

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年5月20日
【発行者名】	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ 株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 山本 幸次
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	太田 裕之
【電話番号】	03 - 4530 - 7093
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型 バランス・オープン（ステイブル）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券 の金額】	継続募集額 2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）
（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型株式投資信託振替受益権です（以下「受益権」といいます。）。

委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の依頼により、信用格付業者から提供もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに受付けたものを当日の受付分として取り扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。また、お申込日が米国もしくは英国の取引所 または銀行の休業日またはフランス及びドイツの両国の取引所または銀行の休業日となる場合には、原則としてお申込みはできません。なお、1億円または1億口を超える大口の取得の申込には、制限を設けることがあります。

収益分配金の再投資を行う場合は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価を行っ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）を、計算日における受益権総口数で除して求めた1口当りの金額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより日々変動します。

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および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」といいます。以下同じとします。

基準価額は、販売会社（下記「（８）申込取扱場所」を参照）にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：<http://www.ssga.co.jp/public/nav.htm>

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

継続申込期間 平成25年5月21日から平成26年5月20日

ただし、お申込みの取扱いは日本における販売会社の営業日に限り行われます。

また、お申込日が米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日またはフランス及びドイツの両国の取引所または銀行の休業日に当たる場合は、原則としてお申込みはできません。なお、1億円または1億口を超える大口の取得の申込には、制限を設けることがあります。

申込み（継続募集）期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の照会先までお問い合わせください。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：<http://www.ssga.co.jp/public/nav.htm>

(9) 【払込期日】

ファンドの受益権の申込者は、販売会社が定める期日（詳しくは、販売会社にお問い合わせください。）

までに、お申込代金をお申込みの販売会社に支払うものとします。振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に当ファンドの受託会社である三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込を受け付けた販売会社とします（上記「（8）申込取扱場所」の項をご参照ください。）。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込みの方法等

当ファンドの受益権のお申込みは、原則として米国もしくは英国の取引所または銀行の休業日またはフランス及びドイツの両国の取引所または銀行の休業日を除き、申込期間における毎営業日受け付けます。信託財産の運用が円滑に行えるよう、お申込みの受け付けは、販売会社の毎営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、1億円または1億口を超える大口の取得の申込には、制限を設けることがあります。

ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、取得申込みを行います（なお、確定拠出年金制度のご利用による取得の申込みの場合は、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。）。その際、「自動けいぞく（累積）投資コース」をお申し込みいただく方

は、お買付に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく(累積)投資契約」(別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。)を取扱会社との間で結んでいただきます。ただし、自動けいぞく(累積)投資コースを申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

取得申込みの受付けの中止、既に受付けた取得申込の受付けの取消し

取引所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(金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天変地異等)により市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)があるときは、信託約款の規定に従い、委託会社の判断により、受益権の取得申込みの受付を中止することおよび既に受付けた取得申込を取り消すことができます。

お申込み代金の利息

お申込み代金には利息を付けません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

振替制度では、

- ・原則として受益証券を保有することはできなくなります。
- ・受益証券を発行しませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます。
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的および基本的性格】

当ファンドは、株式会社エー・エム・シー（AMC）が算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

株式会社エー・エム・シーが、日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより決定した資産配分に基づき、各資産のベンチマークのリターンを合成した指数で、資産配分は定期的に見直しが行われます。

委託会社は、受託会社と合意のうえ、金2兆円を限度として信託金を追加できるものとします。また委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書又は信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投信及び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。
補足分類	インデックス型	目論見書又は信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル 日本 北米			日経 225	ブル・ベア型

債券 一般 国債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州 アジア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX	条件付運用型
不動産投信	日々	中南米	ファンド・ オブ・ファンズ	なし		ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型
その他資産 (投資信託証 券 (資産複合 (株式、債 券)、資産配分 変更型))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)			その他 (AMCリスク バジェット型 資産配分モデル 指数)	その他 ()
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		エマージング				

属性区分に記載している「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。

(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。

当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（資産複合（株式、債券）、資産配分変更型）	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。なお、当ファンドにおける組入資産は、投資信託証券です。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、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	目論見書又は信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書又は信託約款において、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。
対象 インデックス	その他	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等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/>）をご覧ください。

ファンドの目的

当ファンドは、株式会社エー・エム・シー（AMC）が算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

ファンドの特色

1 株式会社エー・エム・シーが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。

日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、株式会社エー・エム・シーが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。

<株式会社エー・エム・シーの概要>

平成10年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。

2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指します。

マザーファンドのベンチマークについては、「マザーファンドの概要」をご参照ください。

また、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」とは、株式会社エー・エム・シーが決定した資産配分に基づき、各ベンチマークのリターンを合成した指数です。

3 実質的に保有する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

投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

ファンドの運用の仕組み

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてヘビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてヘビーファンドに還元されます。



※各マザーファンドには、当ファンド以外にも、各マザーファンドに投資する他のファンド（ヘビーファンド）があります。

主な投資制限

1. マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
2. 株式、公社債および外貨建資産、それぞれの実質投資割合には制限を設けません。
3. 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）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。
4. デリバティブ取引は、約款に定める範囲で行います。

投資対象とするマザーファンドの概要

ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> TOPIX(東証株価指数配当込み)をベンチマークとします。 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。 債券組入比率は原則として高位を維持します。

ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き(MSCI コクサイ指数、円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> 日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)を主要投資対象とし、MSCI コクサイ指数(円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

※MSCI コクサイ指数(円ベース)とは、MSCI コクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等を主要投資対象としシティグループ世界国債指数(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> 公社債への投資は原則として高位を維持します。 外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

※シティグループ世界国債指数(除く日本、円ベース)とは、シティグループ世界国債指数(除く日本)の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

収益分配方針

毎決算時(原則として2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日)に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ① 分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の範囲内とします。
 - ② 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象金額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。
 - ③ 留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
- なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いについて保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

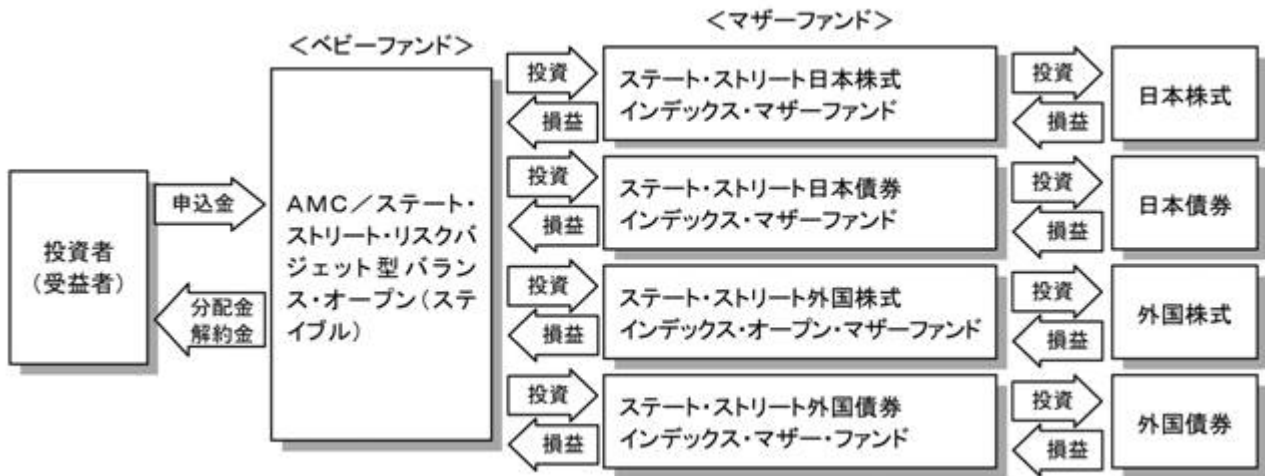
- ・分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりりが小さかった場合も同様です。

(2) 【ファンドの沿革】

平成24年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資家からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

- 1) ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）

委託会社は、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。

- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

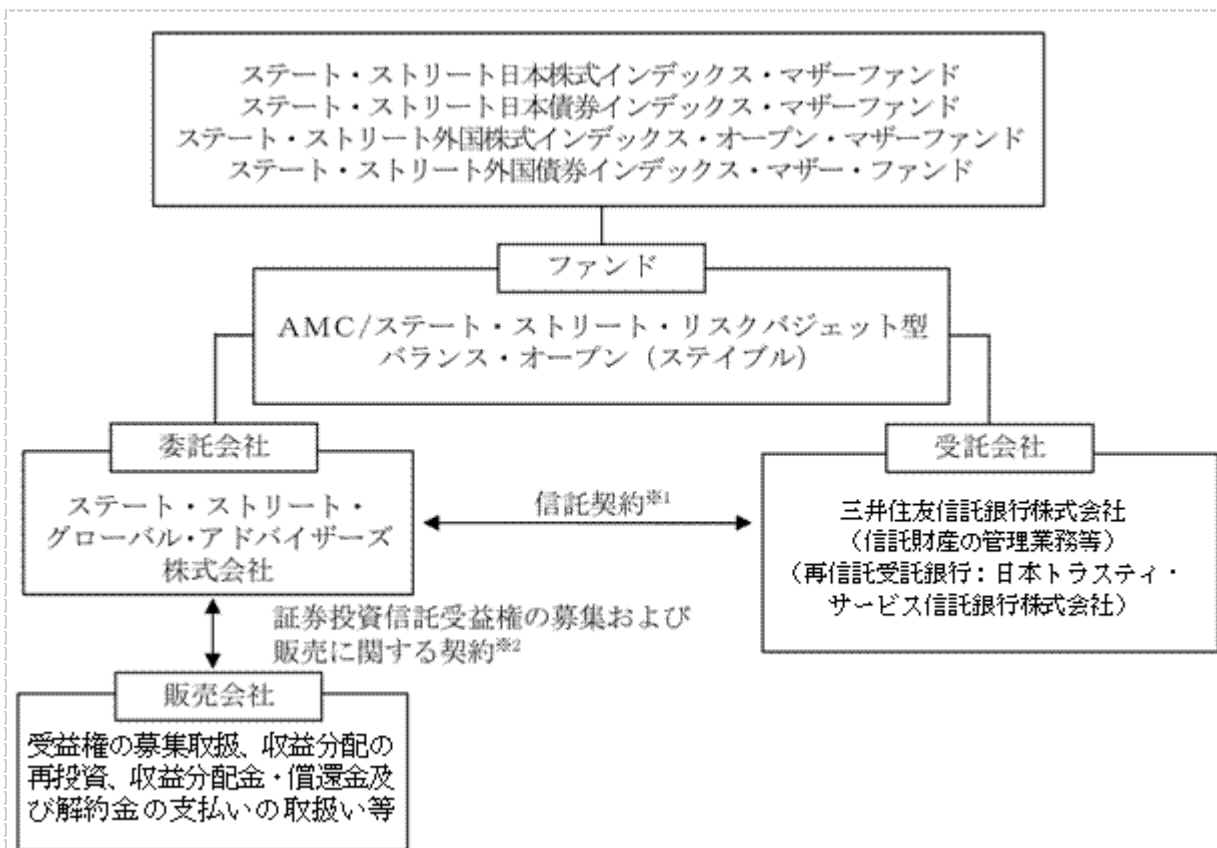
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、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。

- 3) 販売会社

販売会社は、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金、一部解約代金および償還金の支払い等を行います。

ファンド関係法人



1 信託契約

委託会社、受託会社および受益者に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益権に関する事項ならびに信託の元本および収益の管理ならび運営に関する事項等が定められます。

なお、ファンドは、委託会社と受託会社とが信託契約を締結することにより成立します。信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出た信託約款の内容に基づいて締結されます。

2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

販売会社の募集の取扱い、換金の取扱い、償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められます。

委託会社の概況（平成25年3月29日現在）

1）資本金

3億1千万円

2）沿革

平成10年2月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
平成10年3月31日	投資顧問業の登録
平成10年8月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
平成10年9月30日	投資一任契約に係る業務の認可
平成10年9月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
平成19年9月30日	金融商品取引業者の登録
平成20年7月1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

3）大株主の状況

（平成25年3月29日現在）

氏名または名称	住所	所有株数	所有比率
---------	----	------	------

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス・インク	アメリカ合衆国デラウェア州 ウィルミントン センターヴィル ・ロード2711	6,200株	100%
---	--	--------	------

2【投資方針】

（1）【投資方針】

当ファンドは、株式会社エー・エム・シー（AMC）が算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。株式会社エー・エム・シーが、日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより決定した資産配分に基づき、各資産のベンチマークのリターンを合成した指数で、資産配分は定期的に見直しが行われます。

「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。

「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

各マザーファンド受益証券のベンチマークは下記の通りで、各マザーファンド受益証券においては、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド
[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数配当込み）]

ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド
[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合指数]

ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド
[ベンチマーク：MSCIコクサイ指数（円ベース¹）]

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド
[ベンチマーク：シティグループ世界国債指数（除く日本、円ベース²）]

¹ MSCIコクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

² シティグループ世界国債指数（除く日本）の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

マザーファンド受益証券の組入れに伴う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。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。以下同じ。）を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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、または再

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。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（２）【投資対象】

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（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。（信託約款等15条）

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社に係る特定社債券（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．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号までの証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託また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ます。）
- 14．投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（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または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 17．預託証書（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．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

20. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22. 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。）

なお、1)の証券または証書、12)および17)の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに12)および17)の証券または証書のうち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、13)の証券および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

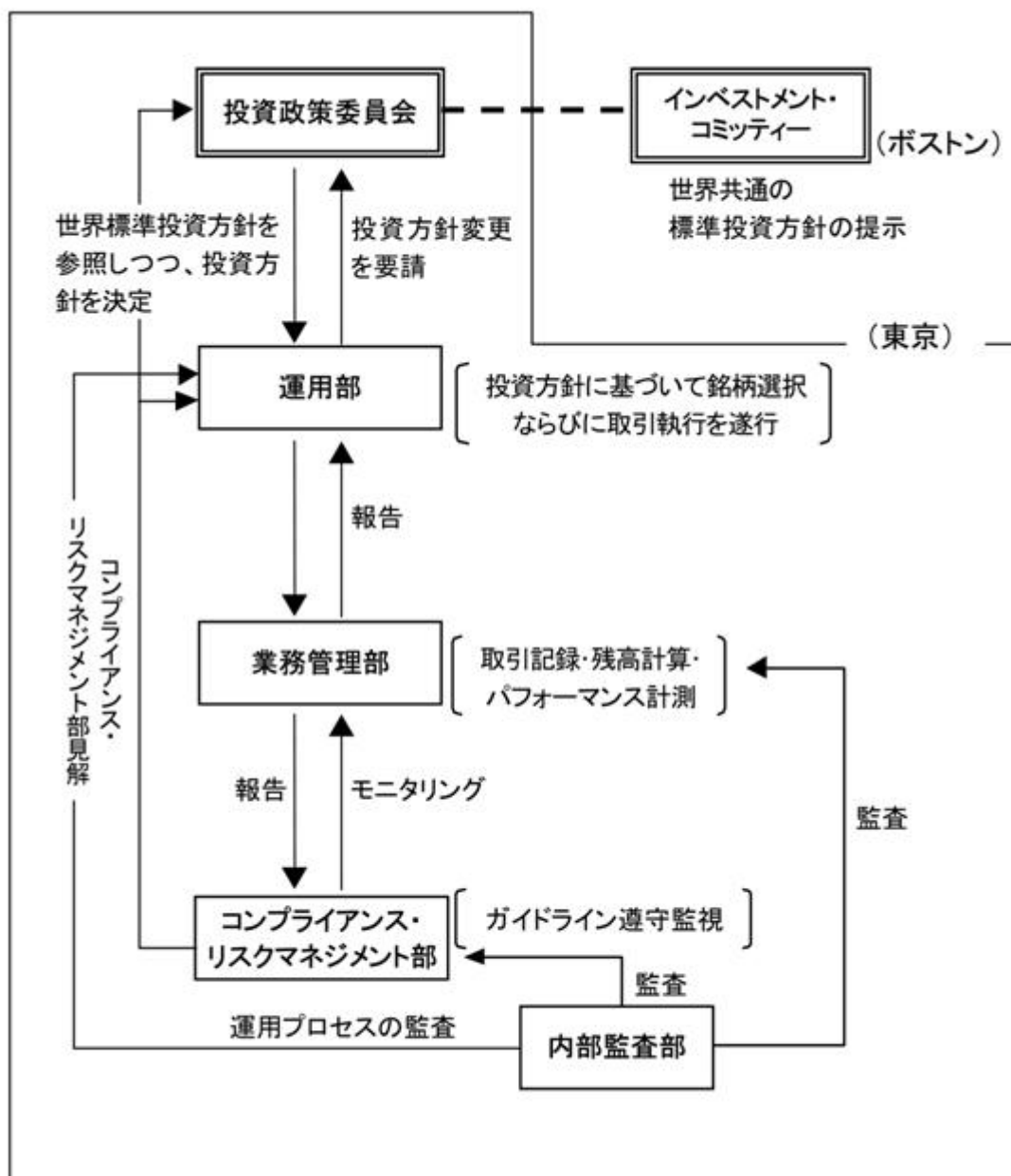
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前項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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下同じ。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

上記において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル／プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該ストラテジーに関わる運用担当者と意見・情報交換を行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

運用の報告は、委託会社の投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

上記運用体制は平成25年3月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【配分方針】

収益配分方針

毎決算時（原則として2月20日、ただし、該当日が休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。

分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の範囲内とします。

分配金額は、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、分配対象金額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いについて保証するものではありません。

< 収益分配金に関する留意事項 >

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 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およ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かさかった場合も同様です。

（５）【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める主な投資制限

- 1) マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- 2) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）の実質投資割合には制限を設けません。
- 3) 公社債の実質投資割合には制限を設けません。
- 4) 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。
- 5) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）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。
- 6) デリバティブ取引は、約款20条、第21条および第22条の範囲で行います。

信託約款上のその他の投資制限（信託約款第18条）

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または取引所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（上場予定または登録予定の株式、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または登録されることが確認できるものを含みます。）とします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- 2) 信用取引の指図範囲（信託約款第19条）
 - (a) 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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 - (b) 上記(a)の信用取引の指図にあたっては、当該売り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り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
 - (c) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り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、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付け

の一部を決済するための指図をするものとします。

- (d) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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り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。
- (e) 委託会社は、上記(a)の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

3) 先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

- (a) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所におけ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。）、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。）および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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- (b) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およ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。
- (c) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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。

4) スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

- (a) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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。）を行うことの指図をすることができます。
- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計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、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。
- (d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の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信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) 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定した価額で評価するものとします。
- (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、

担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

5) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（信託約款第22条）

- (a) 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引およ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。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

6) 有価証券の貸付の指図および範囲（信託約款第23条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
- (b) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

7) 公社債の空売りの指図範囲（信託約款第24条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b) 上記（a）の売り付けの指図にあたっては、当該売り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。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り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、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

8) 公社債の借入れ（信託約款第25条）

- (a) 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あたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記（a）の指図にあたっては、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。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り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。
- (d) 上記（a）の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）

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。

10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額と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との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、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。

- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として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の額と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との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための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。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託者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。
- (d) 上記(a)および(b)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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。

その他の法令上の投資制限

当ファンドに適用されるその他の法令上の投資制限は以下のとおりです（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第27条第1項第5号）。上記 および において記載された投資制限によって特定の法令上の投資制限が充足されている場合には、当該法令上の投資制限は本 において記載されていません。

委託会社は、当ファンドの信託財産の純資産総額に100分の50を乗じて得られる額が当該信託財産に係る次の(a)および(b)に掲げる額（これに係る取引のうち、当該取引が評価損を生じたのと同じ事由により評価益を生じた取引がある場合には当該評価益の合計額を控除した額とします。）ならびに(c)および(d)に掲げる額の合計額を下回ることとなるにもかかわらず、当該信託財産に係る有価証券先物取引等を行うことまたは継続することを受託会社に指図することはできません。

- (a) 当該信託財産に係る先物取引等評価損。但し、有価証券オプション取引等（有価証券オプション取引、外国有価証券市場におけるこれと類似の取引および金融先物取引法第2条第4項第3号に掲げる取引（海外金融先物市場（同条第9項に規定する海外金融先物市場をいいます。）におけるこれと類似の取引を含みます。）をいいます。（b）において同じ。）および有価証券店頭オプション取引等（有価証券店頭オプション取引、同条第5項第2号に掲げる取引および選択権付債券売買（当事者の一方が受渡日を指定できる権利を有する債券売買であって、行使期間内に受渡日の指定が行われない場合には、当該債券売買の契約が解除されるものをいいます。）をいいます。（b）において同じ。）の売付約定に係るものを除きます。
- (b) 当該信託財産に係る有価証券オプション取引等および有価証券店頭オプション取引等のうち売付約定に係るものにおける原証券等（オプションの行使の対象となる一つまたは複数の有価証券もしくは有価証券指数またはこれと類似するものをいいます。）の時価とその行使価格との差額であって当該オプションの行使に伴い発生すると見込まれる損失の額から当該オプションに係る帳簿価額を控除した金額であって評価損となるもの。
- (c) 当該信託財産をもって取得し現在保有している新株予約権を表示する証券または証書に係る時価とその帳簿価額との差額であって評価損となるもの。
- (d) 当該信託財産をもって取得し現在保有しているオプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第10号の2に規定するオプションを表示する証券または証書をいいます。）に係る時価とその帳簿価額との差額であって評価損となるもの。

（参考）「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」には、

当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

1．基本方針

この投資信託は、中長期的な観点から、TOPIX（東証株価指数配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

日本の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

TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り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。）および金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（3）投資対象

この信託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。

1）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。）

（a）有価証券

（b）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、約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限りません。）

（c）金銭債権

（d）約束手形

2）次に掲げる特定資産以外の資産

（a）為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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）株券または新株引受権証券

2）国債証券

3）地方債証券

4）特別の法律により法人の発行する債券

5）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(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。) および新株予約権証券
- 12) 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ます。)
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券(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。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 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。)
- 16) 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
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 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。)

なお、上記1)の証券または証書、上記15)の証書のうち上記1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2)から上記6)までの証券、上記15)の証書のうち第2号から第6号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12)の証券および上記13)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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。)
- 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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記 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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(4) 主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

信用取引の指図は、約款第15条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。

（参考）「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

1．基本方針

この投資信託は、中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

（2）投資態度

NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。

債券組入比率は原則として高位を維持します。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り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。）ならびに金利先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（3）投資対象

この信託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。

1）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。）

（a）有価証券

（b）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、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りません。）

（c）金銭債権

（d）約束手形

2）次に掲げる特定資産以外の資産

（a）為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券
- 12) 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ます。）
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（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。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 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。）
- 16) 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
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 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。）

なお、上記1)の証券または証書、上記15)の証書のうち上記1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2)から上記6)までの証券、上記15)の証書のうち上記2)から上記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12)の証券および上記13)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前項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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

（４）主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債の転換請求および新株予約権（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号および第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。）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は、約款第17条の範囲で行います。

（参考）「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート外国株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

1．基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式を投資対象とし、中長期的に日本を除く世界の主要国の株式市場（MSCIコクサイ指数）の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

2．運用方法

（１）投資対象

日本を除く世界各国の取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とします。

（２）投資態度

株式への投資にあたっては、日本を除く世界各国の株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、MSCIコクサイ指数に連動した投資成果をめざして運用を行います。

株式の組入率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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、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および金利に係るオプション取引なら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および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（３）投資対象

この信託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。

1) 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。）

(a) 有価証券

(b) 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、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限り、）

(c) 金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6) コマーシャル・ペーパー

7) 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。）および新株予約権証券

8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

9) 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号定めるものをいいます。）

10) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（クローズド・エンド型の会社型外国投資信託証券を除きます。以下同じ。）（金融商品取引法第2条第1項第11号定めるものをいいます。）

11) 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。）

12) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

13) 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

14) 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、）

15) 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。）

なお、第1号の証券または証書および第8号の証券または証書のうち上記1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2)から上記5)までの証券および上記8)の証券または証書のうち上記2)から上記5)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。また、上記9)または上記10)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

上記 の規定にかかわらず、この信託の設定、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、前項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。

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

（４）主な投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。

投資信託証券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。

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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第18条の範囲で行います。

金利先物取引及び為替先渡取引は、約款第19条の範囲で行います。

（参考）「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

1．基本方針

この投資信託は、主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等を主要投資対象としシティ・グループ世界国債指数（除く日本）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

2．運用方法

（１）投資対象

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

（２）投資態度

公社債への投資は原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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、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および金利に係るオプション取引なら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および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。その際の実質投資比率は、原則として信託財産の純資産総額の100%以内とします。また、実質投資比率がこの上限を超過した場合には、速やかに調整するものとします。なお、ここでいう実質投資比率は、現物資産の時価総額と有価証券先物等の買建玉の時価総額の合計額から売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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。）ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができま

す。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては上記の運用ができないことがあります。

（３）投資対象

この信託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。

1) 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。）

（a）有価証券

（b）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、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りま。

（c）金銭債権

（d）約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

（a）為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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) 株券または新株引受権証書

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9) 特定目的会社に係る優先出資証券（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。）および新株予約権証券

12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号までの証券または証書の性質を有するもの

13) 投資信託また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ます。）

14) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（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または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。

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) 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

- 20) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの、
- 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 22) 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。）

なお、上記1)の証券または証書、上記12)および上記17)の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2)から上記6)までの証券ならびに上記12)および上記17)の証券または証書のうち上記2)から上記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)の証券および上記14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。

委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(4) 主な投資制限

公社債の投資割合には制限を設けません。

株式への投資は、転換社債、ならびに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号および第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。）の転換による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等は、約款15条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款16条の範囲で行います。

金利先渡取引及び為替先渡取引は、約款17条の範囲で行います。

ベンチマークについて

TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX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 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およ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、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスを義務を持ちません。
- ⑦ 株式会社東京証券取引所は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX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 上記に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドの発行また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。

NOMURA-BPI総合指数

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

当ファンドは、MSCI Inc.(以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。))が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数はMSCIが独自の所有しています。MSCIおよびMSCI指数は、MSCIおよびその関連会社のサービスマークであり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下、「SSgA」といいます。))は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI関係者は、当ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIおよびその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの発行者(SSgA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に関わらず、MSCIにより決定、作成、計算されています。MSCI関係者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの発行者(SSgA)、所有者あるいはいかなる個人または法人の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI関係者は、当ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI関係者は、当ファンドの発行者(SSgA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSgA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。))につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人または法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

シティグループ世界国債指数(除く日本)

「CITIGROUP」は、シティグループまたはシティグループ関連会社の登録商標およびサービスマークであり、世界中において使用・登録されています。シティグループ世界国債指数(除く日本)は、シティグループ・インデックスLLCによって所有・保持されています。

シティグループ世界国債指数(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))は、シティグループ・インクおよびその関連会社(以下、総称して「シティグループ」といいます。))のサービスマークであり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下、「SSgA」といいます。))が利用許諾に基づき特定の目的において使用します。当ファンドは、シティグループによって支持、保証、販売または販売促進されるものではありません。シティグループは、当ファンドの所有者、所有者となる可能性のある者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または当ファンドへの投資適合性について、明示的にも黙示的にも、何ら表明または保証するものではありません。シティグループのSSgAに対する唯一の関係は、シティグループが有する特定の情報、データおよび登録商標についての利用許諾を与えるものです。シティグループは、WGBIに関する決定、作成および計算について、SSgAまたは当ファンドを考慮することなく行いません。シティグループは、WGBIに関する決定、作成または計算において、SSgAまたは当ファンドの所有者の要望等を考慮せずに行いません。シティグループは当ファンドの価格・数量の決定、発行・販売に関する時期、または当ファンドを現金に換算する式の決定もしくは計算に関わらず、これらに責任を負いません。シティグループは、当ファンドの管理、マーケティングまたは取引に関する義務または責任を何ら負うものではありません。

シティグループは、WGBIまたはそれに含まれるいかなるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。シティグループは、WGBIまたはそれらに含まれる一切のデータの使用により、SSgA、当ファンドの所有者あるいは所有者となる可能性のある者、またはその他の者や組織が生じた結果に対して、明示的にも黙示的にも何ら保証しません。シティグループは、WGBIまたはそれに含まれる一切のデータに関して、商品性の保証や特定の目的・使用における適合性に対する一切の保証を免除されることを明示し、かつそれらに関して明示もしくは黙示の保証も行いません。以上のことに関わらず、いかなる直接的、特別な、罰則的、間接的あるいは結果的な損害(逸失利益を含む。))について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、シティグループが責任を負うことはありません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本および世界主要国の株式や公社債等に分散投資を行います。主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動す

場合がありますので、受益権のお申込者はこの点を充分にご理解頂いたうえ、当ファンドの受益権へのお申込みを行ってください。なお、当ファンドは、金融機関の預金とは異なり、元本が保証されている商品ではなく、信託財産に生じた利益および損失は、すべて当ファンドの受益者に帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクおよび留意点は以下のとおりですが、当ファンドのリスクおよび留意点を完全に網羅しておりませんのでご注意ください。また、ファンドのリスクは以下に限定されるものではありません。

資産配分リスク

当ファンドは、国内外の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、市場環境に応じて決定した最適な資産配分比率に変更する運用を行います。この資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予期しない値動きをした場合、損失を被る可能性があります。

株価変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式を実質的な投資対象としていることから、株式の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。従って、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

信用リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式や公社債等を実質的な投資対象としていることから、株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。また公社債等の価格は、公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等、信用状況によって変動し、特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。従って、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式や公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、金融商品取引の相手方や受託者の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

金利変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の公社債等を実質的な投資対象としていることから、金利変動リスクを伴います。一般に、公社債等の価格は、金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します（価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。従って、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

当ファンドの実質的な投資対象である世界主要国の株式や公社債等（日本を除く）は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。一般に、主な為替相場の変動要因としては、金利変動、中央銀行等による政策金利の変更または為替介入、政治的要因等があります。

流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスク

があり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって解約金の支払いに対応する場合があります、その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

投資対象国への投資リスク

当ファンドが実質的に保有する有価証券の発行国（投資対象国）における政治不安や社会不安、あるいは他国との外交関係の悪化などの要因により、投資成果に大きく影響することがあります。また、投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の有価証券への投資に悪影響が及ぶ可能性があります。

デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

パッシブ運用のリスク

当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドは各々パッシブ運用を採用しています。パッシブ運用とは、ベンチマーク（参考指数）とするインデックスと連動する投資成果を目指す運用手法であり、ファンド・マネジャーが経済情勢、市場分析等に基づき個別銘柄の売買を行うことによりインデックスを上回る投資成果を目指すアクティブ運用とは異なります。

各マザーファンドは、投資成果をインデックスにできるだけ連動させるため、原則としてポートフォリオにおける時価構成をインデックスにおける銘柄別時価構成比に近づけるように投資対象銘柄の売買を行います。ただし、インデックス採用銘柄の変更や資本異動等によりポートフォリオの調整が行われる場合等、個別銘柄の売買等にあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があるため、基準価額の変動率がインデックスの変動率に一致せず、ファンドの投資成果がインデックスの投資成果に連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

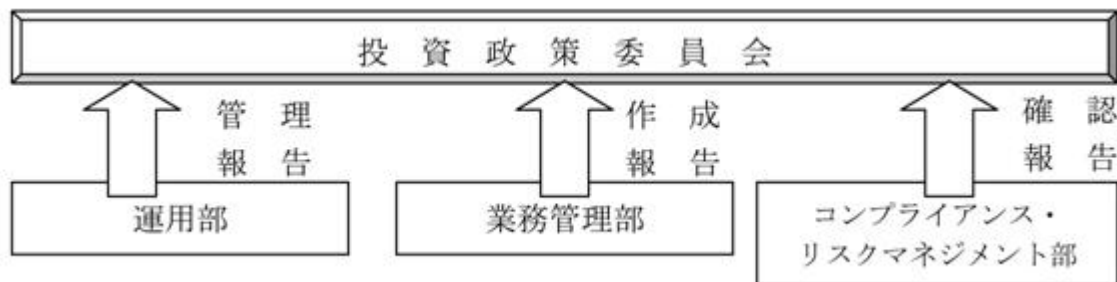
ファミリーファンド方式のリスク

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のファンド（ベビーファンド）に追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあり、これにより、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

（２）その他の留意点

当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。

（３）リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

お申込み手数料は、販売会社がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額に乗じて得た額とします。お申込み手数料には消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）がかかります。

なお、現在申込可能な販売会社では、無手数料です。

分配金を再投資する場合の手数料は、無手数料とします。

償還乗換えでこのファンドをお申込みになる場合（以下「償還乗換え」といいます。）には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額と元本のいずれか大きい額とします。）で取得する口数については上記手数料を無料とします。

「償還乗換え」とは、取得申込み日の属する月の前3ヵ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託および延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込み日の属する月の前3ヵ月以内における受益権の買取請求による売却代金および一部解約金を含みます。）をもって、その支払いを行った販売会社でこのファンドをお申込みいただく場合をいいます。なお、償還乗換えの際に償還金等の支払いを受けたことを証する書類を提示いただくことがあります。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料は、ありません。

ただし、換金（解約）時に信託財産留保額（換金申込日の翌営業日の基準価額に0.05%を乗じて得た額）が差し引かれます。

(3) 【信託報酬等】

当ファンドから支払われる信託報酬は、以下の合計額とします。

- 以下の支払先が行う当ファンドに関する業務の対価として、当ファンドの信託財産の計算期間を通じて毎日、以下の支払先に対してそれぞれ以下の額

支払先	報酬額
委託会社	信託財産の純資産総額の年率0.63%（税抜0.60%）相当額

販売会社	信託財産の純資産総額の年率0.105%（税抜0.10%）相当額
受託会社	信託財産の純資産総額の年率0.0525%（税抜0.05%）相当額
合計	信託財産の純資産総額の年率0.7875%（税抜0.75%）相当額

・マザーファンドで有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料のうち当ファンドに属するとみなした額の100分の50以内の額

上記の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

上記の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

上記において信託財産に属するとみなした額とは、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品貸料の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。（信託約款第38条）。

信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

上記に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託者の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。

ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。その他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。

信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われ、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10.147%の税率により源泉徴収が行われます。なお、上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7.147%の税率は平成26年1月1日以後、15.315%（所得税15.315%）となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記の内容は、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合等には変更となることがあります。

なお、益金不算入制度は適用されません。

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】

(1)【投資状況】

(平成25年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	287,268,845	95.23
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		14,387,969	4.77
純資産総額		301,656,814	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド)

(平成25年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	232,724,014,160	97.44
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		6,111,560,420	2.56
純資産総額		238,835,574,580	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド)

(平成25年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	155,188,289,400	79.18
特殊債券	日本	17,257,677,802	8.80
地方債証券	日本	12,517,052,652	6.39
社債券	日本	10,731,391,470	5.48
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		293,837,496	0.15
純資産総額		195,988,248,820	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(平成25年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	89,956,953,564	54.90
	イギリス	15,541,204,030	9.48
	カナダ	7,758,557,335	4.73
	スイス	6,562,890,312	4.01
	フランス	6,413,365,714	3.91
	オーストラリア	6,135,151,233	3.74
	ドイツ	6,010,219,239	3.67
	スウェーデン	2,352,095,851	1.44
	香港	2,176,845,176	1.33
	スペイン	1,966,285,314	1.20
	オランダ	1,707,970,888	1.04
	イタリア	1,400,429,926	0.85
	シンガポール	1,209,717,587	0.74
	ベルギー	857,449,070	0.52
	デンマーク	832,117,715	0.51
	ノルウェー	656,034,001	0.40
	フィンランド	554,236,363	0.34

（平成25年3月29日現在）

種類	国/地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
	イスラエル	386,767,692	0.24
	オーストリア	193,587,359	0.12
	アイルランド	191,323,804	0.12
	ポルトガル	124,461,773	0.08
	ニュージーランド	94,928,467	0.06
	ギリシャ	46,110,130	0.03
	小計	153,128,702,543	93.46
投資証券	アメリカ	2,496,983,552	1.52
	オーストラリア	461,293,489	0.28
	フランス	195,317,665	0.12
	イギリス	175,619,945	0.11
	香港	77,414,076	0.05
	シンガポール	66,845,399	0.04
	カナダ	38,255,999	0.02
	オランダ	19,236,793	0.01
	小計	3,530,966,918	2.15
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		7,188,854,228	4.39
純資産総額		163,848,523,689	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

平成25年3月29日現在、主要投資対象の親投資信託受益証券のうち、「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資残高はありませんので、参考情報として同親投資信託の投資状況を記載していません。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成25年3月29日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ステート・ストリート 日本債券インデックス ・マザーファンド		168,000,201	1.1477	192,823,477	1.1650	195,720,234	64.88
2	日本	親投資信託 受益証券	ステート・ストリート 日本株式インデックス ・マザーファンド		50,469,613	1.4346	72,405,906	1.5129	76,355,477	25.31
3	日本	親投資信託 受益証券	ステート・ストリート 外国株式インデックス ・オープン・マザー ファンド		11,589,850	1.3071	15,149,336	1.3109	15,193,134	5.04
投資比率：合計										95.23

（注1）投資有価証券は3銘柄です。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（%）
親投資信託受益証券		95.23
合計		95.23

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

<参考情報>

親投資信託受益証券（ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成25年3月29日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,088,100	4,756	9,930,105,717	4,860	10,148,166,000	4.25
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	12,146,700	531	6,444,431,685	558	6,777,858,600	2.84
3	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,371,200	3,499	4,797,924,784	3,555	4,874,616,000	2.04
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,213,100	3,835	4,652,517,513	3,775	4,579,452,500	1.92
5	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	20,707,300	206	4,257,006,734	199	4,120,752,700	1.73
6	日本	株式	キヤノン	電気機器	1,009,600	3,358	3,390,186,320	3,400	3,432,640,000	1.44
7	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	771,500	3,526	2,720,008,115	4,340	3,348,310,000	1.40
8	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	637,600	4,943	3,151,382,632	5,030	3,207,128,000	1.34
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,011,900	3,085	3,121,984,713	3,000	3,035,700,000	1.27
10	日本	株式	三菱地所	不動産業	1,123,000	2,499	2,806,691,440	2,596	2,915,308,000	1.22
11	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	675,300	4,294	2,899,663,917	4,105	2,772,106,500	1.16
12	日本	株式	ファナック	電気機器	169,200	14,033	2,374,456,356	14,490	2,451,708,000	1.03
13	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	299,700	7,254	2,173,915,908	7,720	2,313,684,000	0.97
14	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,251,600	1,811	2,266,722,696	1,743	2,181,538,800	0.91
15	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,902,000	519	2,026,386,640	543	2,118,786,000	0.89
16	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	671,000	2,812	1,887,019,750	3,115	2,090,165,000	0.88
17	日本	株式	三井不動産	不動産業	756,000	2,459	1,859,185,440	2,639	1,995,084,000	0.84
18	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	377,800	5,110	1,930,576,890	5,060	1,911,668,000	0.80
19	日本	株式	信越化学工業	化学	305,300	5,610	1,712,772,689	6,250	1,908,125,000	0.80
20	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	3,279,100	557	1,824,950,314	577	1,892,040,700	0.79
21	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	13,216	143,856	1,901,205,653	142,100	1,877,993,600	0.79
22	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	2,053,000	946	1,943,143,970	905	1,857,965,000	0.78
23	日本	株式	三井物産	卸売業	1,384,500	1,354	1,874,696,070	1,313	1,817,848,500	0.76
24	日本	株式	小松製作所	機械	793,700	2,260	1,793,531,827	2,249	1,785,031,300	0.75
25	日本	株式	KDDI	情報・通信業	452,600	3,489	1,579,306,966	3,870	1,751,562,000	0.73
26	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	533,400	2,945	1,570,724,316	3,170	1,690,878,000	0.71
27	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	7,193,000	248	1,783,000,840	235	1,690,355,000	0.71
28	日本	株式	ソニー	電気機器	1,021,300	1,438	1,468,455,779	1,642	1,676,974,600	0.70
29	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	621,300	2,661	1,653,459,477	2,650	1,646,445,000	0.69
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	401,500	3,937	1,580,789,815	3,985	1,599,977,500	0.67
									投資比率：合計	35.81

