	

BB&T CORP	78,089	35.68	2,786,215.52	
CIT GROUP INC	21,973	50.19	1,102,824.87	
COMERICA INC	20,008	42.86	857,542.88	
FIFTH THIRD BANCORP	95,933	19.59	1,879,327.47	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,949	42.98	384,628.02	
HUDSON CITY BANCORP INC	49,318	9.68	477,398.24	
KEY CORP	98,640	12.37	1,220,176.80	
M & T BANK CORP	12,605	118.43	1,492,810.15	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	45,400	14.80	671,920.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	34,500	15.40	531,300.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,647	77.10	4,598,783.70	
REGIONS FINL CORP	153,936	10.22	1,573,225.92	
SUNTRUST BANKS	59,132	35.09	2,074,941.88	
US BANCORP	211,773	37.54	7,949,958.42	
WELLS FARGO & CO	567,297	44.31	25,136,930.07	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,600	174.29	976,024.00	
AMERICAN EXPRESS	113,012	75.36	8,516,584.32	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	22,393	86.24	1,931,172.32	
BANK NEW YORK CO	130,811	31.92	4,175,487.12	
BANK OF AMERICA CORP	1,224,777	14.71	18,016,469.67	
BLACKROCK INC	15,332	283.95	4,353,521.40	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	65,745	68.72	4,517,996.40	
CITIGROUP	343,686	52.19	17,936,972.34	
CME GROUP INC	35,540	73.63	2,616,810.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	55,809	50.43	2,814,447.87	
EATON VANCE CORP	13,707	40.80	559,245.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	15,858	146.30	2,320,025.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,191	165.04	8,283,522.64	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,360	176.78	1,477,880.80	
INVESCO LTD	48,020	32.69	1,569,773.80	
JPMORGAN CHASE & CO	433,096	56.63	24,526,226.48	
LEGG MASON INC	11,184	34.03	380,591.52	
LEUCADIA NATIONAL CORP	33,151	27.20	901,707.20	
MCGRAW-HILL FINANCIAL	29,872	59.48	1,776,786.56	
MOODY'S CORP	23,535	64.68	1,522,243.80	
MORGAN STANLEY	166,154	27.73	4,607,450.42	
NASDAQ OMX GROUP	11,599	32.81	380,563.19	
NORTHERN TRUST CORP	25,190	59.11	1,488,980.90	

NYSE EURONEXT	26,852	41.18	1,105,765.36	
PRICE T ROWE GROUP INC	28,393	75.61	2,146,794.73	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,240	43.81	623,854.40	
SCHWAB (CHARLES) CORP	128,535	22.11	2,841,908.85	
SEI INVESTMENTS COMPANY	15,373	31.71	487,477.83	
SLM CORP	51,878	24.56	1,274,123.68	
STATE STREET CORP	51,304	69.67	3,574,349.68	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,660	26.73	685,891.80	
ACE LTD	38,434	91.88	3,531,315.92	
AFLAC	52,573	60.90	3,201,695.70	
ALLEGHANY CORP	1,808	401.31	725,568.48	
ALLSTATE CORP	54,857	50.99	2,797,158.43	
AMERICAN INT'L GROUP	158,915	45.96	7,303,733.40	
AON PLC	34,207	66.88	2,287,764.16	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,152	53.85	762,085.20	
ASSURANT INC	8,108	52.94	429,237.52	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	11,323	45.00	509,535.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	121,582	116.46	14,159,439.72	
CHUBB CORPORATION	30,008	86.20	2,586,689.60	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,399	48.68	798,303.32	
EVEREST RE GROUP LTD	5,339	129.46	691,186.94	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	21,984	24.49	538,388.16	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	45,429	31.21	1,417,839.09	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,119	41.32	1,203,197.08	
LOEWS CORP	37,363	46.16	1,724,676.08	
MARSH & MCLENNAN COS	62,136	41.53	2,580,508.08	
METLIFE INC	105,164	49.07	5,160,397.48	
PARTNERRE LTD	5,970	90.19	538,434.30	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	33,730	40.09	1,352,235.70	
PROGRESSIVE CORP	65,709	25.85	1,698,577.65	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	52,405	78.40	4,108,552.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,463	86.94	388,013.22	
TORCHMARK CORP	9,712	69.76	677,509.12	
TRAVELERS COS INC/THE	42,722	82.18	3,510,893.96	
UNUM GROUP	30,415	31.58	960,505.70	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	17,908	43.00	770,044.00	
WR BERKLEY CORP	11,884	42.61	506,377.24	
XL GROUP PLC	32,769	31.80	1,042,054.20	

CBRE GROUP INC-A	32,580	24.36	793,648.80	
REALOGY HOLDINGS CORP	13,107	46.65	611,441.55	
WEYERHAEUSER CO	63,388	28.86	1,829,377.68	
ACCENTURE PLC-CL A	72,734	73.72	5,361,950.48	
ACTIVISION BLIZZARD INC	52,400	15.39	806,436.00	
ADOBE SYSTEMS INC	53,216	47.80	2,543,724.80	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	20,830	43.87	913,812.10	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,468	190.54	1,041,872.72	
ANSYS INC	9,741	79.97	778,987.77	
AUTODESK INC	26,060	36.86	960,571.60	
AUTOMATIC DATA PROCESS	54,558	72.22	3,940,178.76	
BMC SOFTWARE	14,266	45.56	649,958.96	
CA INC	36,036	29.88	1,076,755.68	
CITRIX SYSTEMS INC	20,355	67.49	1,373,758.95	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	33,718	71.75	2,419,266.50	
COMPUTER SCIENCES CORP	17,746	47.53	843,467.38	
EBAY	131,928	52.10	6,873,448.80	
ELECTRONIC ARTS INC	32,717	25.41	831,338.97	
EQUINIX INC	5,625	191.63	1,077,918.75	
FACEBOOK INC-A	180,867	26.51	4,794,784.17	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	33,548	44.32	1,486,847.36	
FISERV INC	14,471	92.01	1,331,476.71	
GOOGLE INC-CL A	30,245	902.90	27,308,210.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	119,941	196.61	23,581,600.01	
INTUIT INC	31,029	63.11	1,958,240.19	
LINKEDIN CORP - A	10,051	197.60	1,986,077.60	
MASTERCARD INC-CLASS A	12,048	590.99	7,120,247.52	
MICROSOFT CORP	899,613	31.96	28,751,631.48	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,279	19.08	577,723.32	
ORACLE CORP	428,674	32.39	13,884,750.86	
PAYCHEX INC	36,616	39.22	1,436,079.52	
RACKSPACE HOSTING INC	13,897	44.96	624,809.12	
RED HAT INC	22,452	50.54	1,134,724.08	
SAIC INC	28,714	14.84	426,115.76	
SALESFORCE.COM INC	62,467	42.01	2,624,238.67	
SYMANTEC CORP	75,803	24.12	1,828,368.36	
SYNOPSYS INC	17,400	37.24	647,976.00	

TERADATA CORP	19,315	57.71	1,114,668.65	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	18,732	27.19	509,323.08	
VERISIGN INC	17,481	45.34	792,588.54	
VISA INC-CLASS A SHARES	60,182	186.75	11,238,988.50	
VMWARE INC-CLASS A	9,349	83.20	777,836.80	
WESTERN UNION CO	65,780	17.44	1,147,203.20	
YAHOO	110,971	27.84	3,089,432.64	
AMPHENOL CORPORATION	17,609	77.91	1,371,917.19	
APPLE INC	106,064	440.61	46,732,859.04	
ARROW ELECTRONICS INC	12,402	44.93	557,221.86	
AVNET INC	13,870	37.54	520,679.80	
CISCO SYSTEMS	603,546	25.59	15,444,742.14	
CORNING	165,172	15.14	2,500,704.08	
DELL INC	165,938	12.91	2,142,259.58	
EMC CORP	238,078	26.75	6,368,586.50	
F5 NETWORKS INC	8,497	81.42	691,825.74	
FLEXTRONICS INTL LTD	68,408	8.13	556,157.04	
FLIR SYSTEMS INC	17,750	29.09	516,347.50	
HARRIS CORP	11,735	52.80	619,608.00	
HEWLETT-PACKARD CO	220,182	26.11	5,748,952.02	
JUNIPER NETWORKS INC	56,426	21.66	1,222,187.16	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28,563	56.04	1,600,670.52	
NETAPP INC	42,048	41.27	1,735,320.96	
QUALCOMM	195,240	61.39	11,985,783.60	
SANDISK CORP	27,034	60.73	1,641,774.82	
SEAGATE TECHNOLOGY	35,797	44.19	1,581,869.43	
TE CONNECTIVITY LTD	46,738	50.76	2,372,420.88	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	27,598	28.50	786,543.00	
WESTERN DIGITAL CORP	23,889	67.53	1,613,224.17	
XEROX CORP	133,890	9.83	1,316,138.70	
AT&T INC	620,874	35.40	21,978,939.60	
CENTURYLINK INC	69,773	35.87	2,502,757.51	
CROWN CASTLE INTL CORP	33,156	76.72	2,543,728.32	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	123,098	4.28	526,859.44	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	16,179	21.59	349,304.61	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	14,573	78.12	1,138,442.76	
SPRINT CORP	94,751	5.77	546,713.27	
T-MOBILE US INC	16,559	24.21	400,893.39	

VERIZON COMMUNICATIONS	323,508	50.38	16,298,333.04	
WINDSTREAM CORP	60,961	8.14	496,527.34	
AES CORP	72,740	12.42	903,430.80	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,160	53.19	646,790.40	
AMEREN CORPORATION	25,800	35.58	917,964.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	54,595	46.38	2,532,116.10	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,762	42.82	803,388.84	
CALPINE CORP	38,723	20.12	779,106.76	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,754	24.45	1,069,785.30	
CMS ENERGY CORP	27,658	27.98	773,870.84	
CONSOLIDATED EDISON INC	33,294	59.63	1,985,321.22	
DOMINION RESOURCES	66,972	58.85	3,941,302.20	
DTE ENERGY COMPANY	18,567	69.65	1,293,191.55	
DUKE ENERGY CORP	80,650	70.50	5,685,825.00	
EDISON INTL	35,150	49.25	1,731,137.50	
ENTERGY CORP	20,160	70.42	1,419,667.20	
EXELON CORP	96,000	31.18	2,993,280.00	
FIRSTENERGY CORP	46,680	38.24	1,785,043.20	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	7,779	62.09	482,998.11	
MDU RESOURCES GROUP INC	19,763	28.14	556,130.82	
NEXTERA ENERGY INC	48,974	83.76	4,102,062.24	
NISOURCE INC	33,000	30.59	1,009,470.00	
NORTHEAST UTILITIES	34,094	44.17	1,505,931.98	
NRG ENERGY INC	37,000	27.43	1,014,910.00	
OGE ENERGY CORP	21,244	36.92	784,328.48	
ONEOK INC	24,080	42.83	1,031,346.40	
PEPCO HOLDINGS INC	26,600	20.12	535,192.00	
PG&E CORP	48,485	45.14	2,188,612.90	
PINNACLE WEST CAPITAL	12,026	58.80	707,128.80	
PPL CORPORATION	66,258	31.16	2,064,599.28	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	55,290	33.82	1,869,907.80	
SCANA CORP	14,394	51.87	746,616.78	
SEMPRA ENERGY	26,381	85.96	2,267,710.76	
SOUTHERN CO	99,215	45.04	4,468,643.60	
WISCONSIN ENERGY CORP	24,490	43.01	1,053,314.90	
XCEL ENERGY INC	54,995	29.68	1,632,251.60	
ALTERA CORPORATION	37,096	35.11	1,302,440.56	
ANALOG DEVICES	35,504	48.23	1,712,357.92	

	APPLIED MATERIALS	134,027	16.10	2,157,834.70	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	28,422	36.89	1,048,487.58	
	BROADCOM CORP-CL A	60,312	27.01	1,629,027.12	
	CREE INC	13,003	68.55	891,355.65	
	INTEL CORP	561,308	22.93	12,870,792.44	
	KLA-TENCOR CORP	19,025	59.45	1,131,036.25	
	LAM RESEARCH CORP	18,601	49.04	912,193.04	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	25,510	39.58	1,009,685.80	
	LSI CORP	66,758	7.42	495,344.36	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	49,920	11.98	598,041.60	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	33,069	27.16	898,154.04	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,482	39.48	848,109.36	
	MICRON TECHNOLOGY	114,715	13.10	1,503,340.07	
	NVIDIA CORP	72,459	14.21	1,029,642.39	
	TEXAS INSTRUMENTS	126,131	38.93	4,910,279.83	
	XILINX INC	28,797	45.51	1,310,551.47	
	アメリカドル小計	34,270,398		1,743,522,299.63 (174,892,721,875)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,705	35.72	418,102.60	
	ARC RESOURCES LTD	32,855	26.01	854,558.55	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	29,900	7.00	209,300.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	11,933	43.61	520,398.13	
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	13.71	300,249.00	
	CAMECO CORP	45,841	21.77	997,958.57	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	123,676	33.81	4,181,485.56	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	55,304	20.63	1,140,921.52	
	CENOVUS ENERGY INC	84,673	30.49	2,581,679.77	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	41,307	38.71	1,598,993.97	
	ENBRIDGE	88,720	46.24	4,102,412.80	
	ENCANA CORP	85,814	17.78	1,525,772.92	
	ENERPLUS CORP	22,122	16.93	374,525.46	
	HUSKY ENERGY INC	38,520	29.58	1,139,421.60	
	IMPERIAL OIL	33,320	43.34	1,444,088.80	
	KEYERA CORP	8,289	56.05	464,598.45	
	MEG ENERGY CORP	18,100	33.85	612,685.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	37,078	20.46	758,615.88	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,036	32.45	1,039,568.20	
	PENGROWTH ENERGY CORP	57,412	5.93	340,453.16	

