

【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26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（売出）内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	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）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託 受益証券の金額】	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26年5月21日から平成27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みの受付けの取消し

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み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)【ファンドの目的及び基本的性格】

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	年1回 年2回	グローバル 日本				ブル・ベア型

中小型株	年4回	北米			日経 225	
債券			ファミリー ファンド	あり		
一般	年6回	欧州		()		条件付運用 型
国債	(隔月)	アジア				
社債					TOPIX	
その他債券	年12回	オセアニア				ロング・ ショート 型 / 絶対収 益追求型
クレジット属性 ()	(毎月)					
不動産投信	日々	中南米	ファンド・ オブ・ファンズ	なし		
	その他	アフリカ			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	()	中近東				その他
(投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)、資産配 分変更型))		(中東)				()
資産複合		エマージング				
資産配分固定型						
資産配分変動型						

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、為替のヘッジを行な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。



※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（ベビーファンド）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	・ 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	・ 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	・ 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	・ 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。

※シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)とは、シティ世界国債指数(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 留保益の運用については、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

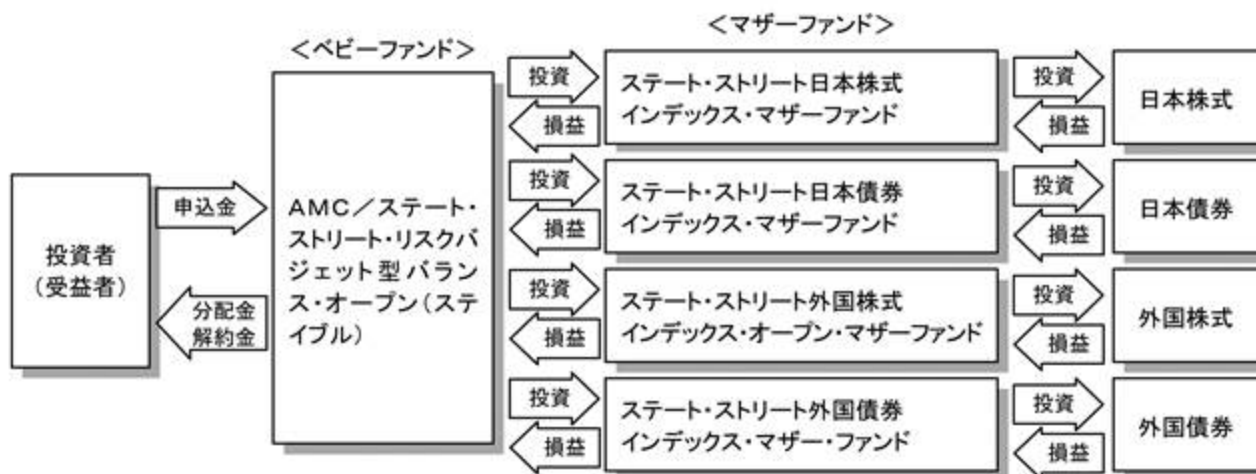
- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基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

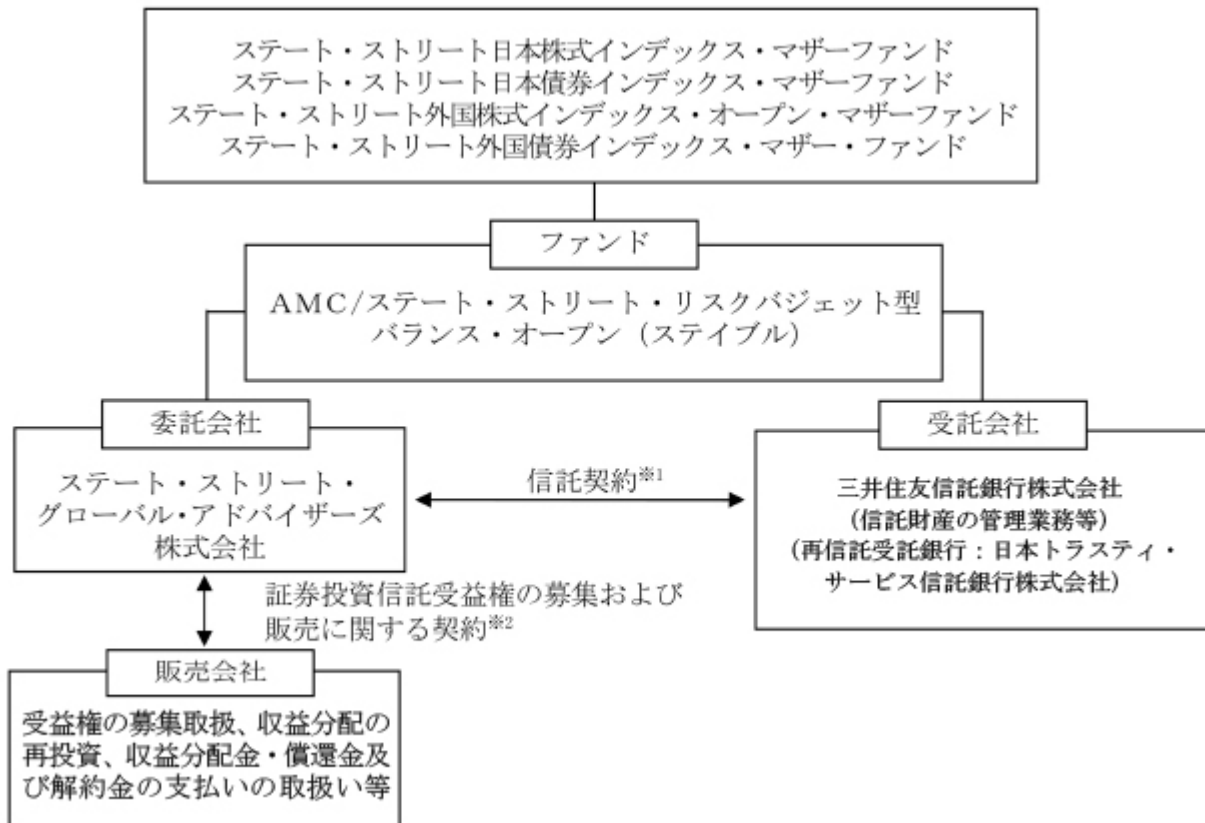
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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26年3月31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26年3月31日現在）

氏名又は名称	住所	所有株式数	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す。）
- 17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。