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.15
	輸送用機器	10.86
	銀行業	10.50
	情報・通信業	5.97
	化学	5.49
	医薬品	5.02
	機械	4.96
	卸売業	4.77
	小売業	4.31
	陸運業	4.30
	食料品	4.07
	不動産業	3.48
	建設業	2.29
	電気・ガス業	2.21
	保険業	2.20
	サービス業	2.11
	証券、商品先物取引業	1.60
	鉄鋼	1.53
	その他製品	1.34
	精密機器	1.23
	その他金融業	1.13
	非鉄金属	0.99
	ゴム製品	0.96
	ガラス・土石製品	0.86
	繊維製品	0.79
	石油・石炭製品	0.69
	金属製品	0.63
	鉱業	0.54
	空運業	0.51
	海運業	0.33
倉庫・運輸関連業	0.28	
パルプ・紙	0.26	
水産・農林業	0.08	
合計		97.44

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX(先物) (2013年6月限)	東京証券取引所	買建	463	4,655,843,200	4,808,255,000	2.01

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成25年3月29日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	日本	国債 証券	第106回利付国 債(5年)	0.200	2017/09/20	2,800,000,000	100.42	2,812,012,000	100.35	2,809,940,000	1.43
2	日本	国債 証券	第102回利付国 債(5年)	0.300	2016/12/20	2,200,000,000	100.83	2,218,282,000	100.75	2,216,698,000	1.13
3	日本	国債 証券	第320回利付国 債(10年)	1.000	2021/12/20	2,000,000,000	103.99	2,079,800,000	104.56	2,091,380,000	1.07
4	日本	国債 証券	第264回利付国 債(10年)	1.500	2014/09/20	2,000,000,000	102.24	2,044,920,000	102.13	2,042,700,000	1.04
5	日本	国債 証券	第107回利付国 債(5年)	0.200	2017/12/20	2,000,000,000	100.42	2,008,560,000	100.35	2,007,020,000	1.02
6	日本	国債 証券	第319回利付国 債(10年)	1.100	2021/12/20	1,800,000,000	104.87	1,887,732,000	105.45	1,898,136,000	0.97
7	日本	国債 証券	第267回利付国 債(10年)	1.300	2014/12/20	1,800,000,000	102.25	1,840,536,000	102.15	1,838,772,000	0.94
8	日本	国債 証券	第308回利付国 債(10年)	1.300	2020/06/20	1,600,000,000	106.78	1,708,624,000	107.13	1,714,224,000	0.87
9	日本	国債 証券	第100回利付国 債(5年)	0.300	2016/09/20	1,700,000,000	100.82	1,714,093,000	100.72	1,712,342,000	0.87
10	日本	国債 証券	第105回利付国 債(5年)	0.200	2017/06/20	1,700,000,000	100.42	1,707,242,000	100.35	1,706,052,000	0.87
11	日本	国債 証券	第298回利付国 債(10年)	1.300	2018/12/20	1,600,000,000	106.50	1,704,128,000	106.45	1,703,344,000	0.87
12	日本	国債 証券	第310回利付国 債(10年)	1.000	2020/09/20	1,600,000,000	104.54	1,672,704,000	104.88	1,678,128,000	0.86
13	日本	国債 証券	第311回利付国 債(10年)	0.800	2020/09/20	1,600,000,000	103.04	1,648,640,000	103.42	1,654,800,000	0.84
14	日本	国債 証券	第286回利付国 債(10年)	1.800	2017/06/20	1,500,000,000	107.28	1,609,200,000	107.07	1,606,050,000	0.82
15	日本	国債 証券	第288回利付国 債(10年)	1.700	2017/09/20	1,500,000,000	107.23	1,608,450,000	107.02	1,605,330,000	0.82
16	日本	国債 証券	第285回利付国 債(10年)	1.700	2017/03/20	1,500,000,000	106.49	1,597,425,000	106.31	1,594,755,000	0.81
17	日本	国債 証券	第274回利付国 債(10年)	1.500	2015/12/20	1,500,000,000	104.06	1,561,005,000	103.90	1,558,605,000	0.80
18	日本	国債 証券	第327回利付国 債(10年)	0.800	2022/12/20	1,500,000,000	101.47	1,522,095,000	102.40	1,536,000,000	0.78
19	日本	国債 証券	第260回利付国 債(10年)	1.600	2014/06/20	1,500,000,000	102.00	1,530,105,000	101.88	1,528,260,000	0.78
20	日本	国債 証券	第101回利付国 債(5年)	0.400	2016/12/20	1,500,000,000	101.20	1,518,120,000	101.12	1,516,935,000	0.77
21	日本	国債 証券	第103回利付国 債(5年)	0.300	2017/03/20	1,500,000,000	100.84	1,512,660,000	100.76	1,511,535,000	0.77
22	日本	国債 証券	第90回利付国債 (5年)	0.300	2015/06/20	1,500,000,000	100.59	1,508,910,000	100.54	1,508,130,000	0.77
23	日本	国債 証券	第284回利付国 債(10年)	1.700	2016/12/20	1,400,000,000	106.13	1,485,946,000	105.96	1,483,510,000	0.76
24	日本	国債 証券	第278回利付国 債(10年)	1.800	2016/03/20	1,400,000,000	105.33	1,474,704,000	105.13	1,471,862,000	0.75
25	日本	国債 証券	第270回利付国 債(10年)	1.300	2015/06/20	1,400,000,000	102.87	1,440,306,000	102.75	1,438,584,000	0.73
26	日本	国債 証券	第104回利付国 債(5年)	0.200	2017/03/20	1,400,000,000	100.44	1,406,188,000	100.37	1,405,250,000	0.72
27	日本	国債 証券	第300回利付国 債(10年)	1.500	2019/03/20	1,300,000,000	107.81	1,401,621,000	107.82	1,401,673,000	0.72

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
28	日本	国債 証券	第305回利付国 債(10年)	1.300	2019/12/20	1,300,000,000	106.72	1,387,412,000	106.97	1,390,636,000	0.71
29	日本	国債 証券	第312回利付国 債(10年)	1.200	2020/12/20	1,300,000,000	105.96	1,377,506,000	106.30	1,381,991,000	0.71
30	日本	国債 証券	第325回利付国 債(10年)	0.800	2022/09/20	1,300,000,000	101.71	1,322,256,000	102.52	1,332,838,000	0.68
投資比率：合計											25.68

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		79.18
特殊債券		8.80
地方債証券		6.39
社債券		5.48
合計		99.85

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

<参考情報>

親投資信託受益証券（ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成25年3月29日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	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	62,608	55,429	3,470,318,115	41,629	2,606,330,438	1.59
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	303,600	8,288	2,516,141,469	8,475	2,572,963,093	1.57
3	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	698,139	1,987	1,387,395,228	2,174	1,518,058,574	0.93
4	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	214,681	6,051	1,299,077,667	6,810	1,461,994,784	0.89
5	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	130,300	9,950	1,296,426,299	11,175	1,456,105,236	0.89
6	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・ サービス	71,461	18,013	1,287,255,327	20,061	1,433,569,473	0.87
7	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	184,521	6,510	1,201,257,727	7,668	1,414,887,930	0.86
8	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	504,283	2,535	1,278,179,645	2,691	1,356,909,820	0.83
9	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	490,095	2,337	1,145,421,853	2,714	1,330,256,526	0.81

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	181,979	6,536	1,189,501,184	7,247	1,318,891,528	0.80
11	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,650	65,072	1,148,525,291	74,679	1,318,075,904	0.80
12	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	378,116	3,191	1,206,612,206	3,451	1,304,762,801	0.80
13	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,225,238	903	1,106,806,004	1,006	1,232,220,631	0.75
14	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	332,951	3,119	1,038,373,617	3,479	1,158,306,396	0.71
15	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	253,074	3,877	981,102,351	4,464	1,129,624,396	0.69
16	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	46,765	18,074	845,241,833	21,923	1,025,238,448	0.63
17	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	153,112	5,719	875,629,154	6,691	1,024,478,516	0.63
18	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	268,670	3,571	959,441,660	3,803	1,021,854,641	0.62
19	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	111,233	8,496	944,984,011	8,719	969,882,294	0.59
20	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	189,999	4,139	786,432,555	4,623	878,281,302	0.54
21	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,273,549	229	749,826,039	267	874,484,618	0.53
22	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	202,374	4,205	850,977,711	4,160	841,841,739	0.51
23	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,268,844	616	781,085,140	658	835,397,803	0.51
24	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	717,348	925	663,196,475	1,146	821,742,937	0.50
25	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	195,214	3,312	646,451,258	4,161	812,240,945	0.50
26	アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品 小売り	111,284	6,662	741,325,209	7,038	783,190,250	0.48
27	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	256,623	2,995	768,470,917	3,042	780,538,614	0.48
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	102,914	6,613	680,534,828	7,440	765,710,571	0.47
29	フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	79,275	8,387	664,888,391	9,570	758,682,924	0.46
30	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	248,784	2,988	743,304,196	3,048	758,262,882	0.46
投資比率：合計										21.70

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成25年3月29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います。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	10.38
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.16

種類	業種	投資比率(%)
	銀行	7.42
	資本財	7.06
	食品・飲料・タバコ	6.81
	ソフトウェア・サービス	6.02
	素材	5.99
	各種金融	4.87
	保険	4.29
	テクノロジー・ハードウェア および機器	3.85
	電気通信サービス	3.58
	公益事業	3.37
	小売	2.87
	ヘルスケア機器・サービス	2.82
	メディア	2.72
	食品・生活必需品小売り	2.26
	家庭用品・パーソナル用品	1.89
	運輸	1.76
	消費者サービス	1.64
	耐久消費財・アパレル	1.39
	半導体・半導体製造装置	1.38
	自動車・自動車部品	1.32
	商業・専門サービス	0.93
	不動産	0.68
	小計	93.46
投資証券		2.15
	合計	95.61

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

(注2) 平成25年3月29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います。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	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	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ ドル	84	32,626,225.00	32,816,700.00	3,086,410,635	1.88
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	ユーロ	204	5,346,804.89	5,210,160.00	629,022,616	0.38
	FTSE100INDEX	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	63	4,033,754.39	4,001,130.00	572,801,770	0.35
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラ リア・ドル	25	3,152,274.99	3,104,375.00	304,011,443	0.19
	S&P 60	モントリオール取引 所	買建	カナダ・ド ル	20	2,935,243.99	2,915,600.00	269,926,248	0.16
	FSMI INDEX	ユーレックス・ チューリッヒ取引所	買建	スイス・フ ラン	35	2,688,432.00	2,692,200.00	267,066,240	0.16

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（平成25年3月29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います）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

平成25年3月29日現在、主要投資対象の親投資信託受益証券のうち、「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資残高はありませんので、参考情報として同親投資信託の投資資産を記載していません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成25年3月29日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）	1口当たりの純資産額（円）
第1期	(平成25年 2月20日)	分配付： 213,198,476	分配付： 1.0667
		分配落： 213,198,476	分配落： 1.0667
平成24年 3月末日		201,040,923	1.0053
4月末日		199,034,818	0.9953
5月末日		194,317,533	0.9717
6月末日		197,348,269	0.9869
7月末日		196,341,879	0.9818
8月末日		196,010,144	0.9802
9月末日		197,185,362	0.9866
10月末日		197,427,008	0.9878
11月末日		200,263,563	1.0020
12月末日		204,725,738	1.0243
平成25年 1月末日		210,783,467	1.0546
2月末日		213,827,867	1.0698
3月末日		301,656,814	1.0977

【分配の推移】

計算期間	一口当たりの分配金
第1期 自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	0.0000円

【収益率の推移】

計算期間	収益率
第1期 自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	6.7%

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期 自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158

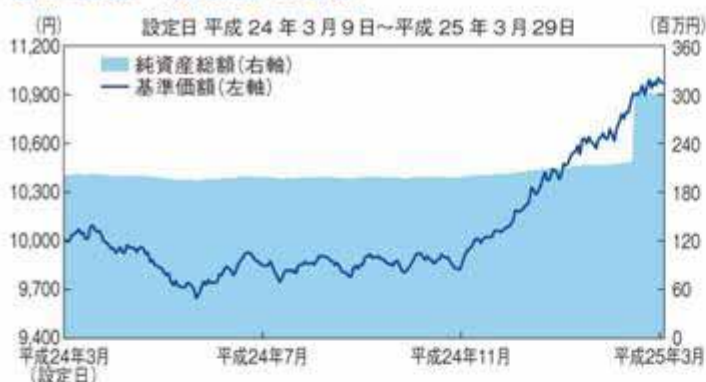
(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

< 参考情報 >

基準価額・純資産の推移

(平成 25 年 3 月 29 日現在)



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

< 基準価額・純資産総額 >

基準価額	10,977円
純資産総額	301百万円

分配の推移

該当する事項はありません。

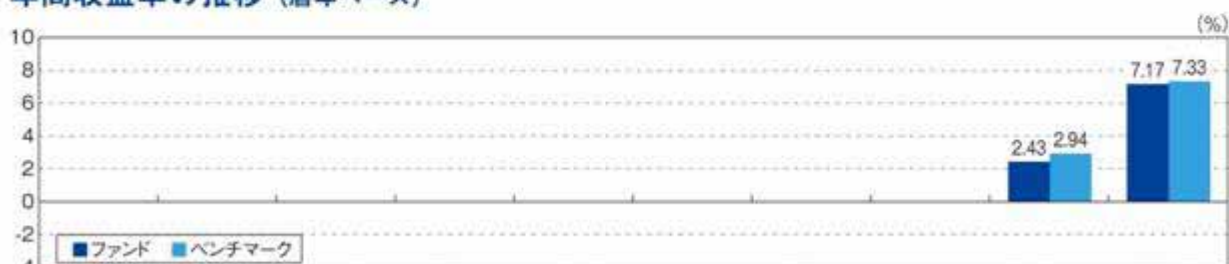
主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
ステート・ストリート日本債券 インデックス・マザーファンド	64.88%	第106回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.200%	2017/09/20	1.43%
		第102回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.300%	2016/12/20	1.13%
		第320回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.000%	2021/12/20	1.07%
ステート・ストリート日本株式 インデックス・マザーファンド	25.31%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	4.25%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.84%
		本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	—	—	2.04%
ステート・ストリート外国株式 インデックス・オープン・ マザーファンド	5.04%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	—	—	1.59%
		EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	1.57%
		GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財	—	—	0.93%

※各マザーファンドの投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する各マザーファンドの評価金額の比率であり、投資銘柄(上位3銘柄)の投資比率は、各マザーファンド純資産総額に対する各投資銘柄の評価金額の比率です。

なお、平成25年3月29日現在、「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」については投資残高がありませんので記載しておりません。

年間収益率の推移 (暦年ベース)



※ベンチマークは、株式会社エー・エム・シーが決定した資産配分に基づき、相入れマザーファンドの各ベンチマークのリターンを合成したAMCリスクバジェット型資産配分モデル指数です。

※平成25年のファンドとベンチマークの収益率は設定時から3月末までで算出しております。

※基準価額と同一基準のデータを取得できないため、設定時以前のベンチマークの収益率は記載しておりません。

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社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) お申込日が原則として米国もしくは英国の取引所 または銀行の休業日またはフランス及びドイツの両国の取引所または銀行の休業日に当たる場合を除き、営業時間内においていつでも、お申込日の翌営業日の基準価額にて申込取扱場所においてお申込みいただくことができます（信託約款第11条第3項）。この場合のお申込みの受付は、販売会社の毎営業日の午後3時までとし、この時間を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとさせていただきます。

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および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」といいます。以下同じとします。

- 2) お申込単位は、販売会社が定める単位にて受け付けます。なお、1億円または1億口を超える大口の取得の申込には、制限を設けることがあります。
- 3) ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、取得申込みを行います。なお、確定拠出年金制度のご利用による取得の申込みの場合は、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。
- 4) 取引所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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、戦争等）により市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込を取り消すことができます（信託約款第11条第7項）。
- 5) 償還乗換えでこのファンドをお申込みになる場合には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額と元本のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を無料とします。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 委託会社は、受益権の買戻しを行いません。ただし、受益者（販売会社を含みます。以下同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口以上1口単位をもって委託会社に対して一部解約の実行を請求することができます。なお、1億円または1億口を超える大口の解約請求には、制限を設けることがあります（信託約款第45条第1項）。一部解約の請求の受付は、営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 2) 受益者が、上記1)の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。（信託約款第45条第2項）。
- 3) 上記1)の規定にかかわらず、解約請求日が米国もしくは英国の取引所（または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツの両国の取引所または銀行の休業日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行を受け付けないものとします。（信託約款第45条第3項）。
- 4) 委託会社は、一部解約の申込みを受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、上記1)の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き換えに、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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます（信託約款第44条第4項）。一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目に当該受益者に支払います（信託約款第42条第4項）。
- 5) 上記4)の一部解約の価額は、解約請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- 6) 委託会社は、取引所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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天

災地変等)による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)があるときは、委託者の判断により、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および既に受け付けた第1項による一部解約の実行の請求を取り消すことができます。(信託約款第45条第6項)。

- 7) 上記5)の規定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け付けたものとして上記5)の規定に準じて計算された価額とします。(信託約款第45条第7項)。
- 8) 解約価額は、販売会社又は委託会社においてご確認ください。ご照会方法の詳細については、3(1)3)をご参照ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

1) 基準価額の算出方法

基準価額とは、算出日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び約款25条に定める借入公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法*により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（「純資産総額」）を、算出日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

* 一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。
株式	原則として、基準価額計算日*の取引所の終値で評価します。 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。

2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

(受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：<http://www.ssga.co.jp/public/nav.htm>

(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無期限ですが、下記（５）１）の理由により信託は終了します。

（４）【計算期間】

- １）当ファンドの計算期間は、毎年２月21日から翌年２月20日までとすることを原則とします（信託約款第36条第１項）。
- ２）上記１）の規定にかかわらず、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。）が休業日のときは、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（信託約款第36条２項）。

（５）【その他】

１）信託の終了

・ 信託契約の解約（信託約款第46条）

（イ）信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくは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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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。この場合において、委託者は、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。

（ロ）株式会社イー・エム・シーがベンチマークである「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」の算出および提供をしないこととなった場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させるものとします。この場合において、委託者は、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。

（ハ）委託会社は、上記（イ）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、書面決議の日なら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送します。

（ニ）上記（ハ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。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。

（ホ）上記（ハ）および上記（ニ）の書面決議は議決権を行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以上にあたる多数をもって行います。

（ヘ）上記（ハ）から上記（ホ）までの規定は、委託者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すべ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及び上記（ロ）の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。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（ハ）から上記（ホ）までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

・ 信託契約に関する監督官庁の命令（信託約款第47条第１項）

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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

・ 委託会社の登録取消等に伴う取扱い（信託約款第48条）

（イ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、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者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記2)の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

・委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い（信託約款第49条）

(イ) 委託会社は、事業の全部また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。

(ロ) 委託会社は、分割により事業の全部また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。

・受託会社の辞任および解任に伴う取扱い（信託約款第50条）

(イ) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、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、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、第51条の規定にしたがい、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) 委託者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) 信託約款の変更等（信託約款第51条）

(a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、また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またはこの信託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、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条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、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およ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（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託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以上にあたる多数をもって行います。

(e) 書面決議の効力は、この信託のすべ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すべ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) 上記の規定にかかわらず、この投資信託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。

3) 反対者の買取請求権

上記1) に規定する信託契約の解約または上記2) に規定する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または重大な約款の変更等に反対した受託者は、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る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および買取請求の手續に関する事項は、上記1) (八) または上記2) (b) に規定する書面に付記します。(信託約款第52条)。

4) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します(信託約款第54条)。

5) 募集・売出し契約の変更

委託会社と販売会社との間の募集・売出し契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年ごとに自動的に更新されます。募集・売出し契約は、当事者間の合意により変更することができます。その終了または変更は、必要に応じて運用報告書に記載する等の方法により受益者に対し通知を行う手配をしますが、必ずしもただちに受益者全員にこれを知らせるものではありません。

4【受益者の権利等】

受益権

当ファンドの受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、信託約款第6条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて取得申込者に帰属します(信託約款第5条)。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません(信託約款第8条)。

収益分配金、償還金および一部解約金の支払い

- 1) 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載また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の末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の末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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。(信託約款第42条第1項)。
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、委託会社の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と受益権の取得申込者との間に結ばれた別に定める自動けいぞく投資約款にしたがった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委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。ただし、上記2 換金(解約)手續等1)により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記1)に準じて受益者に支払います。当該売付けにより増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。(信託約款第42条第2項)。
- 3) 償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託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、当該信託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委託会社の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。(信託約款第42条第3項)。
- 4) 一部解約金は、上記2 換金(解約)手續等1)の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原

則として5営業日目から当該受益者に支払います。(信託約款第42条第4項)。

- 5) 上記1) 2) 3) に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとします。(信託約款第42条第5項)。
- 6) 収益分配金、償還金および一部解約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。(信託約款第42条第6項)。
- 7) 上記6) に規定する「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、前項に規定する「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。(信託約款第47条第7項)。
- 8) 受益者が、収益分配金については上記1) に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金について上記3) 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(信託約款第43条)。

議決権、受益者集会に関する権利

受益者には、議決権、受益者集会に関する権利はありません。

反対した受益者の買取請求権

帳簿閲覧謄写請求権

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドの第1期計算期間は、約款第36条により、平成24年3月9日から平成25年2月20日までとしております。

（3）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成24年3月9日から平成25年2月20日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (平成25年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		11,148,378
親投資信託受益証券		202,778,719
未収利息		21
流動資産合計		213,927,118
資産合計		213,927,118
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		47,945
未払委託者報酬		671,170
その他未払費用		9,527
流動負債合計		728,642
負債合計		728,642
純資産の部		
元本等		
元本	1	199,867,158
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,331,318
（分配準備積立金）		13,331,318
元本等合計		213,198,476
純資産合計		213,198,476
負債純資産合計		213,927,118

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 1 期
	自 平成24年 3月 9日
	至 平成25年 2月20日
営業収益	
受取利息	7,767
有価証券売買等損益	14,840,304
営業収益合計	14,848,071
営業費用	
受託者報酬	99,879
委託者報酬	1,398,244
その他費用	19,852
営業費用合計	1,517,975
営業利益	13,330,096
経常利益	13,330,096
当期純利益	13,330,096
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,222
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
分配金	1
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,331,318

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 (平成25年 2月20日現在)
1 期首元本額	199,976,258円
期中追加設定元本額	円
期中一部解約元本額	109,100円
2 受益権の総数	199,867,158口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期 自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,789,465円)及び費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(10,541,853円)より分配対象収益は13,331,318円(1万口当たり667円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 (平成25年 2月20日現在)
貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第1期 (平成25年 2月20日現在) 当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	14,062,386
合計	14,062,386

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成24年 3月 9日 至 平成25年 2月20日
該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 (平成25年 2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0667円 (10,667円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

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	ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド	37,868,472	53,405,906	
	ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド	120,851,648	138,423,477	
	ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	8,446,607	10,949,336	
合計		167,166,727	202,778,719	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

当ファンドは「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」及び「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」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た「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表		(単位：円)
区 分	注記 番号	(平成25年 2月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,720,105,181
株式	3	180,755,973,175
派生商品評価勘定		285,869,960
未収入金		80,880,760
未収配当金		148,952,586
未収利息		7,134
流動資産合計		184,991,788,796
資産合計		184,991,788,796
負債の部		
流動負債		
前受金		328,787,000
未払解約金		19,750,000
流動負債合計		348,537,000
負債合計		348,537,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	130,928,407,068
剰余金		
剰余金又は欠損金()		53,714,844,728
元本等合計		184,643,251,796
純資産合計		184,643,251,796
負債純資産合計		184,991,788,796

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式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、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成25年 2月20日現在)
1 期首元本額	94,280,841,691円
期中追加設定元本額	86,688,954,263円
期中一部解約元本額	50,041,388,886円
元本の内訳	
ファンド名	
AMC / ステート・ストリート・リスクバ ジェット型バランス・オープン(ステイ ブル)	37,868,472円
ステート・ストリート日本株式インデックス ・ファンド(年金1) < 適格機関投資家限定 >	2,622,282,827円
ステート・ストリート・バランスファンド VA30A < 適格機関投資家限定 >	159,837,599円
ステート・ストリート・バランスファンド VA30B < 適格機関投資家限定 >	6,166,011,661円
ステート・ストリート・バランスファンド VA40A < 適格機関投資家限定 >	19,809,549円
ステート・ストリート・バランスファンド VA40B < 適格機関投資家限定 >	77,093,356円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50A < 適格機関投資家限定 >	66,055,195円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50B < 適格機関投資家限定 >	22,167,160,879円
ステート・ストリート日本株式インデックス ・ファンドVA1 < 適格機関投資家限定 >	1,633,997,535円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50C < 適格機関投資家限定 >	256,120,942円
ステート・ストリート・バランスファンド VA25A < 適格機関投資家限定 >	6,012,419,191円
ステート・ストリート・バランスファンド VA37.5A < 適格機関投資家限定 >	2,265,427,007円
ステート・ストリート・バランスファンド VA75A < 適格機関投資家限定 >	223,882,654円
ステート・ストリート日本株式インデックス ・ファンドM < 適格機関投資家限定 >	1,413,667,747円
ステート・ストリート日本株式インデックス ・ファンドS < 適格機関投資家限定 >	49,590,024,024円
ステート・ストリート4資産バランス20VA < 適 格機関投資家限定 >	885,798,378円

ステート・ストリート4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	7,079,157,440円	
ステート・ストリート4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	1,629,623,948円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	6,997,772,018円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	1,239,284,932円	
ステート・ストリート世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	2,785,835,040円	
ステート・ストリート世界4資産バランスVA20<適格機関投資家限定>	41,047,786円	
ステート・ストリート日本株式インデックス・ファンドFOF<適格機関投資家限定>	5,736,807,472円	
ステート・ストリート・グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	44,632,144円	
ステート・ストリート・グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	68,831,130円	
ステート・ストリート4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	49,895,184円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	1,821,762,874円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	20,170,991円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	25,266,382円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA50D<適格機関投資家限定>	304,295円	
ステート・ストリート・バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	94,029,077円	
ステート・ストリート日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	3,674,349,300円	
ステート・ストリート4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	1,113,471,822円	
ステート・ストリート世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	4,908,708,217円	
計	130,928,407,068円	
2 受益権の総数	130,928,407,068口	
3 差入委託証拠金代用有価証券		先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り、差入れを行っております。
		株式
		352,975,000円

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成25年 2月20日現在)
貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>
-------------------------	---

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券		（単位：円）
種 類	（平成25年 2月20日現在）	
	当期間の損益に 含まれた評価差額	
株式		22,316,870,457
合計		22,316,870,457

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項
株式関連

（単位：円）

区分	種 類	（平成25年 2月20日現在）			
		契 約 額 等		時 価	
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX先物	3,175,931,000		3,462,100,000	286,169,000
	合 計	3,175,931,000		3,462,100,000	286,169,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又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、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。

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 5．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成24年 3月 9日 至 平成25年 2月20日
該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

（平成25年 2月20日現在）	
1口当たり純資産額	1.4103 円
（1万口当たり純資産額）	（14,103 円）

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表
株式

銘柄	株数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	65,000	209.00	13,585,000	
日本水産	163,200	179.00	29,212,800	
マルハニチロホールディングス	291,000	155.00	45,105,000	
ハウスイ	7,000	118.00	826,000	
サカタのタネ	22,400	1,163.00	26,051,200	
ホクト	15,500	1,737.00	26,923,500	
ショーボンドホールディングス	13,400	3,270.00	43,818,000	
ミライト・ホールディングス	43,100	883.00	38,057,300	
住石ホールディングス	44,600	90.00	4,014,000	
日鉄鉱業	39,000	471.00	18,369,000	
三井松島産業	100,000	189.00	18,900,000	
国際石油開発帝石	1,835	512,000.00	939,520,000	
日本海洋掘削	3,800	3,355.00	12,749,000	
関東天然瓦斯開発	15,000	497.00	7,455,000	
石油資源開発	21,600	3,625.00	78,300,000	
ダイセキ環境ソリューション	9	131,700.00	1,185,300	
間組	53,400	236.00	12,602,400	
東急建設	52,680	217.00	11,431,560	
コムシスホールディングス	73,400	1,178.00	86,465,200	
ミサワホーム	18,000	1,193.00	21,474,000	
高松コンストラクショングループ	11,500	1,355.00	15,582,500	
東建コーポレーション	5,670	5,080.00	28,803,600	
ヤマウラ	6,500	273.00	1,774,500	
大成建設	764,000	263.00	200,932,000	
大林組	453,000	467.00	211,551,000	
清水建設	462,000	288.00	133,056,000	
飛鳥建設	89,300	106.00	9,465,800	
長谷工コーポレーション	945,500	80.00	75,640,000	
松井建設	16,000	347.00	5,552,000	
鹿島建設	664,000	266.00	176,624,000	
不動テトラ	107,600	174.00	18,722,400	
大末建設	40,000	65.00	2,600,000	
鉄建建設	88,000	118.00	10,384,000	
安藤建設	50,000	124.00	6,200,000	
太平工業	26,000	366.00	9,516,000	
西松建設	187,000	167.00	31,229,000	
三井住友建設	212,300	75.00	15,922,500	
大豊建設	42,000	119.00	4,998,000	
前田建設工業	93,000	354.00	32,922,000	
佐田建設	48,000	83.00	3,984,000	
ナカノフドー建設	11,500	283.00	3,254,500	
奥村組	134,000	390.00	52,260,000	
大和小田急建設	5,500	200.00	1,100,000	
東鉄工業	19,800	1,336.00	26,452,800	
イチケン	16,000	175.00	2,800,000	
浅沼組	42,000	73.00	3,066,000	
戸田建設	176,000	208.00	36,608,000	
熊谷組	111,000	102.00	11,322,000	
青木あすなろ建設	7,500	530.00	3,975,000	

北野建設	33,000	223.00	7,359,000	
植木組	17,000	190.00	3,230,000	
三井ホーム	19,000	496.00	9,424,000	
矢作建設工業	18,500	419.00	7,751,500	
ピーエス三菱	8,700	520.00	4,524,000	
大東建託	57,300	8,350.00	478,455,000	
新日本建設	16,500	246.00	4,059,000	
NIPPO	35,000	1,224.00	42,840,000	
東亜道路工業	28,000	322.00	9,016,000	
前田道路	43,000	1,351.00	58,093,000	
日本道路	45,000	396.00	17,820,000	
東亜建設工業	133,000	139.00	18,487,000	
若築建設	56,000	109.00	6,104,000	
東洋建設	47,500	293.00	13,917,500	
五洋建設	180,000	224.00	40,320,000	
大林道路	17,000	372.00	6,324,000	
世紀東急工業	55,000	95.00	5,225,000	
福田組	22,000	363.00	7,986,000	
住友林業	104,100	895.00	93,169,500	
日本基礎技術	18,000	319.00	5,742,000	
日成ビルド工業	44,000	187.00	8,228,000	
エス・バイ・エル	78,000	159.00	12,402,000	
バコーポレーション	20,300	327.00	6,638,100	
パナホーム	57,000	579.00	33,003,000	
大和ハウス工業	376,000	1,671.00	628,296,000	
ライト工業	34,300	446.00	15,297,800	
積水ハウス	453,000	1,049.00	475,197,000	
日特建設	5,200	375.00	1,950,000	
北陸電気工事	8,000	279.00	2,232,000	
ユアテック	23,000	293.00	6,739,000	
西部電気工業	12,000	400.00	4,800,000	
四電工	13,000	311.00	4,043,000	
中電工	22,000	932.00	20,504,000	
関電工	69,000	440.00	30,360,000	
きんでん	100,000	620.00	62,000,000	
東京エネシス	15,000	458.00	6,870,000	
トーエネック	22,000	469.00	10,318,000	
住友電設	10,600	1,178.00	12,486,800	
日本電設工業	28,000	928.00	25,984,000	
協和エクシオ	54,400	997.00	54,236,800	
新日本空調	9,700	499.00	4,840,300	
日本工営	48,000	327.00	15,696,000	
NDS	21,000	282.00	5,922,000	
九電工	24,000	458.00	10,992,000	
三機工業	35,000	497.00	17,395,000	
日揮	152,000	2,427.00	368,904,000	
中外炉工業	49,000	242.00	11,858,000	
ヤマト	13,000	304.00	3,952,000	
太平電業	18,000	531.00	9,558,000	
高砂熱学工業	43,300	682.00	29,530,600	
三晃金属工業	16,000	239.00	3,824,000	

NECネットエスアイ	12,600	1,671.00	21,054,600	
朝日工業社	14,000	301.00	4,214,000	
アタカ大機	8,000	333.00	2,664,000	
大気社	21,600	1,928.00	41,644,800	
ダイダン	21,000	507.00	10,647,000	
日比谷総合設備	18,700	1,017.00	19,017,900	
東芝プラントシステム	25,000	1,197.00	29,925,000	
日本製粉	93,000	399.00	37,107,000	
日清製粉グループ本社	137,000	1,137.00	155,769,000	
日東富士製粉	12,000	312.00	3,744,000	
昭和産業	63,000	297.00	18,711,000	
鳥越製粉	11,500	625.00	7,187,500	
協同飼料	52,000	107.00	5,564,000	
中部飼料	12,800	549.00	7,027,200	
日本配合飼料	38,000	119.00	4,522,000	
東洋精糖	23,000	100.00	2,300,000	
日本甜菜製糖	78,000	173.00	13,494,000	
三井製糖	60,000	318.00	19,080,000	
ネクスト	6,100	1,051.00	6,411,100	
日本M&Aセンター	7,300	3,210.00	23,433,000	
ノバレーゼ	28	57,600.00	1,612,800	
アコーディア・ゴルフ	619	82,000.00	50,758,000	
タケエイ	1,500	2,591.00	3,886,500	
パソナグループ	135	45,000.00	6,075,000	
リンクアンドモチベーション	59	43,650.00	2,575,350	
GCAサヴィアングループ	6,100	874.00	5,331,400	
エス・エム・エス	38	207,600.00	7,888,800	
テンプホールディングス	19,300	1,388.00	26,788,400	
クックパッド	4,200	3,110.00	13,062,000	
エスクリ	2,600	696.00	1,809,600	
森永製菓	148,000	197.00	29,156,000	
中村屋	35,000	414.00	14,490,000	
江崎グリコ	55,000	894.00	49,170,000	
名糖産業	6,400	978.00	6,259,200	
不二家	87,000	196.00	17,052,000	
山崎製パン	111,000	1,087.00	120,657,000	
第一屋製パン	16,000	86.00	1,376,000	
モロゾフ	23,000	296.00	6,808,000	
亀田製菓	8,500	2,179.00	18,521,500	
カルビー	13,700	8,100.00	110,970,000	
森永乳業	128,000	284.00	36,352,000	
ヤクルト本社	88,300	3,365.00	297,129,500	
明治ホールディングス	44,700	3,910.00	174,777,000	
雪印メグミルク	29,700	1,443.00	42,857,100	
プリマハム	86,000	176.00	15,136,000	
日本ハム	115,000	1,396.00	160,540,000	
伊藤ハム	83,000	438.00	36,354,000	
林兼産業	47,000	77.00	3,619,000	
丸大食品	73,000	305.00	22,265,000	
米久	12,700	946.00	12,014,200	
S Foods	9,000	899.00	8,091,000	

学情	3,200	321.00	1,027,200	
スタジオアリス	6,400	1,262.00	8,076,800	
シミックホールディングス	5,100	1,442.00	7,354,200	
システナ	139	82,200.00	11,425,800	
NECフィールディング	11,600	1,073.00	12,446,800	
新日鉄住金ソリューションズ	9,000	1,759.00	15,831,000	
総合警備保障	51,400	1,231.00	63,273,400	
日本駐車場開発	1,387	5,780.00	8,016,860	
コア	4,900	739.00	3,621,100	
カカクコム	19,200	3,540.00	67,968,000	
アイロムホールディングス	262	5,920.00	1,551,040	
ルネサンス	6,100	700.00	4,270,000	
新日本科学	8,000	462.00	3,696,000	
ツクイ	6,100	1,638.00	9,991,800	
エムスリー	333	162,000.00	53,946,000	
ベストプライダル	42	117,900.00	4,951,800	
ディー・エヌ・エー	69,400	2,574.00	178,635,600	
博報堂DYホールディングス	19,530	6,820.00	133,194,600	
ぐるなび	9,400	962.00	9,042,800	
一休	84	84,700.00	7,114,800	
ジャパンベストレスキューシステム	14	82,500.00	1,155,000	
ジェイコムホールディングス	2,600	720.00	1,872,000	
PGMホールディングス	201	69,700.00	14,009,700	
バリューコマース	41	62,800.00	2,574,800	
サッポロホールディングス	248,000	316.00	78,368,000	
アサヒグループホールディングス	303,500	2,286.00	693,801,000	
キリンホールディングス	646,000	1,291.00	833,986,000	
宝ホールディングス	119,000	806.00	95,914,000	
オエノンホールディングス	38,000	245.00	9,310,000	
養命酒製造	11,000	784.00	8,624,000	
三国コカ・コーラボトリング	15,900	975.00	15,502,500	
コカ・コーラウエスト	51,200	1,529.00	78,284,800	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	19,000	1,260.00	23,940,000	
ダイドードリンコ	7,700	3,890.00	29,953,000	
伊藤園	41,100	1,862.00	76,528,200	
キーコーヒー	13,300	1,578.00	20,987,400	
ユニカフェ	3,800	530.00	2,014,000	
ジャパンフーズ	2,000	983.00	1,966,000	
日清オイリオグループ	66,000	328.00	21,648,000	
不二製油	36,800	1,343.00	49,422,400	
J-オイルミルズ	64,000	282.00	18,048,000	
ローソン	50,400	7,180.00	361,872,000	
サンエー	5,100	3,860.00	19,686,000	
キリン堂	4,200	664.00	2,788,800	
ダイユーエイト	2,400	645.00	1,548,000	
カワチ薬品	9,300	1,887.00	17,549,100	
エービーシー・マート	15,800	3,355.00	53,009,000	
ハードオフコーポレーション	6,300	646.00	4,069,800	
高千穂交易	5,500	909.00	4,999,500	
アスクル	11,500	1,249.00	14,363,500	
ゲオホールディングス	229	91,300.00	20,907,700	

ポイント	12,300	3,240.00	39,852,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	16,000	82.00	1,312,000	
伊藤忠食品	3,300	3,220.00	10,626,000	
くらコーポレーション	7,500	1,288.00	9,660,000	
キャンドゥ	70	120,400.00	8,428,000	
エレマテック	4,500	1,275.00	5,737,500	
パル	3,900	4,265.00	16,633,500	
JALUX	3,700	901.00	3,333,700	
エディオン	57,900	401.00	23,217,900	
あらた	29,000	336.00	9,744,000	
サーラコーポレーション	11,400	488.00	5,563,200	
トーマンデバイス	2,000	1,792.00	3,584,000	
J Pホールディングス	4,100	1,239.00	5,079,900	
あみやき亭	21	202,000.00	4,242,000	
東京エレクトロン デバイス	25	148,400.00	3,710,000	
ひらまつ	44	182,800.00	8,043,200	
双日	838,700	140.00	117,418,000	
ゲンキー	1,000	2,038.00	2,038,000	
アルフレッサ ホールディングス	34,400	4,515.00	155,316,000	
大黒天物産	2,600	2,281.00	5,930,600	
ハニーズ	10,650	1,149.00	12,236,850	
キッコーマン	123,000	1,383.00	170,109,000	
味の素	398,000	1,203.00	478,794,000	
キューピー	76,900	1,241.00	95,432,900	
ハウス食品	53,200	1,466.00	77,991,200	
カゴメ	54,300	1,723.00	93,558,900	
焼津水産化学工業	7,000	805.00	5,635,000	
アリアケジャパン	13,800	1,772.00	24,453,600	
ニチレイ	169,000	481.00	81,289,000	
横浜冷凍	33,200	679.00	22,542,800	
東洋水産	70,000	2,795.00	195,650,000	
日清食品ホールディングス	59,000	3,670.00	216,530,000	
永谷園	14,000	881.00	12,334,000	
フジッコ	16,000	1,055.00	16,880,000	
ロック・フィールド	8,000	1,553.00	12,424,000	
日本たばこ産業	669,200	2,895.00	1,937,334,000	
ケンコーマヨネーズ	4,500	873.00	3,928,500	
わらべや日洋	9,200	1,483.00	13,643,600	
なとり	6,900	916.00	6,320,400	
片倉工業	17,900	876.00	15,680,400	
ゲンゼ	106,000	236.00	25,016,000	
ヒューリック	172,500	640.00	110,400,000	
神栄	17,000	120.00	2,040,000	
山下医科器械	1,200	1,369.00	1,642,800	
ラサ商事	5,900	480.00	2,832,000	
アルペン	10,300	1,678.00	17,283,400	
クオール	4,200	838.00	3,519,600	
アルコニックス	3,600	1,642.00	5,911,200	
ビックカメラ	508	46,350.00	23,545,800	
D C Mホールディングス	69,100	629.00	43,463,900	
Monotaro	9,000	3,555.00	31,995,000	