PENN WEST PETROLEUM LTD	51,200	12.79	654,848.00	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	15,238	28.56	435,197.28	
SUNCOR ENERGY	171,553	32.84	5,633,800.52	
TALISMAN ENERGY INC	119,391	12.16	1,451,794.56	
TOURMALINE OIL CORP	17,463	40.14	700,964.82	
TRANSCANADA CORP	79,819	46.86	3,740,318.34	
VERMILION ENERGY INC	9,214	55.15	508,152.10	
AGNICO EAGLE MINES	19,864	29.04	576,850.56	
AGRIUM INC	16,488	90.85	1,497,934.80	
BARRICK GOLD CORP	115,533	17.67	2,041,468.11	
ELDORADO GOLD CORP	87,440	7.90	690,776.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,266	17.13	1,118,006.58	
FRANCO-NEVADA CORP	16,813	44.90	754,903.70	
GOLDCORP INC	92,627	29.24	2,708,413.48	
KINROSS GOLD CORP	119,699	5.53	661,935.47	
NEW GOLD INC	49,800	7.58	377,484.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	97,817	39.17	3,831,491.89	
SILVER WHEATON CORP	39,370	23.50	925,195.00	
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,464	23.69	1,550,842.16	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	47,061	5.32	250,364.52	
YAMANA GOLD INC	86,869	11.09	963,377.21	
BOMBARDIER B	165,933	5.01	831,324.33	
CAE INC	26,139	11.45	299,291.55	
FINNING INTERNATIONAL INC	20,851	22.77	474,777.27	
SNC-LAVALIN GROUP INC	17,225	45.44	782,704.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,815	102.48	5,002,561.20	
CP RAILWAY LIMITED	19,813	127.44	2,524,968.72	
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,181	78.00	2,042,118.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,200	45.33	553,026.00	
TIM HORTONS INC	17,879	58.50	1,045,921.50	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	40,348	26.04	1,050,661.92	
THOMSON REUTERS CORP	42,992	36.03	1,549,001.76	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	8,227	83.84	689,751.68	
DOLLARAMA INC	7,474	74.10	553,823.40	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	15,557	63.80	992,536.60	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,416	82.12	198,401.92	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,975	49.46	592,283.50	
METRO INC	9,665	72.91	704,675.15	

SHOPPERS DRUG MART CORP	21,544	61.25	1,319,570.00	
WESTON (GEORGE) LTD	6,170	88.23	544,379.10	
SAPUTO INC	13,502	49.12	663,218.24	
CATAMARAN CORPORATION	23,723	53.07	1,258,979.61	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	33,949	94.25	3,199,693.25	
BANK MONTREAL	74,012	65.49	4,847,045.88	
BANK NOVA SCOTIA	135,715	58.37	7,921,684.55	
CANADIAN IMPERIAL BANK	45,619	78.42	3,577,441.98	
NATIONAL BANK OF CANADA	17,586	78.17	1,374,697.62	
ROYAL BANK OF CANADA	164,101	64.91	10,651,795.91	
TORONTO-DOMINION BANK	104,847	88.12	9,239,117.64	
CI FINANCIAL CORP	17,444	31.45	548,613.80	
IGM FINANCIAL INC	9,882	48.70	481,253.40	
ONEX CORP	10,791	49.63	535,557.33	
GREAT-WEST LIFECO INC	33,503	30.54	1,023,181.62	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	10,095	42.61	430,147.95	
INTACT FINANCIAL CORP	14,698	59.00	867,182.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	205,908	18.50	3,809,298.00	
POWER CORP OF CANADA	39,680	30.12	1,195,161.60	
POWER FINANCIAL CORP	29,320	32.92	965,214.40	
SUN LIFE FINANCIAL INC	67,072	33.69	2,259,655.68	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	64,657	39.07	2,526,148.99	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	33,215	17.45	579,601.75	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,000	17.46	122,220.00	
CGI GROUP INC - CL A	23,601	31.18	735,879.18	
OPEN TEXT CORP	6,689	73.79	493,581.31	
BLACKBERRY LIMITED	52,849	9.30	491,495.70	
BCE INC	28,525	42.59	1,214,879.75	
BELL ALIANT INC	6,300	27.89	175,707.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	41,825	41.95	1,754,558.75	
TELUS CORP	39,260	31.02	1,217,845.20	
ATCO LTD -CLASS I	8,034	45.01	361,610.34	
CANADIAN UTILITIES LTD A	12,412	36.65	454,899.80	
FORTIS INC	21,600	32.26	696,816.00	
TRANSALTA CORP	32,000	14.97	479,040.00	

カナダドル小計		4,215,312		143,584,910.87 (13,963,632,582)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,973	18.60	278,497.80	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	120,292	12.46	1,498,838.32	
	SANTOS	112,430	13.85	1,557,155.50	
	WHITEHAVEN COAL LTD	64,057	2.19	140,284.83	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,046	37.86	2,803,381.56	
	WORLEYPARSONS LTD	24,469	21.97	537,583.93	
	ALUMINA LIMITED	286,552	1.02	292,283.04	
	AMCOR	141,305	10.38	1,466,745.90	
	BHP BILLITON LTD	364,133	34.73	12,646,339.09	
	BORAL LIMITED	84,545	4.42	373,688.90	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	176,976	3.77	667,199.52	
	ILUKA RESOURCES LTD	50,747	11.29	572,933.63	
	INCITEC PIVOT LTD	163,462	2.68	438,078.16	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,784	9.49	443,980.16	
	NEWCREST MINING LIMITED	89,789	12.69	1,139,422.41	
	ORICA LTD	41,870	18.35	768,314.50	
	RIO TINTO LTD	48,718	57.68	2,810,054.24	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	21,263	16.64	353,816.32	
	ALS LTD	37,855	9.08	343,723.40	
	ALS LTD-RIGHTS	3,441	1.15	3,957.15	
	BRAMBLES LTD	174,991	8.94	1,564,419.54	
	SEEK LTD	34,820	9.31	324,174.20	
	ASCIANO GROUP	119,058	5.07	603,624.06	
	AURIZON HOLDINGS LTD	224,602	4.53	1,017,447.06	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	122,140	1.30	158,782.00	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	81,860	5.32	435,495.20	
	TRANSURBAN GROUP	160,256	6.98	1,118,586.88	
	CROWN LTD	48,477	12.55	608,386.35	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	72,016	2.72	195,883.52	
	FLIGHT CENTRE LTD	5,590	43.13	241,096.70	
	TABCORP HOLDINGS	70,012	3.36	235,240.32	
	TATTS GROUP LTD	147,319	3.29	484,679.51	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,357	2.62	139,795.34	
	METCASH LTD	80,938	3.62	292,995.56	
	WESFARMERS LIMITED	113,145	39.96	4,521,274.20	
	WOOLWORTHS LTD	140,009	33.54	4,695,901.86	

	COCA-COLA AMATIL LIMITED	61,389	13.19	809,720.91	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,309	4.73	332,561.57	
	COCHLEAR LIMITED	7,010	62.25	436,372.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,731	37.00	582,047.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	38,723	14.40	557,611.20	
	CSL LIMITED	55,728	65.00	3,622,320.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	310,963	28.98	9,011,707.74	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	44,420	10.56	469,075.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	182,665	72.90	13,316,278.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	265,673	30.67	8,148,190.91	
	WESTPAC BANKING	352,038	29.75	10,473,130.50	
	ASX LTD	20,273	34.79	705,297.67	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	35,527	45.72	1,624,294.44	
	AMP LTD	340,119	4.66	1,584,954.54	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,143	5.94	1,361,109.42	
	QBE INSURANCE GROUP	133,967	16.12	2,159,548.04	
	SUNCORP GROUP LIMITED	148,773	12.69	1,887,929.37	
	COMPUTERSHARE LIMITED	54,947	10.01	550,019.47	
	TELSTRA CORP	489,862	5.01	2,454,208.62	
	AGL ENERGY LTD	58,538	14.97	876,313.86	
	SP AUSNET	219,745	1.23	271,385.07	
	オーストラリアドル小計	6,751,840		107,008,137.19 (9,824,417,075)	
イギリス ポンド	AMEC PLC	30,875	10.61	327,583.75	
	BG GROUP	385,045	11.85	4,562,783.25	
	BP PLC	2,168,867	4.73	10,278,260.71	
	PETROFAC LTD	28,640	13.15	376,616.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	426,014	22.36	9,525,673.04	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	297,374	23.27	6,919,892.98	
	TULLOW OIL PLC	105,896	10.21	1,081,198.16	
	ANGLO AMERICAN PLC	157,021	14.38	2,257,961.98	
	ANTOFAGASTA PLC	47,777	8.85	422,826.45	
	BHP BILLITTON PLC	239,951	19.07	4,575,865.57	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	16,367	24.17	395,590.39	
	FRESNILLO PLC	21,045	10.69	224,971.05	
	GLENCORE XSTRATA PLC	1,104,742	2.87	3,173,371.39	
	JOHNSON MATTHEY PLC	22,425	28.03	628,572.75	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	9,225	47.37	436,988.25	

REXAM	86,147	4.88	420,741.94	
RIO TINTO PLC REG	144,054	29.70	4,279,124.07	
VEDANTA RESOURCES PLC	10,217	11.77	120,254.09	
BAE SYSTEMS PLC	379,109	4.38	1,661,634.74	
BUNZL PLC	35,661	13.79	491,765.19	
COBHAM PLC	134,900	2.79	377,180.40	
IMI PLC	38,008	13.82	525,270.56	
INVENSYS PLC	75,318	4.98	375,083.64	
MEGGITT PLC	84,766	5.40	458,160.23	
MELROSE INDUSTRIES PLC	144,671	2.75	399,147.28	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	214,072	11.80	2,526,049.60	
SMITHS GROUP PLC	42,869	13.78	590,734.82	
TRAVIS PERKINS PLC	25,000	17.10	427,500.00	
WEIR GROUP PLC/THE	24,478	21.35	522,605.30	
WOLSELEY LTD	29,670	32.37	960,417.90	
AGGREKO PLC	32,797	18.20	596,905.40	
BABCOCK INTL GROUP PLC	45,075	11.80	531,885.00	
CAPITA GROUP PLC	74,139	10.37	768,821.43	
EXPERIAN PLC	112,153	12.25	1,373,874.25	
G4S PLC	175,604	2.25	396,162.62	
INTERTEK GROUP PLC	18,553	30.95	574,215.35	
SERCO GROUP PLC	60,711	6.18	375,193.98	
EASYJET PLC	15,000	13.85	207,750.00	
NEW GKN	177,982	3.41	607,096.60	
BURBERRY GROUP PLC	48,537	15.05	730,481.85	
PERSIMMON PLC	30,000	12.60	378,000.00	
CARNIVAL PLC	20,959	25.09	525,861.31	
COMPASS GROUP PLC	207,464	8.85	1,837,093.72	
INTERCONTINENTAL HOTELS	29,009	19.32	560,453.88	
TUI TRAVEL PLC	43,042	3.77	162,397.46	
WHITBREAD PLC	19,291	31.77	612,875.07	
WILLIAM HILL	88,000	4.70	413,688.00	
BRITISH SKY BROADCASTING	121,748	8.38	1,020,248.24	
ITV PLC	401,679	1.58	637,464.57	
PEARSON	94,370	12.60	1,189,062.00	
REED ELSEVIER PLC	137,458	8.01	1,101,038.58	
WPP PLC	143,296	11.81	1,692,325.76	
KINGFISHER PLC	260,852	3.96	1,034,539.03	