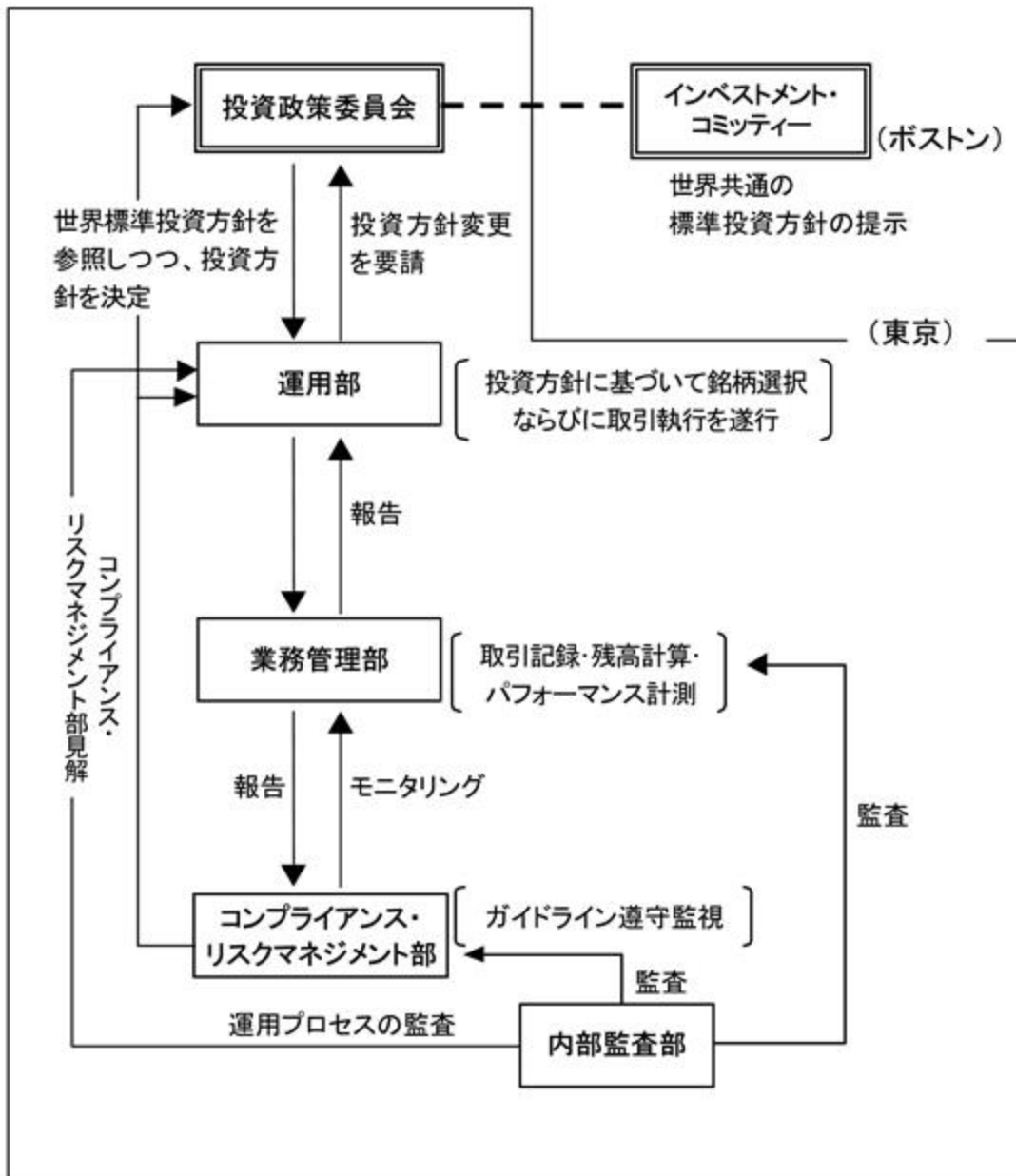
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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26年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

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せん。）
- 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せん。）
- 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、)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ます。)

(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ます。)

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す。）

（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）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す。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 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)

- ①TOPIX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する義務を持ちません。
- 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、野村証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証券株式会社に帰属します。また、野村証券株式会社は、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が独占的に所有しています。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入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、拡大的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ないます。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ないます。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に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暗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が、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る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。

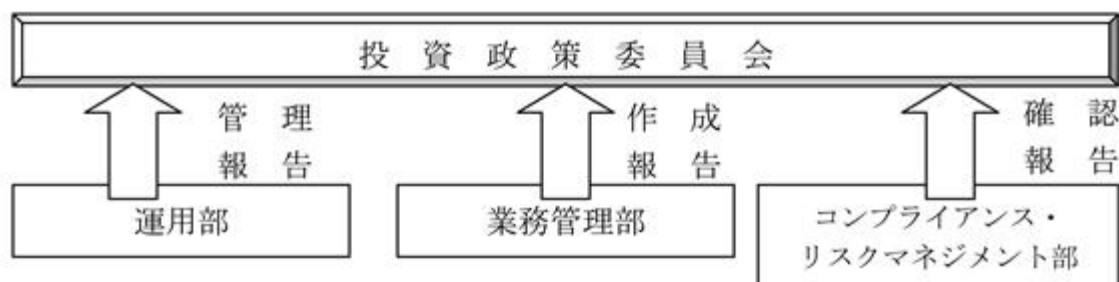
ファミリーファンド方式のリスク

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。

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0.648%（税抜0.60%）相当額

販売会社	信託財産の純資産総額の年率0.108%（税抜0.10%）相当額
受託会社	信託財産の純資産総額の年率0.054%（税抜0.05%）相当額
合計	信託財産の純資産総額の年率0.810%（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。この他に、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、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）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。

< 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20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行われます。

[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）との通算が可能です。

公募株式投資信託は税法上、平成26年1月1日以降の少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の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、15.315%（所得税15.315%）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。

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26年3月31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	1,547,831,446	95.10
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		79,807,949	4.90
純資産総額		1,627,639,395	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26年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	120,429,280,260	97.47
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		3,126,166,593	2.53
純資産総額		123,555,446,853	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26年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	145,837,555,200	78.73
特殊債券	日本	16,355,823,449	8.83
地方債証券	日本	11,708,376,613	6.32
社債券	日本	10,625,037,380	5.73
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		715,650,378	0.39
純資産総額		185,242,443,020	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26年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	93,991,398,772	56.25
	イギリス	15,143,033,612	9.06
	フランス	7,326,245,078	4.38
	カナダ	7,288,576,367	4.36
	ドイツ	6,861,231,224	4.11
	スイス	6,670,428,345	3.99
	オーストラリア	5,321,327,647	3.19
	スペイン	2,563,611,433	1.53
	スウェーデン	2,356,137,897	1.41
	オランダ	1,961,177,686	1.17
	香港	1,950,490,136	1.17
	イタリア	1,866,440,003	1.12
	シンガポール	1,028,833,535	0.62
	デンマーク	959,033,435	0.57
	ベルギー	890,133,287	0.53
	フィンランド	660,339,970	0.40
ノルウェー	600,452,609	0.36	

	イスラエル	383,136,418	0.23
	アイルランド	228,600,978	0.14
	オーストリア	193,736,223	0.12
	ポルトガル	141,073,066	0.08
	ニュージーランド	102,895,954	0.06
	小計	158,488,333,675	94.85
投資証券	アメリカ	2,408,581,774	1.44
	オーストラリア	367,646,935	0.22
	フランス	214,106,986	0.13
	イギリス	206,410,054	0.12
	香港	59,953,860	0.04
	シンガポール	57,865,276	0.03
	カナダ	33,475,422	0.02
	オランダ	16,674,495	0.01
	小計	3,364,714,802	2.01
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		5,249,746,119	3.14
純資産総額		167,102,794,596	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26年3月31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26年3月31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		961,168,506	1.1734	1,127,835,125	1.1715	1,126,008,904	69.18
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		137,726,072	1.7663	243,274,112	1.7943	247,121,890	15.18
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		101,446,288	1.6909	171,539,736	1.7221	174,700,652	10.74
									投資比率：合計	95.10