あい ホールディングス	23,900	713.00	17,040,700	
J. フロント リテイリング	314,000	550.00	172,700,000	
ドトール・日レスホールディングス	23,400	1,289.00	30,162,600	
マツモトキヨシホールディングス	22,500	2,447.00	55,057,500	
ブロンコビリー	900	2,365.00	2,128,500	
スタートトゥデイ	27,700	968.00	26,813,600	
物語コーポレーション	1,900	2,125.00	4,037,500	
ココカラファイン	13,900	2,962.00	41,171,800	
三越伊勢丹ホールディングス	264,300	969.00	256,106,700	
東洋紡	597,000	167.00	99,699,000	
ユニチカ	228,000	52.00	11,856,000	
富士紡ホールディングス	68,000	277.00	18,836,000	
日清紡ホールディングス	90,000	662.00	59,580,000	
倉敷紡績	146,000	158.00	23,068,000	
ダイワボウホールディングス	122,000	184.00	22,448,000	
シキボウ	82,000	115.00	9,430,000	
日東紡績	104,000	354.00	36,816,000	
トヨタ紡織	47,200	1,290.00	60,888,000	
ウエルシアホールディングス	4,700	4,030.00	18,941,000	
クリエイトSDホールディングス	5,700	2,958.00	16,860,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,200	852.00	21,470,400	
八洲電機	9,700	386.00	3,744,200	
U K Cホールディングス	8,000	1,932.00	15,456,000	
丸善CHIホールディングス	6,500	257.00	1,670,500	
T O K A Iホールディングス	52,500	295.00	15,487,500	
日本毛織	45,000	621.00	27,945,000	
大東紡織	23,000	68.00	1,564,000	
トーア紡コーポレーション	64,000	69.00	4,416,000	
ダイドーリミテッド	15,100	663.00	10,011,300	
東京建物不動産販売	6,000	351.00	2,106,000	
三栄建築設計	3,300	900.00	2,970,000	
野村不動産ホールディングス	63,900	1,577.00	100,770,300	
常和ホールディングス	2,300	1,761.00	4,050,300	
帝国繊維	14,000	761.00	10,654,000	
ブックオフコーポレーション	7,300	687.00	5,015,100	
日本コークス工業	115,500	123.00	14,206,500	
ミタチ産業	2,200	450.00	990,000	
あさひ	7,400	1,243.00	9,198,200	
日本調剤	1,550	2,300.00	3,565,000	
コスモス薬品	6,700	10,900.00	73,030,000	
シップヘルスケアホールディングス	19,100	2,513.00	47,998,300	
一六堂	1,200	492.00	590,400	
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	1,455.00	1,600,500	
セブン&アイ・ホールディングス	556,200	2,815.00	1,565,703,000	
ツルハホールディングス	13,000	8,080.00	105,040,000	
サンマルクホールディングス	4,300	3,655.00	15,716,500	
フェリシモ	3,500	1,100.00	3,850,000	
トリドール	11,000	937.00	10,307,000	
クスリのアオキ	1,900	6,060.00	11,514,000	
帝人	536,000	218.00	116,848,000	
東レ	1,092,000	565.00	616,980,000	

クラレ	240,300	1,233.00	296,289,900	
旭化成	880,000	564.00	496,320,000	
サカイオーベックス	34,000	134.00	4,556,000	
稲葉製作所	5,800	1,091.00	6,327,800	
宮地エンジニアリンググループ	45,000	159.00	7,155,000	
トーカロ	7,600	1,403.00	10,662,800	
アルファC o	4,700	1,081.00	5,080,700	
SUMCO	86,400	926.00	80,006,400	
川田テクノロジーズ	2,900	1,816.00	5,266,400	
住江織物	37,000	214.00	7,918,000	
日本フェルト	7,800	422.00	3,291,600	
イチカワ	7,000	164.00	1,148,000	
日本バイリーン	17,000	429.00	7,293,000	
エコナックホールディングス	23,000	47.00	1,081,000	
日東製網	17,000	135.00	2,295,000	
芦森工業	32,000	133.00	4,256,000	
アツギ	120,000	110.00	13,200,000	
ダイニック	26,000	178.00	4,628,000	
共和レザー	8,500	294.00	2,499,000	
セーレン	38,200	563.00	21,506,600	
東海染工	21,000	106.00	2,226,000	
小松精練	23,000	393.00	9,039,000	
ワコールホールディングス	84,000	951.00	79,884,000	
ホギメディカル	8,900	4,690.00	41,741,000	
レナウン	30,700	144.00	4,420,800	
クラウドディア	1,100	1,220.00	1,342,000	
T S Iホールディングス	73,000	487.00	35,551,000	
デジタルハーツ	2,200	687.00	1,511,400	
I Tホールディングス	44,200	1,124.00	49,680,800	
ネオス	23	57,000.00	1,311,000	
電算システム	1,200	1,277.00	1,532,400	
グリー	68,700	1,142.00	78,455,400	
コーエーテクモホールディングス	26,500	797.00	21,120,500	
三菱総合研究所	4,900	1,884.00	9,231,600	
ボルテージ	1,600	897.00	1,435,200	
K L a b	3,700	451.00	1,668,700	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	1,399.00	2,518,200	
ネクソン	109,500	883.00	96,688,500	
アイスタイル	2,800	606.00	1,696,800	
エイチーム	900	2,705.00	2,434,500	
特種東海製紙	83,000	214.00	17,762,000	
ドワンゴ	69	233,400.00	16,104,600	
ベリサーブ	6	143,000.00	858,000	
マクロミル	10,500	1,007.00	10,573,500	
ティーガイア	16,700	962.00	16,065,400	
GMOペイメントゲートウェイ	4,300	1,671.00	7,185,300	
ザッパラス	71	98,300.00	6,979,300	
インターネットイニシアティブ	15,600	2,531.00	39,483,600	
S R Aホールディングス	6,200	997.00	6,181,400	
朝日ネット	10,000	429.00	4,290,000	

王子ホールディングス	624,000	339.00	211,536,000	
三菱製紙	203,000	93.00	18,879,000	
北越紀州製紙	88,000	475.00	41,800,000	
中越バルブ工業	53,000	146.00	7,738,000	
巴川製紙所	21,000	157.00	3,297,000	
大王製紙	60,000	638.00	38,280,000	
日本製紙グループ本社	68,200	1,461.00	99,640,200	
レンゴー	114,000	460.00	52,440,000	
トーモク	45,000	266.00	11,970,000	
ザ・バック	10,100	1,611.00	16,271,100	
コープケミカル	22,000	112.00	2,464,000	
昭和電工	878,000	132.00	115,896,000	
住友化学	970,000	279.00	270,630,000	
日本化成	24,000	143.00	3,432,000	
住友精化	25,000	326.00	8,150,000	
日産化学工業	100,300	1,168.00	117,150,400	
ラサ工業	49,000	119.00	5,831,000	
クレハ	99,000	349.00	34,551,000	
テイカ	23,000	269.00	6,187,000	
石原産業	255,000	83.00	21,165,000	
片倉チッカリン	7,000	223.00	1,561,000	
日本曹達	84,000	412.00	34,608,000	
東ソー	378,000	241.00	91,098,000	
トクヤマ	206,000	222.00	45,732,000	
セントラル硝子	126,000	285.00	35,910,000	
東亜合成	166,000	389.00	64,574,000	
ダイソー	57,000	267.00	15,219,000	
関東電化工業	34,000	176.00	5,984,000	
電気化学工業	283,000	340.00	96,220,000	
イビデン	82,100	1,376.00	112,969,600	
信越化学工業	253,000	5,740.00	1,452,220,000	
日本カーバイド工業	42,000	394.00	16,548,000	
堺化学工業	53,000	259.00	13,727,000	
エア・ウォーター	116,000	1,252.00	145,232,000	
大陽日酸	186,000	652.00	121,272,000	
日本化学工業	52,000	120.00	6,240,000	
日本パーカライジング	33,000	1,516.00	50,028,000	
高圧ガス工業	20,000	507.00	10,140,000	
チタン工業	15,000	227.00	3,405,000	
四国化成工業	21,000	632.00	13,272,000	
戸田工業	20,000	328.00	6,560,000	
ステラ ケミファ	5,900	1,771.00	10,448,900	
保土谷化学工業	31,000	172.00	5,332,000	
日本触媒	103,000	884.00	91,052,000	
大日精化工業	51,000	427.00	21,777,000	
カネカ	176,000	499.00	87,824,000	
協和発酵キリン	169,000	907.00	153,283,000	
三菱瓦斯化学	223,000	644.00	143,612,000	
三井化学	599,000	208.00	124,592,000	
J S R	139,200	1,976.00	275,059,200	
東京応化工業	27,400	1,947.00	53,347,800	

大阪有機化学工業	9,500	379.00	3,600,500	
三菱ケミカルホールディングス	882,500	416.00	367,120,000	
日本合成化学工業	29,000	696.00	20,184,000	
ダイセル	168,000	718.00	120,624,000	
住友ベークライト	110,000	387.00	42,570,000	
積水化学工業	290,000	889.00	257,810,000	
日本ゼオン	122,000	896.00	109,312,000	
アイカ工業	39,700	1,546.00	61,376,200	
宇部興産	676,000	190.00	128,440,000	
積水樹脂	20,000	1,146.00	22,920,000	
タキロン	33,000	347.00	11,451,000	
旭有機材工業	48,000	211.00	10,128,000	
日立化成	61,100	1,333.00	81,446,300	
ニチバン	13,000	316.00	4,108,000	
リケンテクノス	22,000	264.00	5,808,000	
大倉工業	33,000	422.00	13,926,000	
積水化成品工業	35,000	218.00	7,630,000	
群栄化学工業	37,000	221.00	8,177,000	
タイガースポリマー	7,300	335.00	2,445,500	
ミライアル	3,600	1,764.00	6,350,400	
日本カーリット	11,200	459.00	5,140,800	
日本化薬	99,000	1,059.00	104,841,000	
イーピーエス	84	227,500.00	19,110,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	3,100	1,996.00	6,187,600	
フェイス	415	11,020.00	4,573,300	
アミューズ	4,100	1,817.00	7,449,700	
野村総合研究所	75,400	2,049.00	154,494,600	
ドリームインキュベータ	41	89,200.00	3,657,200	
サイバネットシステム	111	25,440.00	2,823,840	
T A C	8,800	195.00	1,716,000	
ケネディクス	1,348	20,170.00	27,189,160	
電通	128,000	2,815.00	360,320,000	
インテージ	3,800	2,091.00	7,945,800	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	9,540.00	4,770,000	
びあ	4,000	1,371.00	5,484,000	
シンプレクス・ホールディングス	238	29,810.00	7,094,780	
イオンファンタジー	4,400	1,339.00	5,891,600	
ソースネクスト	3,000	415.00	1,245,000	
ネクシィーズ	423	2,455.00	1,038,465	
メディカルシステムネットワーク	7,500	405.00	3,037,500	
日本精化	11,300	582.00	6,576,600	
A D E K A	60,900	824.00	50,181,600	
日油	110,000	422.00	46,420,000	
ミヨシ油脂	47,000	179.00	8,413,000	
ハリマ化成グループ	12,000	457.00	5,484,000	
花王	374,200	2,961.00	1,108,006,200	
第一工業製薬	26,000	233.00	6,058,000	
三洋化成工業	45,000	501.00	22,545,000	
武田薬品工業	528,500	4,790.00	2,531,515,000	
アステラス製薬	313,200	5,020.00	1,572,264,000	
大日本住友製薬	100,000	1,273.00	127,300,000	

塩野義製薬	205,700	1,803.00	370,877,100	
田辺三菱製薬	117,500	1,332.00	156,510,000	
わかもと製薬	16,000	234.00	3,744,000	
あすか製薬	16,000	599.00	9,584,000	
日本新薬	30,000	1,192.00	35,760,000	
中外製薬	163,900	2,000.00	327,800,000	
科研製薬	56,000	1,545.00	86,520,000	
エーザイ	173,700	3,905.00	678,298,500	
ロート製薬	59,000	1,172.00	69,148,000	
小野薬品工業	69,000	4,930.00	340,170,000	
久光製薬	43,800	5,210.00	228,198,000	
有機合成薬品工業	9,000	251.00	2,259,000	
持田製薬	53,000	1,151.00	61,003,000	
参天製薬	48,200	4,270.00	205,814,000	
扶桑薬品工業	48,000	364.00	17,472,000	
日本ケミファ	19,000	585.00	11,115,000	
ツムラ	38,500	3,200.00	123,200,000	
日医工	20,500	1,908.00	39,114,000	
テルモ	103,300	4,095.00	423,013,500	
みらかホールディングス	36,800	4,405.00	162,104,000	
キッセイ薬品工業	26,300	1,812.00	47,655,600	
生化学工業	27,100	994.00	26,937,400	
栄研化学	9,600	1,238.00	11,884,800	
日水製薬	5,700	972.00	5,540,400	
鳥居薬品	8,500	2,170.00	18,445,000	
東和薬品	7,200	5,060.00	36,432,000	
富士製薬工業	3,500	1,732.00	6,062,000	
沢井製薬	9,300	9,980.00	92,814,000	
ゼリア新薬工業	20,000	1,420.00	28,400,000	
第一三共	444,900	1,632.00	726,076,800	
キョーリン製薬ホールディングス	37,700	2,055.00	77,473,500	
大幸薬品	6,500	872.00	5,668,000	
ダイト	4,200	1,326.00	5,569,200	
大塚ホールディングス	280,000	2,963.00	829,640,000	
大正製薬ホールディングス	34,000	6,350.00	215,900,000	
大日本塗料	82,000	164.00	13,448,000	
日本ペイント	122,000	859.00	104,798,000	
関西ペイント	160,000	995.00	159,200,000	
トウペ	8,000	124.00	992,000	
中国塗料	44,000	497.00	21,868,000	
日本特殊塗料	10,900	390.00	4,251,000	
藤倉化成	16,900	376.00	6,354,400	
太陽ホールディングス	11,600	2,730.00	31,668,000	
D I C	501,000	184.00	92,184,000	
サカタインクス	28,000	505.00	14,140,000	
東洋インキS Cホールディングス	127,000	412.00	52,324,000	
アルプス技研	5,600	800.00	4,480,000	
サニックス	19,700	429.00	8,451,300	
ダイオーズ	1,800	591.00	1,063,800	
日本空調サービス	3,500	798.00	2,793,000	
オリエンタルランド	41,800	12,970.00	542,146,000	

ダスキン	38,900	1,828.00	71,109,200
パーク24	69,300	1,563.00	108,315,900
明光ネットワークジャパン	13,000	1,053.00	13,689,000
ファルコSDホールディングス	7,500	1,047.00	7,852,500
クレスコ	3,200	639.00	2,044,800
フジ・メディア・ホールディングス	1,287	151,800.00	195,366,600
秀英予備校	1,600	362.00	579,200
田谷	1,700	725.00	1,232,500
ラウンドワン	44,200	641.00	28,332,200
リゾートトラスト	23,900	1,986.00	47,465,400
オービック	4,590	19,430.00	89,183,700
TDCソフトウェアエンジニアリング	2,700	794.00	2,143,800
ヤフー	9,740	39,500.00	384,730,000
ビー・エム・エル	8,400	2,362.00	19,840,800
ワタベウェディング	4,100	766.00	3,140,600
トレンドマイクロ	52,900	2,664.00	140,925,600
もしもしホットライン	23,400	1,281.00	29,975,400
東急コミュニティー	3,700	3,505.00	12,968,500
リソー教育	1,367	8,030.00	10,977,010
日本オラクル	26,600	3,955.00	105,203,000
早稲田アカデミー	1,100	756.00	831,600
アルファシステムズ	4,400	1,130.00	4,972,000
フューチャーアーキテクト	146	37,950.00	5,540,700
ウェアハウス	2,200	299.00	657,800
シーエーシー	7,800	764.00	5,959,200
ソフトバンク・テクノロジー	2,900	909.00	2,636,100
トーセ	3,400	582.00	1,978,800
ユー・エス・エス	15,740	9,910.00	155,983,400
オービックビジネスコンサルタント	4,250	5,070.00	21,547,500
伊藤忠テクノソリューションズ	15,700	3,820.00	59,974,000
アイティフォー	14,800	344.00	5,091,200
東京個別指導学院	7,300	236.00	1,722,800
東計電算	2,200	1,249.00	2,747,800
エクスネット	9	127,400.00	1,146,600
テー・オー・ダブリュー	4,600	542.00	2,493,200
大塚商会	11,900	8,410.00	100,079,000
総合メディカル	3,300	3,030.00	9,999,000
サイボウズ	227	25,470.00	5,781,690
ソフトブレーン	196	13,250.00	2,597,000
アグレックス	3,000	849.00	2,547,000
セントラルスポーツ	4,300	1,462.00	6,286,600
電通国際情報サービス	7,900	955.00	7,544,500
EMシステムズ	2,100	1,610.00	3,381,000
ウェザーニューズ	3,400	2,296.00	7,806,400
C I J	12,100	342.00	4,138,200
WOWOW	40	203,600.00	8,144,000
フルキャストホールディングス	119	14,700.00	1,749,300
富士フイルムホールディングス	301,400	1,796.00	541,314,400
コニカミノルタホールディングス	356,000	701.00	249,556,000
資生堂	251,100	1,260.00	316,386,000
ライオン	163,000	475.00	77,425,000

高砂香料工業	47,000	496.00	23,312,000	
マンダム	15,200	2,854.00	43,380,800	
ミルボン	7,000	3,035.00	21,245,000	
ファンケル	35,600	1,035.00	36,846,000	
コーセー	25,400	2,008.00	51,003,200	
ドクターシーラボ	96	268,100.00	25,737,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	16,800	2,839.00	47,695,200	
ノエビアホールディングス	8,100	1,399.00	11,331,900	
エステー	8,600	992.00	8,531,200	
コニシ	10,300	1,717.00	17,685,100	
長谷川香料	18,000	1,250.00	22,500,000	
星光PMC	6,100	345.00	2,104,500	
小林製薬	21,400	4,440.00	95,016,000	
荒川化学工業	10,900	724.00	7,891,600	
メック	10,400	485.00	5,044,000	
日本高純度化学	37	226,900.00	8,395,300	
JCU	2,100	3,690.00	7,749,000	
新田ゼラチン	5,400	848.00	4,579,200	
アース製薬	10,200	2,973.00	30,324,600	
イハラケミカル工業	23,000	491.00	11,293,000	
北興化学工業	13,000	267.00	3,471,000	
大成ラミック	3,800	2,445.00	9,291,000	
クミアイ化学工業	29,000	528.00	15,312,000	
日本農薬	33,000	611.00	20,163,000	
昭和シェル石油	126,400	620.00	78,368,000	
コスモ石油	391,000	208.00	81,328,000	
富士興産	4,300	570.00	2,451,000	
ニチレキ	17,000	595.00	10,115,000	
東燃ゼネラル石油	213,000	872.00	185,736,000	
ユシロ化学工業	7,400	885.00	6,549,000	
ビービー・カストロール	6,000	382.00	2,292,000	
AOCホールディングス	32,100	349.00	11,202,900	
MORESCO	2,200	832.00	1,830,400	
出光興産	16,800	8,310.00	139,608,000	
JXホールディングス	1,565,800	552.00	864,321,600	
横浜ゴム	158,000	834.00	131,772,000	
東洋ゴム工業	118,000	378.00	44,604,000	
ブリヂストン	442,100	2,809.00	1,241,858,900	
住友ゴム工業	110,200	1,400.00	154,280,000	
藤倉ゴム工業	6,300	264.00	1,663,200	
オカモト	51,000	309.00	15,759,000	
アキレス	116,000	131.00	15,196,000	
フコク	5,400	795.00	4,293,000	
ニッタ	14,000	1,694.00	23,716,000	
クリエートメディック	4,000	820.00	3,280,000	
東海ゴム工業	26,300	1,042.00	27,404,600	
三ツ星ベルト	36,000	502.00	18,072,000	
バンドー化学	49,000	294.00	14,406,000	
鬼怒川ゴム工業	26,000	451.00	11,726,000	
旭硝子	695,000	647.00	449,665,000	
日本板硝子	644,000	118.00	75,992,000	

石塚硝子	19,000	149.00	2,831,000	
有沢製作所	21,800	335.00	7,303,000	
日本山村硝子	54,000	184.00	9,936,000	
日本電気硝子	250,000	465.00	116,250,000	
オハラ	5,400	668.00	3,607,200	
住友大阪セメント	251,000	274.00	68,774,000	
太平洋セメント	777,000	224.00	174,048,000	
デイ・シイ	14,100	308.00	4,342,800	
リゾートソリューション	12,000	188.00	2,256,000	
日本ヒューム	13,000	531.00	6,903,000	
日本コンクリート工業	23,000	306.00	7,038,000	
ジャパンパイル	10,100	595.00	6,009,500	
東海カーボン	123,000	348.00	42,804,000	
日本カーボン	75,000	190.00	14,250,000	
東洋炭素	7,900	2,248.00	17,759,200	
ノリタケカンパニーリミテド	74,000	229.00	16,946,000	
TOTO	218,000	841.00	183,338,000	
日本碍子	184,000	965.00	177,560,000	
日本特殊陶業	122,000	1,278.00	155,916,000	
ダントーホールディングス	20,000	114.00	2,280,000	
MARUWA	3,000	2,294.00	6,882,000	
品川リフラクトリーズ	34,000	206.00	7,004,000	
黒崎播磨	29,000	223.00	6,467,000	
東京窯業	15,000	168.00	2,520,000	
ニッカトー	3,700	420.00	1,554,000	
フジインコーポレーテッド	13,000	1,375.00	17,875,000	
エーアンドエーマテリアル	30,000	82.00	2,460,000	
ニチアス	63,000	517.00	32,571,000	
新日鐵住金	5,962,000	256.00	1,526,272,000	
神戸製鋼所	1,955,000	125.00	244,375,000	
中山製鋼所	52,000	60.00	3,120,000	
合同製鐵	80,000	184.00	14,720,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	359,800	2,036.00	732,552,800	
日新製鋼ホールディングス	60,000	755.00	45,300,000	
東京製鐵	78,200	491.00	38,396,200	
共英製鋼	13,300	1,663.00	22,117,900	
大和工業	29,200	2,670.00	77,964,000	
東京鐵鋼	27,000	396.00	10,692,000	
大阪製鐵	7,200	1,584.00	11,404,800	
淀川製鋼所	101,000	360.00	36,360,000	
東洋鋼鈑	29,000	316.00	9,164,000	
住友鋼管	9,300	759.00	7,058,700	
丸一鋼管	47,300	2,245.00	106,188,500	
モリ工業	21,000	275.00	5,775,000	
大同特殊鋼	218,000	461.00	100,498,000	
日本高周波鋼業	51,000	94.00	4,794,000	
日本冶金工業	105,000	124.00	13,020,000	
山陽特殊製鋼	70,000	346.00	24,220,000	
愛知製鋼	75,000	391.00	29,325,000	
日立金属	100,000	905.00	90,500,000	
日本金属	33,000	125.00	4,125,000	

大太平洋金属	90,000	506.00	45,540,000	
日本電工	56,000	308.00	17,248,000	
栗本鐵工所	62,000	321.00	19,902,000	
日本鑄鉄管	15,000	251.00	3,765,000	
日本製鋼所	218,000	496.00	108,128,000	
三菱製鋼	86,000	182.00	15,652,000	
日亜鋼業	19,000	248.00	4,712,000	
日本精線	10,000	330.00	3,300,000	
大紀アルミニウム工業所	22,000	214.00	4,708,000	
日本軽金属ホールディングス	298,000	108.00	32,184,000	
三井金属鉱業	360,000	232.00	83,520,000	
東邦亜鉛	80,000	378.00	30,240,000	
三菱マテリアル	826,000	283.00	233,758,000	
住友金属鉱山	365,000	1,511.00	551,515,000	
DOWAホールディングス	156,000	666.00	103,896,000	
古河機械金属	239,000	103.00	24,617,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	1,836.00	25,520,400	
東邦チタニウム	24,100	798.00	19,231,800	
住友軽金属工業	343,000	88.00	30,184,000	
古河スカイ	48,000	251.00	12,048,000	
古河電気工業	444,000	200.00	88,800,000	
住友電気工業	498,200	1,065.00	530,583,000	
フジクラ	227,000	269.00	61,063,000	
昭和電線ホールディングス	183,000	80.00	14,640,000	
東京特殊電線	21,000	102.00	2,142,000	
タツタ電線	26,700	654.00	17,461,800	
日立電線	111,000	153.00	16,983,000	
沖電線	15,000	134.00	2,010,000	
カナレ電気	1,700	1,316.00	2,237,200	
平河ヒューテック	2,900	850.00	2,465,000	
リョービ	80,000	240.00	19,200,000	
アサヒホールディングス	21,300	1,776.00	37,828,800	
東洋製罐	100,300	1,346.00	135,003,800	
ホッカンホールディングス	33,000	279.00	9,207,000	
コロナ	6,200	1,123.00	6,962,600	
横河ブリッジホールディングス	27,000	794.00	21,438,000	
日本橋梁	3,200	345.00	1,104,000	
駒井ハルテック	29,000	239.00	6,931,000	
高田機工	9,000	202.00	1,818,000	
三和ホールディングス	130,000	447.00	58,110,000	
文化シャッター	37,000	433.00	16,021,000	
三協立山	18,600	1,780.00	33,108,000	
東洋シャッター	3,100	498.00	1,543,800	
LIXILグループ	196,500	2,010.00	394,965,000	
日本ファイルコン	9,400	370.00	3,478,000	
ノーリツ	27,700	1,702.00	47,145,400	
長府製作所	13,600	1,885.00	25,636,000	
リンナイ	22,700	6,640.00	150,728,000	
ユニプレス	23,700	1,834.00	43,465,800	
ダイニチ工業	6,900	833.00	5,747,700	
日東精工	18,000	286.00	5,148,000	

三洋工業	17,000	179.00	3,043,000	
岡部	28,000	695.00	19,460,000	
中国工業	23,000	87.00	2,001,000	
東プレ	27,300	883.00	24,105,900	
高周波熱錬	18,400	701.00	12,898,400	
東京製綱	97,000	119.00	11,543,000	
パイオラックス	6,100	2,423.00	14,780,300	
日本発條	102,300	816.00	83,476,800	
中央発條	18,000	305.00	5,490,000	
アドバネクス	28,000	88.00	2,464,000	
三浦工業	21,000	2,266.00	47,586,000	
タクマ	48,000	624.00	29,952,000	
リブセンス	1,100	3,850.00	4,235,000	
ツガミ	38,000	520.00	19,760,000	
オークマ	92,000	690.00	63,480,000	
東芝機械	70,000	466.00	32,620,000	
アマダ	216,000	566.00	122,256,000	
アイダエンジニアリング	33,300	707.00	23,543,100	
牧野フライス製作所	66,000	619.00	40,854,000	
オーエスジー	58,100	1,263.00	73,380,300	
ダイジェット工業	17,000	155.00	2,635,000	
旭ダイヤモンド工業	34,900	877.00	30,607,300	
森精機製作所	74,500	980.00	73,010,000	
ディスコ	15,700	5,350.00	83,995,000	
日東工器	8,300	1,860.00	15,438,000	
豊田自動織機	122,700	3,250.00	398,775,000	
豊和工業	78,000	104.00	8,112,000	
大阪機工	53,000	135.00	7,155,000	
石川製作所	29,000	93.00	2,697,000	
東洋機械金属	10,500	220.00	2,310,000	
津田駒工業	33,000	177.00	5,841,000	
エンシュウ	32,000	174.00	5,568,000	
島精機製作所	18,500	1,875.00	34,687,500	
日阪製作所	18,000	849.00	15,282,000	
やまびこ	5,300	1,760.00	9,328,000	
ペガサスミシン製造	13,300	202.00	2,686,600	
ナブテスコ	69,800	1,784.00	124,523,200	
三井海洋開発	11,700	2,179.00	25,494,300	
レオン自動機	13,000	202.00	2,626,000	
S M C	42,100	15,870.00	668,127,000	
新川	11,400	458.00	5,221,200	
ホソカワミクロン	24,000	754.00	18,096,000	
ユニオンツール	7,800	1,793.00	13,985,400	
オイレス工業	14,800	1,802.00	26,669,600	
サトーホールディングス	14,800	1,530.00	22,644,000	
日本エアテック	3,100	429.00	1,329,900	
日精樹脂工業	10,000	520.00	5,200,000	
ワイエイシイ	5,300	483.00	2,559,900	
小松製作所	657,900	2,410.00	1,585,539,000	
住友重機械工業	386,000	404.00	155,944,000	
日立建機	72,100	2,190.00	157,899,000	

日工	20,000	366.00	7,320,000
巴工業	5,100	1,990.00	10,149,000
井関農機	135,000	293.00	39,555,000
TOWA	12,100	534.00	6,461,400
丸山製作所	31,000	188.00	5,828,000
北川鉄工所	60,000	153.00	9,180,000
シンニッタン	10,700	386.00	4,130,200
クボタ	753,000	1,083.00	815,499,000
荏原実業	3,300	1,300.00	4,290,000
東洋エンジニアリング	81,000	441.00	35,721,000
三菱化工機	43,000	152.00	6,536,000
月島機械	23,000	877.00	20,171,000
帝国電機製作所	4,300	1,673.00	7,193,900
東京機械製作所	31,000	81.00	2,511,000
新東工業	28,600	841.00	24,052,600
澁谷工業	8,500	862.00	7,327,000
アイチ コーポレーション	22,300	457.00	10,191,100
小森コーポレーション	34,500	913.00	31,498,500
鶴見製作所	10,000	810.00	8,100,000
住友精密工業	23,000	400.00	9,200,000
酒井重工業	27,000	280.00	7,560,000
荏原製作所	266,000	375.00	99,750,000
石井鐵工所	20,000	207.00	4,140,000
西島製作所	16,500	754.00	12,441,000
千代田化工建設	109,000	1,121.00	122,189,000
ダイキン工業	183,900	3,490.00	641,811,000
オルガノ	25,000	502.00	12,550,000
トーヨーカネツ	76,000	259.00	19,684,000
栗田工業	77,900	1,868.00	145,517,200
椿本チエイン	72,000	508.00	36,576,000
大同工業	28,000	151.00	4,228,000
日本コンベヤ	40,000	85.00	3,400,000
日機装	47,000	1,038.00	48,786,000
木村化工機	11,900	365.00	4,343,500
新興ブランテック	31,200	724.00	22,588,800
アネスト岩田	20,000	375.00	7,500,000
ダイフク	62,000	632.00	39,184,000
加藤製作所	33,000	294.00	9,702,000
油研工業	27,000	161.00	4,347,000
タダノ	65,000	926.00	60,190,000
フジテック	39,000	688.00	26,832,000
CKD	38,000	639.00	24,282,000
キトー	82	80,400.00	6,592,800
平和	29,300	1,737.00	50,894,100
理想科学工業	9,800	1,976.00	19,364,800
SANKYO	40,900	3,905.00	159,714,500
日本金銭機械	11,900	779.00	9,270,100
マースエンジニアリング	7,700	1,867.00	14,375,900
福島工業	3,800	2,292.00	8,709,600
オーイズミ	3,700	426.00	1,576,200
ダイコク電機	5,600	2,426.00	13,585,600

アマノ	41,000	883.00	36,203,000	
JUKI	88,000	147.00	12,936,000	
サンデン	77,000	398.00	30,646,000	
蛇の目ミシン工業	125,000	80.00	10,000,000	
ブラザー工業	174,300	964.00	168,025,200	
マックス	21,000	1,112.00	23,352,000	
モリタホールディングス	24,000	777.00	18,648,000	
グローリー	40,300	2,099.00	84,589,700	
大和冷機工業	21,000	545.00	11,445,000	
セガサミーホールディングス	144,900	1,588.00	230,101,200	
日本ビストンリング	47,000	185.00	8,695,000	
リケン	49,000	366.00	17,934,000	
T P R	15,100	1,249.00	18,859,900	
ホシザキ電機	29,500	2,755.00	81,272,500	
大豊工業	9,100	1,220.00	11,102,000	
日本精工	300,000	688.00	206,400,000	
NTN	290,000	265.00	76,850,000	
ジェイテクト	143,300	920.00	131,836,000	
不二越	126,000	372.00	46,872,000	
ミネベア	184,000	299.00	55,016,000	
日本トムソン	47,000	400.00	18,800,000	
THK	89,700	1,688.00	151,413,600	
ユーシン精機	6,400	1,608.00	10,291,200	
前澤給装工業	4,900	1,289.00	6,316,100	
イーグル工業	17,000	827.00	14,059,000	
前澤工業	9,300	231.00	2,148,300	
日本ビラー工業	13,000	739.00	9,607,000	
キッツ	55,800	438.00	24,440,400	
日立製作所	3,176,000	524.00	1,664,224,000	
東芝	2,659,000	420.00	1,116,780,000	
三菱電機	1,347,000	786.00	1,058,742,000	
富士電機	407,000	256.00	104,192,000	
東洋電機製造	27,000	245.00	6,615,000	
安川電機	148,000	849.00	125,652,000	
シンフォニアテクノロジー	82,000	165.00	13,530,000	
明電舎	134,000	285.00	38,190,000	
オリジン電気	19,000	414.00	7,866,000	
デンヨー	13,400	1,170.00	15,678,000	
日立工機	36,300	778.00	28,241,400	
三櫻工業	16,300	645.00	10,513,500	
マキタ	82,000	4,130.00	338,660,000	
東芝テック	85,000	521.00	44,285,000	
芝浦メカトロニクス	23,000	205.00	4,715,000	
マブチモーター	20,100	4,670.00	93,867,000	
日本電産	72,800	5,270.00	383,656,000	
東光高岳ホールディングス	6,500	1,499.00	9,743,500	
宮越ホールディングス	3,500	317.00	1,109,500	
ダイヘン	74,000	282.00	20,868,000	
ヤーマン	1,300	1,257.00	1,634,100	
JVCケンウッド	82,100	256.00	21,017,600	
第一精工	4,200	1,510.00	6,342,000	

日新電機	27,000	478.00	12,906,000	
大崎電気工業	17,000	453.00	7,701,000	
オムロン	150,100	2,178.00	326,917,800	
日東工業	19,900	1,436.00	28,576,400	
I D E C	17,800	820.00	14,596,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	260,000	326.00	84,760,000	
サクサホールディングス	34,000	176.00	5,984,000	
メルコホールディングス	8,500	1,654.00	14,059,000	
テクノメディカ	10	498,000.00	4,980,000	
日本電気	1,744,000	240.00	418,560,000	
富士通	1,299,000	398.00	517,002,000	
沖電気工業	491,000	103.00	50,573,000	
岩崎通信機	54,000	77.00	4,158,000	
電気興業	36,000	375.00	13,500,000	
サンケン電気	69,000	376.00	25,944,000	
ナカヨ通信機	13,000	262.00	3,406,000	
アイホン	7,900	1,511.00	11,936,900	
ルネサスエレクトロニクス	33,400	263.00	8,784,200	
セイコーエプソン	92,100	944.00	86,942,400	
ワコム	248	311,500.00	77,252,000	
アルバック	22,900	911.00	20,861,900	
アクセル	6,800	2,155.00	14,654,000	
ピクセラ	4,200	184.00	772,800	
ナナオ	11,500	1,558.00	17,917,000	
日本信号	34,200	680.00	23,256,000	
京三製作所	30,000	296.00	8,880,000	
能美防災	18,000	668.00	12,024,000	
ホーチキ	13,000	435.00	5,655,000	
日本無線	19,000	294.00	5,586,000	
パナソニック	1,539,100	685.00	1,054,283,500	
シャープ	697,000	331.00	230,707,000	
アンリツ	72,000	1,350.00	97,200,000	
富士通ゼネラル	32,000	774.00	24,768,000	
日立国際電気	31,000	811.00	25,141,000	
ソニー	846,600	1,355.00	1,147,143,000	
T D K	75,900	3,305.00	250,849,500	
帝国通信工業	32,000	171.00	5,472,000	
ミツミ電機	51,500	560.00	28,840,000	
タムラ製作所	51,000	189.00	9,639,000	
アルプス電気	99,000	627.00	62,073,000	
池上通信機	42,000	69.00	2,898,000	
パイオニア	164,500	201.00	33,064,500	
日本電波工業	10,800	1,005.00	10,854,000	
日本トリム	1,750	2,870.00	5,022,500	
ローランド ディー . ジー .	5,700	1,216.00	6,931,200	
日本コロムビア	89,000	43.00	3,827,000	
フォスター電機	13,900	1,322.00	18,375,800	
クラリオン	68,000	124.00	8,432,000	
S M K	38,000	280.00	10,640,000	
ヨコオ	9,600	450.00	4,320,000	
東光	69,000	271.00	18,699,000	

ティアック	45,000	54.00	2,430,000	
ホシデン	36,800	562.00	20,681,600	
ヒロセ電機	23,400	11,180.00	261,612,000	
日本航空電子工業	31,000	748.00	23,188,000	
TOA	15,000	652.00	9,780,000	
ユニデン	38,000	218.00	8,284,000	
アルパイン	26,500	864.00	22,896,000	
スミダコーポレーション	8,200	528.00	4,329,600	
アイコム	7,500	1,996.00	14,970,000	
リオン	2,300	733.00	1,685,900	
船井電機	13,700	1,213.00	16,618,100	
横河電機	135,000	924.00	124,740,000	
新電元工業	44,000	337.00	14,828,000	
アズビル	37,800	1,938.00	73,256,400	
日本光電工業	26,900	3,235.00	87,021,500	
チノー	23,000	210.00	4,830,000	
共和電業	14,000	283.00	3,962,000	
日本電子材料	5,000	385.00	1,925,000	
堀場製作所	26,700	3,005.00	80,233,500	
アドバンテスト	92,000	1,284.00	118,128,000	
小野測器	15,000	417.00	6,255,000	
エスベック	13,300	779.00	10,360,700	
パナソニック デバイスSUNX	10,800	401.00	4,330,800	
キーエンス	33,100	26,350.00	872,185,000	
日置電機	6,700	1,399.00	9,373,300	
シスメックス	47,500	4,760.00	226,100,000	
メガチップス	11,200	1,371.00	15,355,200	
OBARA GROUP	9,700	1,278.00	12,396,600	
日本電産コパル電子	14,300	429.00	6,134,700	
ミヤチテクノス	5,600	867.00	4,855,200	
東京電波	4,200	600.00	2,520,000	
澤藤電機	8,000	253.00	2,024,000	
デンソー	332,800	3,670.00	1,221,376,000	
コーセル	19,700	1,029.00	20,271,300	
日立メディコ	10,000	1,319.00	13,190,000	
新日本無線	9,000	209.00	1,881,000	
オプテックス	8,400	1,167.00	9,802,800	
千代田インテグレ	6,300	1,046.00	6,589,800	
スタンレー電気	104,900	1,585.00	166,266,500	
岩崎電気	48,000	199.00	9,552,000	
ウシオ電機	81,900	1,043.00	85,421,700	
岡谷電機産業	7,500	345.00	2,587,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	12,000	194.00	2,328,000	
日本セラミック	8,900	1,538.00	13,688,200	
日本デジタル研究所	11,500	1,077.00	12,385,500	
古河電池	9,000	535.00	4,815,000	
双信電機	6,800	324.00	2,203,200	
山一電機	14,800	151.00	2,234,800	
図研	7,600	580.00	4,408,000	
日本電子	50,000	338.00	16,900,000	
カシオ計算機	128,600	715.00	91,949,000	