MARKS & SPENCER GROUP PLC	178,266	4.85	865,303.16	
NEXT PLC	18,453	48.59	896,631.27	
MORRISON SUPERMARKETS	245,203	2.87	705,939.43	
SAINSBURY (J) PLC	151,619	3.94	598,591.81	
TESCO	910,228	3.67	3,347,363.47	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	39,073	18.93	739,651.89	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	218,949	34.50	7,553,740.50	
COCA-COLA HBC AG-CDI	18,838	16.27	306,494.26	
DIAGEO	285,396	20.18	5,760,718.26	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	111,730	22.05	2,463,646.50	
SABMILLER PLC	108,916	32.40	3,528,878.40	
TATE & LYLE	49,590	8.53	423,002.70	
UNILEVER PLC	145,985	27.18	3,967,872.30	
RECKITT BENCKISER PLC	73,016	46.78	3,415,688.48	
SMITH & NEPHEW PLC	99,398	7.91	786,238.18	
ASTRAZENECA	141,454	32.88	4,651,714.79	
GLAXOSMITHKLINE	555,971	16.81	9,345,872.51	
SHIRE PLC	59,961	22.17	1,329,335.37	
BARCLAYS	1,380,296	3.20	4,424,538.82	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	2,093,518	7.33	15,347,580.45	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,238,416	0.69	3,621,840.82	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	257,207	3.41	877,590.28	
STANDARD CHARTERED PLC	274,090	15.05	4,126,424.95	
3I GROUP PLC	110,446	3.87	427,978.25	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	107,828	4.09	441,663.48	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	24,746	9.96	246,470.16	
ICAP PLC	55,892	4.05	226,809.73	
INVESTEC PLC	60,017	4.53	272,297.12	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,415	15.41	330,005.15	
SCHRODERS PLC	11,796	25.46	300,326.16	
ADMIRAL GROUP PLC	23,455	13.92	326,493.60	
AVIVA PIC	329,463	3.67	1,210,117.59	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	70,000	2.24	157,220.00	
LEGAL & GENERAL GROUP	685,281	1.90	1,306,830.86	
OLD MUTUAL PLC	565,435	1.97	1,115,037.82	
PRUDENTIAL	289,781	11.68	3,384,642.08	
RESOLUTION LTD	144,641	3.21	465,310.09	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	404,014	1.26	509,057.64	

	STANDARD LIFE PLC	274,584	3.77	1,036,829.18	
	SAGE GROUP PLC	129,885	3.56	463,169.91	
	BT GROUP PLC	886,705	3.42	3,032,531.10	
	INMARSAT PLC	50,921	7.05	358,993.05	
	VODAFONE GROUP PLC	5,535,807	1.93	10,717,322.35	
	CENTRICA PLC	588,129	3.85	2,268,413.55	
	NATIONAL GRID PLC	416,558	7.69	3,203,331.02	
	SEVERN TRENT PLC	29,121	17.42	507,287.82	
	SSE PLC	112,171	16.25	1,822,778.75	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	77,338	7.10	549,486.49	
	ARM HOLDINGS PLC	163,137	8.88	1,449,472.24	
	イギリスポンド小計	32,712,062		191,865,793.37 (29,466,748,545)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	40,093	46.49	1,863,923.57	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	952	318.75	303,450.00	
	GIVAUDAN-REG	880	1,265.00	1,113,200.00	
	HOLCIM LTD	26,224	67.30	1,764,875.20	
	SIKA AG-BR	262	2,514.00	658,668.00	
	SYNGENTA AG	10,486	371.00	3,890,306.00	
	ABB LTD	249,712	21.44	5,353,825.28	
	GEBERIT AG-REG	4,097	246.40	1,009,500.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,264	130.10	294,546.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,682	133.70	759,683.40	
	SULZER AG-REG	2,388	136.20	325,245.60	
	ADECCO	14,937	59.80	893,232.60	
	SGS SA	599	2,120.00	1,269,880.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,697	110.10	627,239.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	58,783	89.35	5,252,261.05	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	3,578	553.00	1,978,634.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	4,988	97.00	483,836.00	
	ARYZTA AG	8,675	57.25	496,643.75	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	254	880.00	223,520.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	86	3,536.00	304,096.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	12	41,200.00	494,400.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	365,037	62.75	22,906,071.75	
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,042	105.00	634,410.00	
	ACTELION LTD-REG	12,517	60.15	752,897.55	
	LONZA GROUP AG-REG	5,909	74.65	441,106.85	

	NOVARTIS	260,540	68.00	17,716,720.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	79,693	233.40	18,600,346.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	441	475.25	209,585.25	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	169,885	28.40	4,824,734.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,570	41.80	1,068,826.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	67.25	153,935.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,924	247.40	475,997.60	
	UBS AG-REG	413,244	17.94	7,413,597.36	
	BALOISE HOLDING AG	4,682	101.40	474,754.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,651	166.10	606,431.10	
	SWISS RE LTD	39,233	73.70	2,891,472.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,756	255.10	4,274,455.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,859	67.75	464,697.25	
	SWISSCOM	2,511	414.80	1,041,562.80	
	スイスフラン小計	1,857,432		114,312,568.81 (12,228,015,485)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	58,500	25.70	1,503,450.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	251,000	86.75	21,774,250.00	
	NWS HOLDINGS LTD	157,500	12.10	1,905,750.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	140,000	13.92	1,948,800.00	
	MTR CORP	155,500	29.30	4,556,150.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	23,000	46.05	1,059,150.00	
	LI & FUNG	684,400	10.76	7,364,144.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	81,000	21.65	1,753,650.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	245,000	40.95	10,032,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	108,000	21.45	2,316,600.00	
	SANDS CHINA LTD	281,200	42.80	12,035,360.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	182,000	12.92	2,351,440.00	
	SJM HOLDINGS LTD	206,000	19.58	4,033,480.00	
	WYNN MACAU LTD	188,400	21.95	4,135,380.00	
	BANK EAST ASIA	114,964	28.70	3,299,466.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	433,500	24.55	10,642,425.00	
	HANG SENG BANK	82,900	118.80	9,848,520.00	
	FIRST PACIFIC CO	238,000	9.18	2,184,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	125,000	122.60	15,325,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,361,400	36.30	49,418,820.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	156,000	110.60	17,253,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	262,000	24.70	6,471,400.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	123,843	50.10	6,204,534.30	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	73,000	33.60	2,452,800.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	72,000	32.45	2,336,400.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	422,000	11.56	4,878,320.00	
	SINO LAND CO	306,600	11.14	3,415,524.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,000	104.30	18,774,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	78,500	93.20	7,316,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	123,000	24.10	2,964,300.00	
	WHARF HOLDINGS	178,000	69.00	12,282,000.00	
	WHELOCK & CO LTD	96,000	40.55	3,892,800.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	85,500	35.55	3,039,525.00	
	PCCW LTD	429,000	3.57	1,531,530.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	53.35	3,787,850.00	
	CLP HOLDINGS	197,500	64.85	12,807,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	673,607	19.80	13,337,418.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	151,500	69.70	10,559,550.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	21,700	85.15	1,847,755.00	
	香港ドル小計	8,818,014		302,642,807.70 (3,913,171,503)	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	170,500	10.74	1,831,170.00	
	NOBLE GROUP LTD	457,145	0.90	413,716.22	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	121,000	5.11	618,310.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	101,400	4.55	461,370.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	185,000	4.40	814,000.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	152,000	0.95	144,400.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	184,000	1.95	358,800.00	
	SINGAPORE AIRLINES	66,600	10.31	686,646.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	721,400	1.39	1,002,746.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	177,250	4.31	763,947.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	12,000	42.95	515,400.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	162,800	1.70	277,574.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	736,720	0.56	412,563.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	241,000	3.16	761,560.00	
	DBS GROUP	191,000	16.78	3,204,980.00	
	OCBC BANK	290,000	10.63	3,082,700.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	143,000	21.98	3,143,140.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	85,000	7.65	650,250.00	
	CAPITALAND LTD	302,000	3.21	969,420.00	

	CAPITAMALLS ASIA LTD	142,000	1.99	283,290.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	10.73	525,770.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	345,000	2.88	993,600.00	
	KEPPEL LAND LTD	77,000	3.70	284,900.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,400	7.02	332,748.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	896,880	3.96	3,551,644.80	
	STARHUB LTD	64,000	4.33	277,120.00	
シンガポールドル小計		6,121,095		26,361,765.72 (2,084,424,815)	
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	83,334	8.51	709,172.34	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	89,179	3.07	274,225.42	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	4.18	364,796.96	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	225,967	2.35	532,152.28	
	CONTACT ENERGY LTD	34,237	5.50	188,303.50	
ニュージーランドドル小計		519,989		2,068,650.50 (165,429,980)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	23,681	145.70	3,450,321.70	
	BOLIDEN AB	33,839	93.95	3,179,174.05	
	ALFA LAVAL AB	35,219	147.10	5,180,714.90	
	ASSA ABLOY B	39,292	291.80	11,465,405.60	
	ATLAS COPCO A	79,930	169.60	13,556,128.00	
	ATLAS COPCO B	40,953	152.30	6,237,141.90	
	SANDVIK AB	119,639	81.80	9,786,470.20	
	SCANIA AB-B SHS	36,056	136.90	4,936,066.40	
	SKANSKA B	38,143	122.80	4,683,960.40	
	SKF AB-B	43,539	179.70	7,823,958.30	
	VOLVO B	172,621	97.90	16,899,595.90	
	SECURITAS B	34,345	62.50	2,146,562.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	24,949	185.10	4,618,059.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,160	38.76	1,362,801.60	
	HENNES & MAURITZ B	109,074	238.80	26,046,871.20	
	SWEDISH MATCH AB	24,876	235.60	5,860,785.60	
	SCA SV CELLULOSA B	65,337	172.80	11,290,233.60	
	ELEKTA AB-B SHS	42,496	113.20	4,810,547.20	
	GETINGE AB-B SHS	21,452	235.40	5,049,800.80	
	NORDEA BANK AB	302,466	83.05	25,119,801.30	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	166,626	72.05	12,005,403.30	
	SVENSKA HANDELSBK A	57,187	294.40	16,835,852.80	

	SWEDBANK AB-A	104,581	155.90	16,304,177.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	117.70	1,015,868.70	
	INVESTOR AB-B SHS	55,612	198.20	11,022,298.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	23,015	193.90	4,462,608.50	
	RATOS AB-B SHS	29,254	58.25	1,704,045.50	
	ERICSSON (LM) B	351,814	75.90	26,702,682.60	
	HEXAGON AB-B SHS	25,860	194.40	5,027,184.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7,779	540.50	4,204,549.50	
	TELE2 AB-B SHS	29,400	82.60	2,428,440.00	
	TELIASONERA AB	275,719	46.86	12,920,192.34	
スウェーデンクローナ小計		2,458,545		288,137,704.59 (4,440,202,027)	
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	18,420	89.05	1,640,301.00	
	SEADRILL LTD	42,769	252.70	10,807,726.30	
	STATOIL ASA	126,083	132.40	16,693,389.20	
	SUBSEA 7 SA	29,340	114.50	3,359,430.00	
	NORSK HYDRO	82,348	25.01	2,059,523.48	
	YARA INTERNATIONAL ASA	21,369	262.40	5,607,225.60	
	ORKLA	75,570	46.26	3,495,868.20	
	DNB ASA	109,708	97.60	10,707,500.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20,723	91.25	1,890,973.75	
	TELENOR ASA	81,174	128.80	10,455,211.20	
ノルウェークローネ小計		607,504		66,717,149.53 (1,127,519,827)	
デンマーク クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	66	41,920.00	2,766,720.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	141	44,480.00	6,271,680.00	
	DSV A/S	22,493	149.00	3,351,457.00	
	CARLSBERG AS-B	12,388	548.00	6,788,624.00	
	COLOPLAST-B	11,563	326.00	3,769,538.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	2,714	486.60	1,320,632.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	45,660	937.00	42,783,420.00	
	NOVOZYMES A/S	26,435	198.10	5,236,773.50	
	DANSKE BANK A/S	76,547	106.90	8,182,874.30	
	TRYG A/S	2,274	514.00	1,168,836.00	
	TDC A/S	74,134	48.84	3,620,704.56	
デンマーククローネ小計		274,415		85,261,259.76 (1,513,387,360)	

イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	434	990.10	429,703.40	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	55,951	36.20	2,025,426.20	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	327	2,162.00	706,974.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	94,501	147.90	13,976,697.90	
	BANK HAPOALIM BM	129,544	17.22	2,230,747.68	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	141,968	12.09	1,716,393.12	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,694	37.61	439,811.34	
	NICE SYSTEMS LTD	6,530	137.50	897,875.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	211,981	5.50	1,165,895.50	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,752	171.80	472,793.60	
イスラエルシェケル小計		655,682		24,062,317.74 (674,226,143)	
ユーロ	CGG	19,704	19.40	382,257.60	
	ENI	287,785	16.96	4,880,833.60	
	FUGRO NV-CVA	7,183	45.15	324,312.45	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,226	12.11	402,532.99	
	NESTE OIL OYJ	14,446	11.32	163,528.72	
	OMV AG	18,602	33.09	615,540.18	
	REPSOL SA	98,513	17.34	1,708,707.98	
	SAIPEM	31,106	15.75	489,919.50	
	TECHNIP S.A.	11,603	84.61	981,729.83	
	TENARIS SA	57,059	16.80	958,591.20	
	TOTAL SA	241,163	40.20	9,694,752.60	
	AIR LIQUIDE	36,133	98.70	3,566,327.10	
	AKZO NOBEL	27,734	45.09	1,250,526.06	
	ARCELORMITTAL	116,697	9.77	1,140,596.47	
	ARKEMA	6,653	76.56	509,353.68	
	BASF SE	103,284	69.86	7,215,420.24	
	CRH	89,816	15.85	1,423,583.60	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,672	59.14	217,162.08	
	HEIDELBERGCEMENT AG	16,233	54.99	892,652.67	
	IMERYS SA	3,585	50.79	182,082.15	
	K+S AG	17,892	25.84	462,329.28	
	KONINKLIJKE DSM NV	17,571	53.86	946,374.06	
	LAFARGE (FRANCE)	21,545	48.98	1,055,381.82	
	LANXESS	9,584	48.05	460,559.12	
	LINDE AG	20,679	145.05	2,999,488.95	
	SOLVAY SA	6,783	105.15	713,232.45	