（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		95.10
合計		95.10

（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26年3月31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	980,800	5,762	5,651,369,600	5,826	5,714,140,800	4.62	
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,268,500	586	3,087,341,000	567	2,987,239,500	2.42	
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	341,500	7,591	2,592,326,500	7,800	2,663,700,000	2.16	
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	526,000	4,546	2,391,196,000	4,409	2,319,134,000	1.88	
5	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	634,200	3,732	2,366,834,400	3,634	2,304,682,800	1.87	
6	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,004,700	207	1,863,972,900	204	1,836,958,800	1.49	
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	273,300	5,819	1,590,332,700	5,619	1,535,672,700	1.24	
8	日本	株式	ファナック	電気機器	78,600	17,300	1,359,780,000	18,205	1,430,913,000	1.16	
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	437,600	3,222	1,409,947,200	3,240	1,417,824,000	1.15	
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	276,400	4,873	1,346,897,200	4,892	1,352,148,800	1.09	
11	日本	株式	キヤノン	電気機器	408,500	3,146	1,285,141,000	3,191	1,303,523,500	1.06	
12	日本	株式	KDDI	情報・通信業	215,900	6,157	1,329,296,300	5,976	1,290,218,400	1.04	
13	日本	株式	日立製作所	電気機器	1,692,000	808	1,367,136,000	762	1,289,304,000	1.04	
14	日本	株式	三菱地所	不動産業	487,000	2,549	1,241,363,000	2,446	1,191,202,000	0.96	
15	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	290,900	3,903	1,135,382,700	3,944	1,147,309,600	0.93	
16	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	850,000	1,269	1,078,310,000	1,224	1,040,400,000	0.84	
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	542,700	1,947	1,056,636,900	1,916	1,039,813,200	0.84	
18	日本	株式	三井不動産	不動産業	328,000	3,155	1,034,840,000	3,149	1,032,872,000	0.84	
19	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	129,600	7,802	1,011,139,200	7,606	985,737,600	0.80	
20	日本	株式	パナソニック	電気機器	805,000	1,294	1,041,670,000	1,173	944,265,000	0.76	
21	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,421,800	686	975,354,800	662	941,231,600	0.76	
22	日本	株式	三井物産	卸売業	640,300	1,590	1,018,077,000	1,459	934,197,700	0.76	
23	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	573,000	1,679	962,067,000	1,628	932,844,000	0.76	
24	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	989,100	902	892,168,200	920	909,972,000	0.74	
25	日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,119,000	293	913,867,000	282	879,558,000	0.71	
26	日本	株式	デンソー	輸送用機器	174,100	5,283	919,770,300	4,948	861,446,800	0.70	
27	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	231,300	3,749	867,143,700	3,660	846,558,000	0.69	
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	269,400	3,045	820,323,000	3,098	834,601,200	0.68	
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	705,000	1,219	859,395,000	1,162	819,210,000	0.66	
30	日本	株式	信越化学工業	化学	132,400	5,708	755,739,200	5,898	780,895,200	0.63	
										投資比率：合計	35.28

（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	12.37
	輸送用機器	11.45
	銀行業	9.13
	情報・通信業	7.12
	化学	5.30
	機械	5.07
	卸売業	4.53
	医薬品	4.47
	小売業	4.14
	食料品	3.85
	陸運業	3.70
	不動産業	3.23
	建設業	2.45

サービス業	2.36
保険業	2.16
電気・ガス業	2.11
証券、商品先物取引業	1.62
鉄鋼	1.55
その他製品	1.43
精密機器	1.38
その他金融業	1.25
ガラス・土石製品	1.01
非鉄金属	0.99
ゴム製品	0.90
繊維製品	0.71
金属製品	0.68
石油・石炭製品	0.58
空運業	0.50
鉱業	0.48
海運業	0.36
パルプ・紙	0.29
倉庫・運輸関連業	0.23
水産・農林業	0.07
合 計	97.47

（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) (2014年6月限)	大阪取引所	買建	259	3,099,601,560	3,115,770,000	2.52

（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26年3月31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332回利付国 債(10年)	0.600	2023/12/20	1,800,000,000	100.09	1,801,656,000	99.81	1,796,688,000	0.97
2	日本	国債 証券	第105回利付国 債(5年)	0.200	2017/06/20	1,700,000,000	100.29	1,704,998,000	100.27	1,704,624,000	0.92
3	日本	国債 証券	第298回利付国 債(10年)	1.300	2018/12/20	1,600,000,000	105.34	1,685,472,000	105.23	1,683,824,000	0.91
4	日本	国債 証券	第115回利付国 債(5年)	0.200	2018/09/20	1,600,000,000	100.12	1,602,004,000	100.11	1,601,760,000	0.86
5	日本	国債 証券	第116回利付国 債(5年)	0.200	2018/12/20	1,600,000,000	100.09	1,601,504,000	100.07	1,601,120,000	0.86
6	日本	国債 証券	第286回利付国 債(10年)	1.800	2017/06/20	1,500,000,000	105.55	1,583,295,000	105.41	1,581,240,000	0.85

7	日本	国債証券	第111回利付国債(5年)	0.400	2018/03/20	1,500,000,000	101.00	1,515,030,000	100.98	1,514,775,000	0.82
8	日本	国債証券	第101回利付国債(5年)	0.400	2016/12/20	1,500,000,000	100.86	1,512,930,000	100.81	1,512,195,000	0.82
9	日本	国債証券	第278回利付国債(10年)	1.800	2016/03/20	1,400,000,000	103.51	1,449,224,000	103.37	1,447,222,000	0.78
10	日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	1,400,000,000	102.12	1,429,778,000	101.83	1,425,718,000	0.77
11	日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	1.300	2015/06/20	1,400,000,000	101.58	1,422,148,000	101.48	1,420,832,000	0.77
12	日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	0.600	2023/03/20	1,400,000,000	100.60	1,408,442,000	100.34	1,404,774,000	0.76
13	日本	国債証券	第104回利付国債(5年)	0.200	2017/03/20	1,400,000,000	100.30	1,404,228,000	100.28	1,403,920,000	0.76
14	日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	1,300,000,000	105.95	1,377,376,000	105.78	1,375,231,000	0.74
15	日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	1,300,000,000	104.65	1,360,541,000	104.47	1,358,162,000	0.73
16	日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1,300,000,000	102.25	1,329,302,000	101.96	1,325,597,000	0.72
17	日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	0.300	2017/03/20	1,300,000,000	100.60	1,307,865,000	100.57	1,307,488,000	0.71
18	日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	0.400	2015/06/20	1,300,000,000	100.42	1,305,512,000	100.39	1,305,122,000	0.70
19	日本	国債証券	第334回利付国債(2年)	0.100	2015/11/15	1,300,000,000	100.05	1,300,650,000	100.03	1,300,416,000	0.70
20	日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1.400	2018/12/20	1,200,000,000	105.81	1,269,804,000	105.70	1,268,484,000	0.68
21	日本	国債証券	第279回利付国債(10年)	2.000	2016/03/20	1,200,000,000	103.92	1,247,076,000	103.76	1,245,180,000	0.67
22	日本	国債証券	第272回利付国債(10年)	1.400	2015/09/20	1,200,000,000	102.04	1,224,540,000	101.93	1,223,232,000	0.66
23	日本	国債証券	第114回利付国債(5年)	0.300	2018/09/20	1,200,000,000	100.58	1,207,020,000	100.55	1,206,648,000	0.65
24	日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	0.300	2016/12/20	1,200,000,000	100.58	1,207,008,000	100.54	1,206,504,000	0.65
25	日本	国債証券	第331回利付国債(10年)	0.600	2023/09/20	1,200,000,000	100.27	1,203,252,000	100.00	1,200,000,000	0.65
26	日本	国債証券	第304回利付国債(10年)	1.300	2019/09/20	1,100,000,000	106.02	1,166,286,000	105.86	1,164,504,000	0.63
27	日本	国債証券	第295回利付国債(10年)	1.500	2018/06/20	1,100,000,000	105.72	1,163,008,000	105.61	1,161,732,000	0.63
28	日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	1.800	2018/06/20	1,000,000,000	107.00	1,070,060,000	106.86	1,068,680,000	0.58
29	日本	国債証券	第302回利付国債(10年)	1.400	2019/06/20	1,000,000,000	106.33	1,063,340,000	106.22	1,062,220,000	0.57
30	日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	1,000,000,000	106.23	1,062,340,000	106.03	1,060,380,000	0.57
										投資比率：合計	22.09

(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		78.73
特殊債券		8.83
地方債証券		6.32
社債券		5.73
合計		99.61