ファナック	140,200	14,580.00	2,044,116,000	
日本シイエムケイ	27,800	352.00	9,785,600	
エンプラス	6,000	3,910.00	23,460,000	
ローム	71,200	3,295.00	234,604,000	
浜松ホトニクス	52,600	3,680.00	193,568,000	
三井ハイテック	19,800	624.00	12,355,200	
新光電気工業	45,500	736.00	33,488,000	
京セラ	112,000	8,260.00	925,120,000	
協栄産業	16,000	156.00	2,496,000	
太陽誘電	65,700	1,035.00	67,999,500	
村田製作所	141,300	6,080.00	859,104,000	
ユーシン	19,000	710.00	13,490,000	
双葉電子工業	25,100	981.00	24,623,100	
日東電工	116,300	5,330.00	619,879,000	
北陸電気工業	52,000	111.00	5,772,000	
東海理化電機製作所	31,600	1,548.00	48,916,800	
ニチコン	42,600	885.00	37,701,000	
日本ケミコン	78,000	252.00	19,656,000	
K O A	17,100	897.00	15,338,700	
三井造船	522,000	172.00	89,784,000	
日立造船	534,000	134.00	71,556,000	
佐世保重工業	85,000	112.00	9,520,000	
三菱重工業	2,258,000	512.00	1,156,096,000	
川崎重工業	1,049,000	281.00	294,769,000	
I H I	921,000	247.00	227,487,000	
日本車輛製造	50,000	343.00	17,150,000	
日本輸送機	17,000	404.00	6,868,000	
近畿車輛	23,000	295.00	6,785,000	
F P G	1,600	2,065.00	3,304,000	
島根銀行	3,000	1,289.00	3,867,000	
じもとホールディングス	96,300	215.00	20,704,500	
全国保証	10,400	2,729.00	28,381,600	
日産自動車	1,701,800	938.00	1,596,288,400	
いすゞ自動車	781,000	581.00	453,761,000	
トヨタ自動車	1,730,500	4,820.00	8,341,010,000	
日野自動車	168,000	968.00	162,624,000	
三菱自動車工業	3,268,000	102.00	333,336,000	
エフテック	4,700	1,183.00	5,560,100	
武蔵精密工業	14,400	1,947.00	28,036,800	
日産車体	46,000	1,174.00	54,004,000	
新明和工業	55,000	622.00	34,210,000	
極東開発工業	25,200	970.00	24,444,000	
日信工業	27,500	1,480.00	40,700,000	
トピー工業	101,000	228.00	23,028,000	
ティラド	46,000	248.00	11,408,000	
曙ブレーキ工業	63,000	415.00	26,145,000	
タチエス	18,200	1,524.00	27,736,800	
N O K	65,300	1,295.00	84,563,500	
フタバ産業	41,500	381.00	15,811,500	
カヤバ工業	103,000	381.00	39,243,000	
シロキ工業	29,000	228.00	6,612,000	

市光工業	29,000	143.00	4,147,000	
大同メタル工業	19,000	786.00	14,934,000	
プレス工業	58,000	466.00	27,028,000	
カルソニックカンセイ	92,000	386.00	35,512,000	
太平洋工業	27,800	532.00	14,789,600	
ケーヒン	28,000	1,400.00	39,200,000	
河西工業	16,000	447.00	7,152,000	
アイシン精機	123,300	3,290.00	405,657,000	
富士機工	16,000	326.00	5,216,000	
マツダ	2,133,000	276.00	588,708,000	
ダイハツ工業	143,000	1,868.00	267,124,000	
今仙電機製作所	9,500	1,145.00	10,877,500	
本田技研工業	1,136,400	3,500.00	3,977,400,000	
スズキ	281,700	2,307.00	649,881,900	
富士重工業	426,000	1,329.00	566,154,000	
ヤマハ発動機	204,900	1,065.00	218,218,500	
ショーワ	32,000	1,012.00	32,384,000	
小糸製作所	67,000	1,487.00	99,629,000	
T B K	13,000	514.00	6,682,000	
エクセディ	18,400	1,968.00	36,211,200	
ミツバ	25,000	765.00	19,125,000	
豊田合成	38,100	2,229.00	84,924,900	
愛三工業	13,700	830.00	11,371,000	
ヨロズ	10,000	1,472.00	14,720,000	
エフ・シー・シー	22,100	2,090.00	46,189,000	
新家工業	28,000	124.00	3,472,000	
シマノ	54,300	6,540.00	355,122,000	
タカタ	24,400	1,695.00	41,358,000	
テイ・エス テック	28,500	2,230.00	63,555,000	
小野建	11,100	866.00	9,612,600	
はるやま商事	5,500	522.00	2,871,000	
佐島電機	9,000	470.00	4,230,000	
カップ・クリエイトホールディングス	9,850	2,040.00	20,094,000	
エコトレーディング	3,300	845.00	2,788,500	
伯東	7,800	885.00	6,903,000	
コンドーテック	10,700	521.00	5,574,700	
中山福	7,600	703.00	5,342,800	
ライトオン	9,600	669.00	6,422,400	
ナガイレーベン	17,700	1,177.00	20,832,900	
ジーンズメイト	3,300	378.00	1,247,400	
三菱食品	14,700	2,680.00	39,396,000	
良品計画	14,100	5,440.00	76,704,000	
三城ホールディングス	16,300	473.00	7,709,900	
松田産業	9,500	1,279.00	12,150,500	
メディパルホールディングス	133,100	1,158.00	154,129,800	
アドヴァン	6,900	902.00	6,223,800	
S P K	2,800	1,558.00	4,362,400	
アズワン	8,700	1,909.00	16,608,300	
スズデン	4,500	475.00	2,137,500	
尾家産業	3,900	843.00	3,287,700	
シモジマ	7,800	1,007.00	7,854,600	

ドウシシャ	7,100	2,369.00	16,819,900	
コナカ	15,000	787.00	11,805,000	
高速	7,600	815.00	6,194,000	
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,347.00	2,155,200	
G - 7ホールディングス	3,700	530.00	1,961,000	
イオン北海道	7,700	489.00	3,765,300	
コジマ	20,100	306.00	6,150,600	
ヒマラヤ	3,400	724.00	2,461,600	
コーナン商事	17,600	1,106.00	19,465,600	
黒田電気	17,900	1,119.00	20,030,100	
ネットワンシステムズ	48,600	863.00	41,941,800	
エコス	4,600	580.00	2,668,000	
ワタミ	15,800	1,703.00	26,907,400	
マルシェ	2,900	806.00	2,337,400	
ドン・キホーテ	38,800	3,755.00	145,694,000	
丸文	11,400	431.00	4,913,400	
メガネトップ	23,000	1,097.00	25,231,000	
西松屋チェーン	26,400	736.00	19,430,400	
ゼンショーホールディングス	50,800	1,195.00	60,706,000	
ハピネット	8,300	767.00	6,366,100	
幸楽苑	8,000	1,283.00	10,264,000	
トーマンエレクトロニクス	6,700	1,185.00	7,939,500	
ハークスレイ	3,000	719.00	2,157,000	
サイゼリヤ	19,800	1,195.00	23,661,000	
エクセル	5,200	865.00	4,498,000	
マルカキカイ	4,300	1,246.00	5,357,800	
アルゴグラフィックス	4,800	1,333.00	6,398,400	
ガリバーインターナショナル	4,520	3,645.00	16,475,400	
日本エム・ディ・エム	11,300	251.00	2,836,300	
ポプラ	3,100	578.00	1,791,800	
ユナイテッドアローズ	14,300	2,346.00	33,547,800	
進和	7,500	1,074.00	8,055,000	
エスケイジャパン	2,100	298.00	625,800	
ダイトエレクトロン	6,300	366.00	2,305,800	
ハイデイ日高	7,100	2,068.00	14,682,800	
シークス	8,300	1,149.00	9,536,700	
京都きもの友禅	8,700	1,206.00	10,492,200	
コロワイド	44,500	982.00	43,699,000	
田中商事	4,500	486.00	2,187,000	
オーハシテクニカ	6,900	659.00	4,547,100	
壱番屋	5,400	3,005.00	16,227,000	
マクニカ	6,900	1,689.00	11,654,100	
白銅	4,200	828.00	3,477,600	
トップカルチャー	5,000	390.00	1,950,000	
スギホールディングス	21,200	3,280.00	69,536,000	
島津製作所	161,000	582.00	93,702,000	
JMS	19,000	370.00	7,030,000	
クボテック	20	38,500.00	770,000	
モリテックス	2,000	274.00	548,000	
長野計器	9,200	663.00	6,099,600	
ビー・テクノロジー	28	252,200.00	7,061,600	

スター精密	23,800	962.00	22,895,600	
東京計器	42,000	180.00	7,560,000	
愛知時計電機	15,000	283.00	4,245,000	
日本電産トーソク	5,900	625.00	3,687,500	
東京精密	24,300	1,756.00	42,670,800	
マニー	4,000	3,185.00	12,740,000	
ニコン	251,600	2,140.00	538,424,000	
トプコン	27,300	950.00	25,935,000	
オリンパス	158,900	2,060.00	327,334,000	
理研計器	11,200	554.00	6,204,800	
大日本スクリーン製造	139,000	460.00	63,940,000	
キヤノン電子	12,500	1,832.00	22,900,000	
タムロン	10,400	2,117.00	22,016,800	
HOYA	327,600	1,850.00	606,060,000	
ノーリツ鋼機	11,100	495.00	5,494,500	
エー・アンド・デイ	11,900	367.00	4,367,300	
キヤノン	836,800	3,345.00	2,799,096,000	
リコー	405,000	993.00	402,165,000	
日本電産コパル	10,200	648.00	6,609,600	
シチズンホールディングス	152,300	490.00	74,627,000	
リズム時計工業	58,000	171.00	9,918,000	
大研医器	1,500	2,122.00	3,183,000	
パラマウントベッドホールディングス	11,600	2,860.00	33,176,000	
SHO-BI	2,800	393.00	1,100,400	
前田工織	900	2,494.00	2,244,600	
永大産業	17,000	379.00	6,443,000	
ダンロップスポーツ	7,000	1,014.00	7,098,000	
バンダイナムコホールディングス	139,400	1,488.00	207,427,200	
共立印刷	16,000	239.00	3,824,000	
フランスベッドホールディングス	85,000	204.00	17,340,000	
マーベラスAQL	147	45,550.00	6,695,850	
パイロットコーポレーション	118	259,900.00	30,668,200	
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,200	2,421.00	61,009,200	
トッパン・フォームズ	24,300	817.00	19,853,100	
フジシールインターナショナル	16,400	2,148.00	35,227,200	
タカラトミー	44,600	517.00	23,058,200	
廣濟堂	11,300	325.00	3,672,500	
アーク	45,100	166.00	7,486,600	
レック	4,000	1,225.00	4,900,000	
タカノ	5,100	433.00	2,208,300	
プロネクサス	15,500	530.00	8,215,000	
ホクシン	7,600	185.00	1,406,000	
ウッドワン	22,000	281.00	6,182,000	
大建工業	55,000	251.00	13,805,000	
きもと	12,100	840.00	10,164,000	
凸版印刷	381,000	609.00	232,029,000	
大日本印刷	410,000	797.00	326,770,000	
図書印刷	21,000	136.00	2,856,000	
共同印刷	40,000	246.00	9,840,000	
日本写真印刷	20,800	1,739.00	36,171,200	
光村印刷	12,000	265.00	3,180,000	

藤森工業	12,000	2,115.00	25,380,000	
宝印刷	7,000	633.00	4,431,000	
前澤化成工業	9,500	907.00	8,616,500	
アシックス	125,600	1,451.00	182,245,600	
ツツミ	6,800	2,375.00	16,150,000	
J S P	9,000	1,355.00	12,195,000	
ニチハ	15,800	1,267.00	20,018,600	
ローランド	12,300	807.00	9,926,100	
エフビコ	7,000	5,810.00	40,670,000	
小松ウオール工業	4,800	1,657.00	7,953,600	
ヤマハ	99,200	891.00	88,387,200	
河合楽器製作所	46,000	171.00	7,866,000	
クリナップ	13,600	623.00	8,472,800	
ビジョン	10,200	5,190.00	52,938,000	
天馬	10,700	984.00	10,528,800	
兼松日産農林	21,000	155.00	3,255,000	
キングジム	11,100	655.00	7,270,500	
リンテック	28,900	1,678.00	48,494,200	
T A S A K I	1,900	440.00	836,000	
信越ポリマー	26,500	370.00	9,805,000	
東リ	36,000	217.00	7,812,000	
イトーキ	27,800	505.00	14,039,000	
任天堂	77,000	8,740.00	672,980,000	
三菱鉛筆	11,200	1,733.00	19,409,600	
松風	6,600	861.00	5,682,600	
タカラスタンダード	62,000	665.00	41,230,000	
コクヨ	70,300	624.00	43,867,200	
ナカバヤシ	26,000	190.00	4,940,000	
ニフコ	31,600	1,958.00	61,872,800	
グローブライド	63,000	108.00	6,804,000	
岡村製作所	52,000	602.00	31,304,000	
日本バルカー工業	59,000	235.00	13,865,000	
M U T O Hホールディングス	18,000	233.00	4,194,000	
伊藤忠商事	1,060,700	1,090.00	1,156,163,000	
丸紅	1,091,000	690.00	752,790,000	
スクロール	17,300	267.00	4,619,100	
高島	24,000	278.00	6,672,000	
F & A アクアホールディングス	9,700	1,053.00	10,214,100	
三陽商会	75,000	261.00	19,575,000	
長瀬産業	75,400	1,032.00	77,812,800	
ナイガイ	30,000	64.00	1,920,000	
蝶理	8,400	992.00	8,332,800	
豊田通商	148,200	2,336.00	346,195,200	
オンワードホールディングス	94,000	755.00	70,970,000	
三共生興	21,800	334.00	7,281,200	
兼松	284,000	137.00	38,908,000	
美津濃	67,000	406.00	27,202,000	
ツカモトコーポレーション	22,000	163.00	3,586,000	
ファミリーマート	40,900	3,965.00	162,168,500	
ルック	23,000	342.00	7,866,000	
三井物産	1,147,600	1,413.00	1,621,558,800	

日本紙パルプ商事	70,000	308.00	21,560,000	
東京エレクトロン	113,300	4,185.00	474,160,500	
日立ハイテクノロジーズ	40,400	1,987.00	80,274,800	
カメイ	16,000	903.00	14,448,000	
東都水産	24,000	137.00	3,288,000	
スターゼン	45,000	262.00	11,790,000	
セイコーホールディングス	86,000	273.00	23,478,000	
山善	51,300	651.00	33,396,300	
椿本興業	14,000	254.00	3,556,000	
住友商事	784,700	1,174.00	921,237,800	
日本ユニシス	36,900	711.00	26,235,900	
内田洋行	29,000	257.00	7,453,000	
三菱商事	1,037,400	1,924.00	1,995,957,600	
第一実業	29,000	457.00	13,253,000	
キヤノンマーケティングジャパン	44,400	1,279.00	56,787,600	
西華産業	48,000	258.00	12,384,000	
佐藤商事	11,400	581.00	6,623,400	
菱洋エレクトロ	15,900	821.00	13,053,900	
東京産業	12,000	287.00	3,444,000	
ユアサ商事	137,000	176.00	24,112,000	
神鋼商事	32,000	187.00	5,984,000	
阪和興業	133,000	394.00	52,402,000	
カナデン	13,000	571.00	7,423,000	
菱電商事	19,000	586.00	11,134,000	
ニプロ	72,000	711.00	51,192,000	
フルサト工業	7,400	910.00	6,734,000	
岩谷産業	148,000	362.00	53,576,000	
すてきナイスグループ	53,000	230.00	12,190,000	
昭光通商	46,000	136.00	6,256,000	
ニチモウ	19,000	197.00	3,743,000	
極東貿易	14,000	163.00	2,282,000	
イワキ	20,000	189.00	3,780,000	
兼松エレクトロニクス	8,300	1,067.00	8,856,100	
三愛石油	30,000	411.00	12,330,000	
稲畑産業	33,000	638.00	21,054,000	
G S Iクレオス	34,000	135.00	4,590,000	
明和産業	10,200	398.00	4,059,600	
ゴールドウイン	32,000	554.00	17,728,000	
ユニ・チャーム	77,900	5,490.00	427,671,000	
デサント	36,000	593.00	21,348,000	
ヤマトインターナショナル	8,900	398.00	3,542,200	
東邦ホールディングス	42,700	1,903.00	81,258,100	
サンゲツ	23,600	2,319.00	54,728,400	
ミツウロコグループホールディングス	20,500	529.00	10,844,500	
シナネン	28,000	394.00	11,032,000	
伊藤忠エネクス	29,700	493.00	14,642,100	
サンリオ	33,600	3,740.00	125,664,000	
サンワテクノス	6,000	683.00	4,098,000	
リョーサン	21,700	2,024.00	43,920,800	
新光商事	14,300	939.00	13,427,700	
トーホー	27,000	323.00	8,721,000	

三信電気	18,700	652.00	12,192,400	
東陽テクニカ	19,400	1,121.00	21,747,400	
モスフードサービス	17,500	1,753.00	30,677,500	
加賀電子	13,000	778.00	10,114,000	
三益半導体工業	11,400	727.00	8,287,800	
ソーダニッカ	13,000	398.00	5,174,000	
立花エレテック	7,800	859.00	6,700,200	
木曽路	16,400	1,785.00	29,274,000	
千趣会	24,200	669.00	16,189,800	
タカキュー	10,500	334.00	3,507,000	
ケーヨー	22,000	498.00	10,956,000	
アデランス	17,000	1,343.00	22,831,000	
上新電機	29,000	901.00	26,129,000	
日本瓦斯	18,400	1,144.00	21,049,600	
ベスト電器	41,500	167.00	6,930,500	
マルエツ	27,000	305.00	8,235,000	
ロイヤルホールディングス	22,400	1,085.00	24,304,000	
東天紅	10,000	200.00	2,000,000	
いなげや	15,000	1,016.00	15,240,000	
島忠	30,200	1,976.00	59,675,200	
チヨダ	15,700	2,127.00	33,393,900	
ライフコーポレーション	8,500	1,271.00	10,803,500	
カスミ	27,500	586.00	16,115,000	
リンガーハット	12,100	1,235.00	14,943,500	
さが美	7,000	122.00	854,000	
Mr Max	13,300	327.00	4,349,100	
テナライド	8,500	307.00	2,609,500	
AOKIホールディングス	11,500	2,214.00	25,461,000	
オークワ	21,000	1,057.00	22,197,000	
コメリ	20,600	2,553.00	52,591,800	
青山商事	36,700	2,026.00	74,354,200	
しまむら	15,500	9,300.00	144,150,000	
CFSコーポレーション	8,100	423.00	3,426,300	
高島屋	180,000	730.00	131,400,000	
松屋	27,000	818.00	22,086,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	87,000	819.00	71,253,000	
丸栄	23,000	99.00	2,277,000	
ニッセンホールディングス	23,700	324.00	7,678,800	
バルコ	25,700	914.00	23,489,800	
丸井グループ	173,500	766.00	132,901,000	
クレディセゾン	116,400	1,905.00	221,742,000	
原信ナルスホールディングス	7,500	1,645.00	12,337,500	
井筒屋	69,000	97.00	6,693,000	
ダイエー	77,750	199.00	15,472,250	
イズミヤ	50,000	497.00	24,850,000	
イオン	468,800	1,065.00	499,272,000	
ユニー	127,500	662.00	84,405,000	
イズミ	33,100	1,974.00	65,339,400	
東武ストア	17,000	285.00	4,845,000	
平和堂	27,100	1,298.00	35,175,800	
フジ	14,900	1,848.00	27,535,200	

ヤオコー	6,700	3,595.00	24,086,500	
ゼビオ	18,100	1,781.00	32,236,100	
ケーズホールディングス	33,300	2,280.00	75,924,000	
P a l t a c	15,900	1,127.00	17,919,300	
O l y m p i c	7,600	723.00	5,494,800	
日産東京販売ホールディングス	18,000	294.00	5,292,000	
新生銀行	1,151,000	205.00	235,955,000	
あおぞら銀行	484,000	272.00	131,648,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,066,800	533.00	5,365,604,400	
りそなホールディングス	1,367,800	428.00	585,418,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,780,000	357.00	992,460,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,005,400	3,825.00	3,845,655,000	
第四銀行	172,000	330.00	56,760,000	
北越銀行	136,000	210.00	28,560,000	
西日本シティ銀行	467,000	253.00	118,151,000	
千葉銀行	513,000	609.00	312,417,000	
横浜銀行	846,000	481.00	406,926,000	
常陽銀行	502,000	459.00	230,418,000	
群馬銀行	301,000	483.00	145,383,000	
武蔵野銀行	21,500	3,245.00	69,767,500	
千葉興業銀行	25,700	742.00	19,069,400	
筑波銀行	55,700	370.00	20,609,000	
東京都民銀行	25,300	923.00	23,351,900	
七十七銀行	209,000	438.00	91,542,000	
青森銀行	100,000	281.00	28,100,000	
秋田銀行	92,000	253.00	23,276,000	
山形銀行	81,000	408.00	33,048,000	
岩手銀行	9,600	3,815.00	36,624,000	
東邦銀行	113,000	290.00	32,770,000	
東北銀行	65,000	154.00	10,010,000	
みちのく銀行	65,000	207.00	13,455,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	540,000	415.00	224,100,000	
静岡銀行	390,000	920.00	358,800,000	
十六銀行	167,000	336.00	56,112,000	
スルガ銀行	130,000	1,359.00	176,670,000	
八十二銀行	246,000	471.00	115,866,000	
山梨中央銀行	82,000	393.00	32,226,000	
大垣共立銀行	178,000	307.00	54,646,000	
福井銀行	116,000	181.00	20,996,000	
北國銀行	155,000	368.00	57,040,000	
清水銀行	4,600	2,715.00	12,489,000	
滋賀銀行	125,000	536.00	67,000,000	
南都銀行	133,000	424.00	56,392,000	
百五銀行	121,000	403.00	48,763,000	
京都銀行	238,000	799.00	190,162,000	
三重銀行	53,000	216.00	11,448,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	932,000	157.00	146,324,000	
広島銀行	393,000	388.00	152,484,000	
山陰合同銀行	78,000	750.00	58,500,000	
中国銀行	103,000	1,325.00	136,475,000	
鳥取銀行	42,000	190.00	7,980,000	

伊予銀行	142,000	781.00	110,902,000	
百十四銀行	146,000	370.00	54,020,000	
四国銀行	97,000	249.00	24,153,000	
阿波銀行	110,000	555.00	61,050,000	
鹿児島銀行	93,000	616.00	57,288,000	
大分銀行	79,000	337.00	26,623,000	
宮崎銀行	89,000	251.00	22,339,000	
肥後銀行	110,000	547.00	60,170,000	
佐賀銀行	81,000	220.00	17,820,000	
十八銀行	86,000	250.00	21,500,000	
沖縄銀行	9,900	3,720.00	36,828,000	
琉球銀行	27,700	1,200.00	33,240,000	
八千代銀行	6,900	2,353.00	16,235,700	
セブン銀行	449,000	241.00	108,209,000	
みずほフィナンシャルグループ	17,136,500	205.00	3,512,982,500	
紀陽ホールディングス	531,000	137.00	72,747,000	
山口フィナンシャルグループ	133,000	891.00	118,503,000	
アクリーティブ	42	12,670.00	532,140	
芙蓉総合リース	12,700	3,260.00	41,402,000	
興銀リース	20,100	2,423.00	48,702,300	
東京センチュリーリース	31,300	2,133.00	66,762,900	
SBIホールディングス	169,300	726.00	122,911,800	
日本証券金融	51,200	631.00	32,307,200	
大阪証券金融	15,700	242.00	3,799,400	
アイフル	111,150	574.00	63,800,100	
日本アジア投資	93,000	80.00	7,440,000	
ポケットカード	12,800	474.00	6,067,200	
長野銀行	46,000	178.00	8,188,000	
名古屋銀行	121,000	341.00	41,261,000	
北洋銀行	200,800	314.00	63,051,200	
愛知銀行	4,800	5,000.00	24,000,000	
第三銀行	76,000	179.00	13,604,000	
中京銀行	55,000	200.00	11,000,000	
東日本銀行	59,000	244.00	14,396,000	
大光銀行	45,000	241.00	10,845,000	
愛媛銀行	79,000	235.00	18,565,000	
トマト銀行	49,000	178.00	8,722,000	
みなと銀行	121,000	164.00	19,844,000	
京葉銀行	110,000	472.00	51,920,000	
関西アーバン銀行	187,000	117.00	21,879,000	
栃木銀行	67,000	368.00	24,656,000	
北日本銀行	3,800	2,528.00	9,606,400	
東和銀行	145,000	103.00	14,935,000	
福島銀行	166,000	85.00	14,110,000	
大東銀行	84,000	99.00	8,316,000	
リコーリース	9,200	2,353.00	21,647,600	
イオンクレジットサービス	48,500	2,041.00	98,988,500	
アコム	26,780	2,211.00	59,210,580	
ジャックス	74,000	426.00	31,524,000	
オリエントコーポレーション	257,500	283.00	72,872,500	
日立キャピタル	26,200	1,728.00	45,273,600	

オリックス	69,190	10,580.00	732,030,200	
三菱UFJリース	33,760	4,090.00	138,078,400	
ジャフコ	18,200	2,951.00	53,708,200	
トモニホールディングス	102,500	405.00	41,512,500	
大和証券グループ本社	1,317,000	551.00	725,667,000	
野村ホールディングス	2,718,100	544.00	1,478,646,400	
岡三証券グループ	113,000	713.00	80,569,000	
丸三証券	40,900	702.00	28,711,800	
東洋証券	50,000	303.00	15,150,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	153,000	507.00	77,571,000	
光世証券	32,000	229.00	7,328,000	
水戸証券	39,000	393.00	15,327,000	
いちよし証券	30,000	813.00	24,390,000	
松井証券	79,000	863.00	68,177,000	
NK S Jホールディングス	295,400	2,096.00	619,158,400	
だいこう証券ビジネス	6,900	657.00	4,533,300	
マネックスグループ	1,509	31,350.00	47,307,150	
カブドットコム証券	54,600	460.00	25,116,000	
極東証券	18,000	1,202.00	21,636,000	
岩井コスモホールディングス	12,200	673.00	8,210,600	
フィデアホールディングス	77,300	220.00	17,006,000	
池田泉州ホールディングス	110,100	501.00	55,160,100	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	397,400	2,053.00	815,862,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	127,500	1,523.00	194,182,500	
小林洋行	3,000	227.00	681,000	
第一生命保険	7,111	134,200.00	954,296,200	
東京海上ホールディングス	515,000	2,885.00	1,485,775,000	
イー・ギャランティ	1,500	1,932.00	2,898,000	
アサックス	21	149,900.00	3,147,900	
NECキャピタルソリューション	5,200	1,617.00	8,408,400	
T & Dホールディングス	456,200	1,169.00	533,297,800	
三井不動産	627,000	2,130.00	1,335,510,000	
三菱地所	930,000	2,136.00	1,986,480,000	
平和不動産	25,300	1,295.00	32,763,500	
東京建物	254,000	442.00	112,268,000	
ダイビル	34,400	894.00	30,753,600	
東急不動産	290,000	618.00	179,220,000	
京阪神ビルディング	17,100	504.00	8,618,400	
住友不動産	319,000	2,754.00	878,526,000	
東宝不動産	11,200	744.00	8,332,800	
太平洋興発	47,000	96.00	4,512,000	
大京	206,000	218.00	44,908,000	
テーオーシー	46,100	600.00	27,660,000	
東京楽天地	22,000	356.00	7,832,000	
レオパレス21	111,500	322.00	35,903,000	
フジ住宅	16,800	495.00	8,316,000	
空港施設	15,500	454.00	7,037,000	
明和地所	6,100	517.00	3,153,700	
住友不動産販売	4,830	4,155.00	20,068,650	
ゴールドクレスト	10,600	1,653.00	17,521,800	

東栄住宅	6,000	1,227.00	7,362,000	
リロ・ホールディング	4,800	3,460.00	16,608,000	
日本エスリード	5,700	958.00	5,460,600	
東急リバブル	14,200	1,368.00	19,425,600	
飯田産業	7,600	1,230.00	9,348,000	
日神不動産	7,200	582.00	4,190,400	
アーネストワン	22,100	1,558.00	34,431,800	
タカラレーベン	8,900	1,065.00	9,478,500	
サンヨーハウジング名古屋	68	110,800.00	7,534,400	
イオンモール	60,700	2,210.00	134,147,000	
フージャースコーポレーション	129	75,500.00	9,739,500	
タクトホーム	67	134,300.00	8,998,100	
ランド	4,900	7.00	34,300	
トーセイ	165	69,800.00	11,517,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	828	88,500.00	73,278,000	
サンフロンティア不動産	69	79,200.00	5,464,800	
ランドビジネス	64	47,700.00	3,052,800	
グランディハウス	3,000	877.00	2,631,000	
東武鉄道	765,000	504.00	385,560,000	
相鉄ホールディングス	216,000	306.00	66,096,000	
東京急行電鉄	793,000	542.00	429,806,000	
京浜急行電鉄	346,000	820.00	283,720,000	
小田急電鉄	432,000	966.00	417,312,000	
京王電鉄	377,000	729.00	274,833,000	
京成電鉄	202,000	850.00	171,700,000	
富士急行	37,000	558.00	20,646,000	
新京成電鉄	17,000	365.00	6,205,000	
東日本旅客鉄道	248,500	6,840.00	1,699,740,000	
西日本旅客鉄道	116,100	4,050.00	470,205,000	
東海旅客鉄道	112,000	8,980.00	1,005,760,000	
西日本鉄道	175,000	373.00	65,275,000	
ハマキョウレックス	3,900	3,205.00	12,499,500	
サカイ引越センター	2,300	2,052.00	4,719,600	
近畿日本鉄道	1,217,000	397.00	483,149,000	
阪急阪神ホールディングス	851,000	507.00	431,457,000	
南海電気鉄道	281,000	405.00	113,805,000	
京阪電気鉄道	302,000	414.00	125,028,000	
名糖運輸	5,800	635.00	3,683,000	
名古屋鉄道	471,000	272.00	128,112,000	
トランコム	3,600	2,407.00	8,665,200	
日本通運	534,000	405.00	216,270,000	
ヤマトホールディングス	254,600	1,559.00	396,921,400	
山九	164,000	400.00	65,600,000	
日新	49,000	244.00	11,956,000	
丸運	5,500	210.00	1,155,000	
丸全昭和運輸	44,000	315.00	13,860,000	
センコー	54,000	464.00	25,056,000	
トナミホールディングス	25,000	186.00	4,650,000	
日本梱包運輸倉庫	43,600	1,331.00	58,031,600	
日本石油輸送	16,000	205.00	3,280,000	
福山通運	82,000	486.00	39,852,000	

セイノーホールディングス	105,000	723.00	75,915,000	
神奈川中央交通	15,000	489.00	7,335,000	
日立物流	23,500	1,299.00	30,526,500	
日本郵船	1,068,000	223.00	238,164,000	
商船三井	656,000	307.00	201,392,000	
川崎汽船	590,000	182.00	107,380,000	
NSユニテッド海運	56,000	128.00	7,168,000	
乾汽船	16,100	300.00	4,830,000	
明治海運	11,100	325.00	3,607,500	
飯野海運	56,200	436.00	24,503,200	
共栄タンカー	12,000	191.00	2,292,000	
第一中央汽船	95,000	81.00	7,695,000	
日本航空	113,800	4,350.00	495,030,000	
全日本空輸	2,648,000	190.00	503,120,000	
パスコ	11,000	285.00	3,135,000	
三菱倉庫	96,000	1,416.00	135,936,000	
三井倉庫	63,000	393.00	24,759,000	
住友倉庫	91,000	469.00	42,679,000	
澁澤倉庫	36,000	313.00	11,268,000	
ヤマタネ	61,000	143.00	8,723,000	
東陽倉庫	21,000	228.00	4,788,000	
日本トランスシティ	30,000	327.00	9,810,000	
ケイヒン	24,000	129.00	3,096,000	
安田倉庫	10,100	671.00	6,777,100	
東洋埠頭	39,000	156.00	6,084,000	
宇徳	11,200	294.00	3,292,800	
上組	149,000	785.00	116,965,000	
サンリツ	3,700	575.00	2,127,500	
キムラユニティー	3,100	828.00	2,566,800	
キューソー流通システム	3,700	935.00	3,459,500	
郵船ロジスティクス	10,500	911.00	9,565,500	
近鉄エクスプレス	12,100	3,080.00	37,268,000	
東海運	7,700	251.00	1,932,700	
エーアイティー	1,200	1,715.00	2,058,000	
東京放送ホールディングス	71,800	1,123.00	80,631,400	
日本テレビホールディングス	121,500	1,372.00	166,698,000	
テレビ朝日	33,800	1,614.00	54,553,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,157	46,350.00	53,626,950	
テレビ東京ホールディングス	9,200	994.00	9,144,800	
アイ・ティー・シーネットワーク	11,600	701.00	8,131,600	
NECモバイルリング	4,900	4,080.00	19,992,000	
日本電信電話	559,700	4,295.00	2,403,911,500	
KDDI	187,600	6,930.00	1,300,068,000	
光通信	13,400	4,420.00	59,228,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	10,955	141,100.00	1,545,750,500	
GMOインターネット	44,600	736.00	32,825,600	
学研ホールディングス	39,000	258.00	10,062,000	
ゼンリン	17,700	1,107.00	19,593,900	
昭文社	7,800	594.00	4,633,200	
角川グループホールディングス	11,500	2,382.00	27,393,000	
インプレスホールディングス	8,200	128.00	1,049,600	

東京電力	1,143,500	215.00	245,852,500	
中部電力	412,300	1,164.00	479,917,200	
関西電力	549,900	819.00	450,368,100	
中国電力	186,400	1,199.00	223,493,600	
北陸電力	132,100	1,029.00	135,930,900	
東北電力	336,800	725.00	244,180,000	
四国電力	121,500	1,130.00	137,295,000	
九州電力	297,700	908.00	270,311,600	
北海道電力	126,300	808.00	102,050,400	
沖縄電力	8,100	2,797.00	22,655,700	
電源開発	83,700	2,306.00	193,012,200	
東京瓦斯	1,618,000	457.00	739,426,000	
大阪瓦斯	1,308,000	363.00	474,804,000	
東邦瓦斯	343,000	502.00	172,186,000	
北海道瓦斯	24,000	246.00	5,904,000	
西部瓦斯	152,000	213.00	32,376,000	
静岡瓦斯	35,500	631.00	22,400,500	
アイネット	5,800	671.00	3,891,800	
松竹	88,000	1,000.00	88,000,000	
東宝	95,000	1,744.00	165,680,000	
エイチ・アイ・エス	11,500	3,270.00	37,605,000	
東映	56,000	543.00	30,408,000	
AOI Pro.	6,000	603.00	3,618,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	822	273,700.00	224,981,400	
共立メンテナンス	7,000	2,424.00	16,968,000	
イチネンホールディングス	14,600	580.00	8,468,000	
建設技術研究所	7,700	607.00	4,673,900	
スペース	6,900	690.00	4,761,000	
アインファーマシーズ	8,000	5,010.00	40,080,000	
燦ホールディングス	2,800	1,299.00	3,637,200	
スバル興業	9,000	321.00	2,889,000	
東京テアトル	55,000	129.00	7,095,000	
よみうりランド	27,000	454.00	12,258,000	
東京都競馬	109,000	211.00	22,999,000	
常磐興産	42,000	153.00	6,426,000	
カナモト	17,000	1,400.00	23,800,000	
東京ドーム	105,000	328.00	34,440,000	
D T S	12,800	1,317.00	16,857,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	48,400	1,069.00	51,739,600	
シーイーシー	8,400	551.00	4,628,400	
カプコン	25,600	1,465.00	37,504,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	35.00	1,015,000	
日本空港ビルデング	46,100	1,050.00	48,405,000	
トランス・コスモス	18,500	1,183.00	21,885,500	
乃村工藝社	31,000	434.00	13,454,000	
ジャステック	7,700	554.00	4,265,800	
S C S K	31,700	1,557.00	49,356,900	
藤田観光	36,000	297.00	10,692,000	
K N T - C Tホールディングス	44,000	122.00	5,368,000	
日本管財	5,000	1,626.00	8,130,000	
トーカイ	6,300	2,590.00	16,317,000	

白洋舎	14,000	209.00	2,926,000	
セコム	146,400	4,695.00	687,348,000	
日本システムウエア	4,400	374.00	1,645,600	
セントラル警備保障	6,200	872.00	5,406,400	
アイネス	17,800	635.00	11,303,000	
丹青社	12,000	349.00	4,188,000	
メイテック	21,800	2,330.00	50,794,000	
T K C	12,400	1,653.00	20,497,200	
アサツー ディ・ケイ	23,300	2,402.00	55,966,600	
富士ソフト	19,000	2,071.00	39,349,000	
応用地質	14,900	1,075.00	16,017,500	
船井総合研究所	14,200	600.00	8,520,000	
N S D	26,400	972.00	25,660,800	
進学会	6,300	319.00	2,009,700	
丸紅建材リース	9,000	176.00	1,584,000	
コナミ	60,100	1,781.00	107,038,100	
ベネッセホールディングス	42,900	3,710.00	159,159,000	
イオンディライト	13,700	1,717.00	23,522,900	
ナック	3,100	2,583.00	8,007,300	
福井コンピュータホールディングス	2,000	639.00	1,278,000	
ニチイ学館	27,700	896.00	24,819,200	
ダイセキ	20,900	1,377.00	28,779,300	
ステップ	4,300	741.00	3,186,300	
日鐵商事	30,000	277.00	8,310,000	
元気寿司	4,000	1,133.00	4,532,000	
トラスコ中山	15,300	1,776.00	27,172,800	
ヤマダ電機	60,680	3,565.00	216,324,200	
オートバックスセブン	16,400	3,910.00	64,124,000	
アークランドサカモト	8,300	1,366.00	11,337,800	
ニトリホールディングス	26,350	6,890.00	181,551,500	
グルメ杵屋	9,000	650.00	5,850,000	
愛眼	10,500	312.00	3,276,000	
吉野家ホールディングス	362	107,300.00	38,842,600	
加藤産業	19,300	1,707.00	32,945,100	
イノテック	11,500	392.00	4,508,000	
イエローハット	12,700	1,412.00	17,932,400	
富士エレクトロニクス	6,800	1,281.00	8,710,800	
松屋フーズ	6,100	1,647.00	10,046,700	
J B C Cホールディングス	10,700	697.00	7,457,900	
J Kホールディングス	11,200	463.00	5,185,600	
サガミチェーン	15,000	741.00	11,115,000	
日伝	6,100	2,149.00	13,108,900	
ミロク情報サービス	9,000	338.00	3,042,000	
北沢産業	8,000	172.00	1,376,000	
杉本商事	7,100	800.00	5,680,000	
因幡電機産業	15,700	2,850.00	44,745,000	
住金物産	69,000	303.00	20,907,000	
プレナス	15,000	1,522.00	22,830,000	
ミニストップ	9,900	1,534.00	15,186,600	
アークス	22,800	1,789.00	40,789,200	
パロー	28,700	1,574.00	45,173,800	

バイテック	2,900	678.00	1,966,200	
ミスミグループ本社	49,500	2,336.00	115,632,000	
江守商事	2,600	1,010.00	2,626,000	
アルテック	4,800	210.00	1,008,000	
ベルク	6,500	1,376.00	8,944,000	
大庄	6,000	1,222.00	7,332,000	
タキヒヨー	19,000	470.00	8,930,000	
ファーストリテイリング	26,600	25,450.00	676,970,000	
ソフトバンク	635,700	3,395.00	2,158,201,500	
スズケン	51,100	3,125.00	159,687,500	
サンドラッグ	25,300	3,740.00	94,622,000	
東京デリカ	4,300	946.00	4,067,800	
ジェコス	9,400	666.00	6,260,400	
ヤマザワ	3,600	1,552.00	5,587,200	
やまや	2,800	1,573.00	4,404,400	
ベルーナ	16,300	679.00	11,067,700	
合 計	208,273,308		180,755,973,175	