STORA ENSO OYJ R	55,401	5.53	306,644.53	
THYSSEN KRUPP	44,818	17.26	773,782.77	
UMICORE	14,302	33.31	476,471.13	
UPM KYMMENE CORP	60,353	8.38	505,758.14	
VOESTALPINE AG	13,096	28.73	376,313.56	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	13,736	21.44	294,499.84	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS-RTS	13,734	1.13	15,615.55	
ALSTOM RGPT	23,624	26.08	616,113.92	
ANDRITZ AG	8,740	42.21	368,959.10	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	29.20	303,972.00	
BOUYGUES ORD	20,624	22.00	453,831.12	
BRENTAG AG	5,676	122.70	696,445.20	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	64,323	42.32	2,722,149.36	
FERROVIAL SA	42,709	13.12	560,555.62	
FIAT INDUSTRIAL	99,776	8.95	893,494.08	
FINMECCANICA SPA	46,367	3.88	180,089.42	
GEA GROUP AG	22,145	29.16	645,748.20	
HOCHTIEF AG	3,383	55.76	188,636.08	
KONE OYJ-B	16,942	58.35	988,565.70	
KONINKLIJKE PHILIPS	110,494	24.39	2,694,948.66	
LEGRAND SA	28,968	40.40	1,170,452.04	
MAN SE	3,991	87.02	347,296.82	
METSO OYJ	14,851	28.93	429,639.43	
OSRAM LICHT AG	9,289	28.45	264,272.05	
PRYSMIAN SPA	22,963	16.10	369,704.30	
REXEL SA	15,749	19.01	299,388.49	
SAFRAN SA	29,932	42.55	1,273,606.60	
SAINT-GOBAIN	46,267	33.98	1,572,152.66	
SCHNEIDER ELECTRIC	59,551	57.99	3,453,362.49	
SIEMENS	89,092	83.62	7,449,873.04	
THALES SA	9,836	38.20	375,784.38	
VALLOUREC	12,975	43.23	560,909.25	
VINCI S.A.	53,556	40.30	2,158,574.58	
WARTSILA OYJ	18,986	34.85	661,662.10	
ZARDOYA OTIS SA	15,873	10.75	170,634.75	
ZARDOYA OTIS SA-RTS	15,873	0.43	6,825.39	
ZODIAC AEROSPACE	4,111	108.35	445,426.85	
BUREAU VERITAS SA	26,108	21.95	573,201.14	

EDENRED	20,699	24.34	503,813.66	
RANDSTAD HOLDING NV	14,649	36.33	532,271.41	
SOCIETE BIC SA	3,018	84.20	254,115.60	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	44,713	13.73	614,133.05	
ADP	2,976	77.75	231,384.00	
ATLANTIA SPA	35,866	13.68	490,646.88	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,122	15.52	436,453.44	
DEUTSCHE POST AG-REG	100,771	21.22	2,138,360.62	
FRAPORT AG	5,277	48.97	258,441.07	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	69,589	5.96	415,098.38	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	104,852	3.39	355,448.28	
TNT EXPRESS	39,960	6.19	247,672.08	
VOPAK	8,861	43.23	383,105.33	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	36,691	73.86	2,709,997.26	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,041	56.29	340,047.89	
CONTINENTAL AG	12,092	118.20	1,429,274.40	
DAIMLER AG	108,137	53.42	5,776,678.54	
FIAT ORD	100,566	6.13	616,469.58	
MICHELIN	20,836	76.92	1,602,705.12	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,639	33.93	462,771.27	
PIRELLI & CO	25,902	9.73	252,155.97	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	16,723	63.27	1,058,064.21	
RENAULT SA	21,167	59.35	1,256,261.45	
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,688	173.60	2,897,036.80	
VOLKSWAGEN STAMM	3,661	165.70	606,627.70	
ADIDAS AG	24,127	83.27	2,009,055.29	
CHRISTIAN DIOR	6,542	134.60	880,553.20	
HUGO BOSS AG	3,036	86.61	262,947.96	
KERING	8,733	166.55	1,454,481.15	
LUXOTTICA GROUP SPA	18,812	39.73	747,400.76	
LVMH	28,827	130.40	3,759,040.80	
ACCOR	18,216	28.51	519,429.24	
OPAP SA	31,301	6.45	201,891.45	
SODEXO	11,095	68.84	763,779.80	
AXEL SPRINGER AG	3,824	34.54	132,080.96	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,448	22.33	344,953.84	
JC DECAUX SA	6,530	23.35	152,475.50	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	10,484	84.48	885,688.32	

LAGADERE S.C.A	10,764	23.00	247,572.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	12,819	28.91	370,661.38	
PUBLICIS GROUPE	20,945	58.74	1,230,309.30	
REED ELSEVIER NV	75,348	13.70	1,032,267.60	
SES	32,208	21.55	694,243.44	
TELENET GROUP HOLDING NV	5,928	36.92	218,861.76	
WOLTERS KLUWER	38,268	18.09	692,268.12	
INDITEX	24,779	98.88	2,450,147.52	
AHOLD (KON.)	115,609	12.68	1,466,500.16	
CARREFOUR	66,811	23.55	1,573,399.05	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,355	76.82	488,191.10	
COLRUYT SA	8,963	42.92	384,691.96	
DELHAIZE GROUP	12,368	51.93	642,270.24	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	63,188	5.85	369,649.80	
JERONIMO MARTINS	27,071	16.23	439,497.68	
KESKO OYJ-B SHS	6,822	22.70	154,859.40	
METRO STAMM	14,863	26.82	398,625.66	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	89,998	67.56	6,080,264.88	
DANONE (GROUPE)	64,471	58.41	3,765,751.11	
DE MASTER BLENDEERS1753 NV	58,290	12.35	719,881.50	
HEINEKEN HOLDING NV	12,432	46.69	580,512.24	
HEINEKEN NV	25,310	51.88	1,313,082.80	
KERRY GROUP PLC-A	19,726	45.60	899,505.60	
PERNOD-RICARD	23,884	89.29	2,132,602.36	
REMY COINTREAU	3,268	79.26	259,021.68	
SUEDZUCKER AG	9,463	24.94	236,007.22	
UNILEVER NV-CVA	182,931	30.96	5,663,543.76	
BEIERSDORF AG	11,231	68.35	767,638.85	
HENKEL AG & CO KGAA	15,384	62.26	957,807.84	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	20,448	73.50	1,502,928.00	
LOREAL	27,327	127.35	3,480,093.45	
CELESIO AG	12,054	17.73	213,777.69	
ESSILOR INTERNATIONAL	22,899	81.46	1,865,352.54	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	24,248	49.47	1,199,548.56	
FRESENIUS SE&CO KGAA	13,536	97.41	1,318,541.76	
BAYER	92,930	84.27	7,831,211.10	
ELAN CORPORATION PLC	62,373	10.81	674,252.13	

GRIFOLS SA	17,680	31.21	551,881.20	
MERCK KGAA	7,419	123.40	915,504.60	
ORION OYJ-CLASS B	10,739	19.39	208,229.21	
QIAGEN N.V.	28,612	15.72	449,923.70	
SANOFI	135,121	79.75	10,775,899.75	
UCB (GROUPE)	13,683	43.64	597,194.53	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	765,531	0.22	168,416.82	
BANCO BILBAO VIZCAYA	622,064	6.84	4,255,539.82	
BANCO DE SABADELL SA	319,539	1.57	501,995.76	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	229,337	0.70	162,141.25	
BANCO POPULAR ESPANOL	130,417	3.03	395,554.76	
BANCO SANTANDER SA	1,223,334	5.25	6,433,513.50	
BANCO SANTANDER SA-RTS	1,223,334	0.16	195,733.44	
BANK OF IRELAND	2,300,000	0.17	397,900.00	
BANKIA SA	401,244	0.65	262,814.82	
BNP PARIBAS	112,078	47.28	5,299,047.84	
CAIXABANK	124,827	2.75	343,274.25	
COMMERZBANK AG	111,413	6.85	763,736.11	
CREDIT AGRICOLE SA	117,071	7.34	859,886.49	
ERSTE GROUP BANK AG	27,377	22.28	609,959.56	
INTESA SANPAOLO	1,313,852	1.40	1,845,962.06	
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	126,938	—	—	
KBC GROEP NV	25,136	31.00	779,216.00	
NATIXIS	107,265	3.78	405,998.02	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,024	22.87	160,638.88	
SOCIETE GENERALE	78,771	30.29	2,385,973.59	
UNICREDIT SPA	500,456	4.05	2,026,846.80	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	99,300	3.27	325,505.40	
DEUTSCHE BANK NAMEN	114,256	36.05	4,119,500.08	
DEUTSCHE BOERSE	22,405	53.89	1,207,405.45	
EURAZEO	2,708	48.33	130,877.64	
EXOR SPA	6,347	24.72	156,897.84	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,107	60.92	493,878.44	
ING GROEP	427,783	7.72	3,305,479.24	
MEDIOBANCA	60,604	4.56	276,717.86	
OKO BANK-A	15,865	13.09	207,672.85	
WENDEL	3,623	87.11	315,599.53	
AEGON	207,650	5.86	1,217,244.30	

AGEAS	27,738	29.86	828,395.37	
ALLIANZ SE-REG	51,322	117.40	6,025,202.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	132,096	14.57	1,924,638.72	
AXA	201,504	16.64	3,354,034.08	
CNP ASSURANCES	15,411	12.56	193,562.16	
DELTA LLOYD NV	18,951	16.32	309,280.32	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	7,059	55.87	394,386.33	
MAPFRE SA	76,919	2.71	208,912.00	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	20,073	148.10	2,972,811.30	
SAMPO OYJ-A SHS	49,432	33.33	1,647,568.56	
SCOR SE	15,396	23.94	368,580.24	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	3,668	39.11	143,455.48	
IMMOFINANZ AG	96,001	3.06	293,763.06	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	43,482	24.83	1,079,658.06	
ATOS	6,456	58.02	374,577.12	
CAP GEMINI SA	16,298	40.85	665,773.30	
DASSAULT SYSTEMES SA	6,958	100.50	699,279.00	
SAP AG	103,412	55.70	5,760,048.40	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	13,939	23.84	332,375.45	
GEMALTO	10,009	75.22	752,876.98	
NOKIA CORP	433,986	3.03	1,314,977.58	
BELGACOM	17,758	16.94	300,909.31	
DEUTSCHE TELEKOM	313,458	9.31	2,918,920.89	
ELISA A	15,145	16.10	243,834.50	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	31,076	6.50	201,994.00	
ILIAD SA	2,797	167.10	467,378.70	
KPN (KON.)	354,638	1.94	690,480.18	
ORANGE	205,455	7.75	1,592,276.25	
PORTUGAL TELECOM	73,469	2.89	212,325.41	
TELECOM ITALIA ORD	1,098,379	0.52	579,944.11	
TELECOM ITALIA RNC	656,704	0.40	269,182.96	
TELEFONICA	460,429	10.27	4,730,907.97	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	29,607	5.26	155,910.46	
TELEKOM AUSTRIA AG	31,911	5.24	167,213.64	
VIVENDI	132,280	15.97	2,113,173.00	
ZIGGO NV	17,750	27.53	488,746.25	
ACCIONA SA	3,118	36.30	113,183.40	

E.ON SE	201,400	12.78	2,574,899.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	29,375	20.37	598,368.75	
ENAGAS	19,715	18.60	366,699.00	
ENEL	740,886	2.49	1,849,251.45	
ENEL GREEN POWER SPA	205,628	1.64	338,669.31	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	243,138	2.52	612,707.76	
FORTUM OYJ	52,272	14.80	773,625.60	
GAS NATURAL SDG SA	37,646	14.92	561,866.55	
GDF SUEZ	149,727	16.04	2,402,369.71	
IBERDROLA SA	554,644	3.99	2,215,248.13	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,495	41.75	479,916.25	
RWE AG-NON VTG PFD	2,644	23.11	61,116.06	
RWE STAMM	53,096	23.54	1,249,879.84	
SNAM SPA	235,961	3.47	820,200.43	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	31,516	10.20	321,620.78	
TERNA SPA	159,265	3.23	515,063.01	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	37,760	9.86	372,389.12	
VERBUND AG	5,427	15.25	82,761.75	
ASML HOLDING NV	36,585	67.36	2,464,365.60	
INFINEON TECHNOLOGIES	125,655	7.22	907,731.72	
STMICROELECTRONICS	64,205	6.52	418,680.80	
ユーロ小計	23,711,692		289,968,819.57 (38,380,272,958)	
合計	122,973,980		292,674,170,175 (292,674,170,175)	