(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26年3月31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	48,208	57,231	2,758,978,761	55,254	2,663,667,052	1.59
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	234,100	9,621	2,252,267,110	10,055	2,353,941,984	1.41
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	422,683	3,924	1,658,751,635	4,148	1,753,152,134	1.05
4	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,850	109,271	1,622,678,937	115,286	1,711,994,694	1.02
5	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	150,521	9,742	1,466,436,874	10,029	1,509,503,581	0.90
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	543,839	2,744	1,492,211,117	2,664	1,448,553,027	0.87
7	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	269,351	4,531	1,220,305,048	5,073	1,366,397,906	0.82
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	172,210	7,688	1,324,031,074	7,706	1,327,031,144	0.79
9	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	103,200	12,602	1,300,477,359	12,196	1,258,629,264	0.75
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	200,974	5,889	1,183,552,446	6,179	1,241,882,014	0.74
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	146,179	8,668	1,267,068,228	8,209	1,199,968,676	0.72
12	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	37,506	29,349	1,100,747,766	30,858	1,157,375,075	0.69
13	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	347,296	3,266	1,134,147,738	3,281	1,139,509,293	0.68
14	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サービス	55,561	18,493	1,027,470,993	19,601	1,089,057,494	0.65
15	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	220,719	5,117	1,129,469,002	4,880	1,077,211,663	0.64
16	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	995,996	1,167	1,161,949,949	1,047	1,042,513,096	0.62
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	122,794	8,321	1,021,821,798	8,414	1,033,230,834	0.62
18	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	283,516	3,624	1,027,409,023	3,609	1,023,323,897	0.61
19	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	573,448	1,628	933,684,822	1,748	1,002,147,173	0.60
20	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	156,174	5,129	800,938,921	5,761	899,790,503	0.54
21	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	212,970	4,136	880,919,481	4,009	853,740,079	0.51
22	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,005,873	824	828,840,458	829	834,268,414	0.50
23	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	195,423	3,648	712,828,906	4,073	795,868,844	0.48
24	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	162,292	5,447	883,927,662	4,863	789,221,127	0.47
25	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	208,168	3,509	730,546,703	3,758	782,229,739	0.47
26	フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	114,106	6,316	720,713,293	6,803	776,314,408	0.46
27	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,950	11,993	707,003,125	12,714	749,473,063	0.45
28	アメリカ	株式	QUALCOMM	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	90,492	7,573	685,282,667	8,159	738,369,256	0.44
29	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア	89,506	7,260	649,811,483	8,130	727,652,524	0.44
30	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	261,342	2,772	724,386,657	2,772	724,386,657	0.43

- (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26年3月31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	10.03
	銀行	9.63
	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	8.73
	資本財	7.48
	ソフトウェア・サービス	6.59
	食品・飲料・タバコ	5.97
	素材	5.53
	保険	4.10
	各種金融	3.97
	テクノロジー・ハードウェア および機器	3.83
	電気通信サービス	3.25
	公益事業	3.23
	ヘルスケア機器・サービス	2.97
	小売	2.95
	メディア	2.85
	食品・生活必需品小売り	2.15
	運輸	1.88
	自動車・自動車部品	1.80
	家庭用品・パーソナル用品	1.73
	消費者サービス	1.68
	耐久消費財・アパレル	1.54
	半導体・半導体製造装置	1.50
	商業・専門サービス	0.88
不動産	0.58	
	小 計	94.85
投資証券		2.01
	合 計	96.86

- (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26年3月31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	MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	327	30,258,432.50	30,254,040.00	3,113,745,796	1.86
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	171	5,137,602.01	5,307,840.00	751,855,536	0.45
	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	49	3,215,709.69	3,211,950.00	550,239,154	0.33
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	17	2,760,494.00	2,766,240.00	257,730,580	0.15

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	26	2,102,107.09	2,144,220.00	249,029,710	0.15
SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	19	2,544,575.00	2,544,100.00	242,172,879	0.14

(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26年3月31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26年3月31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おりません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成26年3月31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
第2期	(平成26年 2月20日)	分配付：	1,623,142,054	分配付：	1.1583
		分配落：	1,616,135,543	分配落：	1.1533
平成25年 3月末日			301,656,814		1.0977
4月末日			443,536,402		1.1258
5月末日			438,781,618		1.1137
6月末日			436,910,964		1.1090
7月末日			439,964,959		1.1167
8月末日			438,908,364		1.1140
9月末日			547,073,082		1.1364
10月末日			551,760,449		1.1461
11月末日			1,626,603,803		1.1619
12月末日			1,638,524,442		1.1696
平成26年 1月末日			1,622,159,885		1.1577
2月末日			1,629,338,036		1.1569
3月末日			1,627,639,395		1.1560

【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
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	0.0050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%
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	8.6%

(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】

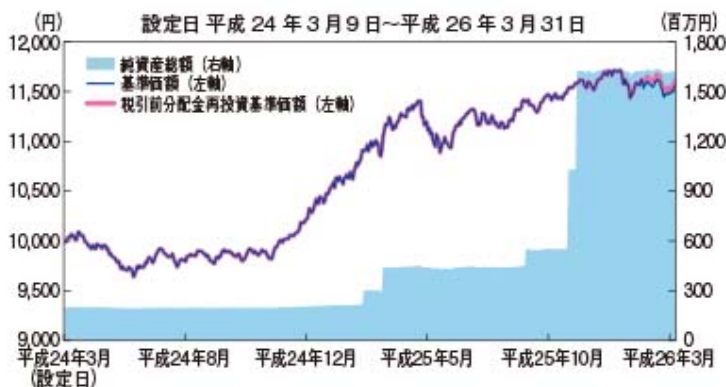
計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395

(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) 運用実績

基準価額・純資産の推移



※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	11,560円
純資産総額	1,627百万円

分配の推移

決算期	分配金
第1期（平成25年2月20日）	0円
第2期（平成26年2月20日）	50円
設定来累計	50円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

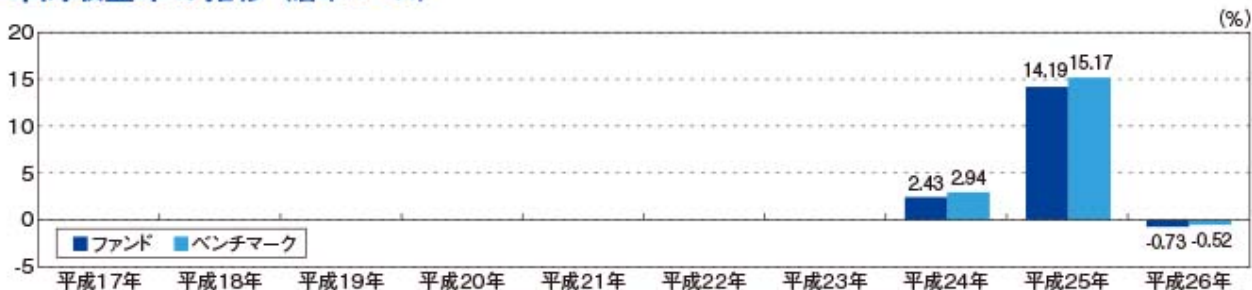
主要な資産の状況

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	69.18%	第332回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.600%	2023/12/20	0.97%
		第105回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.200%	2017/06/20	0.92%
		第298回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.300%	2018/12/20	0.91%
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	15.18%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	4.62%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.42%
		ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	—	—	2.16%
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	10.74%	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	—	—	1.41%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	1.05%

※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26年3月31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、株式会社イー・エム・シーが決定した資産配分に基づき、組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24年のファンドとベンチマークの収益率は設定時から12月末まで、平成26年は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いただけます。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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

（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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

（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)の変更事項にあつては、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。
- (d) 上記(b)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つて、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すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記1) (ハ) 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）手続等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、（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、（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、（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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成25年2月21日から平成26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)	第2期 (平成26年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,148,378	83,763,638
親投資信託受益証券	202,778,719	1,543,647,269
未収利息	21	68
流動資産合計	213,927,118	1,627,410,975
資産合計	213,927,118	1,627,410,975
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	7,006,511
未払解約金	-	507
未払受託者報酬	47,945	280,824
未払委託者報酬	671,170	3,931,488
その他未払費用	9,527	56,102
流動負債合計	728,642	11,275,432
負債合計	728,642	11,275,432
純資産の部		
元本等		
元本	1 199,867,158	1 1,401,302,395
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	13,331,318	214,833,148
(分配準備積立金)	13,331,318	42,296,022
元本等合計	213,198,476	1,616,135,543
純資産合計	213,198,476	1,616,135,543
負債純資産合計	213,927,118	1,627,410,975