(注) 備考欄に 印を附した銘柄については、株価指数先物取引に係る差入証拠金代用有価証券として以下の通り、差入を行っております。なお、以下の表における株数は受渡日ベースで計算しております。

銘柄	株数
トヨタ自動車	50,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	200,000
東京電力	25,000

株式以外の有価証券

該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表		(単位：円)
区 分	注記 番号	(平成25年 2月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		365,905,138
国債証券		153,156,673,700
地方債証券		12,470,330,123
特殊債券		17,174,784,628
社債券		11,130,023,694
未収利息		739,638,493
前払費用		32,079,333
流動資産合計		195,069,435,109
資産合計		195,069,435,109
負債の部		
流動負債		
未払解約金		15,379,396
流動負債合計		15,379,396
負債合計		15,379,396
純資産の部		
元本等		
元本	1	170,288,187,355
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		24,765,868,358
元本等合計		195,054,055,713
純資産合計		195,054,055,713
負債純資産合計		195,069,435,109

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>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、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成25年 2月20日現在)
1 期首元本額	164,988,864,707円
期中追加設定元本額	22,033,591,484円
期中一部解約元本額	16,734,268,836円
元本の内訳 ファンド名	

AMC / ステート・ストリート・リスクバ ジェット型バランス・オープン(ステイブ ル)	120,851,648円
ステート・ストリート日本債券インデックス ・ファンド(年金1) < 適格機関投資家限定 >	5,653,002,861円
ステート・ストリート・バランスファンド VA30A < 適格機関投資家限定 >	463,629,476円
ステート・ストリート・バランスファンド VA30B < 適格機関投資家限定 >	16,537,884,872円
ステート・ストリート・バランスファンド VA40A < 適格機関投資家限定 >	41,366,659円
ステート・ストリート・バランスファンド VA40B < 適格機関投資家限定 >	132,230,404円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50A < 適格機関投資家限定 >	106,666,714円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50B < 適格機関投資家限定 >	25,491,871,787円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50C < 適格機関投資家限定 >	296,117,259円
ステート・ストリート・バランスファンド VA25A < 適格機関投資家限定 >	18,533,597,258円
ステート・ストリート・バランスファンド VA37.5A < 適格機関投資家限定 >	3,958,811,248円
ステート・ストリート・バランスファンド VA75A < 適格機関投資家限定 >	33,643,975円
ステート・ストリート4資産バランス20VA < 適 格機関投資家限定 >	4,221,552,011円
ステート・ストリート4資産バランス40VA < 適 格機関投資家限定 >	12,424,363,897円
ステート・ストリート4資産バランス30VA < 適 格機関投資家限定 >	4,489,831,216円
ステート・ストリート・バランスファンド VA35A < 適格機関投資家限定 >	14,242,525,172円
ステート・ストリート・バランスファンド VA40C < 適格機関投資家限定 >	2,243,714,600円
ステート・ストリート世界4資産バランスV A 4 5 < 適格機関投資家限定 >	5,661,160,193円
ステート・ストリート世界4資産バランスV A 2 0 < 適格機関投資家限定 >	462,115,698円
ステート・ストリート日本債券インデックス ・ファンドVA1 < 適格機関投資家限定 >	473,300,309円
ステート・ストリート・グローバル4資産3 0VA < 適格機関投資家限定 >	105,840,023円
ステート・ストリート・グローバル4資産4 5VA < 適格機関投資家限定 >	79,912,550円
ステート・ストリート日本債券インデックス ・ファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	302,045,143円
ステート・ストリート4資産バランス30V A2 < 適格機関投資家限定 >	173,795,349円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 2 5 B < 適格機関投資家限定 >	6,940,659,955円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家限定 >	101,276,499円

ステート・ストリート・バランスファンドV A 3 5 B <適格機関投資家限定>	58,698,664円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 5 0 D <適格機関投資家限定>	351,778円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 1 0 A <適格機関投資家限定>	1,959,828,493円
ステート・ストリート日本債券インデックス ・ファンドV A 3 <適格機関投資家限定>	13,216,220,385円
ステート・ストリート日本債券インデックス ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,564,739,227円
ステート・ストリート4資産インデックスバ ランスV A 2 0 <適格機関投資家限定>	5,153,916,479円
ステート・ストリート世界分散ファンドV A 2 5 A <適格機関投資家限定>	19,010,599,862円
ステート・ストリート4資産インデックスバ ランスV A 5 0 <適格機関投資家限定>	1,875,001円
ステート・ストリート・グローバルバランス 4 0 V A <適格機関投資家限定>	891,906,343円
ステート・ストリート・グローバルバランス 4 0 V A 2 <適格機関投資家限定>	4,586,452,304円
ステート・ストリート・グローバルバランス 4 0 V A 3 <適格機関投資家限定>	338,610,640円
ステート・ストリート・グローバルバランス 5 0 V A <適格機関投資家限定>	213,221,403円
計	170,288,187,355円
2 受益権の総数	170,288,187,355口

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスク及び信用リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成25年 2月20日現在)
貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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)デリバティブ取引 該当する事項はありません。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券		(単位：円)
種類	(平成25年 2月20日現在)	
	当期間の損益に含まれた評価差額	
国債証券		1,176,781,150
地方債証券		34,298,984
特殊債券		64,838,150
社債券		76,443,670
合計		1,352,361,954

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成24年 3月 9日 至 平成25年 2月20日
該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

(平成25年 2月20日現在)	
1口当たり純資産額	1.1454 円
(1万口当たり純資産額)	(11,454 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
国債証券	第100回利付国債（20年）	100,000,000	111,906,000	
	第100回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,713,328,000	
	第101回利付国債（20年）	300,000,000	343,971,000	
	第101回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,517,430,000	
	第102回利付国債（20年）	300,000,000	343,263,000	
	第102回利付国債（5年）	2,200,000,000	2,217,182,000	
	第103回利付国債（20年）	500,000,000	564,970,000	
	第103回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,511,850,000	
	第104回利付国債（20年）	200,000,000	220,584,000	
	第104回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,405,390,000	
	第105回利付国債（20年）	200,000,000	220,010,000	
	第105回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,706,205,000	
	第106回利付国債（20年）	300,000,000	334,104,000	
	第106回利付国債（5年）	2,800,000,000	2,809,548,000	
	第107回利付国債（20年）	300,000,000	328,908,000	
	第107回利付国債（5年）	2,000,000,000	2,006,700,000	
	第108回利付国債（20年）	300,000,000	320,469,000	
	第109回利付国債（20年）	300,000,000	319,467,000	
	第110回利付国債（20年）	400,000,000	437,592,000	
	第111回利付国債（20年）	500,000,000	552,780,000	
	第112回利付国債（20年）	500,000,000	545,415,000	
	第113回利付国債（20年）	900,000,000	979,479,000	
	第114回利付国債（20年）	200,000,000	216,994,000	
	第115回利付国債（20年）	800,000,000	879,960,000	
	第116回利付国債（20年）	600,000,000	658,422,000	
	第118回利付国債（20年）	600,000,000	638,616,000	
	第122回利付国債（20年）	1,400,000,000	1,443,358,000	
	第123回利付国債（20年）	500,000,000	537,280,000	
	第126回利付国債（20年）	600,000,000	634,086,000	
	第127回利付国債（20年）	300,000,000	312,396,000	
	第128回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,141,899,000	
	第12回利付国債（30年）	300,000,000	317,565,000	
	第130回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,019,870,000	
	第132回利付国債（20年）	700,000,000	700,994,000	
	第133回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,221,456,000	
	第135回利付国債（20年）	600,000,000	599,136,000	
	第136回利付国債（20年）	200,000,000	196,412,000	
	第137回利付国債（20年）	700,000,000	696,955,000	
	第139回利付国債（20年）	700,000,000	685,825,000	
	第13回利付国債（30年）	300,000,000	312,159,000	
第140回利付国債（20年）	100,000,000	99,415,000		
第141回利付国債（20年）	200,000,000	198,382,000		
第14回利付国債（30年）	300,000,000	333,096,000		
第15回利付国債（30年）	200,000,000	225,568,000		
第16回利付国債（30年）	200,000,000	225,612,000		
第17回利付国債（30年）	200,000,000	221,932,000		
第18回利付国債（30年）	300,000,000	327,312,000		

第19回利付国債(30年)	400,000,000	436,364,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	357,465,000	
第1回利付国債(40年)	60,000,000	66,313,800	
第20回利付国債(30年)	300,000,000	338,325,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	218,296,000	
第22回利付国債(30年)	100,000,000	112,883,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	112,889,000	
第247回利付国債(10年)	100,000,000	100,051,000	
第248回利付国債(10年)	100,000,000	100,044,000	
第249回利付国債(10年)	100,000,000	100,037,000	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	112,988,000	
第250回利付国債(10年)	100,000,000	100,138,000	
第251回利付国債(10年)	100,000,000	100,268,000	
第253回利付国債(10年)	100,000,000	100,879,000	
第256回利付国債(10年)	100,000,000	101,104,000	
第258回利付国債(10年)	100,000,000	101,343,000	
第25回利付国債(20年)	250,000,000	260,840,000	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	381,724,000	
第260回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,530,840,000	
第264回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,045,800,000	
第267回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,841,184,000	
第268回利付国債(10年)	100,000,000	103,010,000	
第269回利付国債(10年)	100,000,000	102,596,000	
第26回利付国債(30年)	200,000,000	222,016,000	
第270回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,440,768,000	
第271回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,026,800,000	
第272回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,241,820,000	
第273回利付国債(10年)	100,000,000	103,742,000	
第274回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,561,560,000	
第275回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,038,220,000	
第277回利付国債(10年)	100,000,000	104,753,000	
第278回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,475,124,000	
第279回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,271,748,000	
第27回利付国債(20年)	405,000,000	436,662,900	
第27回利付国債(30年)	600,000,000	678,492,000	
第280回利付国債(10年)	100,000,000	106,102,000	
第281回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,064,340,000	
第282回利付国債(10年)	100,000,000	105,794,000	
第283回利付国債(10年)	700,000,000	743,050,000	
第284回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,485,904,000	
第285回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,597,635,000	
第286回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,609,065,000	
第287回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,077,020,000	
第288回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,607,835,000	
第289回利付国債(10年)	800,000,000	852,752,000	
第28回利付国債(30年)	500,000,000	565,835,000	
第290回利付国債(10年)	500,000,000	531,855,000	
第291回利付国債(10年)	100,000,000	105,867,000	
第292回利付国債(10年)	400,000,000	431,528,000	
第293回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,087,130,000	
第294回利付国債(10年)	400,000,000	432,740,000	

第295回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,178,419,000	
第296回利付国債(10年)	100,000,000	107,315,000	
第297回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,282,536,000	
第298回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,700,832,000	
第299回利付国債(10年)	400,000,000	425,496,000	
第29回利付国債(30年)	400,000,000	444,364,000	
第2回利付国債(30年)	700,000,000	790,125,000	
第2回利付国債(40年)	700,000,000	736,274,000	
第300回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,398,436,000	
第301回利付国債(10年)	600,000,000	645,882,000	
第302回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,070,250,000	
第303回利付国債(10年)	950,000,000	1,016,718,500	
第304回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,170,169,000	
第305回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,382,771,000	
第306回利付国債(10年)	100,000,000	106,950,000	
第307回利付国債(10年)	900,000,000	956,358,000	
第308回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,700,032,000	
第309回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,047,940,000	
第30回利付国債(30年)	500,000,000	545,810,000	
第310回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,663,856,000	
第311回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,639,808,000	
第311回利付国債(2年)	100,000,000	100,109,000	
第312回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,369,550,000	
第313回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,166,913,000	
第313回利付国債(2年)	100,000,000	100,039,000	
第314回利付国債(10年)	300,000,000	313,476,000	
第314回利付国債(2年)	200,000,000	200,116,000	
第315回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,051,730,000	
第315回利付国債(2年)	400,000,000	400,248,000	
第316回利付国債(10年)	700,000,000	730,345,000	
第316回利付国債(2年)	300,000,000	300,201,000	
第317回利付国債(10年)	800,000,000	833,640,000	
第317回利付国債(2年)	200,000,000	200,142,000	
第318回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,188,479,000	
第319回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,873,062,000	
第31回利付国債(30年)	900,000,000	962,982,000	
第320回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,063,580,000	
第321回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,338,974,000	
第322回利付国債(10年)	800,000,000	817,128,000	
第322回利付国債(2年)	700,000,000	700,665,000	
第323回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,019,280,000	
第323回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,990,000	
第324回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,010,070,000	
第324回利付国債(2年)	700,000,000	700,728,000	
第325回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,309,893,000	
第326回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,195,056,000	
第32回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,144,510,500	
第33回利付国債(20年)	100,000,000	113,262,000	
第33回利付国債(30年)	650,000,000	665,977,000	
第34回利付国債(30年)	1,050,000,000	1,119,961,500	
第35回利付国債(30年)	500,000,000	510,675,000	

第36回利付国債(20年)	300,000,000	339,390,000	
第36回利付国債(30年)	900,000,000	917,712,000	
第37回利付国債(20年)	400,000,000	454,340,000	
第37回利付国債(30年)	400,000,000	398,112,000	
第38回利付国債(20年)	100,000,000	112,947,000	
第39回利付国債(20年)	100,000,000	112,443,000	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	332,871,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	261,757,500	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	111,763,000	
第41回利付国債(20年)	100,000,000	107,604,000	
第45回利付国債(20年)	650,000,000	740,415,000	
第47回利付国債(20年)	600,000,000	677,442,000	
第48回利付国債(20年)	300,000,000	345,975,000	
第49回利付国債(20年)	100,000,000	112,421,000	
第4回利付国債(40年)	450,000,000	468,945,000	
第50回利付国債(20年)	50,000,000	55,434,000	
第51回利付国債(20年)	150,000,000	167,515,500	
第52回利付国債(20年)	100,000,000	112,466,000	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	558,795,000	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	887,120,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	108,624,000	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	743,673,000	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	358,190,000	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	550,300,000	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	443,832,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	570,320,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	338,973,000	
第6回利付国債(30年)	200,000,000	223,068,000	
第70回利付国債(20年)	500,000,000	580,950,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	677,250,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	338,292,000	
第76回利付国債(20年)	400,000,000	441,868,000	
第76回利付国債(5年)	100,000,000	100,649,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	334,656,000	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	275,742,500	
第78回利付国債(5年)	100,000,000	100,688,000	
第79回利付国債(5年)	100,000,000	100,523,000	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	328,956,000	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	112,686,000	
第80回利付国債(5年)	100,000,000	100,605,000	
第81回利付国債(20年)	400,000,000	445,176,000	
第81回利付国債(5年)	100,000,000	100,808,000	
第82回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,210,980,000	
第83回利付国債(20年)	800,000,000	899,000,000	
第83回利付国債(5年)	600,000,000	606,780,000	
第84回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,008,660,000	
第85回利付国債(20年)	800,000,000	897,576,000	
第85回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,010,310,000	
第86回利付国債(5年)	400,000,000	403,492,000	
第87回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,008,290,000	
第88回利付国債(20年)	500,000,000	572,380,000	

第88回利付国債(5年)	800,000,000	807,528,000	
第89回利付国債(20年)	400,000,000	452,968,000	
第89回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,310,699,000	
第8回利付国債(30年)	300,000,000	303,090,000	
第90回利付国債(20年)	400,000,000	452,236,000	
第90回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,508,865,000	
第91回利付国債(20年)	600,000,000	685,848,000	
第91回利付国債(5年)	800,000,000	807,304,000	
第92回利付国債(20年)	500,000,000	557,990,000	
第92回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,006,550,000	
第93回利付国債(20年)	400,000,000	440,376,000	
第93回利付国債(5年)	600,000,000	607,698,000	
第94回利付国債(20年)	800,000,000	890,960,000	
第95回利付国債(20年)	650,000,000	739,648,000	
第95回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,016,700,000	
第96回利付国債(20年)	400,000,000	444,816,000	
第96回利付国債(5年)	600,000,000	608,184,000	
第97回利付国債(20年)	800,000,000	898,680,000	
第97回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,011,100,000	
第98回利付国債(20年)	100,000,000	111,027,000	
第98回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,310,127,000	
第99回利付国債(20年)	100,000,000	110,838,000	
第99回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,011,400,000	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	94,362,000	
銘柄数: 224	145,815,000,000	153,156,673,700	
地方債証券	第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,762,000
	第10回共同発行市場公募地方債	7,400,000	7,481,030
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,485,000
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,270,000
	第11回共同発行市場公募地方債	9,100,000	9,210,474
	第120回神奈川県公募公債	11,000,000	11,014,190
	第123回神奈川県公募公債	10,580,000	10,692,253
	第128回神奈川県公募公債	19,500,000	19,939,920
	第129回神奈川県公募公債	30,540,000	31,312,967
	第12回さ号名古屋市公募公債	100,000,000	100,127,000
	第12回め号名古屋市公募公債	30,000,000	30,723,300
	第12回共同発行市場公募地方債	1,600,000	1,622,720
	第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,855,000
	第133回神奈川県公募公債	8,000,000	8,226,560
	第134回神奈川県公募公債	20,000,000	20,654,000
	第136回神奈川県公募公債	60,000,000	62,397,000
	第138回神奈川県公募公債	7,260,000	7,617,555
	第139回神奈川県公募公債	300,000	316,899
	第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,499,000
	第141回神奈川県公募公債	5,000,000	5,308,450
	第143回神奈川県公募公債	10,000,000	10,623,000
	第144回神奈川県公募公債	40,000,000	42,583,200
	第145回神奈川県公募公債	40,000,000	42,682,800
	第147回神奈川県公募公債	50,000,000	53,912,000
	第149回神奈川県公募公債	9,000,000	9,687,240
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,427,000

第14回共同発行市場公募地方債	8,600,000	8,751,016	
第15回共同発行市場公募地方債	3,000,000	3,060,510	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	108,063,000	
第16回共同発行市場公募地方債	1,000,000	1,024,250	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,570,000	
第188回神奈川県公募公債	100,000,000	103,054,000	
第18回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,119,400	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,506,000	
第1回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,009,900	
第1回群馬県公募公債(10年)	27,000,000	27,664,740	
第20回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,246,200	
第21回共同発行市場公募地方債	106,200,000	108,740,304	
第22回共同発行市場公募地方債	11,000,000	11,274,450	
第22回川崎市公募公債(5年)	35,500,000	35,923,515	
第23回共同発行市場公募地方債	3,200,000	3,277,472	
第254回大阪府公募公債(10年)	32,860,000	32,898,446	
第259回大阪府公募公債(10年)	17,050,000	17,195,607	
第25回共同発行市場公募地方債	103,500,000	106,428,015	
第267回大阪府公募公債(10年)	62,000,000	63,221,400	
第268回大阪府公募公債(10年)	2,000,000	2,047,700	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,714,000	
第271回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,246,200	
第275回大阪府公募公債(10年)	5,000,000	5,116,950	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,816,000	
第281回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,314,800	
第284回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,399,500	
第287回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,435,300	
第288回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,478,900	
第28回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,911,000	
第292回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,605,000	
第296回大阪府公募公債(10年)	30,000,000	31,933,500	
第29回共同発行市場公募地方債	1,500,000	1,549,005	
第2回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,012,000	
第2回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,980,000	
第301回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,675,300	
第305回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	43,072,800	
第306回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,331,000	
第309回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,683,500	
第30回共同発行市場公募地方債	1,500,000	1,546,770	
第312回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,687,700	
第316回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,853,800	
第31回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,374,300	
第320回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,876,000	
第323回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	43,221,600	
第324回大阪府公募公債(10年)	8,000,000	8,624,160	
第325回大阪府公募公債(10年)	6,000,000	6,477,180	
第326回大阪府公募公債(10年)	56,000,000	60,460,400	
第327回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	108,188,000	
第32回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,130,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,252,000	
第346回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,884,000	

第34回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,379,500	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,506,000	
第35回大阪府公募公債(5年)	20,000,000	20,002,800	
第37回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,364,000	
第37回大阪府公募公債(5年)	26,000,000	26,041,860	
第3回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,012,800	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	111,608,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,571,000	
第44回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,232,000	
第45回共同発行市場公募地方債	7,800,000	8,265,738	
第468回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,641,000	
第47回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,599,000	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,318,000	
第49回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,846,000	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	110,056,000	
第4回共同発行市場公募地方債	3,000,000	3,012,450	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,769,000	
第56回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,364,550	
第57回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,354,200	
第594回東京都公募公債	10,500,000	10,500,315	
第596回東京都公募公債	4,000,000	4,004,000	
第598回東京都公募公債	41,000,000	41,052,890	
第5回共同発行市場公募地方債	5,500,000	5,521,560	
第600回東京都公募公債	2,000,000	2,007,900	
第602回東京都公募公債	6,240,000	6,293,976	
第603回東京都公募公債	3,500,000	3,536,715	
第604回東京都公募公債	2,000,000	2,023,340	
第605回東京都公募公債	30,000,000	30,357,900	
第606回東京都公募公債	16,000,000	16,195,200	
第608回東京都公募公債	20,000,000	20,320,400	
第60回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,657,400	
第611回東京都公募公債	36,000,000	36,830,880	
第612回東京都公募公債	15,000,000	15,322,350	
第613回東京都公募公債	10,000,000	10,230,800	
第614回東京都公募公債	1,000,000	1,021,820	
第617回東京都公募公債	10,000,000	10,238,000	
第618回東京都公募公債	10,000,000	10,247,100	
第61回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,696,900	
第620回東京都公募公債	1,100,000	1,128,721	
第621回東京都公募公債	2,500,000	2,566,325	
第622回東京都公募公債	2,000,000	2,055,240	
第623回東京都公募公債	8,300,000	8,534,973	
第626回東京都公募公債	8,600,000	8,933,594	
第628回東京都公募公債	10,000,000	10,421,000	
第629回東京都公募公債	20,000,000	20,763,200	
第62回共同発行市場公募地方債	20,000,000	21,608,000	
第631回東京都公募公債	700,000	735,042	
第634回東京都公募公債	20,000,000	21,164,200	
第637回東京都公募公債	10,000,000	10,602,700	
第63回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,888,200	
第642回東京都公募公債	100,000,000	106,517,000	

第649回東京都公募公債	2,300,000	2,463,645	
第652回東京都公募公債	1,400,000	1,501,948	
第658回東京都公募公債	10,000,000	10,925,500	
第662回東京都公募公債	10,000,000	10,799,300	
第663回東京都公募公債	100,000,000	107,469,000	
第669回東京都公募公債	100,000,000	108,158,000	
第674回東京都公募公債	100,000,000	106,611,000	
第675回東京都公募公債	100,000,000	107,126,000	
第6回共同発行市場公募地方債	21,900,000	22,091,625	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,729,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	102,710,000	
第704回東京都公募公債	100,000,000	102,500,000	
第709回東京都公募公債	100,000,000	100,568,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,710,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,591,000	
第7回共同発行市場公募地方債	10,600,000	10,691,266	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,301,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,581,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,752,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,886,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,427,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,879,000	
第8回共同発行市場公募地方債	10,100,000	10,213,322	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,527,000	
第9回共同発行市場公募地方債	4,700,000	4,754,661	
平成14年度第4回福岡市公募公債	85,000,000	85,005,950	
平成15年度第10回大阪市公募公債	10,000,000	10,138,400	
平成15年度第10回兵庫県公募公債	10,000,000	10,138,400	
平成15年度第1回広島県公募公債	3,000,000	3,026,250	
平成15年度第3回北海道公募公債	18,200,000	18,267,704	
平成15年度第4回札幌市公募公債	33,000,000	33,293,370	
平成15年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	101,188,000	
平成15年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,214,000	
平成15年度第6回福岡市公募公債	14,900,000	15,079,098	
平成15年度第7回大阪市公募公債(10年)	1,500,000	1,517,115	
平成15年度第8回北海道公募公債	10,200,000	10,319,850	
平成16年度第1回横浜市公募公債	5,000,000	5,080,900	
平成16年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,236,000	
平成16年度第1回埼玉県公募公債	5,000,000	5,083,000	
平成16年度第1回兵庫県公募公債	10,000,000	10,162,400	
平成16年度第2回愛知県公募公債(10年)	11,200,000	11,483,024	
平成16年度第2回横浜市公募公債	20,000,000	20,447,000	
平成16年度第2回広島県公募公債	30,000,000	30,872,700	
平成16年度第2回札幌市公募公債	100,000,000	101,881,000	
平成16年度第2回北九州市公募公債	65,100,000	66,636,360	
平成16年度第3回京都府公募公債	14,200,000	14,539,522	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	16,000,000	16,436,800	
平成16年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	102,418,000	
平成16年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,645,000	

平成16年度第5回埼玉県公募公債	50,000,000	51,237,000	
平成16年度第6回福岡市公募公債	16,000,000	16,381,920	
平成16年度第8回千葉県公募公債	7,000,000	7,169,470	
平成16年度第8回大阪市公募公債	6,000,000	6,147,600	
平成17年度第10回大阪市公募公債	5,000,000	5,198,450	
平成17年度第11回大阪市公募公債	100,000,000	104,373,000	
平成17年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,840,000	
平成17年度第1回横浜市公募公債	18,800,000	19,269,436	
平成17年度第1回北海道公募公債	40,000,000	41,083,600	
平成17年度第2回埼玉県公募公債	13,100,000	13,456,451	
平成17年度第2回鹿児島県公募公債(10年)	12,000,000	12,590,160	
平成17年度第2回静岡県公募公債	30,900,000	31,769,217	
平成17年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	102,816,000	
平成17年度第4回兵庫県公募公債	4,100,000	4,212,053	
平成17年度第5回福岡県公募公債	6,000,000	6,245,700	
平成17年度第9回兵庫県公募公債	10,000,000	10,405,000	
平成17年度第9回北海道公募公債	3,000,000	3,113,880	
平成18年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	106,833,000	
平成18年度第12回北海道公募公債	100,000,000	106,782,000	
平成18年度第1回横浜市公募公債	10,000,000	10,557,200	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	105,971,000	
平成18年度第1回広島市公募公債	30,000,000	31,909,800	
平成18年度第1回堺市公募公債	19,000,000	20,224,170	
平成18年度第1回埼玉県公募公債	5,500,000	5,795,515	
平成18年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	106,053,000	
平成18年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,240,000	
平成18年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,647,200	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,304,000	
平成18年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	106,225,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	7,500,000	7,997,775	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	2,000,000	2,120,280	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	23,100,000	24,503,325	
平成18年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,670,700	
平成18年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	106,625,000	
平成18年度第5回兵庫県公募公債	30,000,000	31,841,100	
平成18年度第6回福岡市公募公債	30,000,000	31,893,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	2,000,000	2,131,980	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	107,178,000	
平成19年度第14回北海道公募公債	10,000,000	10,714,500	
平成19年度第1回愛知県公募公債(10年)	21,700,000	23,193,828	
平成19年度第1回岡山県公募公債(10年)	42,200,000	45,265,830	
平成19年度第1回広島県公募公債	13,800,000	14,742,126	
平成19年度第1回埼玉県公募公債	13,150,000	14,039,860	
平成19年度第1回静岡県公募公債	18,300,000	19,549,890	
平成19年度第1回千葉県公募公債	2,000,000	2,136,600	
平成19年度第1回大分県公募公債	15,670,000	16,902,288	

平成19年度第2回熊本県公募公債（10年）	30,000,000	32,358,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,647,000	
平成19年度第4回大阪市公募公債	10,000,000	10,730,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	13,700,000	14,591,870	
平成19年度第9回大阪市公募公債	30,000,000	32,136,000	
平成19年度第9回北海道公募公債	21,000,000	22,458,030	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,127,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	108,065,000	
平成20年度第1回長野県公募公債	100,000,000	100,783,000	
平成20年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	108,355,000	
平成20年度第1回浜松市公募公債	11,000,000	11,909,480	
平成20年度第2回札幌市公募公債	22,550,000	24,600,246	
平成20年度第2回大阪市公募公債	20,000,000	21,799,400	
平成20年度第2回福島県公募公債	100,000,000	100,873,000	
平成20年度第3回大阪市公募公債	20,000,000	21,680,800	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	107,787,000	
平成20年度第5回広島県公募公債	100,000,000	107,072,000	
平成20年度第7回千葉県公募公債	1,000,000	1,075,130	
平成20年度第7回兵庫県公募公債	10,000,000	10,821,700	
平成20年度第8回大阪市公募公債	40,000,000	43,020,000	
平成20年度第8回兵庫県公募公債（5年）	20,000,000	20,104,000	
平成20年度第9回千葉県公募公債	13,600,000	13,722,128	
平成21年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,536,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	100,000,000	108,039,000	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	107,527,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	20,000,000	21,490,000	
平成21年度第1回千葉県公募公債	40,000,000	42,982,400	
平成21年度第25回兵庫県公募公債	100,000,000	107,321,000	
平成21年度第2回京都府公募公債	100,000,000	106,683,000	
平成21年度第2回広島県公募公債	16,160,000	17,291,038	
平成21年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,758,200	
平成21年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	108,266,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	40,000,000	43,092,000	
平成21年度第3回埼玉県公募公債	20,000,000	21,640,600	
平成21年度第4回大阪市公募公債	100,000,000	107,851,000	
平成21年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,173,000	
平成21年度第6回北海道公募公債	60,000,000	64,546,200	
平成21年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	107,515,000	
平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	103,554,000	
平成24年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,660,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,052,000	
平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	30,160,200	
平成24年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,765,000	
銘柄数：266	11,838,060,000	12,470,330,123	

特殊債券	F 2 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,289,000	
	F 3 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,140,000	
	い第 6 9 4 号農林債	100,000,000	100,099,000	
	い第 6 9 5 号商工債	100,000,000	100,193,000	
	い第 6 9 7 号農林債	100,000,000	100,467,000	
	い第 7 0 2 号農林債	100,000,000	101,068,000	
	い第 7 0 4 号農林債	100,000,000	101,077,000	
	い第 7 1 0 号農林債	100,000,000	101,179,000	
	い第 7 1 1 号農林債	100,000,000	101,329,000	
	い第 7 1 2 号農林債	100,000,000	101,154,000	
	い第 7 2 3 号農林債	100,000,000	100,938,000	
	い第 7 3 0 号商工債	100,000,000	101,707,000	
	い第 7 3 4 号商工債	200,000,000	202,662,000	
	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	106,046,000	
	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	106,727,000	
	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	106,020,000	
	第 1 0 回公営企業債券	10,000,000	10,216,800	
	第 1 0 回国際協力銀行債券	10,000,000	10,106,500	
	第 1 0 回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,762,100	
	第 1 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,703,000	
	第 1 1 回関西国際空港	100,000,000	106,166,000	
	第 1 1 回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,445,000	
	第 1 1 回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	103,090,000	
	第 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	105,435,000	
	第 1 1 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,549,000	
	第 1 1 回中日本高速道路	100,000,000	100,888,000	
	第 1 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,419,000	
	第 1 2 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	105,090,000	
	第 1 2 回政府保証国民生活債券	17,000,000	17,240,550	
	第 1 2 回政府保証東日本高速道路債券	22,000,000	23,366,200	
	第 1 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	106,234,000	
	第 1 2 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,388,000	
	第 1 3 5 回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,882,000	
	第 1 3 回沖縄振興開発金融公庫債券	10,000,000	10,790,500	
	第 1 3 回公営企業債券	30,000,000	30,889,800	
	第 1 3 回公営企業債券(20年)	10,000,000	11,195,300	
	第 1 3 回政府保証西日本高速道路債券	4,000,000	4,247,480	
	第 1 3 回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,066,270	
	第 1 4 1 号商工債(3年)	100,000,000	100,268,000	
	第 1 4 5 号商工債(3年)	200,000,000	200,602,000	
第 1 4 6 回政府保証阪神高速道路債券	1,000,000	1,027,620		
第 1 4 回政府保証中日本高速道路債券	5,000,000	5,376,500		
第 1 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	11,000,000	11,661,870		

第15回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,850,000	
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	53,280,000	
第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000	213,038	
第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,066,810	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	117,564,000	123,543,305	
第173回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,006,100	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,371,000	
第176回政府保証中小企業債券	1,000,000	1,008,520	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,457,000	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,677,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	120,246,000	126,762,130	
第185回政府保証預金保険機構債	300,000,000	301,062,000	
第186回政府保証首都高速道路債券	10,000,000	10,040,800	
第187回政府保証中小企業債券	18,000,000	18,715,320	
第18回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,021,000	
第18回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,077,960	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	120,926,000	126,699,007	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,793,000	
第190回政府保証首都高速道路債券	1,000,000	1,013,920	
第191回政府保証中小企業債券	116,000,000	124,126,960	
第193回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,257,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	10,000,000	10,331,600	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	107,958,000	
第19回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,070,000	
第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,754,000	
第19回都市再生債券	50,000,000	54,377,500	
第1回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,173,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	65,000,000	67,712,450	
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	34,000,000	35,369,520	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	90,210,000	94,097,148	
第20回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000	212,434	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,891,000	
第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,334,000	
第223回信金中金債(5年)	100,000,000	100,477,000	
第228回信金中金債(5年)	100,000,000	101,015,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,785,000	

第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,192,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,300,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	3,000,000	3,181,740	
第23回政府保証本州四国連絡橋債券	8,000,000	8,113,200	
第240回信金中金債（5年）	100,000,000	101,330,000	
第246回信金中金債（5年）	100,000,000	101,139,000	
第24回公営企業債券	70,000,000	74,700,500	
第24回政府保証中日本高速道路債券	20,000,000	21,218,800	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,250,000	
第251回信金中金債（5年）	100,000,000	100,533,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,875,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,508,000	140,072,931	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	20,000,000	21,577,000	
第26回公営企業債券	100,000,000	106,470,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,143,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,703,000	
第27回都市再生債券	100,000,000	100,716,000	
第28回一般担保住宅金融支援機構債券	20,000,000	20,221,200	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,770,000	75,761,847	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,253,000	51,670,337	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,904,000	76,852,480	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,289,000	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,371,000	
第2回政府保証西日本高速道路債券	13,000,000	13,802,100	
第2回政府保証中日本高速道路債券	1,000,000	1,040,010	
第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	109,695,000	
第2回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	106,659,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	62,318,000	65,280,597	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,360,000	111,505,529	
第2号商工債（10年）	100,000,000	104,894,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,046,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	10,640,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,627,000	77,745,694	
第315回政府保証道路債券	3,000,000	3,003,090	
第317回政府保証道路債券	19,000,000	19,025,270	
第318回政府保証道路債券	80,000,000	80,336,800	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,120,000	

第3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,335,000	81,247,377	
第3 2 1 回政府保証道路債券	9,000,000	9,078,390	
第3 2 3 回政府保証道路債券	10,000,000	10,116,100	
第3 2 4 回政府保証道路債券	1,000,000	1,012,070	
第3 2 5 回政府保証道路債券	2,000,000	2,024,420	
第3 2 6 回政府保証道路債券	41,000,000	41,592,860	
第3 2 7 回政府保証道路債券	9,000,000	9,150,480	
第3 2 8 回政府保証道路債券	15,000,000	15,271,050	
第3 2 9 回政府保証道路債券	1,000,000	1,020,460	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,567,000	79,129,228	
第3 3 0 回政府保証道路債券	30,000,000	30,739,800	
第3 3 1 回政府保証道路債券	64,000,000	65,671,680	
第3 3 2 回政府保証道路債券	7,000,000	7,159,320	
第3 3 3 回政府保証道路債券	20,000,000	20,511,400	
第3 3 4 回政府保証道路債券	1,000,000	1,025,090	
第3 3 5 回政府保証道路債券	4,000,000	4,097,440	
第3 3 6 回政府保証道路債券	24,000,000	24,614,880	
第3 3 7 回政府保証道路債券	100,000,000	102,469,000	
第3 3 8 回政府保証道路債券	9,000,000	9,268,380	
第3 3 9 回政府保証道路債券	1,000,000	1,028,880	
第3 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	3,000,000	3,195,570	
第3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	108,850,000	
第3 4 1 回政府保証道路債券	100,000,000	102,774,000	
第3 4 2 回東京交通債券	30,000,000	34,257,000	
第3 4 3 回政府保証道路債券	6,000,000	6,172,860	
第3 4 5 回政府保証道路債券	2,000,000	2,054,700	
第3 4 6 回政府保証道路債券	50,000,000	51,661,000	
第3 4 7 回政府保証道路債券	21,000,000	21,663,810	
第3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	53,314,500	
第3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,948,000	58,681,059	
第3 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,285,000	
第3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	7,000,000	7,530,040	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,811,000	87,797,889	
第3 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,705,000	
第3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,077,440	
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,024,000	
第3 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,317,000	54,054,761	
第3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,241,000	88,074,410	
第3 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,376,000	

第39回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,490,000	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,676,000	89,071,724	
第39回日本政策投資銀行債券	10,000,000	10,684,100	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	50,000,000	50,770,500	
第3回成田国際空港	100,000,000	106,355,000	
第3回政府保証東日本高速道路債券	17,000,000	18,049,920	
第3回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	6,600,000	6,874,824	
第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,542,000	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,751,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,078,670	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	66,000,000	70,659,600	
第42回政府保証関西国際空港債券	7,000,000	7,059,290	
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,076,640	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,845,000	91,777,565	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,372,000	186,483,003	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	9,000,000	9,659,070	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,347,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,405,000	94,678,444	
第46回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,264,000	
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	68,000,000	72,384,640	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	13,000,000	13,854,620	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,615,000	
第4回政府保証新東京国際空港債券	7,000,000	7,029,820	
第50回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,596,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,247,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,147,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	11,000,000	11,684,970	
第55回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	106,139,000	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,145,000	96,801,474	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,293,000	

第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2,000,000	2,159,300	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,960,000	
第5回政府保証成田国際空港債券	2,000,000	2,021,460	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,509,000	
第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	104,573,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	8,000,000	8,685,040	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,664,000	97,666,405	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,115,000	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,142,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,139,000	98,261,619	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	77,000,000	83,006,000	
第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	110,451,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,221,000	35,730,182	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,534,000	49,992,933	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,162,000	
第6回中小企業債券	10,000,000	10,265,500	
第6回都市基盤整備債券	100,000,000	100,058,000	
第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	62,000,000	66,144,080	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,186,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,812,000	
第7回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,092,000	
第7回中日本高速道路	30,000,000	30,288,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	66,000,000	70,898,520	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,275,000	
第825回政府保証公営企業債券	7,000,000	7,004,620	
第826回政府保証公営企業債券	32,000,000	32,031,680	
第827回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,019,050	
第828回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,020,100	
第829回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,037,260	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,443,000	
第831回政府保証公営企業債券	29,000,000	29,256,650	
第832回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,035,000	
第835回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,234,000	
第836回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,012,380	
第837回政府保証公営企業債券	28,000,000	28,404,600	

第838回政府保証公営企業債券	22,000,000	22,366,520	
第839回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,787,000	
第840回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,060,510	
第842回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,598,000	
第843回政府保証公営企業債券	42,000,000	42,955,920	
第844回政府保証公営企業債券	91,000,000	93,335,060	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,559,000	
第849回政府保証公営企業債券	76,000,000	78,245,040	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,763,000	
第850回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,863,000	
第851回政府保証公営企業債券	24,000,000	24,659,760	
第852回政府保証公営企業債券	11,000,000	11,315,150	
第853回政府保証公営企業債券	7,000,000	7,189,490	
第854回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,032,800	
第855回政府保証公営企業債券	2,000,000	2,062,700	
第856回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,568,050	
第857回政府保証公営企業債券	21,000,000	21,884,100	
第859回政府保証公営企業債券	28,000,000	29,161,440	
第860回政府保証公営企業債券	2,000,000	2,090,880	
第861回政府保証公営企業債券	18,000,000	18,837,360	
第862回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,270,350	
第863回政府保証公営企業債券	12,000,000	12,745,680	
第865回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,581,310	
第866回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,197,730	
第867回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,241,360	
第868回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,308,550	
第872回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,267,480	
第873回政府保証公営企業債券	50,000,000	53,187,500	
第874回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,584,460	
第875回政府保証公営企業債券	74,000,000	78,875,860	
第877回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,682,000	
第879回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,280,920	
第880回政府保証公営企業債券	15,000,000	16,090,350	
第881回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,545,000	
第882回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,071,390	
第885回政府保証公営企業債券	40,000,000	43,172,800	
第886回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,256,380	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,532,000	
第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	10,878,400	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	33,000,000	34,544,730	
第8回政府保証日本政策投資銀行債券	2,000,000	2,052,040	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,093,000	57,211,461	
第8回独立行政法人福祉医療機構債券	60,000,000	62,307,000	
第8回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,680,000	
第90回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,095,000	