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	453,720.00	
	アメリカドル小計		597,000.00	453,720.00 (45,512,653)	
	オーストラリア ドル	APA GROUP	85,414.00	515,900.56	
		LEND LEASE GROUP	55,331.00	499,085.62	
		SYDNEY AIRPORT	16,013.00	58,607.58	
	オーストラリアドル小計		156,758.00	1,073,593.76 (98,566,643)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	276,000.00	2,067,240.00	
	香港ドル小計		276,000.00	2,067,240.00 (26,729,413)	

投資信託受益証券合計				170,808,709 (170,808,709)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	42,300.00	903,105.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	45,702.00	3,379,205.88	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	106,511.00	1,248,308.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,158.00	1,955,078.22	
		BOSTON PROPERTIES	17,441.00	1,901,592.23	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,927.00	643,279.62	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,951.00	880,866.14	
		DUKE REALTY CORP	37,800.00	642,600.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	40,205.00	2,309,375.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,941.00	726,375.65	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	54,376.00	1,163,102.64	
		HCP INC	51,165.00	2,300,378.40	
		HEALTH CARE REIT INC	32,523.00	2,136,110.64	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	79,191.00	1,428,605.64	
		KIMCO REALTY CORP	43,588.00	982,909.40	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	14,105.00	549,389.75	
		MACERICH CO/THE	14,977.00	962,422.02	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	18,073.00	881,058.75	
		PROLOGIS INC	55,459.00	2,210,595.74	
		PUBLIC STORAGE	16,849.00	2,681,012.88	
		RAYONIER INC	13,000.00	750,230.00	
		REALTY INCOME CORP	21,200.00	941,492.00	
		REGENCY CENTERS CORP	9,134.00	487,390.24	
		SIMON PROPERTY GROUP	35,451.00	5,828,498.91	
		SL GREEN REALTY CORP	9,886.00	925,428.46	
		UDR INC	26,825.00	680,013.75	
		VENTAS INC	32,897.00	2,268,577.12	
		VORNADO REALTY TRUST	19,403.00	1,689,419.21	
	アメリカドル小計		882,038.00	43,456,422.41 (4,359,113,731)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	12,000.00	253,320.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,297.00	401,884.02	
	カナダドル小計		28,297.00	655,204.02 (63,718,590)	
	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	588,145.45	

		FEDERATION CENTRES	186,565.00	429,099.50	
		GOODMAN GROUP	184,867.00	883,664.26	
		GPT GROUP	188,654.00	696,133.26	
		MIRVAC GROUP	429,658.00	717,528.86	
		STOCKLAND	248,547.00	902,225.61	
		WESTFIELD GROUP	244,115.00	2,773,146.40	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	331,257.00	1,033,521.84	
	オーストラリアドル小計		2,614,494.00	8,478,500.86 (778,411,163)	
イギリスポンド		BRITISH LAND CO PLC	106,377.00	650,495.35	
		HAMMERSON PLC	78,494.00	417,195.61	
		INTU PROPERTIES PLC	78,831.00	263,532.03	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	85,796.00	815,490.98	
		SEGRO PLC	76,632.00	228,899.78	
	イギリスポンド小計		426,130.00	2,375,613.75 (364,846,759)	
香港ドル		LINK REIT	251,000.00	9,613,300.00	
	香港ドル小計		251,000.00	9,613,300.00 (124,299,969)	
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	226,000.00	531,100.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	212,000.00	318,000.00	
		CAPITAMALL TRUST	286,600.00	587,530.00	
	シンガポールドル小計		724,600.00	1,436,630.00 (113,594,334)	
ユーロ		BGP HOLDINGS PLC	1,605,584.00	0.00	
		CORIO NV	9,339.00	306,879.54	
		FONCIERE DES REGIONS	3,754.00	228,731.22	
		GECINA SA	2,157.00	201,226.53	
		ICADE	2,114.00	144,259.36	
		KLEPIERRE	10,981.00	359,737.56	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	10,638.00	1,977,072.30	
	ユーロ小計		1,644,567.00	3,217,906.51 (425,922,105)	
投資証券合計				6,229,906,651 (6,229,906,651)	
合計				6,400,715,360 (6,400,715,360)	

(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 574銘柄	97.5%	58.5%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券 28銘柄	2.4%	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 57銘柄	91.8%	3.3%
	投資信託受益証券 3銘柄	0.9%	0.0%
	投資証券 9銘柄	7.3%	0.3%
イギリスポンド	株式 102銘柄	98.8%	9.9%
	投資証券 5銘柄	1.2%	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	96.3%	1.3%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.7%	0.0%
	投資証券 1銘柄	3.1%	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 32銘柄	100.0%	1.5%
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 235銘柄	98.9%	12.8%
	投資証券 7銘柄	1.1%	0.1%

(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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 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 7月25日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	378,243,333
コール・ローン	3,805,823,989
国債証券	405,561,947,619
未収入金	7,415,165
未収利息	4,257,628,038
前払費用	93,011,271
差入委託証拠金	177,682,575
流動資産合計	414,281,751,990
資産合計	414,281,751,990
負債の部	
流動負債	
未払金	32,600,500
未払解約金	2,806,844,129
流動負債合計	2,839,444,629
負債合計	2,839,444,629
純資産の部	
元本等	
元本	206,342,738,096
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	205,099,569,265
元本等合計	411,442,307,361
純資産合計	411,442,307,361
負債純資産合計	414,281,751,990

(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 7月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月25日現在
1. 計算期間の期首元本額	259,176,475,029円
計算期間中の追加設定元本額	11,976,901,791円
計算期間中の一部解約元本額	64,810,638,724円
計算日の元本額	206,342,738,096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	4,725,961,435円
DC外国債券インデックスファンド	1,864,561,870円
DC外国債券インデックスファンドL	9,115,043,251円
物価連動債組入世界債券ファンド	58,320,340円
DCバランスファンド30	130,054,155円
DCバランスファンド50	204,427,868円
DCバランスファンド70	42,413,496円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	96,345,724円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	57,934,134円
新生・4分散ファンド	86,694,101円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	415,415,180円

4資産インデックスバランスオープン(分配型)	16,123,048円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	65,053,852円
外国債券インデックスe	1,025,195,718円
インデックスコレクション(外国債券)	1,111,326,957円
インデックスコレクション(バランス株式30)	148,556,955円
インデックスコレクション(バランス株式50)	163,614,961円
インデックスコレクション(バランス株式70)	53,467,549円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	2,696,138,948円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	321,634,255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)	10,949,151,748円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	5,652,944,300円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	19,507,205,315円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	61,505,090,837円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	3,732,345,801円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	101,302,330円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	7,652,145,112円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,388,809,518円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,786,843,982円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	17,095,332,277円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	741,965,796円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	27,792,343,119円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	4,477,926,857円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	373,906,770円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,705,548,978円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,735,587,492円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	298,024,818円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	118,839,659円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,235,882,493円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	5,743,214,210円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	38,285,017円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	747,340,007円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	249,540,702円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	3,276,501,887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)	37,012,244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	206,342,738,096口
3. 1口当たり純資産額	1.9940円
(1万口当たり純資産額)	(19,940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 7月25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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月25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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月25日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△5,386,494,228
合計	△5,386,494,228

(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7月25日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成25年 7月25日現在
計算日においてデリバティブ取引の残高がないため、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)

平成25年 7月25日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月25日現在)

① 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	999,804.69	
		T 0.125% 12/31/14	15,000,000.00	14,981,250.00	
		T 0.25% 01/15/15	9,000,000.00	9,001,757.79	
		T 0.25% 01/31/15	10,000,000.00	10,001,171.90	
		T 0.25% 02/15/15	15,000,000.00	14,997,070.35	
		T 0.25% 02/28/15	9,550,000.00	9,547,575.15	
		T 0.25% 05/15/15	20,090,000.00	20,067,634.20	
		T 0.25% 05/15/16	9,000,000.00	8,915,800.77	
		T 0.25% 06/30/14	1,000,000.00	1,001,152.34	

T 0.25% 07/15/15	10,000,000.00	9,980,273.40	
T 0.25% 08/15/15	5,000,000.00	4,987,109.40	
T 0.25% 08/31/14	1,000,000.00	1,000,957.03	
T 0.25% 09/15/14	18,000,000.00	18,016,523.46	
T 0.25% 09/15/15	18,000,000.00	17,943,398.46	
T 0.25% 09/30/14	9,000,000.00	9,008,261.73	
T 0.25% 10/15/15	5,000,000.00	4,981,933.60	
T 0.25% 10/31/14	5,000,000.00	5,004,296.90	
T 0.25% 11/30/14	4,000,000.00	4,002,812.52	
T 0.25% 12/15/14	6,100,000.00	6,103,931.63	
T 0.25% 12/15/15	19,000,000.00	18,904,257.86	
T 0.375% 02/15/16	17,350,000.00	17,289,681.68	
T 0.375% 03/15/15	15,300,000.00	15,323,906.25	
T 0.375% 03/15/16	15,000,000.00	14,937,304.65	
T 0.375% 04/15/15	17,500,000.00	17,523,242.27	
T 0.375% 06/15/15	6,000,000.00	6,004,921.86	
T 0.375% 11/15/14	10,000,000.00	10,023,437.50	
T 0.375% 11/15/15	6,000,000.00	5,990,976.54	
T 0.5% 06/15/16	1,050,000.00	1,046,657.23	
T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,855,013.31	
T 0.5% 08/15/14	10,150,000.00	10,186,674.79	
T 0.5% 10/15/14	5,100,000.00	5,120,121.08	
T 0.625% 04/30/18	20,000,000.00	19,352,343.80	
T 0.625% 05/31/17	14,000,000.00	13,803,125.00	
T 0.625% 07/15/14	2,000,000.00	2,009,335.94	
T 0.625% 08/31/17	16,500,000.00	16,189,013.61	
T 0.625% 09/30/17	12,000,000.00	11,753,203.08	
T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,881,445.30	
T 0.75% 02/28/18	16,300,000.00	15,922,425.82	
T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,873,730.45	
T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,957,109.36	
T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,572,875.00	
T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,899,804.70	
T 0.875% 01/31/17	13,000,000.00	13,003,046.94	
T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,966,992.18	
T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	5,995,664.04	
T 0.875% 04/30/17	7,000,000.00	6,978,125.00	
T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,758,398.45	

T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,005,000.00	
T 0.875% 12/31/16	9,500,000.00	9,512,802.77	
T 1% 03/31/17	10,000,000.00	10,025,976.60	
T 1% 05/31/18	1,000,000.00	983,632.81	
T 1% 06/30/19	5,000,000.00	4,803,320.30	
T 1% 08/31/16	10,850,000.00	10,950,447.23	
T 1% 08/31/19	6,000,000.00	5,739,023.46	
T 1% 09/30/16	10,000,000.00	10,084,570.30	
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,774,023.45	
T 1% 10/31/16	9,000,000.00	9,068,203.17	
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,800,480.48	
T 1.125% 05/31/19	12,000,000.00	11,637,656.28	
T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	4,972,398.44	
T 1.25% 01/31/19	24,000,000.00	23,604,843.84	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,957,109.38	
T 1.25% 08/31/15	11,990,000.00	12,209,426.35	
T 1.25% 09/30/15	21,980,000.00	22,390,407.92	
T 1.25% 10/31/15	10,000,000.00	10,187,500.00	
T 1.375% 02/28/19	15,000,000.00	14,830,371.15	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,810,253.90	
T 1.375% 09/30/18	8,520,000.00	8,483,057.79	
T 1.375% 11/30/15	4,550,000.00	4,648,731.45	
T 1.375% 11/30/18	9,000,000.00	8,938,476.54	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,668,058.60	
T 1.5% 06/30/16	7,450,000.00	7,636,686.49	
T 1.5% 07/31/16	9,950,000.00	10,196,806.66	
T 1.5% 08/31/18	6,500,000.00	6,522,978.54	
T 1.625% 08/15/22	10,000,000.00	9,315,625.00	
T 1.625% 11/15/22	11,500,000.00	10,651,201.20	
T 1.75% 05/15/22	26,300,000.00	24,907,435.51	
T 1.75% 05/15/23	9,800,000.00	9,094,859.42	
T 1.75% 05/31/16	4,600,000.00	4,748,960.92	
T 1.75% 07/31/15	22,000,000.00	22,614,882.84	
T 1.75% 10/31/18	5,000,000.00	5,069,335.95	
T 1.875% 06/30/15	18,900,000.00	19,462,201.10	
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,062,734.38	
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,246,819.92	
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,046,138.67	