（ 2 ） 【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期	第2期
	自 平成24年 3月 9日 至 平成25年 2月20日	自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日
営業収益		
受取利息	7,767	12,793
有価証券売買等損益	14,840,304	41,868,550
営業収益合計	14,848,071	41,881,343
営業費用		
受託者報酬	99,879	384,440
委託者報酬	1,398,244	5,382,023
その他費用	19,852	76,767
営業費用合計	1,517,975	5,843,230
営業利益	13,330,096	36,038,113
経常利益	13,330,096	36,038,113
当期純利益	13,330,096	36,038,113
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,222	43,410
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	13,331,318
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	172,660,954
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	172,660,954
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	147,316
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	147,316
分配金	1 -	1 7,006,511
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,331,318	214,833,148

(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)	第2期 (平成26年 2月20日現在)
1 期首元本額	199,976,258円	199,867,158円
期中追加設定元本額	円	1,202,700,140円
期中一部解約元本額	109,100円	1,264,903円
2 受益権の総数	199,867,158口	1,401,302,395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	第2期 自 平成25年 2月21日 至 平成26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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,230,481円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(27,764,222円)、収益調整金(172,537,126円)及び分配準備積立金(13,307,830円)より分配対象収益は221,839,659円(1万口当たり1,583円)であり、うち7,006,511円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(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)	第2期 (平成26年 2月20日現在)
1 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。	同左
2 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>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(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)	第2期 (平成26年 2月20日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	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	31,812,369
合計	14,062,386	31,812,369

(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	第2期 自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（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）	第2期 （平成26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）	1.1533円 （11,533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	128,244,226	226,274,112	
	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	978,211,540	1,147,833,421	
	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	100,283,767	169,539,736	
合計		1,206,739,533	1,543,647,269	

（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。

<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）	（平成26年 2月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			

コール・ローン		3,720,105,181	2,414,581,267
株式	3	180,755,973,175	119,574,162,660
派生商品評価勘定		285,869,960	
未収入金		80,880,760	133,715,221
未収配当金		148,952,586	119,258,894
未収利息		7,134	1,984
前払金			44,207,000
流動資産合計		184,991,788,796	122,285,927,026
資産合計		184,991,788,796	122,285,927,026
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			99,554,840
未払金			152,474,040
前受金		328,787,000	
未払解約金		19,750,000	34,960,000
流動負債合計		348,537,000	286,988,880
負債合計		348,537,000	286,988,880
純資産の部			
元本等			
元本	1	130,928,407,068	69,146,165,476
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		53,714,844,728	52,852,772,670
元本等合計		184,643,251,796	121,998,938,146
純資産合計		184,643,251,796	121,998,938,146
負債純資産合計		184,991,788,796	122,285,927,026

（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）	（平成26年 2月20日現在）
1 期首元本額	94,280,841,691円	130,928,407,068円
期中追加設定元本額	86,688,954,263円	37,445,760,823円
期中一部解約元本額	50,041,388,886円	99,228,002,415円

元本の内訳		
ファンド名		
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）	37,868,472円	128,244,226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	2,435,204,689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	88,320,889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	4,576,111,851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	12,116,239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	55,080,601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	42,288,048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	16,977,424,577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	1,196,985,754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	165,511,494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	4,454,504,084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	1,736,086,316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	182,581,187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	1,323,478,764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	10,020,162,782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	277,236,331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	2,865,109,904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	757,302,006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	5,006,928,140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	818,421,936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	1,932,675,423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	5,721,159円
ステート・ストリート日本株式インデック ス・ファンドF O F＜適格機関投資家限定 ＞	5,736,807,472円	5,627,852,296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	32,627,252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	41,647,163円
ステート・ストリート4資産バランス30 VA2<適格機関投資家限定>	49,895,184円	27,949,777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	1,288,034,879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	15,381,049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	17,903,818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	264,909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	66,337,788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	2,648,039,935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	760,881,567円
ステート・ストリート世界分散ファンドV A25A<適格機関投資家限定>	4,908,708,217円	3,561,748,643円
計	130,928,407,068円	69,146,165,476円
2 受益権の総数	130,928,407,068口	69,146,165,476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	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 424,975,000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	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。 デリバティブ取引には、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、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。

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)	(平成26年 2月20日現在)
1 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	同左
2 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>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「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>	同左

（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）	（平成26年 2月20日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
株式	22,316,870,457	19,663,491,546
合計	22,316,870,457	19,663,491,546

（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 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

（単位：円）

区分	種 類	（平成26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 TOPIX先物	2,496,311,000		2,396,925,000	99,386,000
	合 計	2,496,311,000		2,396,925,000	99,386,000

（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	自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成25年 2月20日現在）	（平成26年 2月20日現在）
1口当たり純資産額	1.4103円	1.7644円
（1万口当たり純資産額）	（14,103円）	（17,644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	35,000	268.00	9,380,000	
日本水産	90,100	224.00	20,182,400	
マルハニチロホールディングス	151,000	172.00	25,972,000	
ハウスイ	6,000	137.00	822,000	
サカタのタネ	12,400	1,299.00	16,107,600	
ホクト	8,500	1,938.00	16,473,000	
ショーボンドホールディングス	7,000	4,570.00	31,990,000	
ミライト・ホールディングス	22,300	918.00	20,471,400	
タマホーム	3,400	868.00	2,951,200	
住石ホールディングス	23,700	123.00	2,915,100	
日鉄鉱業	21,000	427.00	8,967,000	
三井松島産業	56,000	155.00	8,680,000	
国際石油開発帝石	383,900	1,299.00	498,686,100	
日本海洋掘削	2,100	4,830.00	10,143,000	
石油資源開発	11,300	3,760.00	42,488,000	
K&Oエナジーグループ	4,000	1,294.00	5,176,000	
ダイセキ環境ソリューション	800	1,587.00	1,269,600	
安藤・間	49,600	376.00	18,649,600	
東急建設	29,400	405.00	11,907,000	
コムシスホールディングス	38,800	1,581.00	61,342,800	
ミサワホーム	8,600	1,306.00	11,231,600	
高松コンストラクショングループ	6,200	1,757.00	10,893,400	
東建コーポレーション	3,130	4,565.00	14,288,450	
ヤマウラ	5,000	277.00	1,385,000	
大成建設	401,000	439.00	176,039,000	
大林組	238,000	584.00	138,992,000	
清水建設	243,000	520.00	126,360,000	
飛鳥建設	53,900	146.00	7,869,400	
長谷工コーポレーション	103,300	676.00	69,830,800	
松井建設	9,000	395.00	3,555,000	
銭高組	3,000	286.00	858,000	
鹿島建設	348,000	358.00	124,584,000	
不動テトラ	57,700	175.00	10,097,500	
大末建設	30,000	110.00	3,300,000	
鉄建建設	50,000	269.00	13,450,000	
日鉄住金テックスエンジ	14,000	373.00	5,222,000	
西松建設	103,000	349.00	35,947,000	
三井住友建設	143,200	107.00	15,322,400	
大豊建設	23,000	331.00	7,613,000	
前田建設工業	48,000	634.00	30,432,000	
佐田建設	27,000	124.00	3,348,000	
ナカノフドー建設	6,000	223.00	1,338,000	
奥村組	70,000	443.00	31,010,000	
大和小田急建設	4,500	246.00	1,107,000	
東鉄工業	9,700	2,019.00	19,584,300	
イチケン	10,000	169.00	1,690,000	
浅沼組	24,000	138.00	3,312,000	