	第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,696,000	
	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,065,000	
	第9回政府保証国民生活債券	1,000,000	1,003,980	
	第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	110,461,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	69,364,000	74,353,352	
	第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,367,000	59,935,031	
	第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,806,000	
	銘柄数：272	16,445,730,000	17,174,784,628	
社債券	第100回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	100,501,000	
	第101回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	108,734,000	
	第106回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	101,077,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	105,775,000	
	第11回旭硝子	100,000,000	101,001,000	
	第11回三井住友銀行	100,000,000	108,620,000	
	第11回商船三井	100,000,000	100,852,000	
	第11回電源開発	100,000,000	105,034,000	
	第12回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	108,042,000	
	第12回日立製作所	100,000,000	100,128,000	
	第13回ジェイエフイーホールディングス	100,000,000	100,933,000	
	第15回ダイキン工業	100,000,000	103,564,000	
	第15回豊田自動織機	100,000,000	103,740,000	
	第16回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	100,889,000	
	第16回みずほコーポレート銀行	100,000,000	101,339,000	
	第17回三菱重工業	100,000,000	100,160,000	
	第17回東日本旅客鉄道	100,000,000	112,870,000	
	第17回野村ホールディングス	100,000,000	101,386,000	
	第18回みずほ銀行	100,000,000	106,258,000	
	第19回ソニー	100,000,000	100,078,000	
	第19回味の素	100,000,000	101,842,000	
	第1回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	100,407,000	
	第1回第一三共	100,000,000	101,176,000	
	第1回東海旅客鉄道	50,000,000	52,244,500	
	第1回日東電工	100,000,000	101,311,000	
	第20回大阪瓦斯	100,000,000	108,860,000	
	第21回サントリー	100,000,000	101,230,000	
	第21回三井不動産	100,000,000	100,119,000	
	第22回シティグループ・インク	100,000,000	102,188,000	
	第23回新日本石油	100,000,000	100,132,000	
	第245回四国電力	100,000,000	107,658,000	
	第24回みずほコーポレート銀行	100,000,000	101,103,000	
	第257回北海道電力	100,000,000	110,316,000	
第25回日本郵船	100,000,000	105,953,000		
第261回北海道電力	12,000,000	13,180,080		
第26回東海旅客鉄道	100,000,000	109,683,000		

第27回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,981,000	
第281回北陸電力	100,000,000	106,823,000	
第28回東京瓦斯	100,000,000	111,610,000	
第294回北陸電力	8,900,000	8,902,314	
第299回北海道電力	100,000,000	100,490,000	
第2回キリンホールディングス	100,000,000	102,212,000	
第2回花王	100,000,000	100,552,000	
第2回東日本旅客鉄道	100,000,000	109,514,000	
第31回アサヒビール	100,000,000	101,014,000	
第32回住友商事	100,000,000	106,519,000	
第32回東日本旅客鉄道	100,000,000	113,129,000	
第341回中国電力	100,000,000	101,514,000	
第34回東邦瓦斯	100,000,000	100,596,000	
第354回中国電力	100,000,000	106,732,000	
第36回NTTファイナンス	100,000,000	101,129,000	
第374回九州電力	10,000,000	10,059,200	
第378回東北電力	100,000,000	109,955,000	
第37回三菱化学	100,000,000	108,635,000	
第382回東北電力	10,000,000	10,977,100	
第394回九州電力	100,000,000	105,023,000	
第3回TDK	100,000,000	101,091,000	
第3回住友信託銀行	100,000,000	101,889,000	
第3回松下電工	100,000,000	101,815,000	
第3回西日本旅客鉄道	70,000,000	78,647,100	
第3回東日本旅客鉄道	3,000,000	3,340,500	
第400回九州電力	100,000,000	104,326,000	
第401回九州電力	100,000,000	101,500,000	
第407回中部電力	100,000,000	107,170,000	
第415回東北電力	10,000,000	10,006,800	
第427回関西電力	100,000,000	100,288,000	
第428回東京電力	10,000,000	10,294,800	
第42回三菱電機	100,000,000	101,291,000	
第42回住友化学	100,000,000	100,995,000	
第435回東北電力	100,000,000	104,268,000	
第43回三井物産	100,000,000	100,051,000	
第445回東北電力	100,000,000	104,394,000	
第44回三井住友銀行	100,000,000	100,504,000	
第450回関西電力	100,000,000	103,881,000	
第462回中部電力	100,000,000	100,048,000	
第466回中部電力	100,000,000	101,925,000	
第46回伊藤忠商事	100,000,000	107,076,000	
第473回関西電力	100,000,000	101,219,000	
第473回中部電力	100,000,000	103,160,000	
第486回中部電力	100,000,000	105,666,000	
第48回三菱商事	100,000,000	100,050,000	
第48回日本電信電話	100,000,000	102,266,000	
第49回小田急電鉄	100,000,000	101,093,000	
第49回新日本製鐵	100,000,000	100,155,000	
第4回ブリヂストン	100,000,000	100,146,000	
第4回東京地下鉄	10,000,000	11,349,100	
第4回日本通運	100,000,000	101,173,000	

第502回東京電力	20,000,000	19,994,000	
第50回日本電信電話	100,000,000	103,615,000	
第515回東京電力	100,000,000	97,493,000	
第51回神戸製鋼所	100,000,000	101,355,000	
第520回東京電力	100,000,000	97,271,000	
第525回東京電力	100,000,000	94,759,000	
第52回日本電信電話	100,000,000	106,293,000	
第531回東京電力	100,000,000	94,138,000	
第536回東京電力	100,000,000	92,475,000	
第542回東京電力	100,000,000	91,763,000	
第545回東京電力	100,000,000	92,523,000	
第546回東京電力	10,000,000	9,842,200	
第56回住友金属工業	100,000,000	100,162,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	112,712,000	
第59回東日本旅客鉄道	100,000,000	100,911,000	
第5回ウエストパック・バンキング・ コーポレーション	100,000,000	101,663,000	
第5回セブン銀行	100,000,000	101,120,000	
第5回日本たばこ産業	100,000,000	101,192,000	
第65回三菱地所	100,000,000	100,084,000	
第65回東京急行電鉄	100,000,000	101,598,000	
第6回みずほ銀行	100,000,000	106,676,000	
第70回丸紅	100,000,000	101,774,000	
第72回三菱商事	100,000,000	101,039,000	
第7回オリエンタルランド	100,000,000	104,883,000	
第7回トヨタ自動車	100,000,000	100,974,000	
第7回パナソニック	100,000,000	100,722,000	
第7回みずほコーポレート銀行	100,000,000	110,992,000	
第7回小松製作所	100,000,000	101,286,000	
第8回KDDI	100,000,000	100,958,000	
第8回日興コーディアルグループ	100,000,000	101,362,000	
第9回沖縄電力	100,000,000	102,566,000	
銘柄数：118	10,823,900,000	11,130,023,694	
合計	184,922,690,000	193,931,812,145	

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

[次へ](#)

「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表		(単位：円)
区 分	注記 番号	(平成25年 2月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		1,185,571,232
コール・ローン		2,247,093,458
株式		159,469,953,294
投資証券		3,670,223,095
派生商品評価勘定		104,432,409
未収入金		699,405
未収配当金		231,852,112
未収利息		4,309
差入委託証拠金		632,282,569
流動資産合計		167,542,111,883
資産合計		167,542,111,883
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		16,247,583
未払解約金		230,050,000
流動負債合計		246,297,583
負債合計		246,297,583
純資産の部		
元本等		
元本	1	129,060,389,058
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		38,235,425,242
元本等合計		167,295,814,300
純資産合計		167,295,814,300
負債純資産合計		167,542,111,883

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年12月1日から、翌年11月30日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券、新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所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つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式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、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成25年 2月20日現在)
1 期首元本額	140,608,680,472円
期中追加設定元本額	26,878,620,365円
期中一部解約元本額	38,426,911,779円
元本の内訳	
ファンド名	
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	12,633,758,885円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	6,528,890,170円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	27,166,854円
AMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン(ステイブル)	8,446,607円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA1(適格機関投資家専用)	6,036,320,227円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA2(適格機関投資家専用)	880,770,553円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	87,643,477円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	6,672,746,747円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	12,965,709円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	83,657,989円

ステート・ストリート・バランスファンド VA50A < 適格機関投資家限定 >	47,621,000円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50B < 適格機関投資家限定 >	23,989,450,774円
ステート・ストリート・バランスファンド VA50C < 適格機関投資家限定 >	120,299,212円
ステート・ストリート・バランスファンド VA25A < 適格機関投資家限定 >	4,355,494,682円
ステート・ストリート・バランスファンド VA37.5A < 適格機関投資家限定 >	2,156,250,160円
ステート・ストリート・バランスファンド VA75A < 適格機関投資家限定 >	277,955,272円
ステート・ストリート4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	958,474,547円
ステート・ストリート4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	7,656,404,820円
ステート・ストリート4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	1,773,473,392円
ステート・ストリート・バランスファンド VA35A < 適格機関投資家限定 >	5,676,510,519円
ステート・ストリート・バランスファンド VA40C < 適格機関投資家限定 >	1,341,553,493円
ステート・ストリート世界4資産バランスV A 4 5 < 適格機関投資家限定 >	3,715,644,034円
ステート・ストリート世界4資産バランスV A 2 0 < 適格機関投資家限定 >	130,181,513円
ステート・ストリート・グローバル4資産3 0VA < 適格機関投資家限定 >	96,780,521円
ステート・ストリート・グローバル4資産4 5VA < 適格機関投資家限定 >	149,538,195円
ステート・ストリート4資産バランス30V A2 < 適格機関投資家限定 >	108,093,752円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 2 5 B < 適格機関投資家限定 >	859,884,557円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家限定 >	7,486,875円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 3 5 B < 適格機関投資家限定 >	11,096,048円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 5 0 D < 適格機関投資家限定 >	142,946円
ステート・ストリート・バランスファンドV A 1 0 A < 適格機関投資家限定 >	102,021,365円
ステート・ストリート外国株式インデックス ・ファンドVA3 < 適格機関投資家限定 >	24,665,324,629円
ステート・ストリート4資産インデックスバ ランスVA20 < 適格機関投資家限定 >	807,457,937円
ステート・ストリート4資産インデックスバ ランスVA50 < 適格機関投資家限定 >	7,676,916円
ワールドエクイティ・ファンドVL < 適格機 関投資家限定 >	17,073,204,681円
計	129,060,389,058円
2 受益権の総数	129,060,389,058口

（金融商品に関する注記）

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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、株価指数先物取引、為替予約取引があり、株価指数先物取引はファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、効率的な運用に資する目的として、また為替予約取引は保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用しております。これらは、それぞれの取引種類により、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

金融商品の時価等に関する事項

区分	（平成25年 2月20日現在）
貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p>

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載してあります。
	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。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券		(単位：円)
種 類	(平成25年 2月20日現在)	
	当期間の損益に含まれた評価差額	
株式		11,757,237,014
投資証券		226,150,372
合計		11,983,387,386

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
株式関連

(単位：円)

区分	種 類	(平成25年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500	2,279,187,561		2,326,074,399	46,886,838
	S&P 60	230,953,782		231,211,977	258,195
	SPI 200	223,824,294		232,971,254	9,146,960
	FTSE100INDEX	454,077,125		459,976,936	5,899,811
	FSMI INDEX	193,437,906		198,486,235	5,048,329
	EURO STOXX 50	521,671,251		509,064,035	12,607,216
	合 計	3,903,151,919		3,957,784,836	54,632,917

(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、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又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、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。

- 2 . 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 . 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 4 . 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 5 . ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

通貨関連

(単位：円)

区分	種 類	(平成25年 2月20日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益

		うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	買建			
	アメリカ・ドル	1,962,750,160	1,993,084,800	30,334,640
	カナダ・ドル	174,520,710	174,938,400	417,690
	オーストラリア・ドル	115,406,400	116,148,000	741,600
	イギリス・ポンド	363,127,500	361,375,000	1,752,500
	ユーロ	373,422,900	376,980,000	3,557,100
	売建			
	アメリカ・ドル	748,562,636	749,280,000	717,364
	カナダ・ドル	59,583,102	59,238,400	344,702
	オーストラリア・ドル	50,183,155	50,330,800	147,645
	イギリス・ポンド	126,570,615	125,758,500	812,115
	ユーロ	158,293,171	158,331,600	38,429
	合計	4,132,420,349	4,165,465,500	33,551,909

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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で評価しております。

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、以下の方法によっております。

- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、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ております。
- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成24年 3月 9日
至 平成25年 2月20日
該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成25年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	1.2963 円
(1万口当たり純資産額)	(12,963 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表
株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	34,880	84.13	2,934,454.40	
	APACHE CORP	27,239	77.30	2,105,574.70	
	BAKER HUGHES	30,620	46.65	1,428,423.00	
	CABOT OIL GAS CORP	14,500	55.52	805,040.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,108	65.95	1,128,272.60	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	46,200	20.36	940,632.00	
	CHEVRON CORPORATION	137,100	115.92	15,892,632.00	
	CIMAREX ENERGY CO	6,500	66.95	435,175.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	13,800	25.22	348,036.00	
	CONCHO RESOURCES INC	7,200	97.79	704,088.00	
	CONOCOPHILLIPS	80,600	58.60	4,723,160.00	
	CONSOL ENERGY INC	16,800	34.38	577,584.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,400	84.90	288,660.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,500	135.58	474,530.00	
	DENBURY RESOURCES INC	27,000	18.72	505,440.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	26,740	60.57	1,619,641.80	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,100	74.66	380,766.00	
	ENERGEN CORP	5,300	47.97	254,241.00	
	ENSCO PLC CL A	16,116	65.45	1,054,792.20	
	EOG RESOURCES INC	18,854	131.40	2,477,415.60	
	EQT CORPORATION	10,300	60.72	625,416.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	322,700	89.32	28,823,564.00	
	FMC TECHNOLOGIES INC	16,500	53.05	875,325.00	
	HALLIBURTON CO	64,734	42.81	2,771,262.54	
	HELMERICH & PAYNE	7,800	67.94	529,932.00	
	HESS CORP	21,400	68.21	1,459,694.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	13,343	56.32	751,477.76	
	KINDER MORGAN INC	44,981	37.42	1,683,189.02	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	7,441	82.70	615,370.70	
	MARATHON OIL CORP	49,157	35.71	1,755,396.47	
	MARATHON PETROLEUM CORP	23,566	84.21	1,984,492.86	
	MURPHY OIL CORP	12,800	61.99	793,472.00	
	NABORS INDUSTRIES	19,866	18.00	357,588.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	29,731	69.48	2,065,709.88	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	9,900	27.30	270,270.00	
	NOBLE CORP	17,448	39.68	692,336.64	
	NOBLE ENERGY INC	12,400	113.90	1,412,360.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	56,546	85.80	4,851,646.80	
	OCEANEERING INTL INC	7,458	63.00	469,854.00	
	PEABODY ENERGY CORP	18,500	24.45	452,325.00	
	PHILLIPS 66	41,505	64.76	2,687,863.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,124	132.45	1,076,023.80		
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,430	47.27	445,756.10		
QEP RESOURCES INC	12,200	30.62	373,564.00		
RANGE RESOURCES CORP	11,300	72.49	819,137.00		
ROWAN COMPANIES PLC	9,400	36.65	344,510.00		
SCHLUMBERGER LTD	92,687	79.99	7,414,033.13		
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,200	33.28	805,376.00		
SPECTRA ENERGY CORP	45,419	29.74	1,350,761.06		
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,600	26.91	312,156.00		
ULTRA PETROLEUM CORP	11,300	16.44	185,772.00		

VALERO ENERGY CORP	38,426	47.73	1,834,072.98	
WEATHERFORD INTL LTD	55,260	13.10	723,906.00	
WHITING PETROLEUM CORP	8,100	50.19	406,539.00	
WILLIAMS COS	47,341	35.45	1,678,238.45	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	14,696	88.70	1,303,535.20	
AIRGAS INC	4,800	98.64	473,472.00	
ALBEMARLE CORP	6,100	65.84	401,624.00	
ALCOA INC	73,788	9.06	668,519.28	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	8,000	32.64	261,120.00	
BALL CORP	10,900	45.09	491,481.00	
CELANESE CORP DEL COM SER A	11,000	49.74	547,140.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,400	218.53	961,532.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,700	28.84	308,588.00	
CROWN HOLDINGS INC	10,900	39.63	431,967.00	
DOW CHEMICAL CO	83,574	32.20	2,691,082.80	
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	64,878	47.18	3,060,944.04	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,600	73.43	778,358.00	
ECOLAB INC	20,394	75.69	1,543,621.86	
FMC CORP	10,100	59.32	599,132.00	
FREEPORT MCMORAN C & G B	66,124	34.26	2,265,408.24	
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	5,889	73.85	434,902.65	
INT'L PAPER CO	28,890	41.91	1,210,779.90	
LYONDELLBASELL INDU CL A	22,000	61.18	1,345,960.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,300	102.04	336,732.00	
MEADWESTVACO CORP	12,340	35.17	433,997.80	
MONSANTO CO	37,178	101.89	3,788,066.42	
MOSAIC CO/THE	21,464	61.46	1,319,177.44	
NEWMONT MINING CORP HOLD ING CO	34,553	42.90	1,482,323.70	
NUCOR CORP	22,084	47.72	1,053,848.48	
OWENS-ILLINOIS INC	11,300	26.52	299,676.00	
PPG INDUSTRIES	10,662	135.71	1,446,940.02	
PRAXAIR	20,789	110.74	2,302,173.86	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,300	82.68	438,204.00	
SEALED AIR CORP	12,410	21.15	262,471.50	
SHERWIN-WILLIAMS CO	6,064	164.10	995,102.40	
SIGMA-ALDRICH	8,368	77.50	648,520.00	
UNITED STATES STEEL CORP	11,100	23.14	256,854.00	
VULCAN MATERIALS CO	9,456	54.81	518,283.36	
3M CO	45,856	104.18	4,777,278.08	
AGCO CORP	7,000	53.86	377,020.00	
AMETEK INC	16,800	42.43	712,824.00	
BOEING CO	49,798	74.65	3,717,420.70	
CATERPILLAR	45,600	95.60	4,359,360.00	
CUMMINS ENGINE CO	12,600	118.87	1,497,762.00	
DANAHER CORP	41,216	61.80	2,547,148.80	
DEERE & CO	25,992	90.37	2,348,897.04	
DOVER CORP	12,714	72.86	926,342.04	
EATON CORP PLC	32,946	61.49	2,025,849.54	
EMERSON ELECTRIC CO	50,708	58.56	2,969,460.48	
FASTENAL CO	19,500	53.18	1,037,010.00	

FLOWSERVE CORP	3,700	159.72	590,964.00
FLUOR CORP	12,168	66.28	806,495.04
GENERAL DYNAMICS CORP	20,896	67.03	1,400,658.88
GENERAL ELECTRIC CO	737,939	23.75	17,526,051.25
GRAINGER (WW)	4,145	229.13	949,743.85
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	51,737	70.93	3,669,705.41
ILLINOIS TOOL WORKS	29,440	64.19	1,889,753.60
INGERSOLL-RAND PLC	21,459	53.64	1,151,060.76
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,900	50.30	447,670.00
JOY GLOBAL INC	7,300	63.54	463,842.00
KBR INC COM	10,600	32.18	341,108.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,000	77.63	543,410.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	19,189	88.23	1,693,045.47
MASCO CORP	26,123	19.98	521,937.54
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,292	66.20	1,078,530.40
PACCAR INC	23,306	48.46	1,129,408.76
PALL CORP	8,500	68.70	583,950.00
PARKER HANNIFIN CORP	10,362	97.46	1,009,880.52
PENTAIR LTD REGISTERED	14,514	52.62	763,726.68
PRECISION CASTPARTS CORP	10,100	185.23	1,870,823.00
QUANTA SERVICES INC	15,400	28.89	444,906.00
RAYTHEON COMPANY	23,099	54.29	1,254,044.71
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,822	90.85	892,328.70
ROCKWELL COLLINS	9,309	59.12	550,348.08
ROPER INDUSTRIES INC	6,800	121.66	827,288.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,900	33.54	231,426.00
SPX CORP	3,944	80.04	315,677.76
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,060	79.17	875,620.20
TEXTRON	19,452	29.58	575,390.16
TRANSDIGM GROUP INC	3,400	143.05	486,370.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,476	91.02	5,504,525.52
XYLEM INC	13,430	28.76	386,246.80
ADT CORP/THE	16,025	47.27	757,501.75
AVERY DENNISON CORP	7,757	40.07	310,822.99
CINTAS CORP	7,799	44.56	347,523.44
DUN & BRADSTREET CORP	3,200	83.07	265,824.00
EQUIFAX INC	8,303	55.80	463,307.40
IHS INC	4,100	105.06	430,746.00
IRON MOUNTAIN INC	10,180	34.96	355,892.80
MANPOWER GROUP	5,654	56.15	317,472.10
NIELSEN HOLDINGS N	8,600	32.69	281,134.00
PITNEY BOWES INC	14,888	13.58	202,179.04
REPUBLIC SERVICES INC	21,530	31.17	671,090.10
ROBERT HALF INTERNATIONA L INC	10,140	36.73	372,442.20
STERICYCLE INC	5,900	96.70	570,530.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	31,951	32.34	1,033,295.34
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,300	54.99	566,397.00
WASTE MANAGEMENT (NEW)	30,623	36.62	1,121,414.26
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,200	58.37	653,744.00
CSX CORP	72,370	23.08	1,670,299.60

DELTA AIR LINES INC	14,700	14.30	210,210.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,604	42.60	622,130.40	
FEDEX CORP	20,796	107.33	2,232,034.68	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	20,500	19.61	402,005.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,000	67.62	473,340.00	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	357,000	0.85	303,450.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,000	99.08	792,640.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,223	73.20	1,626,723.60	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,910	11.70	162,747.00	
UNION PACIFIC CORP	33,100	137.53	4,552,243.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,727	26.75	179,947.25	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	50,657	84.76	4,293,687.32	
AUTOLIV INC	6,600	69.18	456,588.00	
BORGWARNER INC	7,900	76.80	606,720.00	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	21,254	39.76	845,059.04	
FORD MOTOR COMPANY	248,121	12.99	3,223,091.79	
GENERAL MOTORS CO	54,500	27.68	1,508,560.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	18,800	14.09	264,892.00	
HARLEY-DAVIDSON	15,758	52.40	825,719.20	
JOHNSON CONTROLS	47,642	32.46	1,546,459.32	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,600	61.42	466,792.00	
COACH INC	19,766	49.02	968,929.32	
DR HORTON INC	19,766	23.29	460,350.14	
FOSSIL INC	3,600	104.95	377,820.00	
GARMIN LTD	8,500	39.24	333,540.00	
HASBRO INC	8,700	40.91	355,917.00	
LEGGETT & PLATT INC	10,600	30.65	324,890.00	
LENNAR CORP-CL A	11,012	39.91	439,488.92	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,900	69.75	481,275.00	
MATTEL	23,661	41.20	974,833.20	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,000	108.78	435,120.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	19,889	24.09	479,126.01	
NIKE B	50,792	54.47	2,766,640.24	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,489	86.31	387,445.59	
PULTE GROUP INC	23,863	19.95	476,066.85	
PVH CORP	4,900	121.14	593,586.00	
RALPH LAUREN CORP	4,400	177.04	778,976.00	
TOLL BROTHERS INC	10,400	36.90	383,760.00	
UNDER ARMOUR INC CLASS A	6,060	49.76	301,545.60	
VF CORP	6,139	163.38	1,002,989.82	
WHIRLPOOL CORP	5,674	112.61	638,949.14	
BLOCK (H&R)	19,584	25.00	489,600.00	
CARNIVAL CORP	31,115	36.51	1,136,008.65	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,300	313.05	720,015.00	
DARDEN RESTAURANTS	8,819	45.25	399,059.75	
INT'L GAME TECHNOLOGY	19,121	16.60	317,408.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,600	51.25	1,465,750.00	
MARRIOTT INT'L A	18,867	40.83	770,339.61	
MCDONALD'S CORP	70,450	93.85	6,611,732.50	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	26,400	12.74	336,336.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,600	35.34	374,604.00	

STARBUCKS CORP	53,012	54.45	2,886,503.40	
STARWOOD HOTELS & RESORT S WORLDWIDE INC	13,613	61.44	836,382.72	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,800	58.87	576,926.00	
WYNN RESORTS LTD	5,600	120.39	674,184.00	
YUM! BRANDS INC	31,764	65.15	2,069,424.60	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	14,200	15.28	216,976.00	
CBS CORP-CL B	41,617	44.88	1,867,770.96	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,200	79.39	254,048.00	
COMCAST CORP-CL A	147,688	41.45	6,121,667.60	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	40,160	39.34	1,579,894.40	
DIRECTV	43,819	49.26	2,158,523.94	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,145	70.63	716,541.35	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,845	63.02	431,371.90	
DISH NETWORK CORP-A	15,597	36.09	562,895.73	
DISNEY (WALT) CO NEW	119,106	55.73	6,637,777.38	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	31,616	12.58	397,729.28	
LIBERTY GLOBAL INC	9,500	65.05	617,975.00	
LIBERTY GLOBAL INC-C	8,100	59.63	483,003.00	
LIBERTY MEDIA CORP	7,260	110.72	803,827.20	
NEWS CORP INC-CL A	109,227	29.15	3,183,967.05	
NEWS CORP-CLASS B	30,418	29.75	904,935.50	
OMNICOM GROUP	18,488	57.29	1,059,177.52	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	5,900	62.42	368,278.00	
SIRIUS XM RADIO INC	265,800	3.17	842,586.00	
TIME WARNER CABLE INC-A	21,372	86.98	1,858,936.56	
TIME WARNER INC	66,243	53.79	3,563,210.97	
VIACOM INC-CLASS B	32,317	60.16	1,944,190.72	
VIRGIN MEDIA INC	17,717	44.73	792,569.99	
ADOVANCE AUTO PARTS	5,450	80.72	439,924.00	
AMAZON COM INC	25,223	269.75	6,803,904.25	
AUTOZONE INC	2,359	375.21	885,120.39	
BED BATH & BEYOND INC	16,187	58.16	941,517.01	
BEST BUY COMPANY INC	21,257	17.33	368,383.81	
CARMAX INC	15,750	40.05	630,787.50	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,800	49.46	336,328.00	
DOLLAR GENERAL CORP	18,200	43.96	800,072.00	
DOLLAR TREE INC	15,900	40.40	642,360.00	
EXPEDIA INC	6,727	64.42	433,353.34	
FAMILY DOLLAR STORES	7,444	55.03	409,643.32	
GAMESTOP CORP NEW	9,700	25.50	247,350.00	
GAP	21,673	32.64	707,406.72	
GENUINE PARTS CO	10,700	68.75	735,625.00	
HOME DEPOT	105,288	67.55	7,112,204.40	
KOHL'S CORP	15,421	46.48	716,768.08	
LIBERTY INTERACTIVE CORP	35,678	21.70	774,212.60	
LIMITED BRANDS INC	16,890	44.64	753,969.60	
LKQ CORP	20,445	22.41	458,172.45	
LOWE'S COMPANIES	82,132	39.41	3,236,822.12	
MACY'S INC	27,950	40.43	1,130,018.50	
NETFLIX INC	3,700	196.45	726,865.00	

NORDSTROM INC	11,700	56.47	660,699.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,200	102.16	837,712.00	
PENNEY (J.C) CO	11,672	19.61	228,887.92	
PETSMART INC	8,000	63.98	511,840.00	
PRICELINE COM INC	3,480	703.47	2,448,075.60	
ROSS STORES INC	15,700	59.93	940,901.00	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,656	48.54	128,922.24	
STAPLES	49,739	14.65	728,676.35	
TARGET CORP	43,370	61.87	2,683,301.90	
TIFFANY & CO	9,225	65.65	605,621.25	
TJX COMPANIES INC	51,326	45.15	2,317,368.90	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,100	103.44	527,544.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,100	85.71	351,411.00	
URBAN OUTFITTERS INC	8,500	41.69	354,365.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,190	101.90	3,076,361.00	
CVS CAREMARK CORP	88,820	52.66	4,677,261.20	
KROGER CO	35,954	28.21	1,014,262.34	
SAFEWAY INC	17,551	20.46	359,093.46	
SYSCO CORP	40,789	32.29	1,317,076.81	
WALGREEN CO	62,362	41.70	2,600,495.40	
WAL-MART STORES	129,984	68.76	8,937,699.84	
WHOLE FOODS MARKET INC	12,200	87.36	1,065,792.00	
ALTRIA GROUP INC	141,923	34.77	4,934,662.71	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	45,854	33.08	1,516,850.32	
BEAM INC	9,868	62.60	617,736.80	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,962	66.48	595,793.76	
BUNGE LIMITED	10,100	74.82	755,682.00	
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,906	40.00	556,240.00	
COCA COLA ENTERPRISES	20,400	36.50	744,600.00	
COCA-COLA CO	283,770	37.67	10,689,615.90	
CONAGRA FOODS	28,169	33.45	942,253.05	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,100	43.28	480,408.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	15,362	43.00	660,566.00	
GENERAL MILLS	45,122	45.43	2,049,892.46	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,400	45.35	426,290.00	
HEINZ (H.J) CO	22,282	72.20	1,608,760.40	
HORMEL FOODS CORP	10,700	36.54	390,978.00	
JM SMUCKER CO	8,088	91.75	742,074.00	
KELLOGG CO	17,440	60.14	1,048,841.60	
KRAFT FOODS GROUP INC	39,148	47.37	1,854,440.76	
LORILLARD INC	27,238	42.41	1,155,163.58	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,900	65.01	578,589.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION C OMPANY	14,182	80.40	1,140,232.80	
MOLSON COORS BREWING CO-B	10,900	45.10	491,590.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	117,626	26.98	3,173,549.48	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,100	49.68	551,448.00	
PEPSICO INC	108,714	75.50	8,207,907.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIO NAL INC-W/I	117,833	91.31	10,759,331.23	
REYNOLDS AMERICAN INC	23,600	44.18	1,042,648.00	

THE HERSHEY COMPANY	10,900	81.73	890,857.00	
TYSON FOODS INC-CL A	21,200	24.13	511,556.00	
AVON PRODUCTS	29,838	20.69	617,348.22	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,200	60.43	616,386.00	
CLOROX CO	8,524	82.54	703,570.96	
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,100	111.91	3,704,221.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,400	92.19	405,636.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	16,400	63.60	1,043,040.00	
HERBALIFE LTD	8,100	39.74	321,894.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,523	92.21	2,537,895.83	
PROCTER & GAMBLE CO	192,679	77.38	14,909,501.02	
ABBOTT LABORATORIES	109,509	34.82	3,813,103.38	
AETNA INC-NEW	23,212	48.71	1,130,656.52	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,392	47.22	821,250.24	
BARD (C.R.) INC	5,492	100.30	550,847.60	
BAXTER INTERNATIONAL	38,137	68.32	2,605,519.84	
BECTON DICKINSON	13,851	88.57	1,226,783.07	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	98,177	7.50	736,327.50	
CARDINAL HEALTH INC	23,684	46.46	1,100,358.64	
CAREFUSION CORP	16,442	33.07	543,736.94	
CERNER CORP	10,100	88.43	893,143.00	
CIGNA CORP	20,032	60.43	1,210,533.76	
COVENTRY HEALTH CARE INC	9,750	45.95	448,012.50	
COVIDIEN PLC	33,474	63.56	2,127,607.44	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	6,800	115.90	788,120.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,400	43.49	452,296.00	
EDWARDS LIFESCIENCES	8,000	86.70	693,600.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	56,541	56.99	3,222,271.59	
HCA HOLDINGS INC	13,506	36.41	491,753.46	
HENRY SCHEIN INC	6,400	89.30	571,520.00	
HOLOGIC INC	19,116	21.89	418,449.24	
HUMANA	11,200	73.01	817,712.00	
INTUITIVE SURGICAL INC COMMON NEW	2,830	582.27	1,647,824.10	
LABORATORY CORP OF AMER HLDGS	6,644	90.28	599,820.32	
MCKESSON CORP	16,462	103.87	1,709,907.94	
MEDTRONIC INC	71,503	45.80	3,274,837.40	
OMNICARE INC	8,500	39.30	334,050.00	
PATTERSON COS INC	6,400	37.22	238,208.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	11,546	57.54	664,356.84	
RESMED INC	9,833	43.24	425,178.92	
ST JUDE MEDICAL INC	21,824	41.65	908,969.60	
STRYKER CORP	21,190	63.69	1,349,591.10	
UNITED HEALTH GROUP INC	72,090	56.66	4,084,619.40	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,060	70.69	569,761.40	
WELLPOINT INC	22,672	62.77	1,423,121.44	
ZIMMER HOLDINGS INC	12,131	76.11	923,290.41	
ABBVIE INC	109,509	38.19	4,182,148.71	
ACTAVIS INC	9,300	84.81	788,733.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,120	43.01	1,037,401.20	

ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,400	83.39	1,117,426.00	
ALLERGAN INC	21,400	109.08	2,334,312.00	
AMGEN INC	53,779	84.20	4,528,191.80	
BIOGEN IDEC INC	15,633	166.81	2,607,740.73	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	117,192	36.94	4,329,072.48	
CELGENE CORP	30,100	100.46	3,023,846.00	
FOREST LABORATORIES INC	18,400	36.34	668,656.00	
GILEAD SCIENCES INC	105,628	42.28	4,465,951.84	
HOSPIRA INC	12,120	30.06	364,327.20	
ILLUMINA INC	8,500	49.02	416,670.00	
JOHNSON & JOHNSON	192,721	76.96	14,831,808.16	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	12,146	63.36	769,570.56	
LILLY (ELI) & CO	72,894	54.18	3,949,396.92	
MERCK & CO	212,774	42.22	8,983,318.28	
MYLAN INC	28,100	29.11	817,991.00	
PERRIGO CO	6,500	114.73	745,745.00	
PFIZER	521,995	27.71	14,464,481.45	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,200	160.42	834,184.00	
THERMO ELECTRON CORP	25,478	75.00	1,910,850.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,800	46.52	735,016.00	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	16,700	14.56	243,152.00	
WATERS CORPORATION	6,427	93.36	600,024.72	
BB&T CORPORATION	48,700	30.37	1,479,019.00	
CIT GROUP INC	14,000	42.94	601,160.00	
COMERICA	13,322	35.40	471,598.80	
FIFTH THIRD BANCORP	63,820	15.96	1,018,567.20	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,200	37.05	266,760.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,400	8.78	284,472.00	
KEYCORP	65,191	9.58	624,529.78	
M & T BANK CORP	7,904	105.78	836,085.12	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31,669	13.75	435,448.75	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	27,000	13.07	352,890.00	
PNC BANK CORP	36,865	63.51	2,341,296.15	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,945	7.96	779,642.20	
SUNTRUST BANKS	37,423	27.69	1,036,242.87	
US BANCORP	132,281	34.08	4,508,136.48	
WELLS FARGO COMPANY	350,651	35.14	12,321,876.14	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,800	148.62	564,756.00	
AMERICAN EXPRESS	71,244	62.28	4,437,076.32	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,628	69.03	1,009,770.84	
BANK NEW YORK MELLO CORP	82,300	28.24	2,324,152.00	
BANK OF AMERICA CORP	752,948	12.19	9,178,436.12	
BLACKROCK INC	9,300	244.12	2,270,316.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,511	53.12	2,151,944.32	
CITIGROUP INC	204,849	44.50	9,115,780.50	
CME GROUP INC	21,950	58.96	1,294,172.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	35,842	39.53	1,416,834.26	
EATON VANCE CORP	8,800	40.86	359,568.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	10,335	146.08	1,509,736.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31,790	158.65	5,043,483.50	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,000	155.75	778,750.00	

INVESCO LTD	30,880	27.66	854,140.80
JPMORGAN CHASE & CO	265,474	49.45	13,127,689.30
LEGG MASON INC	8,618	28.63	246,733.34
LEUCADIA NATIONAL CORP	15,400	27.18	418,572.00
MCGRAW-HILL COS	17,470	46.02	803,969.40
MOODY'S CORPORATION	13,886	48.57	674,443.02
MORGAN STANLEY	103,244	24.32	2,510,894.08
NORTHERN TRUST CORP	15,005	53.90	808,769.50
NYSE EURONEXT	17,000	37.37	635,290.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	75,311	17.10	1,287,818.10
SEI INVESTMENTS CO COM	9,400	28.31	266,114.00
SLM CORP	32,456	19.21	623,479.76
STATE STREET CORP	33,390	57.54	1,921,260.60
T ROWE PRICE GROUP INC	17,664	73.81	1,303,779.84
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	16,500	20.11	331,815.00
THE NASDAQ OMX GROUP	9,900	31.49	311,751.00
ACE LTD	23,641	86.95	2,055,584.95
AFLAC	32,568	49.53	1,613,093.04
ALLEGHANY CORP	948	377.03	357,424.44
ALLSTATE CORP	33,725	46.74	1,576,306.50
AMERICAN INT'L GROUP	97,875	38.60	3,777,975.00
AON PLC	21,314	57.91	1,234,293.74
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,400	48.01	451,294.00
ASSURANT INC	5,700	42.21	240,597.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,500	40.69	345,865.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,450	101.02	6,510,739.00
CHUBB CORP	18,470	83.72	1,546,308.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,564	45.06	521,073.84
EVEREST RE GROUP LTD	3,600	122.76	441,936.00
FIDELITY NATIONAL TITLE-CL A	13,785	25.59	352,758.15
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,709	24.76	710,834.84
LINCOLN NATIONAL CORP	19,315	30.75	593,936.25
LOEWS CORP	22,005	43.92	966,459.60
MARSH & MCLENNAN COS	37,893	36.28	1,374,758.04
METLIFE INC	59,257	37.00	2,192,509.00
PARTNERRE LTD	4,500	86.49	389,205.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,500	32.28	694,020.00
PROGRESSIVE CORP	40,188	24.49	984,204.12
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,320	58.15	1,879,408.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,600	84.83	305,388.00
TORCHMARK CORP	6,900	56.73	391,437.00
TRAVELERS COS INC/THE ST. PAUL TRAVELERS	26,835	80.60	2,162,901.00
UNUM GROUP	20,332	24.80	504,233.60
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	12,500	36.68	458,500.00
WR BERKLEY CORP	8,010	41.66	333,696.60
XL GROUP PLC	21,100	28.80	607,680.00
CBRE GROUP INC	21,486	24.50	526,407.00
ACCENTURE PLC-CL A	44,315	75.40	3,341,351.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,600	14.63	476,938.00
ADOBE SYSTEMS	34,188	39.00	1,333,332.00