T 11.25% 02/15/15	2,550,000.00	2,985,043.94	
T 2% 01/31/16	3,000,000.00	3,113,378.91	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	5,831,718.78	
T 2% 02/15/23	12,500,000.00	11,926,269.49	
T 2% 04/30/16	6,090,000.00	6,327,295.87	
T 2% 11/15/21	17,500,000.00	17,095,996.05	
T 2.125% 05/31/15	6,950,000.00	7,179,947.28	
T 2.125% 08/15/21	14,300,000.00	14,168,171.87	
T 2.125% 11/30/14	18,400,000.00	18,876,531.29	
T 2.125% 12/31/15	11,000,000.00	11,440,214.83	
T 2.25% 01/31/15	14,900,000.00	15,350,492.26	
T 2.25% 03/31/16	9,150,000.00	9,567,647.44	
T 2.25% 07/31/18	4,500,000.00	4,685,361.34	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,090,156.26	
T 2.375% 02/28/15	15,500,000.00	16,020,400.41	
T 2.375% 03/31/16	7,900,000.00	8,288,056.61	
T 2.375% 05/31/18	3,800,000.00	3,984,433.60	
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,619,775.40	
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,103,398.44	
T 2.375% 08/31/14	20,500,000.00	20,997,685.47	
T 2.375% 09/30/14	22,150,000.00	22,726,246.20	
T 2.375% 10/31/14	15,950,000.00	16,390,805.68	
T 2.5% 03/31/15	12,820,000.00	13,295,241.37	
T 2.5% 04/30/15	4,930,000.00	5,120,074.62	
T 2.5% 06/30/17	8,200,000.00	8,665,574.18	
T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,563,039.08	
T 2.625% 02/29/16	12,850,000.00	13,552,483.41	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,386,974.60	
T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,817,195.30	
T 2.625% 06/30/14	1,000,000.00	1,023,144.53	
T 2.625% 07/31/14	13,350,000.00	13,685,575.21	
T 2.625% 08/15/20	13,000,000.00	13,554,023.47	
T 2.625% 11/15/20	15,000,000.00	15,595,312.50	
T 2.625% 12/31/14	3,480,000.00	3,599,557.03	
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,125,429.68	
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	309,433.39	
T 2.75% 05/31/17	9,900,000.00	10,559,162.09	
T 2.75% 08/15/42	12,150,000.00	10,203,626.98	

T 2.75% 11/15/42	1,900,000.00	1,593,587.89	
T 2.75% 11/30/16	12,500,000.00	13,303,222.62	
T 2.75% 12/31/17	11,000,000.00	11,730,253.92	
T 2.875% 03/31/18	4,800,000.00	5,146,781.23	
T 2.875% 05/15/43	1,300,000.00	1,118,787.11	
T 3% 02/28/17	16,800,000.00	18,054,421.89	
T 3% 05/15/42	13,580,000.00	12,055,167.52	
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,102,763.86	
T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,285,468.76	
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,313,203.12	
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	3,466,015.64	
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,361,734.38	
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,292,095.69	
T 3.125% 05/15/19	11,920,000.00	12,912,014.10	
T 3.125% 05/15/21	9,190,000.00	9,822,350.94	
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,506,449.22	
T 3.125% 11/15/41	16,700,000.00	15,254,406.25	
T 3.25% 03/31/17	15,300,000.00	16,586,753.86	
T 3.25% 05/31/16	3,250,000.00	3,493,496.11	
T 3.25% 06/30/16	2,500,000.00	2,690,283.20	
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,834,370.30	
T 3.25% 12/31/16	9,800,000.00	10,603,140.67	
T 3.375% 11/15/19	10,390,000.00	11,399,778.12	
T 3.5% 02/15/18	6,850,000.00	7,535,535.19	
T 3.5% 02/15/39	6,700,000.00	6,646,085.97	
T 3.5% 05/15/20	14,900,000.00	16,433,070.38	
T 3.625% 02/15/20	22,030,000.00	24,497,187.94	
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	5,791,509.95	
T 3.625% 08/15/19	1,400,000.00	1,555,093.75	
T 3.75% 08/15/41	8,840,000.00	9,098,984.41	
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,626,392.20	
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,287,752.93	
T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	5,178,227.94	
T 4.0% 02/15/15	10,020,000.00	10,601,629.73	
T 4.0% 08/15/18	4,000,000.00	4,513,750.00	
T 4.125% 05/15/15	4,040,000.00	4,316,566.40	
T 4.25% 05/15/39	3,250,000.00	3,649,521.49	
T 4.25% 08/15/14	12,550,000.00	13,092,689.48	

T 4.25% 08/15/15	10,500,000.00	11,333,232.43	
T 4.25% 11/15/14	9,230,000.00	9,717,459.37	
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,526,000.97	
T 4.25% 11/15/40	9,220,000.00	10,343,147.30	
T 4.375% 02/15/38	3,150,000.00	3,605,027.35	
T 4.375% 05/15/40	9,800,000.00	11,217,746.10	
T 4.375% 05/15/41	3,350,000.00	3,833,656.25	
T 4.375% 11/15/39	5,800,000.00	6,640,207.02	
T 4.5% 02/15/16	2,420,000.00	2,665,544.91	
T 4.5% 02/15/36	4,620,000.00	5,385,097.27	
T 4.5% 05/15/17	15,530,000.00	17,574,682.28	
T 4.5% 05/15/38	2,500,000.00	2,914,648.45	
T 4.5% 08/15/39	5,750,000.00	6,711,665.01	
T 4.5% 11/15/15	2,160,000.00	2,361,065.63	
T 4.625% 02/15/17	5,500,000.00	6,219,726.59	
T 4.625% 02/15/40	8,900,000.00	10,587,001.94	
T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,757,541.98	
T 4.75% 02/15/37	2,500,000.00	3,016,748.05	
T 4.75% 02/15/41	7,900,000.00	9,582,298.83	
T 4.75% 08/15/17	19,000,000.00	21,779,121.07	
T 4.875% 08/15/16	750,000.00	845,083.00	
T 5.0% 05/15/37	1,250,000.00	1,560,717.77	
T 5.125% 05/15/16	2,000,000.00	2,252,968.76	
T 5.25% 02/15/29	1,600,000.00	2,004,968.75	
T 5.25% 11/15/28	3,350,000.00	4,197,052.72	
T 5.375% 02/15/31	4,000,000.00	5,122,343.75	
T 5.5% 08/15/28	2,250,000.00	2,886,679.68	
T 6.0% 02/15/26	2,440,000.00	3,238,385.15	
T 6.125% 11/15/27	3,700,000.00	5,009,019.52	
T 6.25% 05/15/30	2,520,000.00	3,513,234.38	
T 6.25% 08/15/23	3,600,000.00	4,786,101.57	
T 6.5% 11/15/26	1,150,000.00	1,597,713.87	
T 7.125% 02/15/23	1,450,000.00	2,029,886.72	
T 7.25% 05/15/16	1,670,000.00	1,980,222.07	
T 7.25% 08/15/22	1,000,000.00	1,401,210.94	
T 7.5% 11/15/16	8,250,000.00	10,063,388.69	
T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,743,695.30	
T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,489,064.44	

	T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,613,375.00	
アメリカドル小計		1,580,050,000.00	1,629,010,137.72 (163,406,006,914)	
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	3,850,000.00	3,842,627.25	
	CAN 1% 05/01/15	1,000,000.00	997,440.00	
	CAN 1% 11/01/14	2,100,000.00	2,097,123.00	
	CAN 1.25% 02/01/16	2,400,000.00	2,399,712.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	2,350,000.00	2,297,724.25	
	CAN 1.5% 03/01/17	3,300,000.00	3,301,237.50	
	CAN 1.5% 06/01/23	3,350,000.00	3,066,171.25	
	CAN 1.5% 08/01/15	1,400,000.00	1,409,919.00	
	CAN 1.5% 09/01/17	3,000,000.00	2,981,505.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,900,000.00	1,936,556.00	
	CAN 2% 12/01/14	8,360,000.00	8,458,146.40	
	CAN 2.25% 08/01/14	3,800,000.00	3,844,080.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	4,080,000.00	4,182,000.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	3,600,000.00	3,704,058.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,410,000.00	3,550,918.25	
	CAN 3% 12/01/15	2,310,000.00	2,404,074.75	
	CAN 3.25% 06/01/21	3,400,000.00	3,637,745.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	3,750,000.00	4,074,337.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	3,450,000.00	3,819,322.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	5,850,000.00	6,421,047.75	
	CAN 4% 06/01/16	5,050,000.00	5,428,876.25	
	CAN 4% 06/01/17	4,200,000.00	4,582,431.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	4,550,000.00	5,422,667.25	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,500,000.00	2,785,487.50	
	CAN 4.5% 06/01/15	2,200,000.00	2,335,399.00	
	CAN 5% 06/01/37	3,900,000.00	5,242,887.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	3,300,000.00	4,547,548.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	3,800,000.00	5,414,734.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,090,000.00	1,754,932.70	
カナダドル小計		97,250,000.00	105,940,708.60 (10,302,733,911)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,900,000.00	1,719,604.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,700,000.00	1,593,835.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,450,000.00	1,288,622.25	
	ACGB 4.25% 07/21/17	4,250,000.00	4,470,213.75	

	ACGB 4.5% 04/15/20	5,100,000.00	5,433,030.00	
	ACGB 4.5% 10/21/14	3,450,000.00	3,534,990.75	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,400,000.00	2,569,920.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	4,600,000.00	4,869,560.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,600,000.00	2,723,916.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	4,500,000.00	4,980,892.50	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,490,000.00	3,858,596.35	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,500,000.00	5,136,885.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	4,750,000.00	5,453,902.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	4,400,000.00	5,086,136.00	
	ACGB 6% 02/15/17	4,770,000.00	5,289,023.70	
	ACGB 6.25% 04/15/15	4,850,000.00	5,155,525.75	
オーストラリアドル小計		58,710,000.00	63,164,654.05 (5,799,146,888)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	5,650,000.00	5,642,400.75	
	UKT 1.25% 07/22/18	3,100,000.00	3,091,630.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	8,650,000.00	8,926,756.75	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,950,000.00	3,742,269.50	
	UKT 2% 01/22/16	6,600,000.00	6,836,742.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	900,000.00	873,819.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	7,040,000.00	7,290,307.20	
	UKT 3.25% 01/22/44	850,000.00	794,376.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	3,970,000.00	4,100,533.60	
	UKT 3.75% 09/07/19	6,630,000.00	7,468,960.20	
	UKT 3.75% 09/07/20	6,500,000.00	7,312,142.50	
	UKT 3.75% 09/07/21	7,000,000.00	7,847,875.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,750,000.00	3,030,362.50	
	UKT 4% 03/07/22	4,350,000.00	4,952,061.75	
	UKT 4% 09/07/16	4,400,000.00	4,854,344.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	5,250,000.00	5,960,298.75	
	UKT 4.25% 06/07/32	5,450,000.00	6,217,550.75	
	UKT 4.25% 09/07/39	4,100,000.00	4,636,362.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	3,900,000.00	4,480,963.50	
	UKT 4.25% 12/07/40	5,650,000.00	6,374,951.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	6,050,000.00	6,843,669.25	
	UKT 4.25% 12/07/49	4,500,000.00	5,116,297.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	4,250,000.00	4,889,752.50	
	UKT 4.5% 03/07/19	5,090,000.00	5,926,388.80	

	UKT 4.5% 09/07/34	3,980,000.00	4,675,485.10	
	UKT 4.5% 12/07/42	4,700,000.00	5,532,182.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	5,220,000.00	6,202,090.80	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,090,000.00	5,560,061.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	4,980,000.00	6,036,432.30	
	UKT 4.75% 12/07/38	4,800,000.00	5,861,856.00	
	UKT 5% 03/07/18	5,300,000.00	6,221,829.00	
	UKT 5% 03/07/25	4,450,000.00	5,487,851.25	
	UKT 5.0% 09/07/14	7,650,000.00	8,048,526.75	
	UKT 6.0% 12/07/28	3,200,000.00	4,383,264.00	
	UKT 8% 06/07/21	4,100,000.00	5,876,325.00	
	UKT 8% 12/07/15	2,100,000.00	2,477,443.50	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,920,000.00	2,515,238.40	
イギリスポンド小計		174,070,000.00	196,089,400.90 (30,115,410,190)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	1,050,000.00	1,161,546.75	
	SWISS 2.5% 03/12/16	2,200,000.00	2,343,033.00	
	SWISS 3% 01/08/18	2,000,000.00	2,241,570.00	
	SWISS 3% 05/12/19	1,450,000.00	1,658,488.25	
	SWISS 3.75% 06/10/15	1,050,000.00	1,124,623.50	
	SWISS 4% 02/11/23	1,350,000.00	1,714,068.00	
	SWISS 4% 04/08/28	1,600,000.00	2,162,328.00	
	SWISS 4.25% 06/05/17	1,570,000.00	1,814,386.20	
スイスフラン小計		12,270,000.00	14,220,043.70 (1,521,118,074)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	850,000.00	850,816.00	
	SIGB 0.5% 04/01/18	250,000.00	246,158.75	
	SIGB 1.125% 04/01/16	600,000.00	614,343.00	
	SIGB 1.375% 10/01/14	1,490,000.00	1,511,239.95	
	SIGB 2.25% 06/01/21	920,000.00	933,786.20	
	SIGB 2.375% 04/01/17	1,510,000.00	1,621,755.10	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,240,000.00	1,318,386.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	850,000.00	775,017.25	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,800,000.00	1,892,880.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	800,000.00	775,332.00	
	SIGB 3% 09/01/24	1,100,000.00	1,133,797.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,400,000.00	1,502,564.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,410,000.00	1,537,337.10	