戸田建設	91,000	314.00	28,574,000	
熊谷組	63,000	249.00	15,687,000	
青木あすなろ建設	5,000	556.00	2,780,000	
北野建設	19,000	269.00	5,111,000	
植木組	10,000	193.00	1,930,000	
三井ホーム	11,000	466.00	5,126,000	
矢作建設工業	10,100	935.00	9,443,500	
ピーエス三菱	7,100	468.00	3,322,800	
大東建託	30,100	9,436.00	284,023,600	
新日本建設	11,200	297.00	3,326,400	
N I P P O	19,000	1,485.00	28,215,000	
東亜道路工業	16,000	450.00	7,200,000	
前田道路	24,000	1,582.00	37,968,000	
日本道路	22,000	497.00	10,934,000	
東亜建設工業	72,000	208.00	14,976,000	
若築建設	46,000	133.00	6,118,000	
東洋建設	26,800	335.00	8,978,000	
五洋建設	94,000	374.00	35,156,000	
大林道路	10,000	558.00	5,580,000	
世紀東急工業	29,000	117.00	3,393,000	
福田組	12,000	406.00	4,872,000	
日本ドライケミカル	400	2,254.00	901,600	
住友林業	55,000	1,048.00	57,640,000	
日本基礎技術	9,700	334.00	3,239,800	
日成ビルド工業	24,000	229.00	5,496,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	44,000	113.00	4,972,000	
巴コーポレーション	11,100	413.00	4,584,300	
パナホーム	31,000	687.00	21,297,000	
大和ハウス工業	217,000	1,854.00	402,318,000	
ライト工業	16,700	839.00	14,011,300	
積水ハウス	207,300	1,321.00	273,843,300	
日特建設	5,200	367.00	1,908,400	
北陸電気工事	4,000	451.00	1,804,000	
ユアテック	13,000	336.00	4,368,000	
西部電気工業	7,000	457.00	3,199,000	
四電工	8,000	349.00	2,792,000	
中電工	12,000	1,638.00	19,656,000	
関電工	38,000	523.00	19,874,000	
きんでん	45,000	1,043.00	46,935,000	
東京エネシス	9,000	460.00	4,140,000	
トーエネック	12,000	584.00	7,008,000	
住友電設	6,000	1,306.00	7,836,000	
日本電設工業	13,000	1,307.00	16,991,000	
協和エクシオ	29,600	1,371.00	40,581,600	
新日本空調	5,700	618.00	3,522,600	
日本工営	26,000	428.00	11,128,000	
N D S	13,000	286.00	3,718,000	
九電工	14,000	793.00	11,102,000	
三機工業	18,000	580.00	10,440,000	
日揮	79,000	3,642.00	287,718,000	
中外炉工業	28,000	226.00	6,328,000	
ヤマト	7,000	336.00	2,352,000	
太平電業	10,000	639.00	6,390,000	

高砂熱学工業	22,400	1,007.00	22,556,800	
三晃金属工業	9,000	268.00	2,412,000	
NECネットエスアイ	6,900	2,278.00	15,718,200	
朝日工業社	8,000	376.00	3,008,000	
明星工業	4,000	442.00	1,768,000	
アタカ大機	5,000	383.00	1,915,000	
大気社	10,700	1,970.00	21,079,000	
ダイダン	11,000	525.00	5,775,000	
日比谷総合設備	10,100	1,162.00	11,736,200	
東芝プラントシステム	13,000	1,361.00	17,693,000	
日本製粉	48,000	497.00	23,856,000	
日清製粉グループ本社	78,600	1,017.00	79,936,200	
日東富士製粉	7,000	315.00	2,205,000	
昭和産業	34,000	342.00	11,628,000	
鳥越製粉	6,500	684.00	4,446,000	
協同飼料	28,000	107.00	2,996,000	
中部飼料	7,200	597.00	4,298,400	
日本配合飼料	26,000	122.00	3,172,000	
東洋精糖	14,000	100.00	1,400,000	
日本甜菜製糖	44,000	193.00	8,492,000	
三井製糖	32,000	419.00	13,408,000	
ネクスト	6,300	860.00	5,418,000	
日本M&Aセンター	3,800	8,260.00	31,388,000	
ノバレーゼ	2,500	919.00	2,297,500	
アコーディア・ゴルフ	30,600	1,302.00	39,841,200	
タケエイ	3,200	973.00	3,113,600	
トラスト・テック	800	1,533.00	1,226,400	
パソナグループ	5,300	634.00	3,360,200	
CDS	1,000	931.00	931,000	
リンクアンドモチベーション	118	21,200.00	2,501,600	
GCAサヴィアン	4,500	809.00	3,640,500	
エス・エム・エス	4,500	2,087.00	9,391,500	
テンプホールディングス	16,500	2,884.00	47,586,000	
リニカル	1,600	905.00	1,448,000	
クックパッド	3,600	2,840.00	10,224,000	
エスクリ	2,000	941.00	1,882,000	
アイ・ケイ・ケイ	1,800	794.00	1,429,200	
森永製菓	82,000	221.00	18,122,000	
中村屋	20,000	399.00	7,980,000	
江崎グリコ	27,000	1,408.00	38,016,000	
名糖産業	3,600	1,016.00	3,657,600	
不二家	47,000	188.00	8,836,000	
山崎製パン	58,000	1,113.00	64,554,000	
第一屋製パン	10,000	126.00	1,260,000	
モロゾフ	12,000	314.00	3,768,000	
亀田製菓	4,600	2,862.00	13,165,200	
カルビー	29,400	2,514.00	73,911,600	
森永乳業	66,000	314.00	20,724,000	
六甲バター	1,300	758.00	985,400	
ヤクルト本社	46,400	4,845.00	224,808,000	
明治ホールディングス	23,500	6,200.00	145,700,000	
雪印メグミルク	16,400	1,288.00	21,123,200	
プリマハム	39,000	188.00	7,332,000	

日本ハム	55,000	1,582.00	87,010,000	
伊藤ハム	46,000	440.00	20,240,000	
林兼産業	31,000	78.00	2,418,000	
丸大食品	40,000	306.00	12,240,000	
米久	2,700	872.00	2,354,400	
S Foods	5,000	1,072.00	5,360,000	
学情	2,400	762.00	1,828,800	
スタジオアリス	3,100	1,356.00	4,203,600	
シミックホールディングス	3,000	1,369.00	4,107,000	
システナ	8,000	751.00	6,008,000	
NECフィールドینگ	6,500	1,576.00	10,244,000	
デジタルアーツ	2,700	735.00	1,984,500	
新日鉄住金ソリューションズ	4,800	2,675.00	12,840,000	
総合警備保障	27,100	1,953.00	52,926,300	
日本駐車場開発	82,200	103.00	8,466,600	
コア	3,100	731.00	2,266,100	
カカクコム	41,700	1,650.00	68,805,000	
アイロムホールディングス	1,600	786.00	1,257,600	
ルネサンス	3,300	817.00	2,696,100	
ディップ	1,100	1,464.00	1,610,400	
SBSホールディングス	1,400	1,681.00	2,353,400	
オプト	2,100	846.00	1,776,600	
新日本科学	4,900	1,218.00	5,968,200	
ツクイ	9,100	1,015.00	9,236,500	
総合臨床ホールディングス	1,200	513.00	615,600	
キャリアデザインセンター	8	105,000.00	840,000	
エムスリー	245	298,400.00	73,108,000	
ベストプライダグ	4,400	629.00	2,767,600	
アウトソーシング	2,500	1,045.00	2,612,500	
ディー・エヌ・エー	38,000	2,072.00	78,736,000	
博報堂DYホールディングス	103,300	765.00	79,024,500	
ぐるなび	5,300	3,425.00	18,152,500	
一休	50	128,100.00	6,405,000	
ジャパンベストレスキューシステム	50	46,550.00	2,327,500	
ジェイコムホールディングス	1,400	728.00	1,019,200	
PGMホールディングス	10,700	932.00	9,972,400	
WDBホールディングス	600	1,167.00	700,200	
バリューコマース	4,700	1,040.00	4,888,000	
サッポロホールディングス	131,000	358.00	46,898,000	
アサヒグループホールディングス	158,700	2,547.00	404,208,900	
麒麟ホールディングス	338,000	1,326.00	448,188,000	
宝ホールディングス	63,000	763.00	48,069,000	
オエノンホールディングス	21,000	215.00	4,515,000	
養命酒製造	6,000	848.00	5,088,000	
コカ・コーラウエスト	24,600	1,785.00	43,911,000	
コカ・コーライーストジャパン	16,500	2,224.00	36,696,000	
サントリー食品インターナショナル	40,500	3,470.00	140,535,000	
ダイトードリンコ	3,700	4,100.00	15,170,000	
伊藤園	21,700	2,203.00	47,805,100	
キーコーヒー	7,200	1,575.00	11,340,000	
ユニカフェ	2,900	641.00	1,858,900	
ジャパンフーズ	1,300	1,229.00	1,597,700	
日清オイリオグループ	36,000	327.00	11,772,000	