AKAMA I TECHNOLOGIES	12,200	38.58	470,676.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,400	154.94	526,796.00	
ANSYS INC	6,700	76.28	511,076.00	
AUTODESK INC	15,700	38.98	611,986.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,803	61.46	2,077,532.38	
BMC SOFTWARE	11,655	41.60	484,848.00	
CA INC	22,725	24.99	567,897.75	
CITRIX SYSTEMS INC	12,967	73.46	952,555.82	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,800	78.33	1,629,264.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	10,733	48.80	523,770.40	
EBAY INC	80,928	56.68	4,586,999.04	
ELECTRONIC ARTS	23,224	17.59	408,510.16	
EQUINIX INC	3,300	220.98	729,234.00	
FACEBOOK INC-A	69,011	28.96	1,998,558.56	
FIDELITY NATIONAL INFORM ATION	17,330	36.99	641,036.70	
FISERV INC	9,358	81.02	758,185.16	
GOOGLE INC-CL A	18,350	806.85	14,805,697.50	
IBM CORP	75,861	200.32	15,196,475.52	
INTUIT CORP	19,436	62.24	1,209,696.64	
LINKEDIN CORP - A	5,568	160.76	895,111.68	
MASTERCARD INC-CLASS A	7,490	522.86	3,916,221.40	
MICROSOFT CORP	527,283	28.05	14,790,288.15	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,600	18.88	332,288.00	
ORACLE CORP	272,923	35.40	9,661,474.20	
PAYCHEX INC	22,651	33.93	768,548.43	
RACKSPACE HOSTING INC	7,900	57.74	456,146.00	
RED HAT INC	13,400	53.94	722,796.00	
SAIC INC	20,500	12.25	251,125.00	
SALESFORCE COM INC COM	9,200	174.83	1,608,436.00	
SYMANTEC CORP	48,800	22.60	1,102,880.00	
SYNOPSYS INC	10,715	34.62	370,953.30	
TERADATA CORP	11,700	63.50	742,950.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,916	23.48	279,787.68	
VERIFONE SYSTEMS INC	8,300	33.04	274,232.00	
VERISIGN INC	11,311	46.22	522,794.42	
VISA INC-CLASS A SHARES	36,840	157.61	5,806,352.40	
VMWARE INC	5,700	73.66	419,862.00	
WESTERN UNION CO	43,915	14.25	625,788.75	
YAHOO! INC	78,388	21.29	1,668,880.52	
AMPHENOL CORP-CL A	11,200	70.89	793,968.00	
APPLE INC	65,508	459.99	30,133,024.92	
ARROW ELECTRONICS INC	8,400	41.56	349,104.00	
AVNET	9,700	36.34	352,498.00	
CISCO SYSTEMS	374,209	21.46	8,030,525.14	
CORNING	103,588	12.90	1,336,285.20	
DELL INC	102,565	13.80	1,415,397.00	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	4,100	32.03	131,323.00	
EMC CORP	146,460	23.92	3,503,323.20	
FLEXTRONICS INTL LTD	49,345	6.63	327,157.35	
FLIR SYSTEMS INC	11,200	26.97	302,064.00	

FS NETWORKS INC	5,500	103.62	569,910.00	
HARRIS CORP	7,800	47.65	371,670.00	
HEWLETT-PACKARD CO	137,422	16.89	2,321,057.58	
JUNIPER NETWORKS INC	36,508	22.25	812,303.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17,943	62.03	1,113,004.29	
NETAPP INC	25,248	36.47	920,794.56	
QUALCOMM	118,992	65.70	7,817,774.40	
SANDISK CORP	16,700	51.65	862,555.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	24,800	34.17	847,416.00	
TE CONNECTIVITY LTD	29,751	41.30	1,228,716.30	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	8,700	62.09	540,183.00	
WESTERN DIGITAL CORP	15,400	48.58	748,132.00	
XEROX CORP	90,533	8.00	724,264.00	
AT & T INC	403,216	35.67	14,382,714.72	
CENTURYLINK INC	43,349	34.14	1,479,934.86	
CROWN CASTLE INTL CORP	20,400	67.04	1,367,616.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	74,629	4.17	311,202.93	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	11,200	21.20	237,440.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC COM	24,000	10.27	246,480.00	
SBA COMMUNICATIONS COR	8,900	67.90	604,310.00	
SPRINT NEXTEL CORP	208,535	5.90	1,230,356.50	
VERIZON COMMUNICATIONS	198,999	44.50	8,855,455.50	
WINDSTREAM CORP	40,400	8.96	361,984.00	
AES CORPORATION	46,200	11.37	525,294.00	
ALLIANT ENERGY CORP	8,100	48.02	388,962.00	
AMEREN CORPORATION	17,677	33.24	587,583.48	
AMERICAN ELECTRIC POWER	33,756	45.56	1,537,923.36	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,900	39.75	512,775.00	
CALPINE CORP	22,000	19.01	418,220.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	28,048	20.51	575,264.48	
CMS ENERGY CORP	18,300	26.09	477,447.00	
CONSOLIDATED EDISON	20,382	57.00	1,161,774.00	
DOMINION RESOURCES INC/VA	39,964	55.59	2,221,598.76	
DTE ENERGY	11,866	64.75	768,323.50	
DUKE ENERGY CORP	49,111	68.96	3,386,694.56	
EDISON INTERNATIONAL	21,525	47.04	1,012,536.00	
ENTERGY CORP	12,320	61.78	761,129.60	
EXELON CORP	59,509	30.59	1,820,380.31	
FIRSTENERGY CORP	29,116	41.08	1,196,085.28	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	6,000	56.57	339,420.00	
MDU RES GROUP INC	13,900	24.26	337,214.00	
NEXTERA ENERGY INC	27,990	72.90	2,040,471.00	
NISOURCE INC	19,647	27.26	535,577.22	
NORTHEAST UTILITIES	21,771	41.41	901,537.11	
NRG ENERGY INC COM NEW	16,700	24.53	409,651.00	
OGE ENERGY CORP	6,756	59.83	404,211.48	
ONEOK INC NEW	14,200	47.95	680,890.00	
PEPCO HOLDINGS INC	17,495	20.16	352,699.20	
PG&E CORP	29,634	43.22	1,280,781.48	

	PINNACLE WEST CAPITAL	8,000	54.98	439,840.00	
	PPL CORPORATION	40,334	30.47	1,228,976.98	
	PUBLIC SV ENTERPRISE CO	35,146	31.41	1,103,935.86	
	SCANA CORP	8,600	48.68	418,648.00	
	SEMPRA ENERGY	15,913	76.46	1,216,707.98	
	SOUTHERN CO	61,024	44.48	2,714,347.52	
	WISCONSIN ENERGY CORP	15,900	40.21	639,339.00	
	XCEL ENERGY INC	33,878	28.30	958,747.40	
	ALTERA CORPORATION	22,175	36.19	802,513.25	
	ANALOG DEVICES	20,729	47.01	974,470.29	
	APPLIED MATERIALS	85,947	13.89	1,193,803.83	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	17,000	35.55	604,350.00	
	BROADCOM CORP	35,220	35.09	1,235,869.80	
	CREE INC	8,100	45.98	372,438.00	
	INTEL CORP	349,487	21.09	7,370,680.83	
	KLA-TENCOR CORPORATION	11,548	56.39	651,191.72	
	LAM RESEARCH CORP	13,200	42.75	564,300.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,949	38.58	615,312.42	
	LSI CORP	42,300	7.22	305,406.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,000	9.29	325,150.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,200	32.78	662,156.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,360	37.15	533,474.00	
	MICRON TECHNOLOGY	70,230	8.12	570,267.60	
	NVIDIA CORP	42,800	12.56	537,568.00	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,333	33.95	2,693,355.35	
	XILINX INC	18,110	39.14	708,825.40	
	アメリカ・ドル 小計	21,749,265		982,205,458.22 (92,013,007,326)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	21,083	25.93	546,682.19	
	ATHABASCA OIL CORP	23,000	10.21	234,830.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	8,300	44.42	368,686.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	13,294	12.57	167,105.58	
	CAMECO CORP	27,322	22.52	615,291.44	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	76,376	31.07	2,373,002.32	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	33,600	21.77	731,472.00	
	CENOVUS ENERGY INC	52,648	32.76	1,724,748.48	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	24,241	38.70	938,126.70	
	ENBRIDGE INC	52,820	44.81	2,366,864.20	
	ENCANA CORP	51,148	18.52	947,260.96	
	ENERPLUS CORP	14,101	12.75	179,787.75	
	HUSKY ENERGY INC	23,861	30.79	734,680.19	
	IMPERIAL OIL LTD	20,612	42.75	881,163.00	
	MEG ENERGY CORP	9,500	34.48	327,560.00	
	NEXEN INC	36,776	27.74	1,020,166.24	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	20,800	24.86	517,088.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	19,919	29.38	585,220.22	
	PENGROWTH ENERGY CORP	37,421	4.50	168,394.50	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	35,323	10.43	368,418.89	
SUNCOR ENERGY INC	107,828	32.17	3,468,826.76		
TALISMAN ENERGY INC	71,584	12.70	909,116.80		
TOURMALINE OIL CORP	9,700	35.23	341,731.00		

TRANSCANADA CORP	49,130	47.39	2,328,270.70	
VERMILION ENERGY TRUST	6,700	52.28	350,276.00	
AGNICO-EAGLE MINES	11,842	41.23	488,245.66	
AGRIUM INC	10,339	110.09	1,138,220.51	
BARRICK GOLD CORP	69,776	31.87	2,223,761.12	
CENTERRA GOLD INC	12,000	7.64	91,680.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	46,800	10.07	471,276.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,000	19.93	657,690.00	
FRANCO NEV CORP	10,000	50.25	502,500.00	
GOLDCORP INC	56,487	34.06	1,923,947.22	
IAMGOLD CORP	25,500	8.06	205,530.00	
INMET MINING CORP COM NPV	3,500	69.10	241,850.00	
KINROSS GOLD CORP	78,862	8.04	634,050.48	
NEW GOLD INC	31,600	9.36	295,776.00	
OSISKO MINING CORP	30,100	6.07	182,707.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	10,200	16.83	171,666.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	59,930	42.00	2,517,060.00	
SILVER WHEATON CORCOM NPV	24,500	35.04	858,480.00	
TECK RESOURCES LTD	40,108	32.77	1,314,339.16	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	27,000	7.33	197,910.00	
YAMANA GOLD INC	52,113	15.23	793,680.99	
BOMBARDIER INC.	99,041	4.11	407,058.51	
CAE Inc.	18,650	10.51	196,011.50	
FINNING INTERNATIONAL INC	12,402	27.25	337,954.50	
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,413	48.91	509,299.83	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	6,000	22.88	137,280.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	30,350	101.50	3,080,525.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,950	120.88	1,444,516.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,422	54.99	848,055.78	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,900	37.45	295,855.00	
TIM HORTONS INC	11,281	50.41	568,675.21	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,156	24.39	637,944.84	
THOMSON CORP	25,765	31.29	806,186.85	
CANADIAN TIRE CORP.	5,731	68.50	392,573.50	
DOLLARAMA INC	4,796	60.74	291,309.04	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,700	54.30	472,410.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,200	62.90	138,380.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,065	39.90	321,793.50	
METRO INC	6,700	64.94	435,098.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	14,359	42.14	605,088.26	
WESTON (GEORGE)	3,736	73.43	274,334.48	
SAPUTO INC	8,900	49.81	443,309.00	
CATAMARAN CORP	14,154	54.68	773,940.72	
VALENT PHARMACEUTICALS INTE	20,104	67.83	1,363,654.32	
BANK MONTREAL	45,083	63.18	2,848,343.94	
BANK OF NOVA SCOTIA	80,884	59.15	4,784,288.60	
CANADIAN IMPERIAL BANK	28,300	84.46	2,390,218.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	11,273	79.52	896,428.96	
ROYAL BANK OF CANADA	100,846	64.43	6,497,507.78	
TRONTO-DOMINION BANK	63,850	83.84	5,353,184.00	
CI FINANCIAL CORP	11,153	26.97	300,796.41	

	IGM FINANCIAL INC	7,433	45.32	336,863.56	
	ONEX CORPORATION	6,909	45.75	316,086.75	
	GREAT-WEST LIFECO INC	20,738	27.43	568,843.34	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,100	38.59	235,399.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,000	64.00	576,000.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	126,400	15.53	1,962,992.00	
	POWER CORP OF CANADA	24,188	27.15	656,704.20	
	POWER FINANCIAL CORP	18,058	29.64	535,239.12	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	41,272	29.14	1,202,666.08	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	38,782	38.95	1,510,558.90	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	18,918	17.22	325,767.96	
	CGI GROUP INC	14,684	27.82	408,508.88	
	OPEN TEXT CORP	4,200	57.98	243,516.00	
	RESEARCH IN MOTION	32,600	14.57	474,982.00	
	BCE INC	17,667	45.01	795,191.67	
	BELL ALIANT INC	5,600	27.49	153,944.00	
	ROGERSCOMMUNICATIONS-CL B	26,642	48.49	1,291,870.58	
	TELUS CORP	10,466	69.32	725,503.12	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	3,900	74.55	290,745.00	
	FORTIS INC	13,100	33.44	438,064.00	
	TRANSALTA CORP.	17,031	16.44	279,989.64	
	カナダ・ドル 小計	2,658,596		89,286,597.39 (8,268,831,784)	
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,699	18.87	183,020.13	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	75,683	12.28	929,387.24	
	SANTOS	66,257	12.61	835,500.77	
	WHITEHAVEN COAL LTD	33,380	3.20	106,816.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	45,902	37.91	1,740,144.82	
	WORLEYPARSONS LTD	14,121	26.53	374,630.13	
	ALUMINA LTD	179,421	1.28	230,555.98	
	AMCOR	83,580	9.31	778,129.80	
	BHP BILLITON LTD	225,282	39.00	8,785,998.00	
	BORAL LIMITED	57,798	4.70	271,650.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,886	5.18	527,769.48	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	28,562	10.91	311,611.42	
	INCITEC PIVOT LTD	111,754	3.21	358,730.34	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	32,680	9.69	316,669.20	
	NEWCREST MINING	53,210	21.81	1,160,510.10	
	ORICA	25,305	27.20	688,296.00	
	OZ MINERALS LIMITED	23,716	7.28	172,652.48	
	RIO TINTO LTD	30,369	70.51	2,141,318.19	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	13,376	10.93	146,199.68	
	LEIGHTON HOLDINGS	10,276	23.45	240,972.20	
	ALS LTD	23,254	12.11	281,605.94	
	BRAMBLES LTD	107,918	8.50	917,303.00	
	ASCIANO LTD	71,659	5.35	383,375.65	
	AURIZON HOLDINGS LTD	123,821	4.21	521,286.41	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	91,032	1.63	148,382.16		
SYDNEY AIRPORT	26,239	3.15	82,652.85		
TOLL HOLDINGS LIMITED	52,090	5.63	293,266.70		
TRANSURBAN GROUP	90,901	6.12	556,314.12		

CROWN LTD	27,448	11.93	327,454.64		
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	53,937	3.55	191,476.35		
FLIGHT CENTRE LTD	4,422	33.42	147,783.24		
TABCORP HOLDINGS	52,429	3.14	164,627.06		
TATTS GROUP LTD	93,228	3.31	308,584.68		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	39,935	2.34	93,447.90		
METCASH	59,806	3.95	236,233.70		
WESFARMERS LIMITED	70,208	39.29	2,758,472.32		
WOOLWORTHS LIMITED	85,957	33.54	2,882,997.78		
COCA-COLA AMATIL	39,443	13.90	548,257.70		
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,237	5.00	251,185.00		
COCHLEAR LIMITED	4,156	71.12	295,574.72		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,455	30.18	285,351.90		
SONIC HEALTHCARE LIMITED	25,574	12.85	328,625.90		
CSL LIMITED	35,226	57.59	2,028,665.34		
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	189,654	28.53	5,410,828.62		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	29,152	10.40	303,180.80		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	111,222	66.05	7,346,213.10		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	158,700	30.17	4,787,979.00		
WESTPAC BANKING	215,124	30.30	6,518,257.20		
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	12,050	36.17	435,848.50		
MACQUARIE GROUP LIMITED	22,414	39.44	884,008.16		
AMP LTD	201,177	5.54	1,114,520.58		
INSURANCE AUSTRALIA GROU P LTD	144,027	5.28	760,462.56		
QBE INSURANCE GROUP	82,055	13.40	1,099,537.00		
SUNCORP GROUP LTD	89,356	11.67	1,042,784.52		
LEND LEASE GROUP	37,400	10.20	381,480.00		
COMPUTERSHARE LIMITED	32,403	9.68	313,661.04		
TELSTRA CORP	303,071	4.63	1,403,218.73		
AGL ENERGY LTD	37,738	15.33	578,523.54		
APA GROUP	56,719	5.86	332,373.34		
SP AUSNET	119,187	1.16	138,852.85		
オーストラリア・ドル 小計	4,302,081		67,185,217.16 (6,512,263,099)		
イギリス・ポンド	AMEC	21,457	10.28	220,577.96	
	BG GROUP PLC	237,172	11.47	2,720,362.84	
	BP PLC	1,330,458	4.46	5,938,499.28	
	PETROFAC	17,883	16.13	288,452.79	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	259,622	21.46	5,571,488.12	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	183,752	21.99	4,041,625.24	
	TULLOW OIL ORD GBPO.10	63,056	12.46	785,677.76	
	ANGLO AMERICAN PLC	96,984	19.95	1,935,315.72	
	ANTOFAGASTA PLC	27,225	10.95	298,113.75	
	BHP BILLITON PLC	147,471	22.36	3,297,451.56	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	9,282	25.55	237,155.10	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	20,898	3.88	81,084.24	
	EVRAZ PLC	27,069	2.86	77,579.75	
	FRESNILLO PLC	12,273	15.47	189,863.31	

GLENCORE INTERNATIONAL PLC	265,103	3.92	1,039,336.31
JOHNSON MATTHEY PLC	14,144	23.33	329,979.52
KAZAKHMYS ORD GBPO.20 (WI)	14,060	7.24	101,794.40
RANDGOLD RESOURCES	6,028	55.50	334,554.00
REXAM PLC	57,879	4.76	275,909.19
RIO TINTO PLC REG	93,603	37.13	3,475,947.40
VEDANTA RESOURCES ORD US DO.10	7,544	12.85	96,940.40
XSTRATA PLC	146,594	11.77	1,726,144.35
BAE SYSTEMS PLC	225,931	3.30	745,572.30
BALFOUR BEATTY PLC	46,565	2.73	127,494.97
BUNZL PLC	22,784	12.21	278,192.64
COBHAM PLC	80,888	2.25	182,725.99
IMI PLC	23,284	11.74	273,354.16
INVENSYS PLC	55,620	3.57	198,952.74
MEGGITT PLC	53,690	4.54	243,913.67
MELROSE INDUSTRIES PLC	82,305	2.42	199,754.23
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	130,446	10.43	1,360,551.78
SMITHS GROUP PLC	28,620	12.49	357,463.80
WEIR GROUP PLC/THE	15,554	21.75	338,299.50
WOLSELEY PLC	19,001	30.99	588,840.99
AGGREKO PLC	18,511	17.15	317,463.65
BABCOCK INTL GROUP PLC	24,760	10.51	260,227.60
CAPITA PLC	45,171	8.43	381,017.38
EXPERIAN PLC	70,187	10.91	765,740.17
G4S PLC	97,065	2.90	282,070.89
INTERTEK GROUP PLC	11,102	33.19	368,475.38
SERCO GROUP PLC	36,141	5.74	207,630.04
GKN PLC	112,078	2.61	293,532.28
BURBERRY GROUP PLC	30,559	13.80	421,714.20
CARNIVAL PLC	12,581	24.85	312,637.85
COMPASS GROUP PLC	129,569	7.98	1,033,960.62
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP INC	18,796	19.53	367,085.88
TUI TRAVEL PLC	31,655	3.29	104,366.53
WHITBREAD PLC	13,046	26.81	349,763.26
BRITISH SKY BROADCASTING	75,051	8.27	620,671.77
ITV PLC	270,397	1.23	332,588.31
PEARSON	56,706	12.05	683,307.30
REED ELSEVIER PLC	84,648	7.14	604,386.72
WPP PLC	87,868	10.60	931,400.80
KINGFISHER PLC	164,096	2.75	451,920.38
MARKS & SPENCER GROUP PLC	111,254	3.86	429,551.69
NEXT PLC	11,418	42.00	479,556.00
MORRISON SUPERMARKETS	159,044	2.60	414,786.75
SAINSBURY (J) PLC	84,482	3.32	280,733.68
TESCO	561,016	3.69	2,070,710.05
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,654	18.52	456,592.08
BRITISH AMERICAN TOBACCO	135,749	33.90	4,601,891.10
DIAGEO	175,012	19.44	3,403,108.34
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	69,159	24.08	1,665,348.72

SABMILLER PLC	66,751	32.41	2,163,399.91		
TATE & LYLE	32,059	7.99	256,311.70		
UNILEVER PLC	89,569	26.11	2,338,646.59		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	45,403	45.66	2,073,100.98		
SMITH&NEOHEW PLC	62,269	7.02	437,128.38		
ASTRAZENECA PLC	87,052	29.48	2,566,728.22		
GLAXOSMITHKLINE PLC	347,465	14.86	5,163,329.90		
SHIRE PLC	39,126	20.72	810,690.72		
BARCLAYS PLC	811,473	3.25	2,637,287.25		
HSBC HOLDINGS PLC	1,279,721	7.28	9,326,606.64		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,942,829	0.55	1,626,207.30		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	146,066	3.45	504,073.76		
STANDARD CHARTERED PLC	167,026	17.71	2,958,030.46		
3I GROUP PLC	66,220	3.06	202,633.20		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	62,308	4.37	272,285.96		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,502	8.48	156,989.47		
ICAP PLC	42,863	3.50	150,063.36		
INVESTEC PLC	37,132	4.94	183,654.87		
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	11,781	13.17	155,155.77		
SCHRODERS PLC	7,676	19.75	151,601.00		
ADMIRAL GROUP PLC	13,870	12.90	178,923.00		
AVIVA PLC	202,875	3.69	749,014.50		
LEGAL & GENERAL GROUP	410,232	1.54	634,218.67		
OLD MUTUAL PLC	339,394	2.00	680,145.57		
PRUDENTIAL PLC	178,297	9.69	1,728,589.41		
RESOLUTION LTD	95,674	2.64	253,057.73		
RSA INSURANCE GROUP PLC	256,367	1.36	349,428.22		
STANDARD LIFE PLC	163,612	3.45	564,788.62		
SAGE GROUP PLC (THE)	89,734	3.37	302,583.04		
BT GROUP PLC	548,782	2.76	1,519,577.35		
INMARSAT PLC	30,649	6.63	203,356.11		
VODAFONE GROUP PLC	3,435,728	1.63	5,617,415.28		
CENTRICA PLC	362,087	3.51	1,273,822.06		
NATIONAL GRID PLC	253,745	7.00	1,777,483.72		
SEVERN TRENT PLC	17,477	16.06	280,680.62		
SSE PLC	65,742	14.22	934,851.24		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	47,089	7.25	341,630.69		
ARM HOLDINGS PLC	95,913	9.41	903,020.89		
イギリス・ポンド 小計	19,536,578		113,277,721.34 (16,378,825,728)		
スイス・フラン	TRANSOCEAN LTD	25,011	51.85	1,296,820.35	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	651	262.00	170,562.00	
	GIVAUDAN-REG	575	1,099.00	631,925.00	
	HOLCIM LTD-REG	15,921	72.75	1,158,252.75	
	SIKA AG-BR	150	2,345.00	351,750.00	
	SYNGETA AG	6,496	397.20	2,580,211.20	
	ABB LTD	153,436	21.22	3,255,911.92	
	GEBERIT AG-REG	2,549	224.00	570,976.00	
	SCHINDLER HLDG AG	1,458	136.20	198,579.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,352	138.70	464,922.40	
	SULZER	1,826	163.10	297,820.60	

	ADECCO SA-REG	9,661	53.90	520,727.90	
	SGS S.A.	380	2,329.00	885,020.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,943	110.80	436,884.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	36,416	76.45	2,784,003.20	
	THE SWATCH GROUP	3,167	94.00	297,698.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,144	528.50	1,133,104.00	
	ARYZTA AG	6,191	53.95	334,004.45	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	138	907.50	125,235.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	65	3,378.00	219,570.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	39,060.00	273,420.00	
	NESTLE SA-REG	225,383	64.10	14,447,050.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,621	113.10	409,535.10	
	ACTELION CHFO.50 (REGD)	7,387	48.14	355,610.18	
	LOMZA AG-REG	3,793	59.85	227,011.05	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,736	64.30	10,335,324.80	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	49,093	210.80	10,348,804.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	245	512.00	125,440.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	87,455	27.09	2,369,155.95	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,983	37.27	558,416.41	
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	2,164	66.95	144,879.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,184	212.10	251,126.40	
	UBS AG-REG	254,222	15.28	3,884,512.16	
	BALOISE HOLDING AG REG	3,246	83.30	270,391.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,193	147.40	323,248.20	
	SWISS RE LTD	24,533	73.35	1,799,495.55	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,281	258.80	2,660,722.80	
	SWISS PRIME SITE REG	3,816	74.20	283,147.20	
	SWISSCOM	1,614	420.30	678,364.20	
	スイス・フラン 小計	1,129,486		67,459,635.07 (6,861,994,079)	
香港・ドル	HOPEWELL HOLDINGS	38,000	34.00	1,292,000.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	148,200	85.75	12,708,150.00	
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	100,500	14.62	1,469,310.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	79,000	14.60	1,153,400.00	
	MTR CORP	106,000	32.20	3,413,200.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	17,500	51.85	907,375.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	53,500	27.15	1,452,525.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	144,000	33.15	4,773,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	76,800	16.98	1,304,064.00	
	SANDS CHINA LTD	167,321	36.25	6,065,386.25	
	SHANGRI-LA ASIA	112,000	18.02	2,018,240.00	
	SJM HOLDINGS LTD	133,000	19.32	2,569,560.00	
	WYNN MACAU LTD	114,561	20.15	2,308,404.15	
	LI & FUNG LTD	424,400	10.38	4,405,272.00	
	BANK EAST ASIA	88,440	31.45	2,781,438.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	256,500	26.45	6,784,425.00	
	HANG SENG BANK	53,000	126.10	6,683,300.00	
	WING HANG BANK LIMITED	14,000	83.00	1,162,000.00	
	FIRST PACIFIC CO	162,000	9.79	1,585,980.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	76,900	144.70	11,127,430.00	

	AIA GROUP LTD	756,200	31.60	23,895,920.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	97,000	123.30	11,960,100.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	155,000	29.90	4,634,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,585	54.00	3,595,590.00	
	HYSAN DEVELOPMENT	46,000	38.70	1,780,200.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	52,500	39.75	2,086,875.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	267,355	13.88	3,710,887.40	
	SINO LAND	211,200	14.00	2,956,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	109,000	121.90	13,287,100.00	
	SWIRE PACIFIC A	47,000	100.30	4,714,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	80,000	28.90	2,312,000.00	
	WHARF HOLDINGS	105,125	66.45	6,985,556.25	
	WHELOCK & CO LTD	63,000	41.90	2,639,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	177,000	7.10	1,256,700.00	
	PCCW LIMITED	325,000	3.70	1,202,500.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	50.30	1,710,200.00	
	CLP HOLDINGS	123,000	66.70	8,204,100.00	
	HONGKONG CHINAGAS	361,933	21.75	7,872,042.75	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,000	70.85	6,801,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,400	103.90	1,392,260.00	
香港・ドル 小計		5,551,920		188,963,790.80 (2,282,682,593)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	99,900	11.65	1,163,835.00	
	NOBLE GROUP LTD	292,745	1.18	346,902.82	
	SEMBCORP INDUSTRIES	67,560	5.50	371,580.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	56,200	4.73	265,826.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	105,000	4.18	438,900.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	155,000	0.97	150,350.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	127,000	1.91	243,205.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	36,800	10.95	402,960.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	421,000	1.53	644,130.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINDS	111,000	4.13	458,430.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	51.55	412,400.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	102,600	1.66	170,829.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	515,960	0.65	335,374.00	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	132,000	3.66	483,120.00	
	DBS GROUP HOLDING	126,989	15.12	1,920,073.68	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	179,240	9.98	1,788,815.20	
	UNITED OVERSEAS BANK	88,056	19.35	1,703,883.60	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,000	7.78	482,360.00	
	CAPITALAND LIMITED	177,000	3.95	699,150.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	96,000	2.10	201,600.00	
	CITY DEVELOPMENTS	34,000	11.34	385,560.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES	141,000	2.68	377,880.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	58,000	4.25	246,500.00	
	UOL GROUP LIMITED	34,405	6.35	218,471.75	
SINGAPORE TELECOM	555,060	3.56	1,976,013.60		
STARHUB LTD	43,000	4.11	176,730.00		
シンガポール・ドル 小計		3,825,515		16,064,879.65 (1,217,075,282)	

ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,852	9.32	436,660.64	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	65,428	2.73	178,945.58	
	SKY CITY LIMITED	39,910	4.02	160,438.20	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	140,836	2.28	321,106.08	
	CONTACT ENERGY LIMITED	26,702	5.25	140,185.50	
ニュージーランド・ドル 小計		319,728		1,237,336.00 (98,034,131)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	15,293	148.30	2,267,951.90	
	BOLIDEN AB	19,767	112.10	2,215,880.70	
	ALFA LAVALAB	24,595	147.00	3,615,465.00	
	ASSA ABLOY AB-B	23,179	252.30	5,848,061.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	46,719	186.30	8,703,749.70	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	27,023	166.70	4,504,734.10	
	SANDVIK AB	69,752	107.70	7,512,290.40	
	SCANIA AB-B SHS	22,054	137.60	3,034,630.40	
	SKANSKA AB-B	27,854	115.40	3,214,351.60	
	SKF AB-B SHARES	27,145	159.00	4,316,055.00	
	VOLVO AB-B SHS	97,097	99.10	9,622,312.70	
	SECURITAS B	24,362	58.30	1,420,304.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,622	165.20	2,911,154.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	28,922	39.74	1,149,360.28	
	HENNES & MAURITZ B	66,199	230.00	15,225,770.00	
	SWEDISH MATCH	14,222	221.90	3,155,861.80	
	SCA SV CELLULOSA AB-B SHS	40,196	156.50	6,290,674.00	
	ELEKTA AB-B SHS	25,315	101.00	2,556,815.00	
	GETINGE AB-B SHS	14,693	195.20	2,868,073.60	
	NORDEA BANK AB	183,401	73.70	13,516,653.70	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	97,905	66.30	6,491,101.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	34,492	272.60	9,402,519.20	
	SWEDBANK AB	55,700	156.20	8,700,340.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,176	118.20	966,403.20	
	INVESTOR AB SER B NPV	31,600	188.10	5,943,960.00	
	KINNEVIK INV AB	14,093	148.80	2,097,038.40	
	RATOS AB	13,889	65.95	915,979.55	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	212,158	79.05	16,771,089.90	
HEXAGON AB B SHS	17,311	182.40	3,157,526.40		
MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 USD1.5	4,636	520.50	2,413,038.00		
TELE2 AB	21,840	103.60	2,262,624.00		
TELIASONERA	150,422	43.53	6,547,869.66		
スウェーデン・クローナ 小計		1,477,632		169,619,640.39 (2,522,244,052)	

ノルウェー・クローネ	ACERGY SA	20,466	133.60	2,734,257.60	
	AKER SOLUTIONS ASA	11,735	108.40	1,272,074.00	
	SEADRILL LTD	24,431	209.50	5,118,294.50	
	STATOIL ASA	77,772	144.30	11,222,499.60	
	NORSK HYDRO	63,657	27.42	1,745,474.94	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,941	286.80	3,711,478.80	
	ORKLA ASA	53,171	47.96	2,550,081.16	
	DNB ASA	67,831	85.00	5,765,635.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	15,012	89.95	1,350,329.40	
	TELENOR ASA	48,770	124.60	6,076,742.00	
ノルウェー・クローネ 小計		395,786		41,546,867.00 (704,219,396)	
デンマーク・クローネ	NOVOZYMES A/S B SHARES	17,725	190.30	3,373,067.50	
	"DSV, DE SAMMENSLUT VOGN"	12,882	142.90	1,840,837.80	
	A P MOLLER MAERSK A/S	91	45,640.00	4,153,240.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	38	43,680.00	1,659,840.00	
	CARLSBERG B	7,415	567.00	4,204,305.00	
	COLOPLAST B	8,290	297.30	2,464,617.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,908	489.00	933,012.00	
	NOVO NORDISK A/S SER-B	28,438	964.00	27,414,232.00	
	DANSKE BANK A/S	45,480	108.50	4,934,580.00	
	TRYG A/S	2,021	448.00	905,408.00	
TDC A/S	33,700	42.44	1,430,228.00		
デンマーク・クローネ 小計		157,988		53,313,367.30 (897,797,105)	
イスラエル・シェケル	DELEK GROUP LTD	283	944.00	267,152.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	30,625	48.77	1,493,581.25	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	184	2,655.00	488,520.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	65,762	141.20	9,285,594.40	
	BANK HAPOLIM BM	78,960	16.60	1,310,736.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	92,870	13.30	1,235,171.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,722	38.75	337,977.50	
	NICE SYSTEMS LTD	3,993	134.30	536,259.90	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	137,769	4.74	653,025.06	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,608	195.90	510,907.20	
イスラエル・シェケル 小計		421,776		16,118,924.31 (411,354,948)	
ユーロ	ENI SPA	177,608	17.84	3,168,526.72	
	FUGRO NV-CVA	5,051	36.95	186,659.70	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,964	11.80	200,260.02	
	GENERALE GEOPHYSIQUE	10,862	20.81	226,092.53	
	NESTE OIL OYJ	8,499	11.34	96,378.66	
	OMV AG	10,769	30.04	323,554.60	
	REPSOL SA	56,796	15.74	894,253.02	
	SAIPEM EUR1	18,351	20.68	379,498.68	
	TECHNIP SA	7,046	80.00	563,680.00	
	TENARIS SA	32,692	15.30	500,187.60	
	TOTAL SA	148,706	38.30	5,695,439.80	
	AIR LIQUIDE	21,757	90.87	1,977,058.59	
	AKZO NOBEL	16,558	52.10	862,671.80	
	ARCELORMITTAL	69,138	12.45	861,113.79	

ARKEMA	4,302	85.95	369,756.90
BASF SE	64,153	73.79	4,733,849.87
CRH	50,176	16.10	807,833.60
HEIDELBERGCEMENT AG	9,719	50.36	489,448.84
IMERYS SA	2,547	51.89	132,163.83
K&S AG	11,896	34.74	413,326.52
KONINKLIJKE DSM N.V	10,672	46.92	500,730.24
LAFARGE (FRANCE)	12,943	46.72	604,696.96
LANXESS AG	5,737	68.00	390,116.00
LINDE	12,898	133.55	1,722,527.90
SALZGITTER AG	2,803	35.75	100,207.25
SOLVAY	4,102	112.30	460,654.60
STORA ENSO OYJ-R SHS	40,072	4.91	196,753.52
THYSSENKRUPP AG	26,688	17.96	479,316.48
UMICORE	8,389	38.00	318,823.94
UPM-KYMMENE	36,232	8.81	319,203.92
VOESTALPINE AG	7,495	26.36	197,605.67
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,880	17.67	192,249.60
ALSTOM-NEW	14,277	34.24	488,844.48
ANDRITZ AG	4,987	51.30	255,833.10
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,167	32.83	169,632.61
BOUYGUES SA	12,978	20.25	262,804.50
BRENTAG AG	3,553	110.70	393,317.10
CIE DE SAINT-GOBAIN	27,687	31.58	874,355.46
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	28,767	35.76	1,028,707.92
FERROVIAL SA	27,772	11.58	321,599.76
FIAT INDUSTRIAL	59,314	9.61	570,007.54
FINMECCANICA SPA	31,774	4.09	130,146.30
GEA GROUP AG NPV	12,023	27.00	324,621.00
HOCHTIEF	2,182	53.55	116,846.10
KONE OYJ	10,800	64.00	691,200.00
LEGRAND PROMESSES EUR4	16,428	34.35	564,301.80
MAN SE	2,899	88.79	257,402.21
METSO OYJ	8,787	33.63	295,506.81
PHILIPS ELECTRONICS	72,450	21.93	1,589,190.75
PRYSMIAN SPA EURO.10	14,631	16.06	234,973.86
REXEL SA	8,600	17.14	147,404.00
SAFRAN SA	15,890	35.45	563,379.95
SCHNEIDER	36,658	55.46	2,033,052.68
SIEMENS AG	57,467	79.00	4,539,893.00
THALES SA	6,177	27.55	170,207.23
VALLOUREC	7,548	40.16	303,165.42
VINCI SA	32,050	35.81	1,147,710.50
WARTSILA OYJ	11,580	37.57	435,060.60
ZARDOYA OTIS	10,820	10.63	115,016.60
ZODIAC AEROSPACE	2,323	85.54	198,709.42
BIC	1,949	89.61	174,649.89
BUREAU VERITAS	3,806	95.02	361,646.12
EDENRED	11,633	25.48	296,467.00
RANDSTAD HOLDING NV	8,974	32.55	292,148.57
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	26,814	12.90	345,900.60

ADP	1,993	61.99	123,546.07	
ATLANTIA SPA	24,334	13.53	329,239.02	
DEUTSCHE POST AG-REG	63,112	17.24	1,088,366.44	
FRAPORT AG NPV	2,950	43.26	127,631.75	
GROUPE EUROTUNNEL SA REGR	38,395	6.50	249,605.89	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	71,230	2.66	189,756.72	
LUFTHANSA	16,481	15.99	263,531.19	
TNT EXPRESS NV - W/I	25,663	5.75	147,741.89	
VOPAK	5,113	54.06	276,408.78	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	23,083	71.79	1,657,128.57	
BAYER MOTOREN WERKNON-VT G PRF EUR1	3,724	49.88	185,771.74	
CONTINENTAL	7,631	89.61	683,813.91	
DAIMLER AG	63,311	45.23	2,863,556.53	
FIAT SPA	60,116	4.31	259,099.96	
MICHELIN B	12,652	67.96	859,829.92	
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,681	36.25	278,436.25	
PEUGEOT SA	18,266	6.23	113,833.71	
PIRELLI & C.	17,841	8.83	157,536.03	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	10,630	65.14	692,438.20	
RENAULT SA	13,324	49.00	652,942.62	
VOLKSWAGEN STAMM	2,034	169.90	345,576.60	
VOLKSWAGEN VORZUG	10,085	181.00	1,825,385.00	
ADIDAS AG	14,555	71.62	1,042,429.10	
CHRISTIAN DIOR	3,773	129.00	486,717.00	
HUGO BOSS AG -ORD	1,654	87.53	144,774.62	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,359	34.38	390,522.42	
LVMH	17,732	133.80	2,372,541.60	
ACCOR SA	10,850	29.04	315,138.25	
GREEK ORG OF FOOTBALL PROGNO	17,090	7.40	126,466.00	
SODEXO	6,515	70.55	459,633.25	
AXEL SPRINGER AG	2,946	36.07	106,262.22	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,032	26.75	241,606.00	
JC DECAUX SA NPV	4,982	21.95	109,354.90	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,104	67.37	411,226.48	
LAGARDERE	8,059	26.25	211,589.04	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	6,431	24.23	155,823.13	
PUBLICIS GROUPE	12,283	51.19	628,766.77	
REED ELSEVIER	47,657	11.74	559,731.46	
SES	21,008	23.42	492,112.40	
WOLTERS KLUWER CVA	22,103	15.15	334,970.96	
INDITEX	15,206	102.45	1,557,854.70	
PPR	5,253	173.65	912,183.45	
AHOLD (KON.)	70,008	10.99	769,387.92	
CARREFOUR	41,913	20.99	879,963.43	
CASINO ORD	4,047	77.33	312,954.51	
COLRUYT NV	5,536	35.02	193,870.72	
DELHAIZE GROUP	6,982	35.94	250,933.08	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	44,679	5.90	263,606.10	
JERONIMO MARTINS	16,119	16.17	260,644.23	