	SIGB 3.5% 03/01/27	1,500,000.00	1,591,710.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,500,000.00	1,548,472.50	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,390,000.00	1,539,668.25	
	SIGB 4% 09/01/18	1,150,000.00	1,317,859.75	
シンガポールドル小計		19,760,000.00	20,711,123.95 (1,637,628,570)	
マレーシア リングgit	MGS 3.172% 07/15/16	650,000.00	646,204.00	
	MGS 3.197% 10/15/15	2,960,000.00	2,956,048.40	
	MGS 3.26% 03/01/18	2,050,000.00	2,027,275.75	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,800,000.00	1,743,678.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	2,050,000.00	2,057,749.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,561,576.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	4,150,000.00	4,089,451.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,680,000.00	1,594,840.80	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,493,625.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	2,830,000.00	2,855,087.95	
	MGS 3.814% 02/15/17	3,050,000.00	3,078,029.50	
	MGS 3.835% 08/12/15	3,900,000.00	3,945,103.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,590,000.00	1,573,686.60	
	MGS 4.127% 04/15/32	250,000.00	250,637.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	4,610,000.00	4,717,389.95	
	MGS 4.24% 02/07/18	9,470,000.00	9,718,256.05	
	MGS 4.262% 09/15/16	7,310,000.00	7,485,440.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	6,400,000.00	6,616,672.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,650,000.00	2,764,122.25	
	MGS 5.248% 09/15/28	2,050,000.00	2,338,988.50	
マレーシアリングgit小計		63,550,000.00	64,513,862.25 (2,022,509,581)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	17,000,000.00	15,956,710.00	
	SGB 3% 07/12/16	13,850,000.00	14,563,759.75	
	SGB 3.5% 03/30/39	12,850,000.00	14,276,607.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	18,350,000.00	20,492,362.50	
	SGB 3.75% 08/12/17	17,400,000.00	19,011,588.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	21,100,000.00	24,005,575.50	
	SGB 4.5% 08/12/15	20,150,000.00	21,524,230.00	
	SGB 5% 12/01/20	13,150,000.00	15,937,997.25	
スウェーデンクローナ小計		133,850,000.00	145,768,830.00 (2,246,297,670)	

ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	7,950,000.00	7,538,786.25	
	NGB 3.75% 05/25/21	14,450,000.00	15,844,930.75	
	NGB 4.25% 05/19/17	15,450,000.00	16,887,159.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	13,450,000.00	15,227,215.75	
	NGB 5% 05/15/15	20,950,000.00	22,269,954.75	
ノルウェークローネ小計		72,250,000.00	77,768,046.50 (1,314,279,985)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,100,000.00	8,864,992.50	
	DGB 2% 11/15/14	12,170,000.00	12,468,834.35	
	DGB 2.5% 11/15/16	7,550,000.00	8,074,234.25	
	DGB 3% 11/15/21	26,750,000.00	30,006,545.00	
	DGB 4% 11/15/15	28,200,000.00	30,645,927.00	
	DGB 4% 11/15/17	15,500,000.00	17,721,537.50	
	DGB 4% 11/15/19	25,150,000.00	29,686,808.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	32,500,000.00	46,102,225.00	
	DGB 7% 11/10/24	7,350,000.00	11,339,800.50	
デンマーククローネ小計		164,270,000.00	194,910,904.60 (3,459,668,556)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	17,950,000.00	24,455,887.75	
	MBONO 10% 12/05/24	27,600,000.00	37,253,376.00	
	MBONO 5% 06/15/17	19,250,000.00	19,446,927.50	
	MBONO 6% 06/18/15	33,800,000.00	34,961,368.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	32,550,000.00	34,274,987.25	
	MBONO 6.5% 06/09/22	14,900,000.00	15,651,705.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	30,530,000.00	32,162,286.45	
	MBONO 7.25% 12/15/16	22,500,000.00	24,431,062.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	24,600,000.00	27,689,883.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,000,000.00	24,404,490.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	12,750,000.00	14,054,707.50	
	MBONO 7.75% 12/14/17	28,200,000.00	31,502,361.00	
	MBONO 8% 06/11/20	27,900,000.00	32,085,558.00	
	MBONO 8% 12/07/23	13,150,000.00	15,375,374.50	
	MBONO 8% 12/17/15	27,050,000.00	29,408,489.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	34,650,000.00	42,217,213.50	
	MBONO 8.5% 11/18/38	34,300,000.00	40,770,009.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	13,000,000.00	15,181,855.00	
	MBONO 9.5% 12/18/14	35,100,000.00	37,691,784.00	

メキシコペソ小計		471,780,000.00	533,019,325.45 (4,237,503,637)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/16	2,550,000.00	2,371,551.00	
	POLGB 0% 07/25/14	1,500,000.00	1,462,162.50	
	POLGB 0% 07/25/15	350,000.00	330,872.50	
	POLGB 2.5% 07/25/18	2,700,000.00	2,595,753.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	6,500,000.00	6,615,570.00	
	POLGB 4% 10/25/23	3,500,000.00	3,498,775.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	6,700,000.00	7,065,250.50	
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,540,000.00	5,822,706.20	
	POLGB 5% 04/25/16	7,200,000.00	7,565,760.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	9,170,000.00	9,879,849.70	
	POLGB 5.25% 10/25/20	6,750,000.00	7,384,297.50	
	POLGB 5.5% 04/25/15	9,600,000.00	10,028,400.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	8,200,000.00	9,076,170.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	3,270,000.00	3,807,048.45	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,400,000.00	8,385,569.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	6,220,000.00	7,030,901.40	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,800,000.00	9,426,472.00	
ポーランドズロチ小計		95,950,000.00	102,347,108.75 (3,201,417,561)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	35,900,000.00	43,235,088.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	19,400,000.00	22,239,287.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	20,150,000.00	15,171,035.75	
	SAGB 6.5% 02/28/41	16,200,000.00	12,149,595.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	25,800,000.00	24,842,175.00	
	SAGB 7% 02/28/31	17,200,000.00	14,763,706.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	26,500,000.00	26,505,565.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,150,000.00	6,181,211.25	
	SAGB 8% 12/21/18	21,650,000.00	22,642,219.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	24,000,000.00	25,281,600.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	6,800,000.00	6,589,948.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	5,200,000.00	5,431,244.00	
南アフリカランド小計		224,950,000.00	225,032,674.50 (2,308,835,240)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	2,300,000.00	2,294,905.50	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,950,000.00	1,898,949.00	
	BGB 2.75% 03/28/16	1,740,000.00	1,841,120.10	

BGB 3% 09/28/19	1,890,000.00	2,041,681.95	
BGB 3.25% 09/28/16	3,800,000.00	4,102,347.00	
BGB 3.5% 03/28/15	2,100,000.00	2,210,911.50	
BGB 3.5% 06/28/17	3,670,000.00	4,023,310.90	
BGB 3.75% 09/28/15	4,350,000.00	4,664,309.25	
BGB 3.75% 09/28/20	6,000,000.00	6,761,460.00	
BGB 4% 03/28/18	3,550,000.00	4,005,056.75	
BGB 4% 03/28/22	5,340,000.00	6,075,157.80	
BGB 4% 03/28/32	2,100,000.00	2,309,895.00	
BGB 4.0% 03/28/17	3,350,000.00	3,725,082.75	
BGB 4.0% 03/28/19	3,150,000.00	3,582,369.00	
BGB 4.25% 03/28/41	3,300,000.00	3,781,470.00	
BGB 4.25% 09/28/14	3,400,000.00	3,559,494.00	
BGB 4.25% 09/28/21	3,100,000.00	3,597,596.50	
BGB 4.25% 09/28/22	3,500,000.00	4,037,792.50	
BGB 4.5% 03/28/26	2,100,000.00	2,463,909.00	
BGB 5% 03/28/35	5,150,000.00	6,478,674.25	
BGB 5.5% 03/28/28	4,450,000.00	5,764,797.00	
BGB 5.5% 09/28/17	1,800,000.00	2,127,258.00	
BGB 8.0% 03/28/15	2,010,000.00	2,265,933.30	
BKO 0% 12/12/14	7,200,000.00	7,189,164.00	
BTNS 0.75% 09/25/14	470,000.00	473,099.65	
BTNS 1% 07/25/17	3,890,000.00	3,915,129.40	
BTNS 1.75% 02/25/17	6,000,000.00	6,218,220.00	
BTNS 2% 07/12/15	8,590,000.00	8,869,260.90	
BTNS 2.25% 02/25/16	7,740,000.00	8,095,227.30	
BTNS 2.5% 01/15/15	9,250,000.00	9,557,377.50	
BTNS 2.5% 07/25/16	7,010,000.00	7,412,233.80	
BTNS 3% 07/12/14	9,900,000.00	10,167,052.50	
BTPS 2.25% 05/15/16	750,000.00	750,918.75	
BTPS 2.5% 03/01/15	3,200,000.00	3,248,368.00	
BTPS 3% 04/15/15	8,100,000.00	8,281,075.50	
BTPS 3% 06/15/15	8,510,000.00	8,696,794.50	
BTPS 3% 11/01/15	8,200,000.00	8,390,855.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	2,960,987.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	5,240,000.00	5,250,296.60	
BTPS 3.75% 04/15/16	5,330,000.00	5,555,912.05	
BTPS 3.75% 08/01/15	9,130,000.00	9,456,397.50	

BTPS 3.75% 08/01/16	6,500,000.00	6,766,012.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	10,800,000.00	10,830,510.00	
BTPS 4% 02/01/17	8,150,000.00	8,520,091.50	
BTPS 4% 02/01/37	6,750,000.00	6,075,337.50	
BTPS 4% 09/01/20	6,250,000.00	6,384,031.25	
BTPS 4.25% 02/01/15	8,800,000.00	9,172,064.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	7,500,000.00	7,839,075.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	6,200,000.00	6,418,550.00	
BTPS 4.25% 07/01/14	4,100,000.00	4,220,540.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	4,170,000.00	4,299,707.85	
BTPS 4.25% 09/01/19	8,050,000.00	8,393,735.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	9,100,000.00	9,663,881.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	5,620,000.00	5,899,061.10	
BTPS 4.5% 03/01/19	8,050,000.00	8,493,595.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,600,000.00	4,636,524.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,078,925.50	
BTPS 4.5% 07/15/15	1,410,000.00	1,480,535.25	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,130,000.00	6,510,489.10	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,160,000.00	3,374,516.60	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,600,000.00	3,841,848.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	6,130,000.00	6,371,644.60	
BTPS 4.75% 09/01/21	8,350,000.00	8,815,554.25	
BTPS 4.75% 09/01/28	900,000.00	910,255.50	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,435,012.50	
BTPS 4.75% 09/15/16	5,450,000.00	5,824,006.25	
BTPS 5% 03/01/22	8,340,000.00	8,879,889.90	
BTPS 5% 03/01/25	5,650,000.00	5,929,392.50	
BTPS 5% 08/01/34	6,350,000.00	6,495,764.25	
BTPS 5% 09/01/40	6,140,000.00	6,166,095.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,950,000.00	5,007,717.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	10,150,000.00	11,045,686.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	9,300,000.00	9,821,172.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,950,000.00	4,309,371.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,350,000.00	4,740,521.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,900,000.00	4,348,051.50	
BTPS 6% 05/01/31	9,450,000.00	10,803,287.25	
BTPS 6% 11/15/14	2,700,000.00	2,861,109.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	8,310,000.00	9,796,534.35	

BTPS 7.25% 11/01/26	2,600,000.00	3,257,150.00	
BTPS 9% 11/01/23	3,920,000.00	5,392,156.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,300,000.00	2,280,450.00	
DBR 1.5% 05/15/23	3,050,000.00	3,010,456.75	
DBR 1.5% 09/04/22	4,000,000.00	3,997,160.00	
DBR 1.75% 07/04/22	8,740,000.00	8,946,089.20	
DBR 2% 01/04/22	5,690,000.00	5,983,632.45	
DBR 2.25% 09/04/20	8,150,000.00	8,801,022.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,820,000.00	4,103,654.10	
DBR 2.5% 01/04/21	5,000,000.00	5,483,400.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,100,000.00	2,124,696.00	
DBR 3% 07/04/20	6,720,000.00	7,600,723.20	
DBR 3.25% 01/04/20	6,500,000.00	7,435,350.00	
DBR 3.25% 07/04/15	9,300,000.00	9,856,558.50	
DBR 3.25% 07/04/21	4,250,000.00	4,895,383.75	
DBR 3.25% 07/04/42	4,400,000.00	5,159,616.00	
DBR 3.5% 01/04/16	9,050,000.00	9,777,439.00	
DBR 3.5% 07/04/19	6,060,000.00	6,989,513.10	
DBR 3.75% 01/04/15	6,140,000.00	6,461,889.50	
DBR 3.75% 01/04/17	6,400,000.00	7,148,160.00	
DBR 3.75% 01/04/19	8,000,000.00	9,272,960.00	
DBR 4% 07/04/16	5,600,000.00	6,209,896.00	
DBR 4.0% 01/04/18	5,820,000.00	6,703,126.80	
DBR 4.0% 01/04/37	6,700,000.00	8,586,887.50	
DBR 4.25% 07/04/14	4,610,000.00	4,788,752.75	
DBR 4.25% 07/04/17	7,010,000.00	8,052,737.50	
DBR 4.25% 07/04/18	5,300,000.00	6,222,968.50	
DBR 4.25% 07/04/39	4,150,000.00	5,609,534.25	
DBR 4.75% 07/04/28	2,950,000.00	3,929,090.25	
DBR 4.75% 07/04/34	5,450,000.00	7,571,957.50	
DBR 4.75% 07/04/40	5,000,000.00	7,294,225.00	
DBR 5.5% 01/04/31	4,330,000.00	6,316,863.80	
DBR 5.625% 01/04/28	3,860,000.00	5,549,464.10	
DBR 6% 06/20/16	900,000.00	1,048,374.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,650,000.00	3,810,633.75	
DBR 6.25% 01/04/30	2,600,000.00	4,030,208.00	
DBR 6.5% 07/04/27	3,400,000.00	5,241,542.00	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,100,000.00	2,092,912.50	