不二製油	19,100	1,372.00	26,205,200	
かどや製油	600	2,691.00	1,614,600	
J - オイルミルズ	34,000	271.00	9,214,000	
ローソン	28,500	7,230.00	206,055,000	
サンエー	5,600	2,899.00	16,234,400	
キリン堂	2,500	630.00	1,575,000	
ダイユーエイト	1,800	663.00	1,193,400	
カワチ薬品	5,000	1,859.00	9,295,000	
エービーシー・マート	8,600	4,365.00	37,539,000	
ハードオフコーポレーション	3,400	853.00	2,900,200	
高千穂交易	3,100	1,016.00	3,149,600	
アスクル	6,200	3,695.00	22,909,000	
ゲオホールディングス	12,500	922.00	11,525,000	
アダストリアホールディングス	5,500	2,441.00	13,425,500	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	8,000	192.00	1,536,000	
伊藤忠食品	1,800	3,445.00	6,201,000	
くらコーポレーション	4,500	1,704.00	7,668,000	
キャンドゥ	3,400	1,529.00	5,198,600	
エレマテック	3,400	1,908.00	6,487,200	
パル	4,300	1,881.00	8,088,300	
JALUX	2,400	1,181.00	2,834,400	
エディオ	31,900	530.00	16,907,000	
あらた	17,000	327.00	5,559,000	
サーラコーポレーション	6,400	492.00	3,148,800	
トーメンデバイス	1,200	1,773.00	2,127,600	
J Pホールディングス	12,000	468.00	5,616,000	
あみやき亭	1,200	3,000.00	3,600,000	
東京エレクトロン デバイス	1,600	1,576.00	2,521,600	
ひらまつ	7,800	732.00	5,709,600	
双日	458,500	180.00	82,530,000	
ゲンキー	800	2,216.00	1,772,800	
アルフレッサ ホールディングス	20,500	5,810.00	119,105,000	
大黒天物産	1,500	2,730.00	4,095,000	
ハニーズ	5,990	892.00	5,343,080	
キッコーマン	65,000	1,839.00	119,535,000	
味の素	188,000	1,507.00	283,316,000	
キュービー	40,700	1,412.00	57,468,400	
ハウス食品グループ本社	27,800	1,583.00	44,007,400	
カゴメ	29,700	1,714.00	50,905,800	
焼津水産化学工業	3,800	924.00	3,511,200	
アリアケジャパン	7,600	2,379.00	18,080,400	
ニチレイ	84,000	426.00	35,784,000	
横浜冷凍	18,200	792.00	14,414,400	
東洋水産	38,000	3,305.00	125,590,000	
イートアンド	400	1,775.00	710,000	
日清食品ホールディングス	31,000	4,470.00	138,570,000	
永谷園	8,000	959.00	7,672,000	
フジッコ	8,000	1,198.00	9,584,000	
ロック・フィールド	4,500	1,785.00	8,032,500	
日本たばこ産業	437,600	3,286.00	1,437,953,600	
ケンコーマヨネーズ	2,800	878.00	2,458,400	
わらべや日洋	4,900	1,943.00	9,520,700	
なとり	3,700	1,148.00	4,247,600	

片倉工業	8,900	1,073.00	9,549,700	
グンゼ	58,000	265.00	15,370,000	
ヒューリック	117,200	1,261.00	147,789,200	
神栄	9,000	206.00	1,854,000	
山下医科器械	700	1,672.00	1,170,400	
ラサ商事	4,000	463.00	1,852,000	
アルペン	5,500	1,735.00	9,542,500	
クオール	3,700	597.00	2,208,900	
アルコニックス	2,000	2,213.00	4,426,000	
神戸物産	300	2,444.00	733,200	
ジェイアイエヌ	3,800	2,725.00	10,355,000	
ビックカメラ	279	60,200.00	16,795,800	
D C Mホールディングス	34,100	664.00	22,642,400	
MonotaRO	10,000	2,082.00	20,820,000	
あいホールディングス	11,100	1,462.00	16,228,200	
J.フロントリテイリング	164,000	695.00	113,980,000	
ドトール・日レスホールディングス	12,100	1,656.00	20,037,600	
マツモトキヨシホールディングス	12,500	3,255.00	40,687,500	
ブロンコピリー	900	1,808.00	1,627,200	
スタートトゥデイ	20,200	2,195.00	44,339,000	
物語コーポレーション	1,000	3,035.00	3,035,000	
ココカラファイン	7,700	2,660.00	20,482,000	
三越伊勢丹ホールディングス	138,800	1,179.00	163,645,200	
東洋紡	316,000	175.00	55,300,000	
ユニチカ	213,000	62.00	13,206,000	
富士紡ホールディングス	39,000	210.00	8,190,000	
日清紡ホールディングス	47,000	859.00	40,373,000	
倉敷紡績	80,000	179.00	14,320,000	
ダイワボウホールディングス	67,000	185.00	12,395,000	
シキボウ	49,000	118.00	5,782,000	
日東紡績	56,000	415.00	23,240,000	
トヨタ紡織	24,500	1,054.00	25,823,000	
ウエルシアホールディングス	2,600	5,620.00	14,612,000	
クリエイトSDホールディングス	3,000	3,300.00	9,900,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,700	678.00	9,288,600	
八洲電機	6,100	450.00	2,745,000	
U K Cホールディングス	4,500	1,754.00	7,893,000	
丸善C H Iホールディングス	5,300	310.00	1,643,000	
T O K A Iホールディングス	28,100	328.00	9,216,800	
エー・ピーカンパニー	200	1,880.00	376,000	
三洋貿易	1,800	910.00	1,638,000	
日本毛織	24,000	715.00	17,160,000	
大東紡織	12,000	71.00	852,000	
トーア紡コーポレーション	34,000	72.00	2,448,000	
ガイドーリミテッド	9,000	643.00	5,787,000	
東京建物不動産販売	4,200	405.00	1,701,000	
三栄建築設計	2,100	842.00	1,768,200	
野村不動産ホールディングス	46,500	2,193.00	101,974,500	
プレサンスコーポレーション	900	2,755.00	2,479,500	
常和ホールディングス	1,600	3,145.00	5,032,000	
フージャースホールディングス	10,200	590.00	6,018,000	
オープンハウス	2,800	1,905.00	5,334,000	
東急不動産ホールディングス	154,100	844.00	130,060,400	