KESKO ORD	4,530	24.16	109,444.80
METRO STAMM	8,841	24.30	214,880.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	56,083	69.20	3,880,943.60
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	14,462	20.10	290,686.20
DANONE	40,374	53.15	2,145,878.10
DE MASTER BLENDEERS 1753 NV-W/I	41,030	8.82	361,925.63
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	7,366	45.77	337,178.65
HEINEKEN NV	16,011	54.77	876,922.47
KERRY GROUP A	10,304	41.00	422,464.00
PERNOD RICARD	14,784	98.08	1,450,014.72
REMY COINTREAU	1,506	97.40	146,684.40
SUEDZUCKER AG	4,757	33.30	158,408.10
UNILEVER NV CVA	113,729	29.82	3,391,967.42
BEIERSDORF	6,968	64.13	446,857.84
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	12,379	66.76	826,422.04
HENKEL KGAA	8,989	55.89	502,395.21
L'OREAL	16,819	111.70	1,878,682.30
CELESIO AG	6,103	13.39	81,719.17
ESSILOR INTERNATIONAL	14,087	73.24	1,031,731.88
FRESENIUS MEDICAL CARE A G AND CO KGAA	14,682	52.41	769,483.62
FRESENIUS SE & CO KGaA	8,645	89.34	772,344.30
BAYER AG	57,754	71.79	4,146,159.66
ELAN CORP PLC	36,121	7.57	273,724.93
GRIFOLS SA	10,966	26.83	294,217.78
MERCK KGAA	4,696	106.35	499,419.60
ORION OYJ	7,189	23.20	166,784.80
QIAGEN N.V.	16,987	16.43	279,096.41
SANOFI	83,316	74.10	6,173,715.60
UCB SA	7,985	42.79	341,678.15
BANCA INTESA SPA	701,157	1.39	976,711.70
BANCA INTESA SPA	75,635	1.17	88,871.12
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	519,418	0.23	122,063.23
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	380,332	7.65	2,909,539.80
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	142,450	1.01	144,016.95
BANCO POPOLARE SPA	126,067	1.43	181,032.21
BANCO POPULAR ESPANOL	365,004	0.65	237,982.60
BANCO SANTANDER SA	720,882	5.96	4,302,223.77
BANKIA SAU	65,000	0.33	21,450.00
BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV)	193,897	1.70	329,624.90
BNP PARIBAS	70,022	45.62	3,194,753.75
CAIXABANK	55,814	3.01	168,502.46
COMMERZBANK AG	261,865	1.50	394,630.55
CREDIT AGRICOLE SA	69,206	7.32	506,795.53
ERSTE GROUP BANK AG	14,965	23.14	346,290.10
IRISH BANK RESOLUTION CO RP LTD	150,806		
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	13,661	29.85	407,780.85
NATIXIS	69,322	3.41	236,734.63

RAIFFEISEN BANK INTERNAT IONAL	3,264	30.78	100,465.92	
SOCIETE GENERALE-A	48,951	31.15	1,525,068.40	
UNICREDIT SPA	282,173	4.33	1,222,373.43	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	58,603	3.60	211,439.62	
DEUTSCHE BANK AG-REG	64,853	36.62	2,375,241.12	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,390	47.65	638,100.45	
EURAZEO NPV	1,949	41.71	81,292.79	
EXOR SPA	5,306	22.25	118,058.50	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	5,558	60.68	337,259.44	
ING GROUP N.V.	267,131	6.70	1,790,044.83	
MEDIOBANCA	37,667	5.44	205,096.81	
POHJOLA BANK PLC	11,000	12.39	136,290.00	
WENDEL	2,494	83.48	208,199.12	
AEGON NV	121,235	5.13	622,178.02	
AGEAS	16,593	26.04	432,164.68	
ALLIANZ	31,786	105.35	3,348,655.10	
ASSICURAZIONI GENERALI	81,285	13.10	1,064,833.50	
AXA	123,248	13.93	1,716,844.64	
CNP ASSURANCES	12,487	12.42	155,088.54	
DELTA LLOYD NV	9,346	14.15	132,292.63	
HANNOVER RUECKVERSORD NPV	4,131	58.39	241,209.09	
MAPFRE SA	54,199	2.42	131,486.77	
MUENCHENER RUECK AG-REG	12,502	136.45	1,705,897.90	
SAMPO INSURANCE CO A	29,108	28.05	816,479.40	
SCOR SE	11,903	21.80	259,485.40	
VIENNA INSURANCE GROUP A G WIENER	3,073	38.07	116,989.11	
IMMOFINANZ IMMOBILIEN ANLAGE	68,379	3.32	227,565.31	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	21,635	20.16	436,161.60	
ATOS	3,752	57.62	216,190.24	
CAP GEMINI SA	10,745	36.63	393,589.35	
DASSAULT SYSTEMES	4,311	84.87	365,874.57	
SAP AG	64,330	59.80	3,846,934.00	
UNITED INTERNET	6,463	17.67	114,201.21	
GEMALTO	5,763	70.38	405,599.94	
NOKIA	260,206	2.96	770,209.76	
BELGACOM SA	11,187	21.20	237,164.40	
DEUTSCHE TELEKOM	195,826	8.30	1,626,726.58	
ELISA CORP-A SHARES	10,276	16.05	164,929.80	
FRANCE TELECOM	129,048	7.72	996,379.60	
ILIAD SA	1,559	142.15	221,611.85	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	68,864	3.22	222,292.99	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA	45,444	3.99	181,548.78	
TELECOM ITALIA SPA	649,581	0.62	404,039.38	
TELECOM ITALIA-RNC	413,196	0.54	223,125.84	
TELEFONICA S.A.	285,920	9.79	2,800,586.40	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,791	5.16	81,513.14	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,438	38.20	131,348.79	
VIVENDI SA	90,656	15.83	1,435,084.48	
ZIGGO NV	8,171	25.80	210,852.65	

ACCIONA S.A	1,914	48.21	92,273.94	
E.ON SE	125,529	13.16	1,652,589.28	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	131,252	2.32	305,292.15	
ELEC DE FRANCE EURO.5	16,451	14.95	245,942.45	
ENAGAS	13,066	17.86	233,424.09	
ENEL GREEN POWER SPA	119,014	1.46	174,474.52	
ENEL SPA	458,646	2.94	1,349,336.53	
FORTUM OYJ	30,675	14.81	454,296.75	
GAS NATURAL SDG-E	24,146	15.30	369,433.80	
GDF SUEZ	88,962	14.76	1,313,523.93	
IBERDROLA SA	277,748	3.75	1,043,499.23	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,443	41.87	311,638.41	
RWE AG	34,036	28.36	965,260.96	
RWE AG-NON VTG PFD	3,201	26.96	86,314.96	
SNAM SPA	116,859	3.70	432,378.30	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	21,187	10.06	213,247.15	
TERNA SPA	92,040	3.19	293,975.76	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,351	9.56	232,819.91	
VERBUND AG	5,576	16.70	93,147.08	
ASML HOLDING NV	21,926	55.09	1,207,903.34	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	75,252	6.54	492,674.84	
STMICROELECTRONICS NV	43,762	6.25	273,512.50	
ユーロ 小計	12,518,569		169,504,446.34 (21,301,623,771)	
合計	74,044,920		159,469,953,294 (159,469,953,294)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,700	773,568.00	
		AMERICAN TOWER CORP	27,500	2,052,050.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	67,700	1,029,717.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,315	954,022.30	
		BOSTON PROPERTIES INC	10,450	1,121,807.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,706	403,300.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,400	542,808.00	
		DUKE REALTY CORP	20,500	327,385.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	22,216	1,279,197.28	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,400	480,920.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	29,189	586,115.12	
		HCP INC	31,500	1,519,875.00	
		HEALTH CARE REIT INC	17,700	1,131,738.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	50,148	866,557.44	
		KIMCO REALTY CORP	29,700	651,024.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,800	349,184.00	
		MACERICH CO/THE	9,700	601,691.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	11,956	576,757.44	
PROLOGIS INC	32,047	1,270,984.02			

	PUBLIC STORAGE	10,200	1,557,744.00	
	RAYONIER INC	8,450	472,270.50	
	REALTY INCOME CORP	9,774	436,897.80	
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	327,474.00	
	SIMON PPTY(SIMON DEBART	21,184	3,400,032.00	
	SL GREEN REALTY CORP	6,700	559,383.00	
	UDR INC	17,200	427,936.00	
	VENTAS INC COM	20,500	1,421,675.00	
	VORNADO REALTY TRUST	11,659	999,759.25	
	WEYERHAEUSER CO	37,391	1,152,764.53	
アメリカ・ドル 小計		567,985	27,274,637.26 (2,555,088,018)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5,900	132,632.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,900	275,220.00	
カナダ・ドル 小計		15,800	407,852.00 (37,771,173)	
オーストラリア・ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	140,068	288,540.08	
	DEXUS PROPERTY GROUP	335,968	354,446.24	
	FEDERATION CENTRES	100,935	236,187.90	
	GOODMAN GROUP	117,517	533,527.18	
	GPT GROUP	104,743	392,786.25	
	MIRVAC GROUP	250,065	400,104.00	
	STOCKLAND	152,167	558,452.89	
	WESTFIELD GROUP	149,553	1,645,083.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	200,792	620,447.28	
オーストラリア・ドル 小計		1,551,808	5,029,574.82 (487,516,687)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	61,492	360,035.66	
	HAMMERSON	51,913	261,122.39	
	INTU PROPERTIES PLC	40,531	145,141.51	
	LAND SECURITIES GROUP	54,023	456,764.46	
	SEGRO PLC	57,634	148,004.11	
イギリス・ポンド 小計		265,593	1,371,068.13 (198,242,740)	
香港・ドル	LINK REIT	158,500	6,775,875.00	
香港・ドル 小計		158,500	6,775,875.00 (81,852,570)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	133,013	359,135.10	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	155,000	254,200.00	
	CAPITAMALL TRUST	158,700	345,966.00	
シンガポール・ドル 小計		446,713	959,301.10 (72,676,651)	
ユーロ	CORIO NV	4,999	176,239.74	
	FONCIERE DES REGIONS	1,740	111,307.80	
	GECINA SA	1,502	129,892.96	
	ICADE	1,907	130,209.96	
	KLEPIERRE	6,800	206,040.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,400	1,132,800.00	
ユーロ 小計		23,348	1,886,490.46 (237,075,256)	

投資証券 小計		3,670,223,095 (3,670,223,095)	
合計		3,670,223,095 (3,670,223,095)	

- (注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
 2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
 3. 投資証券における券面総額は、証券数です。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 576銘柄	97.3%		58.0%
	投資証券 29銘柄		2.7%	
カナダ・ドル	株式 95銘柄	99.5%		5.1%
	投資証券 2銘柄		0.5%	
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄	93.0%		4.3%
	投資証券 9銘柄		7.0%	
イギリス・ポンド	株式 101銘柄	98.8%		10.2%
	投資証券 5銘柄		1.2%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	100.0%		4.2%
香港・ドル	株式 40銘柄	96.5%		1.4%
	投資証券 1銘柄		3.5%	
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	94.4%		0.8%
	投資証券 3銘柄		5.6%	
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%		0.3%
ユーロ	株式 232銘柄	98.9%		13.2%
	投資証券 6銘柄		1.1%	

(注)組入株式時価比率及び組入投資証券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(平成25年3月29日現在)

資産総額	301,862,547円
負債総額	205,733円
純資産総額(-)	301,656,814円
発行済口数	274,813,850口
1口当たり純資産額(/)	1.0977円

<参考情報>

親投資信託受益証券（ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド）

(平成25年3月29日現在)

資産総額	239,266,445,300円
負債総額	430,870,720円
純資産総額(-)	238,835,574,580円
発行済口数	157,869,850,960口
1口当たり純資産額(/)	1.5129円

<参考情報>

親投資信託受益証券（ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド）

(平成25年3月29日現在)

資産総額	197,702,904,426円
負債総額	1,714,655,606円
純資産総額(-)	195,988,248,820円
発行済口数	168,234,103,170口
1口当たり純資産額(/)	1.1650円

<参考情報>

親投資信託受益証券（ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(平成25年3月29日現在)

資産総額	163,958,156,769円
負債総額	109,633,080円
純資産総額(-)	163,848,523,689円
発行済口数	124,993,374,356口
1口当たり純資産額(/)	1.3109円

平成25年3月29日現在、主要投資対象の親投資信託受益証券のうち、「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資残高はありませんので、参考情報として同親投資信託の純資産額計算書を記載していません。

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

受益者が委託会社に対して行う下記の手続きは、販売会社を通じて、委託会社に請求することにより行うことができます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（1）受益証券の名義書換等

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託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また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、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。従って該当事項はありません。

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）受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

（3）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（4）内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

< 受益権の譲渡 >

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また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。

前項の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、上記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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、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また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またはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

< 受益権の譲渡の対抗要件 >

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

（5）その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

< 受益権の再分割 >

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

< 償還金 >

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です(平成25年3月29日現在)。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です(平成25年3月29日現在)。

発行済株式の総数

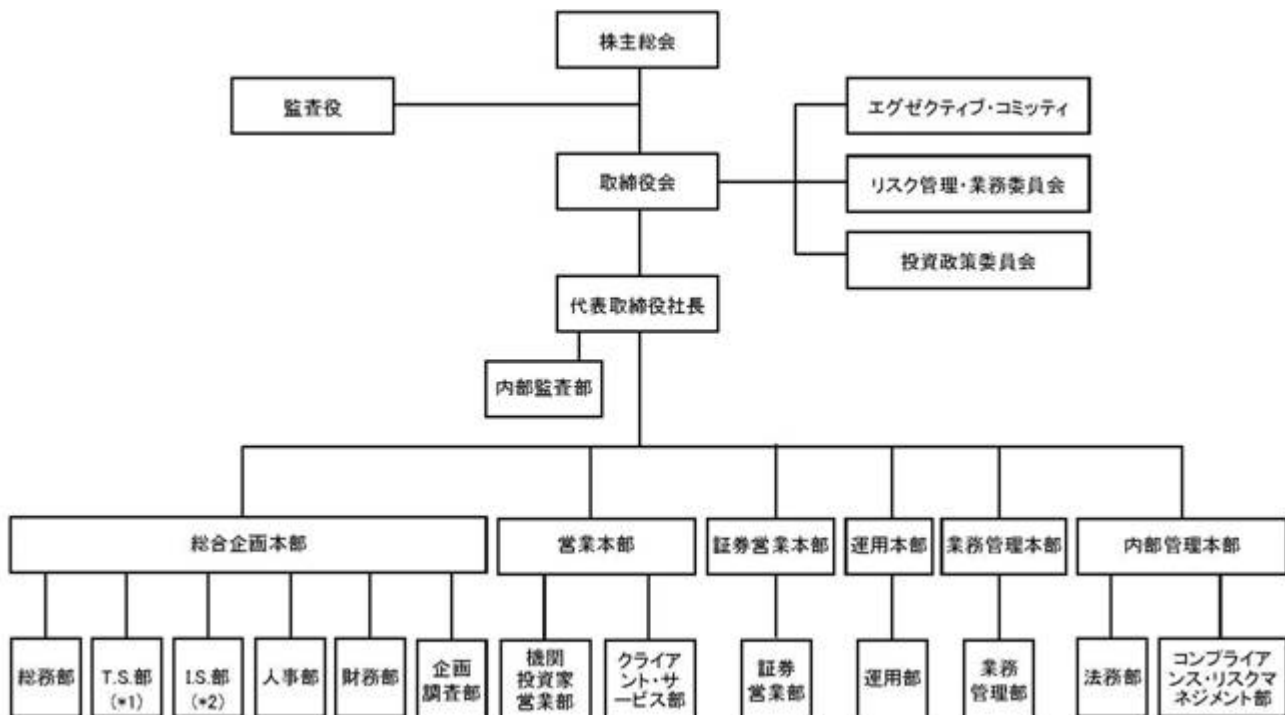
委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成25年3月29日現在)。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

組織図



内部管理本部の代表者は内部管理統括責任者の職を担う。

(*1)T.S.部はテクノロジー・サービス部、(*2)I.S.部はインフラストラクチャー・サービス部の略称。

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査および業務監査を行います。各部には、部長をおき、部長は、代表取締役社長または取締役の命を受け、所属員を指揮監督し、部の業務を統括します。

各部の業務分掌体制は以下の通りとなっています。

部署名		業務内容
営業本部	機関投資家営業部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓、投資信託販売会社との交渉・連絡、コンサルタントとの折衝等
	クライアント・サービス部	投資運用業務、投資助言業務のサポート、投資信託販売会社との交渉・連絡、コンサルタントとの折衝等
証券営業本部	証券営業部	グループ会社の運用するETF、海外ファンド等の国内投資家向け需要喚起・勧誘、自社設定投信の企画・勧誘等
運用本部	運用部	投資一任・助言に係る資産及び投資信託の運用の指図、売買発注、運用報告の作成、運用手法・運用モデルの研究開発等
業務管理本部	業務管理部	資産運用管理業務、投資信託管理業務、運用報告書等の作成、投資パフォーマンスの計測・要因分析等
総合企画本部	企画調査部	商品設計、法定書面、契約締結手続き、広告、営業イベント企画、市場動向調査等の各種ビジネス・サポート
	財務部	会社経理・決算、税務申告、予算管理等の経理業務、ディスクロージャー資料作成等
	人事部	福利厚生、給与支払等の人事に関する事務的業務
	インフラストラクチャー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[コンピューター機器及び付属機器の設置・保守管理]、SSgAのソフトウェアの開発・PC管理・サポート、システム管理
	テクノロジー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[ソフトウェアの開発・保守管理、セキュリティ管理]
	総務部	備品の購入・管理、オフィスの安全・防犯管理等の総務関連業務（総務業務）、メンテナンスを含む施設管理に関する業務（管財業務）および対外広報管理等の広報に関する業務（広報業務）
内部管理本部	コンプライアンス・リスクマネジメント部	法令遵守状況の確認・指導、投資判断その他に関するリスク管理、内部管理責任者、情報管理責任者、広告審査、内部監査対応等
	法務部	法務調査・契約書類等の作成等の法務的業務
	内部監査部	経営諸活動の内部統制システムの妥当性及有効性について検証・評価し、その結果及び改善案を経営陣に対して報告

投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

投資政策委員会で、投資対象地域経済、産業、政治について更に精緻に分析を行い、投資対象企業、債券を様々な面より分析しつつ、基本的な運用方針を決定します。

2) 運用実施計画の作成

ファンド・マネージャーは決定された運用基本方針に基づいて、具体的な銘柄選択と運用実施計画を作成します。

3) 運用の実行

ファンド・マネージャーは運用計画に基づいて、組入有価証券の売買等を指図します。

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者は、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）を行っております。また金融商品取引法に定める投資助言業、第1種金融商品取引業及び第2種金融商品取引業を行っております。

平成25年3月29日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計113本であり、その純資産総額は1,159,063百万円です(親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。)

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）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）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表ならびに第16期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成23年3月31日現在)		当事業年度 (平成24年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(資 産 の 部)		%		%
流動資産				
現金	51		108	
預金	6,661,535		6,846,204	
有価証券	55,860		96,020	
前払金	4,358		24,411	
前払費用	17,658		17,419	
未収入金	361,818		354,309	
未収委託者報酬	349,939		361,180	
未収収益	30,627		37,563	
未収消費税等	22,424		25,103	
未収還付法人税等	131,504		-	
繰延税金資産	24,293		37,059	
流動資産計	7,660,073	96.0	7,799,380	96.4
固定資産				
有形固定資産	172,747		160,569	
建物附属設備	143,387		129,885	
器具備品	29,360		21,984	
リース資産	-		8,699	
無形固定資産	1,667		3,096	
ソフトウェア	1,667		3,096	
投資その他の資産	143,436		125,422	
長期差入保証金	93,357		80,749	
繰延税金資産	45,229		39,823	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	317,851	4.0	289,087	3.6
資産合計	7,977,925	100.0	8,088,468	100.0
(負 債 の 部)		%		%
流動負債				
預り金	84,273		37,390	
未払金	424,170		216,365	
未払手数料	109,589		106,399	
その他未払金	314,580		109,966	
未払費用	72,454		68,177	
未払法人税等	265		205,843	
未払消費税等	-		-	
賞与引当金	54,792		35,727	
リース債務	-		2,223	
流動負債計	635,955	8.0	565,728	7.0
固定負債				
役員退職慰労引当金	-		-	
退職給付引当金	84,094		69,969	
長期リース債務	-		6,448	
固定負債計	84,094	1.1	76,417	0.9
負債合計	720,050	9.0	642,146	7.9
(純 資 産 の 部)		%		%
株主資本	7,257,874	91.0	7,446,321	92.1
資本金	310,000		310,000	
利益剰余金	77,500		77,500	
利益準備金	77,500		77,500	
その他利益剰余金	31,620		31,620	
別途積立金	31,620		31,620	
繰越利益剰余金	6,838,754		7,027,201	
純資産合計	7,257,874	91.0	7,446,321	92.1
負債・純資産合計	7,977,925	100.0	8,088,468	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度		当事業年度	
	自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日	金額	自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日	金額
		構成比		構成比
		%		%
営業収益				
委託者報酬	3,343,307		1,938,693	
投資顧問収入	1,785,199		1,324,526	
その他営業収益	18,337		248,693	
営業収益計	5,146,844	100.0	3,511,914	100.0
営業費用				
支払手数料	1,355,270		491,137	
広告宣伝費	17,530		14,465	
公告費	2,400		1,755	
調査費	493,033		379,325	
調査費	248,560		206,637	
委託調査費	242,832		171,141	
図書費	1,640		1,546	
委託計算費	171,824		155,279	
営業雑経費	40,718		37,603	
通信費	7,033		6,683	
印刷費	8,341		10,572	
協会費	13,797		11,049	
諸会費	2,901		3,633	
その他	8,644		5,663	
営業費用計	2,080,777	40.4	1,079,565	30.7
一般管理費				
給料	1,254,505		1,338,902	
役員報酬	305,535		413,892	
給料・手当	761,648		766,394	
賞与	132,528		116,894	
賞与引当金繰入額	54,792		41,721	
退職金	2,846		-	
交際費	2,992		5,974	
旅費交通費	26,905		30,537	
租税公課	14,439		16,034	
不動産賃借料	135,683		125,330	
役員退職慰労引当金繰入額	9,188		-	
退職給付費用	60,658		62,909	
固定資産減価償却費	31,299		22,921	
福利厚生費	87,865		101,047	
事務手数料	749,844		55,825	
諸経費	118,910		117,938	
一般管理費計	2,495,141	48.5	1,877,421	53.5
営業利益	570,925	11.1	554,927	15.8
営業外収益				
受取利息	-		-	
有価証券売却益	-		-	
雑収入	572		7,304	
営業外収益計	572	0.0	7,304	0.2
営業外費用				
支払利息	-		70	
為替差損	1,144		1,769	
有価証券売却損	1,620		942	
雑損失	425		932	
営業外費用計	3,190	0.0	3,715	0.1
経常利益	568,306	16.2	558,516	15.9
特別損失				

資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		20,630			-	
役員退職慰労金制度終了損		6,662			-	
事業再構築費用		-			36,057	
事務処理損失		7,866			3,089	
特別損失計		35,159	0.7		39,147	1.1
税引前当期純利益		533,147	10.4		519,369	14.8
法人税,住民税及び事業税		275,975	5.4		338,282	9.6
法人税等調整額		25,770	0.5		7,359	0.2
当期純利益		231,401	4.5		188,446	5.4

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	310,000	310,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	310,000	310,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	77,500	77,500
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	77,500	77,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	31,620	31,620
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	31,620	31,620
繰越利益剰余金		
当期首残高	6,607,353	6,838,754
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	6,838,754	7,027,201
利益剰余金合計		
当期首残高	6,716,473	6,947,874
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	6,947,874	7,136,321
株主資本合計		
当期首残高	7,026,473	7,257,874
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	7,257,874	7,446,321
純資産合計		
当期首残高	7,026,473	7,257,874
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	7,257,874	7,446,321

[重要な会計方針]

1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2.固定資産の減価償却方法	(1)有形固定資産 (イ)リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 6～18年 器具備品 8年 (ロ)リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。 (2)無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4.引当金の計上基準	(1)賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2)退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。また、過去勤務債務及び数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 過去勤務債務 その発生年度の従業員等の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	(1)消費税等の処理方法 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。

[追加情報]

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成23年3月 31日 現在)	当事業年度 (平成24年3月 31日 現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 48,437千円 器具備品 28,565千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 61,939千円 器具備品 35,941千円 リース資産 457千円
2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 6,842千円	2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 8,428千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

(損益計算書関係)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日
1. 移転価格の取扱いに係る注記 該当事項はありません。	1. 移転価格の取扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することに致しました。当会計期間には、ステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーから当社に支払われた調整額228,767千円が、損益計算書のその他営業収益に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日）

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

当事業年度（自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日）

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

(リース取引関係)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日
--	--

<p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるものの以外のファイナンス・リース取引 (リース取引開始日が平成20年3月31日以前のもの)</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <table border="0"> <tr> <td>支払リース料</td> <td>2,473千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>2,250千円</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td>60千円</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p>	支払リース料	2,473千円	減価償却費相当額	2,250千円	支払利息相当額	60千円	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>リース資産の内容 社用車両であります。</p> <p>リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減価償却方法」に記載の通りであります。</p>
支払リース料	2,473千円						
減価償却費相当額	2,250千円						
支払利息相当額	60千円						

(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、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料には、平成19年8月17日金融庁告示五九「金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算定の基準等を定める件」により定義される取引先リスクが存在しますが、取引先の多くは、「指定国の政府機関および中央銀行（これらに準ずる者を含む。）」、「我が国の地方公共団体」および「指定格付を付与された金融機関」であるため、取引先リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成23年3月31日 現在

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	6,661,535	6,661,535	
(2)未収委託者報酬	349,939	349,939	
(3)未収入金	361,818	361,818	
(4)その他未払金	314,580	314,580	

平成24年3月31日 現在

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	6,846,204	6,846,204	
(2)未収委託者報酬	361,180	361,180	
(3)未収入金	294,937	294,937	
(4)その他未払金	60,028	60,028	

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 現金及び預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(4)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に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

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

(注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 55,860千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 900千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 96,020千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 100千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 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。	同 左

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社は、設立時より適格退職年金制度を設けておりましたが、退職給付制度の改定を実施し、平成23年3月31日に適格退職年金制度を廃止し、平成23年4月1日より確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）へ移行するとともに、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当社は、平成23年3月31日に適格退職年金制度を廃止し、平成23年4月1日より確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）へ移行するとともに、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

2．退職給付債務及びその内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月 31日現在)	当事業年度 (平成24年3月 31日現在)
退職給付債務	322,666	372,119
(1)年金資産	172,261	228,989
(2)退職給付引当金	84,094	69,969
(3)未認識数理計算上の差異	20,905	5,334
(4)未認識過去勤務債務	87,216	78,494

3．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日
退職給付費用	60,658	44,552
(1)勤務費用	36,339	54,763
(2)利息費用	1,988	3,226
(3)期待運用収益（減算）	966	1,253
(4)過去勤務債務の費用処理額	3,265	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,032	20,905

4．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成23年3月 31日現在)	当事業年度 (平成24年3月 31日現在)
(1)割引率	1.0%	1.0%
(2)期待運用収益率	0.75%	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	期間定額基準
(4)過去勤務債務の処理年数	発生時より 11年	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年	1年

(税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成22年4月 1日	自 平成23年4月 1日
至 平成23年3月 31日	至 平成24年3月 31日

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	(単位：千円)	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	(単位：千円)
繰延税金資産（流動）		繰延税金資産（流動）	
賞与引当金繰入超過額	17,154	賞与引当金繰入超過額	11,012
その他	19,822	未払事業税	14,990
		その他	14,803
繰延税金資産（流動）合計	36,977	繰延税金資産（流動）合計	40,805
繰延税金負債（流動）との相殺	12,683	繰延税金負債（流動）との相殺	3,746
繰延税金資産（流動）の純額	24,293	繰延税金資産（流動）の純額	37,059
繰延税金資産（固定）		繰延税金資産（固定）	
退職給付引当金	35,207	退職給付引当金	25,807
その他	13,831	その他	14,015
繰延税金資産（固定）合計	49,038	繰延税金資産（固定）合計	39,823
繰延税金負債（固定）との相殺	3,809	繰延税金負債（固定）との相殺	-
繰延税金資産（固定）の純額	45,229	繰延税金資産（固定）の純額	39,823
繰延税金資産合計	69,522	繰延税金資産合計	80,628
繰延税金負債（流動）		繰延税金負債（流動）	
事業譲受に係る調整項目	3,809	事業譲受に係る調整項目	3,559
未収還付事業税	8,873	その他	187
繰延税金負債（流動）合計	12,683	繰延税金負債（流動）合計	3,746
繰延税金負債（流動）との相殺	12,683	繰延税金負債（流動）との相殺	3,746
繰延税金負債（流動）の純額	-	繰延税金負債（流動）の純額	-
繰延税金負債（固定）		繰延税金負債（固定）	
事業譲受に係る調整項目	3,809	事業譲受に係る調整項目	-
繰延税金負債（固定）合計	3,809	繰延税金負債（固定）合計	-
繰延税金負債（固定）との相殺	3,809	繰延税金負債（固定）との相殺	-
繰延税金負債（固定）の純額	-	繰延税金負債（固定）の純額	-
繰延税金資産の純額	69,522 =====	繰延税金資産の純額	76,882 =====

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間の差異の原因となった主要な項目別内訳	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間の差異の原因となった主要な項目別内訳																								
<table> <tr> <td>法定実効税率</td> <td>40.7%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td>15.8%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>0.0%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td>56.5%</td> </tr> <tr> <td></td> <td>=====</td> </tr> </table>	法定実効税率	40.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目	15.8%	その他	0.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	56.5%		=====	<table> <tr> <td>法定実効税率</td> <td>40.7%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td>21.4%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による</td> <td></td> </tr> <tr> <td> 期末繰延税金資産の減額修正</td> <td>1.6%</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>0.0%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td>63.7%</td> </tr> <tr> <td></td> <td>=====</td> </tr> </table>	法定実効税率	40.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目	21.4%	税率変更による		期末繰延税金資産の減額修正	1.6%	その他	0.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	63.7%		=====
法定実効税率	40.7%																								
交際費等永久に損金に算入されない項目	15.8%																								
その他	0.0%																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	56.5%																								
	=====																								
法定実効税率	40.7%																								
交際費等永久に損金に算入されない項目	21.4%																								
税率変更による																									
期末繰延税金資産の減額修正	1.6%																								
その他	0.0%																								
税効果会計適用後の法人税等の負担率	63.7%																								
	=====																								

(企業結合関係等)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 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。	同 左

(資産除去債務関係)

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びデータセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は59,837千円であります。また資産除去債務の総額は、データセンターの賃貸借契約期間満了が近づいたことに伴う見積りの見直しの実施等を主な理由とし、当期中において12,509千円減少しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びデータセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は63,661千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、データセンターの賃貸借契約期間が満了したこと、また、資産除却費用の見積額を更新したことから、3,824千円増加しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客へ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. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への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。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

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. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

(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)

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

前事業年度											
自 平成22年4月 1日											
至 平成23年3月 31日											
種 類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有(被所有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラストカンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取	207,364	未収入金	31,050
								ソフトウェア使用料の支払	171,911	未払金	213,964
								投資顧問料の支払	199,549	未払費用	15,975
								ソフトウェアの使用契約			
						人件費等及び事務手数料の支払	人件費等の支払	145,191			
							事務手数料	699,910			

ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 事務所賃借料の支払 人件費等の支払	37,966 8,694 103,543	前払金 未払金	4,358 3,658
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	20,022 11,711	未収入金	477
ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国ルクセンブルク市	12.5万ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役役に就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	44,053		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポールシンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	121	未収収益	63
タッカーマン・グループ	米国ニューヨーク州ニューヨーク市	1百万ドル	不動産投資顧問業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の支払	5,934	未払金	3,121
ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ, LLC	米国マサチューセッツ州ボストン市	237百万米ドル	証券業	なし	なし	ETF商品の紹介	紹介料の受取	13,973	未収収益	6,701
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・オーストラリア	オーストラリアシドニー	8百万オーストラリアドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の受取	3,018		

(注) 上表の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
4. 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（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23年4月 1日 至 平成24年3月 31日											
種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有（被所有）割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アント・トラストカンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	173,013	未収入金	59,214
								ソフトウェア使用料の支払	135,004	未払費用	14,977
								ソフトウェアの使用契約	147,278	未収収益	9,050
								投資顧問料の支払	252,817		
								人件費等及び事務手数料の支払	228,767		
ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	36,711	前払金	24,411	
							事務所賃借料の支払	4,890	未払金	12,010	
							兼職社員の人件費支払等	111,504			

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国 ロンドン	62百万 ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	770 6,849	未収入金	63
ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国 ルクセンブルク市	12.5万 ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役役に就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	39,445		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール市	136万 シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	183	未収収益	94
タッカーマン・グループ	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	1百万 ドル	不動産投資顧問業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の支払	1		
ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ,LLC	米国 マサチューセッツ州 ボストン市	237百万 米ドル	証券業	なし	なし	ETF商品の紹介	紹介料の受取	15,885	未収収益	8,956

(注) 上表の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役務料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて支払われております。
4. 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて計算されております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション
(ニューヨーク証券取引所に上場)

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク
（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス
（非上場）

（２）重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

前事業年度		当事業年度	
自	平成22年4月 1日	自	平成23年4月 1日
至	平成23年3月 31日	至	平成24年3月 31日
1株当たり純資産	1,170,624円94銭	1株当たり純資産	1,201,019円51銭
1株当たり当期純利益	37,322円82銭	1株当たり当期純利益	30,394円51銭
なお、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、記載していません。		なお、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、記載していません。	

注）1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度	当事業年度
	自 平成22年4月 1日	自 平成23年4月 1日
	至 平成23年3月 31日	至 平成24年3月 31日
当期純利益（千円）	231,401	188,446
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	231,401	188,446
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

（重要な後発事象）

	当事業年度
	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。	

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	期 別	第16期中間会計期間末 (平成24年9月30日現在)	
		金 額	構成比
(資産の部)			
流動資産			%
現金		90	
預金		7,032,253	
有価証券		47,350	
前払金		17,726	
前払費用		16,152	
未収入金		394,821	
未収委託者報酬		368,085	
未収収益		210,742	
繰延税金資産		56,235	
流動資産計		8,143,458	96.7
固定資産			
有形固定資産		148,455	
建物附属設備	1	123,134	
器具備品	1	18,453	
リース資産	1	6,867	
無形固定資産		2,398	
ソフトウェア		2,398	
投資その他の資産			
長期差入保証金		81,545	
繰延税金資産		42,666	
その他投資		4,850	
固定資産計		279,915	3.3
資 産 合 計		8,423,374	100.0
(負債の部)			
流動負債			%
預り金		28,361	
未払金		187,674	
未払手数料		96,657	
その他未払金		91,016	
未払費用		69,185	
未払法人税等		235,293	
未払消費税等	2	18,311	
賞与引当金		90,656	
リース債務		1,898	
流動負債計		631,380	7.5
固定負債			
退職給付引当金		72,972	
長期リース債務		5,893	
固定負債計		78,865	0.9
負 債 合 計		710,246	8.4
(純資産の部)			
株主資本		7,713,128	91.6
資本金		310,000	
利益剰余金		7,403,128	
利益準備金		77,500	
その他利益剰余金			
別途積立金		31,620	
繰越利益剰余金		7,294,008	
純資産合計		7,713,128	91.6
負 債 ・ 純 資 産 合 計		8,423,374	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期 別	第16期中間会計期間	
	自 平成24年4月 1 日 至 平成24年9月30日	
科 目	金 額	構成比
営業収益		%
委託者報酬	951,647	
投資顧問収入	633,222	
その他営業収益	354,517	
営業収益計	1,939,387	100.0
営業費用・一般管理費		
営業費用	569,634	
支払手数料	236,753	
その他営業費用	332,881	
1		
一般管理費	885,953	
2		
営業費用・一般管理費計	1,455,587	75.1
営業利益	483,799	24.9
営業外収益	2,055	0.1
営業外費用	4,325	0.2
経常利益	481,529	24.8
特別損失	2,191	0.1
税引前中間純利益	479,338	24.7
法人税、住民税及び事業税	234,550	12.1
法人税等調整額	22,019	1.1
中間純利益	266,806	13.8

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第16期	
(自 平成24年4月 1 日 至 平成24年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	310,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	310,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	77,500
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	77,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	31,620
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	31,620
繰越利益剰余金	
当期首残高	7,027,201
当中間期変動額	
中間純利益	266,806
当中間期変動額合計	266,806
当中間期末残高	7,294,008
利益剰余金合計	
当期首残高	7,136,321
当中間期変動額	
中間純利益	266,806

当中間期変動額合計	266,806
当中間期末残高	7,403,128
株主資本合計	
当期首残高	7,446,321
当中間期変動額	
中間純利益	266,806
当中間期変動額合計	266,806
当中間期末残高	7,713,128
純資産合計	
前期末残高	7,446,321
当中間期変動額	
中間純利益	266,806
当中間期変動額合計	266,806
当中間期末残高	7,713,128

重要な会計方針

	第16期中間会計期間 自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日
1. 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 売買目的の有価証券 中間決算日の市場価格等に基づく時価法(取得原価は移動平均法により算定)を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 (イ)リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 6~18年 器具備品 8年 (ロ)リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。数理計算上の差異は、その発生時の翌期に一括償却することとしております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

注 記 事 項

（中間貸借対照表関係）

第16期中間会計期末 (平成24年9月30日 現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	
建物付属設備	68,690千円
器具備品	39,472千円
リース資産	2,289千円
2. 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第16期中間会計期間 自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日	
1. 当社とステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することに致しました。当中間会計期間には、ステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーから当社に支払われるべき調整額348,035千円が、損益計算書のその他営業収益に含まれております。	
2. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,282千円
無形固定資産	697千円
リース資産	1,831千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第16期中間会計期間 自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日				
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 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期末 株式数（株）
普通株式	6,200			6,200

（金融商品関係）

第16期中間会計期間 自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日			
1. 金融商品の時価等に関する事項 平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。			
（単位：千円）			
	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	7,032,253	7,032,253	
(2) 未収入金	394,821	394,821	
(3) 未収委託者報酬	368,085	368,085	

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) 未収入金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりません。

(注2) 金銭債権の中間決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

(有価証券関係)

第16期中間会計期間末
(平成24年9月30日 現在)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

第16期中間会計期間末
(平成24年9月30日 現在)

資産除去債務の総額の期中における増減はありません。

(デリバティブ取引関係)

第16期中間会計期間末
(平成24年9月30日 現在)

当社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。

(セグメント情報等)

第16期中間会計期間末
(平成24年9月30日 現在)

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

（セグメント関連情報）

1. 商品およびサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦に所在している顧客への収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除いております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

（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。

（1株当たり情報）

第16期中間会計期間

自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日

1株当たり純資産額 1,244,052円95銭

1株当たり中間純利益 43,033円33銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第16期中間会計期間	
自 平成24年4月1日	
至 平成24年9月30日	
中間純利益（千円）	266,806
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益（千円）	266,806
期中平均株式数（株）	6,200

（重要な後発事象）

第16期中間会計期間

自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「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。

自己又はその取締役若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、若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がないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

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、若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がないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

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、委託者の親法人等（委託者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。以下において同じ。）又は子法人等（委託者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金融デリバティブ取引を行うこと。

委託者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、運用財産の額若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。

上記に掲げるもののほか、委託者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、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

（１）定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

その他、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。

（２）訴訟事件その他の重要事項

訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実は存在しておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（平成24年4月1日現在）

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社

名 称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成24年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）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	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 （平成24年4月1日現在）	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

受託会社は主として、信託財産の保管・管理・計算、受益権の設定に係る振替機関への通知、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(2) 販売会社

販売会社は主として、受益権の募集取扱、収益分配の再投資、収益分配金・償還金及び解約金の支払いの取扱い、目論見書・運用報告書の交付等を行います。

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。

第3【その他】

- (1) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (2) 目論見書の表紙および裏表紙に、委託会社の名称および本店の所在地、販売会社等の名称、当ファンドの基本的形態等を記載すること、委託会社および当ファンドのロゴマークを表示し、図案を採用することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に、以下のような別称を使用することがあります。
交付目論見書 「投資信託説明書（交付目論見書）」
請求目論見書 「投資信託説明書（請求目論見書）」
- (4) 目論見書の表紙裏に、以下の事項を記載することがあります。
「当ファンドは、有価証券などの値動きのある証券に投資します（また、外国証券にはこの他に為替変動もあります。）ので、基準価額は変動します。従って、元本が保証されているものではありません。」
- (5) 請求目論見書に当ファンドの信託約款の全文を記載します。
- (6) 目論見書の表紙裏などに「契約締結前のご留意事項」として、ファンドに係るリスク、手数料等について記載することがあります。
- (7) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成25年4月3日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

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AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成24年3月9日から平成25年2月20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、AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成25年2月20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

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

() 上記は、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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月28日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 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」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第15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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成24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、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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 丘本 正彦 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 湯原 尚 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」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第16期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

() 上記は、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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。