FRTR 1% 05/25/18	2,000,000.00	1,997,090.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,350,000.00	7,398,436.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	10,490,000.00	11,113,368.25	
FRTR 3% 04/25/22	10,800,000.00	11,618,100.00	
FRTR 3% 10/25/15	8,700,000.00	9,215,910.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	9,300,000.00	10,000,662.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,100,000.00	1,080,695.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,150,000.00	5,678,364.25	
FRTR 3.5% 04/25/15	9,200,000.00	9,713,360.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	9,960,000.00	11,234,929.80	
FRTR 3.5% 04/25/26	10,100,000.00	11,016,070.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	10,190,000.00	11,313,090.85	
FRTR 3.75% 04/25/21	11,200,000.00	12,798,856.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	8,050,000.00	9,203,283.25	
FRTR 4% 04/25/18	8,410,000.00	9,580,966.35	
FRTR 4% 04/25/55	4,500,000.00	5,041,597.50	
FRTR 4% 04/25/60	2,250,000.00	2,523,881.25	
FRTR 4% 10/25/14	2,410,000.00	2,523,547.15	
FRTR 4% 10/25/38	6,950,000.00	7,847,245.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	8,800,000.00	10,270,348.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	8,230,000.00	9,382,693.80	
FRTR 4.25% 10/25/18	8,470,000.00	9,828,333.90	
FRTR 4.25% 10/25/23	11,650,000.00	13,657,469.75	
FRTR 4.5% 04/25/41	6,600,000.00	8,057,280.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	5,700,000.00	7,118,673.00	
FRTR 5% 10/25/16	9,810,000.00	11,187,667.35	
FRTR 5.5% 04/25/29	6,600,000.00	8,772,786.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	7,030,000.00	9,786,884.80	
FRTR 6.0% 10/25/25	5,040,000.00	6,855,055.20	
FRTR 8.5% 04/25/23	4,090,000.00	6,328,375.20	
FRTR 8.5% 10/25/19	3,060,000.00	4,372,709.40	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,300,000.00	1,308,703.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,200,000.00	2,338,028.00	
IRISH 4.5% 02/18/15	950,000.00	1,005,095.25	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,500,000.00	3,707,060.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	2,700,000.00	2,914,191.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	3,350,000.00	3,613,896.25	
IRISH 5% 10/18/20	2,600,000.00	2,830,178.00	

IRISH 5.4% 03/13/25	3,350,000.00	3,713,458.25	
IRISH 5.5% 10/18/17	1,200,000.00	1,340,586.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,600,000.00	1,822,968.00	
NETHER 0% 04/15/16	1,600,000.00	1,582,424.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	3,320,000.00	3,350,793.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	3,200,000.00	3,252,512.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	1,949,580.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	4,480,000.00	4,633,283.20	
NETHER 2.5% 01/15/17	4,140,000.00	4,408,147.80	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,900,000.00	2,859,980.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	4,750,000.00	4,930,381.25	
NETHER 3.25% 07/15/15	5,500,000.00	5,824,307.50	
NETHER 3.25% 07/15/21	4,310,000.00	4,829,419.65	
NETHER 3.5% 07/15/20	4,350,000.00	4,952,061.75	
NETHER 3.75% 01/15/23	3,050,000.00	3,538,305.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	3,750,000.00	4,591,762.50	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,900,000.00	5,072,210.50	
NETHER 4% 01/15/37	3,650,000.00	4,537,753.00	
NETHER 4% 07/15/16	3,800,000.00	4,196,758.00	
NETHER 4% 07/15/19	4,000,000.00	4,645,020.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	4,200,000.00	4,813,809.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	5,310,000.00	6,093,251.55	
NETHER 5.5% 01/15/28	3,850,000.00	5,308,630.25	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,040,144.00	
OBL 0.25% 04/13/18	2,500,000.00	2,453,862.50	
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,035,527.75	
OBL 0.5% 04/07/17	4,860,000.00	4,876,378.20	
OBL 0.5% 10/13/17	2,800,000.00	2,798,852.00	
OBL 0.75% 02/24/17	6,570,000.00	6,657,578.10	
OBL 1.25% 10/14/16	3,500,000.00	3,604,965.00	
OBL 1.75% 10/09/15	4,980,000.00	5,154,001.20	
OBL 2% 02/26/16	3,150,000.00	3,294,868.50	
OBL 2.25% 04/10/15	9,650,000.00	9,996,772.75	
OBL 2.5% 02/27/15	6,970,000.00	7,231,932.60	
OBL 2.5% 10/10/14	6,700,000.00	6,892,625.00	
OBL 2.75% 04/08/16	2,450,000.00	2,615,705.75	
RAGB 1.95% 06/18/19	1,150,000.00	1,200,824.25	
RAGB 3.15% 06/20/44	950,000.00	1,025,738.75	

RAGB 3.2% 02/20/17	2,700,000.00	2,946,672.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	2,650,000.00	2,755,483.25	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,450,000.00	1,634,106.50	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,750,000.00	3,991,031.25	
RAGB 3.5% 09/15/21	4,400,000.00	5,009,092.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,200,000.00	2,526,513.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	850,000.00	1,070,668.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	4,410,000.00	5,125,963.50	
RAGB 4% 09/15/16	3,500,000.00	3,883,390.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	3,300,000.00	4,122,475.50	
RAGB 4.3% 07/15/14	3,100,000.00	3,224,899.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,550,000.00	1,773,029.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	3,810,000.00	4,479,969.45	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,500,000.00	4,083,555.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,700,000.00	3,450,519.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,400,000.00	3,485,844.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	1,250,000.00	1,205,262.50	
RFGB 1.625% 09/15/22	1,200,000.00	1,183,200.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	1,700,000.00	1,765,229.00	
RFGB 1.875% 04/15/17	1,450,000.00	1,517,831.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	700,000.00	703,972.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	1,150,000.00	1,197,753.75	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,950,000.00	2,016,797.25	
RFGB 3.375% 04/15/20	2,150,000.00	2,433,993.50	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,920,000.00	2,194,108.80	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,600,000.00	1,805,784.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,650,000.00	1,965,587.25	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,500,000.00	1,617,562.50	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,100,000.00	1,304,209.50	
SPGB 3% 04/30/15	5,360,000.00	5,453,800.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	7,000,000.00	7,128,275.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	6,420,000.00	6,550,903.80	
SPGB 3.3% 07/30/16	2,050,000.00	2,091,317.75	
SPGB 3.3% 10/31/14	9,250,000.00	9,447,487.50	
SPGB 3.75% 10/31/15	3,150,000.00	3,246,689.25	
SPGB 3.8% 01/31/17	6,490,000.00	6,680,254.35	
SPGB 4% 04/30/20	5,700,000.00	5,691,079.50	
SPGB 4% 07/30/15	5,250,000.00	5,437,740.00	

	SPGB 4.1% 07/30/18	5,200,000.00	5,383,690.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	4,400,000.00	3,798,520.00	
	SPGB 4.25% 10/31/16	6,770,000.00	7,080,979.95	
	SPGB 4.3% 10/31/19	5,100,000.00	5,235,660.00	
	SPGB 4.4% 01/31/15	7,420,000.00	7,717,430.70	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,500,000.00	2,446,087.50	
	SPGB 4.5% 01/31/18	4,800,000.00	5,045,952.00	
	SPGB 4.6% 07/30/19	5,250,000.00	5,505,937.50	
	SPGB 4.65% 07/30/25	4,300,000.00	4,226,040.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	3,240,000.00	2,991,686.40	
	SPGB 4.75% 07/30/14	2,550,000.00	2,635,170.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	4,730,000.00	4,761,123.40	
	SPGB 4.85% 10/31/20	6,300,000.00	6,580,318.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	3,800,000.00	3,628,202.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,400,000.00	4,653,792.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	8,330,000.00	9,023,805.70	
	SPGB 5.5% 07/30/17	5,390,000.00	5,879,438.95	
	SPGB 5.75% 07/30/32	4,100,000.00	4,404,753.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,243,434.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,150,000.00	2,344,919.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	5,220,000.00	5,766,768.90	
	ユーロ小計	1,199,140,000.00	1,314,516,401.05 (173,989,390,842)	
国債証券合計			405,561,947,619 (405,561,947,619)	
合計			405,561,947,619 (405,561,947,619)	

(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 200銘柄	100.0%	40.3%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.5%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.0%	1.4%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	7.4%
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git	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%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券	19銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	17銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券	252銘柄	100.0%	42.9%

(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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 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8月30日現在）

インデックスコレクション(バランス株式30)

I 資産総額	3,155,996,741 円
II 負債総額	4,807,055 円
III 純資産総額(I－II)	3,151,189,686 円
IV 発行済口数	2,633,364,197 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.1966 円
1万口当たり純資産額	11,966 円

インデックスコレクション(バランス株式50)

I 資産総額	3,219,212,735 円
II 負債総額	1,142,156 円
III 純資産総額(I－II)	3,218,070,579 円
IV 発行済口数	2,488,460,520 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.2932 円
1万口当たり純資産額	12,932 円

インデックスコレクション(バランス株式70)

I 資産総額	2,298,196,897 円
II 負債総額	1,638,288 円
III 純資産総額(I－II)	2,296,558,609 円
IV 発行済口数	1,668,167,604 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.3767 円
1万口当たり純資産額	13,767 円

(参考情報)

日本株式マザーファンド

I 資産総額	273,261,256,163 円
II 負債総額	1,873,283,557 円
III 純資産総額(I－II)	271,387,972,606 円
IV 発行済口数	261,241,887,849 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.0388 円
1万口当たり純資産額	10,388 円

日本債券マザーファンド

I 資産総額	405,165,492,968 円
II 負債総額	11,772,488,838 円
III 純資産総額(I － II)	393,393,004,130 円
IV 発行済口数	318,251,594,483 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.2361 円
1万口当たり純資産額	12,361 円

外国株式マザーファンド

I 資産総額	288,304,336,690 円
II 負債総額	1,656,991,122 円
III 純資産総額(I － II)	286,647,345,568 円
IV 発行済口数	194,924,199,234 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.4706 円
1万口当たり純資産額	14,706 円

外国債券マザーファンド

I 資産総額	387,629,731,436 円
II 負債総額	2,054,128,414 円
III 純資産総額(I － II)	385,575,603,022 円
IV 発行済口数	198,194,235,043 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	1.9454 円
1万口当たり純資産額	19,454 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限

該当事項はありません。

（4）振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 受益証券の不発行

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

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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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します。）に支払います。

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（平成25年8月30日現在）

資本金の額：3億円

発行可能株式総数：12,000株

発行済株式総数：3,000株

最近5年間に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

① 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發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

② 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）に運用パフォーマンスの評価・分析に係るモニタリング状況を報告します。

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

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

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

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

委託会社の機構は平成25年10月25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8月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	323	4,270,410
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	323	4,270,410

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 (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 (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)
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 (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)
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

（リース取引関係）

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

①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。

②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。

③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

①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

①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

① 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。

② 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 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

① 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。

② 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

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

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

（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）通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

（４）親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

（５）その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

（１）定款の変更

委託会社は、平成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10月25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

- ① 名称：三井住友信託銀行株式会社
- ② 資本金の額：342,037百万円（平成25年３月末日現在）
- ③ 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
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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【関係業務の概要】

（１）受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

（２）販売会社

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

３【資本関係】

（１）受託会社

該当事項はありません。

（２）販売会社

該当事項はありません。

（参考）再信託受託会社

- ① 名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ② 設立年月日：平成12年６月20日
- ③ 資本金の額：51,000百万円（平成25年３月末日現在）
- ④ 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。
- ⑤ 再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間中に、金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる次の書類を提出しております。

提出日	書類名
平成24年10月25日	有価証券報告書
平成24年10月25日	有価証券届出書
平成25年4月25日	半期報告書
平成25年4月25日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成25年9月25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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式30）の平成24年7月26日から平成25年7月25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、インデックスコレクション（バランス株式30）の平成25年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- ※ 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRL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9月25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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式50）の平成24年7月26日から平成25年7月25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、インデックスコレクション（バランス株式50）の平成25年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- ※ 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRL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9月25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」に掲げられているインデックスコレクション（バランス株式70）の平成24年7月26日から平成25年7月25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、インデックスコレクション（バランス株式70）の平成25年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

-
- ※ 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRL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。