飯田グループホールディングス	30,800	1,592.00	49,033,600	
帝国繊維	8,000	1,373.00	10,984,000	
ブックオフコーポレーション	4,100	721.00	2,956,100	
日本コークス工業	65,000	130.00	8,450,000	
ミタチ産業	2,000	500.00	1,000,000	
あさひ	4,400	1,337.00	5,882,800	
日本調剤	890	2,747.00	2,444,830	
コスモス薬品	3,500	12,370.00	43,295,000	
シップヘルスケアホールディングス	10,000	3,540.00	35,400,000	
トーエル	3,500	544.00	1,904,000	
一六堂	1,200	449.00	538,800	
ソフトクリエイティブホールディングス	2,200	932.00	2,050,400	
セブン&アイ・ホールディングス	290,900	3,931.00	1,143,527,900	
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	600	2,952.00	1,771,200	
ツルハホールディングス	6,900	9,460.00	65,274,000	
サンマルクホールディングス	2,400	4,765.00	11,436,000	
フェリシモ	2,400	993.00	2,383,200	
トリドール	6,600	962.00	6,349,200	
クスリのアオキ	1,100	5,710.00	6,281,000	
帝人	293,000	236.00	69,148,000	
東レ	535,000	704.00	376,640,000	
クラレ	117,200	1,121.00	131,381,200	
旭化成	460,000	722.00	332,120,000	
サカイオーベックス	21,000	178.00	3,738,000	
稲葉製作所	3,300	1,224.00	4,039,200	
宮地エンジニアリンググループ	25,000	237.00	5,925,000	
トーカロ	4,500	1,590.00	7,155,000	
アルファC o	2,500	994.00	2,485,000	
SUMCO	45,200	765.00	34,578,000	
川田テクノロジーズ	1,700	2,520.00	4,284,000	
住江織物	21,000	292.00	6,132,000	
日本フェルト	4,900	468.00	2,293,200	
イチカワ	5,000	288.00	1,440,000	
日本バイリーン	7,000	603.00	4,221,000	
エコナックホールディングス	23,000	48.00	1,104,000	
日東製網	10,000	161.00	1,610,000	
芦森工業	18,000	124.00	2,232,000	
アツギ	67,000	115.00	7,705,000	
ダイニック	17,000	174.00	2,958,000	
共和レザー	4,200	514.00	2,158,800	
セーレン	21,000	825.00	17,325,000	
東海染工	14,000	121.00	1,694,000	
小松精練	13,000	471.00	6,123,000	
ワコールホールディングス	44,000	1,081.00	47,564,000	
ホギメディカル	4,600	5,350.00	24,610,000	
レナウン	19,300	123.00	2,373,900	
クラウディア	1,000	1,148.00	1,148,000	
T S Iホールディングス	36,200	617.00	22,335,400	
I Tホールディングス	24,500	1,713.00	41,968,500	
ネオス	1,300	1,013.00	1,316,900	
電算システム	1,800	1,087.00	1,956,600	
グリー	36,600	1,123.00	41,101,800	
コーエーテクモホールディングス	14,500	1,186.00	17,197,000	

三菱総合研究所	2,900	2,041.00	5,918,900	
ボルテージ	1,200	1,569.00	1,882,800	
電算	300	1,855.00	556,500	
ヒト・コミュニケーションズ	400	1,802.00	720,800	
ブレインパッド	300	1,333.00	399,900	
K L a b	4,800	717.00	3,441,600	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,000	1,546.00	4,638,000	
イーブックイニシアティブジャパン	700	1,773.00	1,241,100	
ネクソン	58,400	868.00	50,691,200	
アイスタイル	1,900	540.00	1,026,000	
エムアップ	400	722.00	288,800	
エイチーム	600	6,240.00	3,744,000	
e n i s h	900	2,066.00	1,859,400	
モバイルクリエイト	500	3,385.00	1,692,500	
ブロードリーフ	6,800	1,465.00	9,962,000	
ハーツユナイテッドグループ	1,300	2,671.00	3,472,300	
特種東海製紙	44,000	211.00	9,284,000	
ドワンゴ	6,200	2,600.00	16,120,000	
ベリサーブ	500	1,613.00	806,500	
ティーガイア	7,000	1,061.00	7,427,000	
豆蔵ホールディングス	2,900	393.00	1,139,700	
テクマトリックス	1,900	577.00	1,096,300	
GMOペイメントゲートウェイ	2,900	4,960.00	14,384,000	
ザッパラス	3,900	704.00	2,745,600	
インターネットイニシアティブ	9,600	2,034.00	19,526,400	
ビットアイル	3,400	715.00	2,431,000	
S R Aホールディングス	3,400	1,335.00	4,539,000	
朝日ネット	6,000	488.00	2,928,000	
コムチュア	500	1,857.00	928,500	
王子ホールディングス	327,000	491.00	160,557,000	
日本製紙	37,400	1,995.00	74,613,000	
三菱製紙	109,000	94.00	10,246,000	
北越紀州製紙	48,500	443.00	21,485,500	
中越パルプ工業	29,000	211.00	6,119,000	
巴川製紙所	13,000	192.00	2,496,000	
大王製紙	26,000	970.00	25,220,000	
レンゴー	59,000	605.00	35,695,000	
トーモク	25,000	311.00	7,775,000	
ザ・パック	5,700	1,839.00	10,482,300	
コープケミカル	11,000	129.00	1,419,000	
昭和電工	489,000	145.00	70,905,000	
住友化学	546,000	420.00	229,320,000	
日本化成	16,000	136.00	2,176,000	
住友精化	14,000	796.00	11,144,000	
日産化学工業	51,200	1,463.00	74,905,600	
ラサ工業	27,000	152.00	4,104,000	
クレハ	52,000	485.00	25,220,000	
多木化学	2,000	602.00	1,204,000	
テイカ	13,000	291.00	3,783,000	
石原産業	138,000	106.00	14,628,000	
片倉チッカリン	6,000	271.00	1,626,000	
日本曹達	46,000	540.00	24,840,000	

東ソー	200,000	399.00	79,800,000	
トクヤマ	112,000	364.00	40,768,000	
セントラル硝子	70,000	336.00	23,520,000	
東亜合成	87,000	415.00	36,105,000	
ダイソー	32,000	336.00	10,752,000	
関東電化工業	18,000	258.00	4,644,000	
電気化学工業	149,000	379.00	56,471,000	
イビデン	42,800	1,972.00	84,401,600	
信越化学工業	132,400	5,518.00	730,583,200	
日本カーバイド工業	23,000	229.00	5,267,000	
堺化学工業	30,000	310.00	9,300,000	
エア・ウォーター	61,000	1,518.00	92,598,000	
大陽日酸	95,000	769.00	73,055,000	
日本化学工業	28,000	140.00	3,920,000	
日本パーカライジング	17,000	2,225.00	37,825,000	
高压ガス工業	12,000	555.00	6,660,000	
チタン工業	10,000	242.00	2,420,000	
四国化成工業	11,000	736.00	8,096,000	
戸田工業	11,000	251.00	2,761,000	
ステラ ケミファ	3,400	1,393.00	4,736,200	
保土谷化学工業	18,000	186.00	3,348,000	
日本触媒	62,000	1,201.00	74,462,000	
大日精化工業	28,000	435.00	12,180,000	
カネカ	93,000	637.00	59,241,000	
協和発酵キリン	89,000	1,063.00	94,607,000	
三菱瓦斯化学	117,000	673.00	78,741,000	
三井化学	328,000	265.00	86,920,000	
J S R	68,000	1,727.00	117,436,000	
東京応化工業	14,200	2,106.00	29,905,200	
大阪有機化学工業	5,000	458.00	2,290,000	
三菱ケミカルホールディングス	463,400	452.00	209,456,800	
日本合成化学工業	16,000	851.00	13,616,000	
ダイセル	92,000	895.00	82,340,000	
住友ベークライト	57,000	390.00	22,230,000	
積水化学工業	152,000	1,133.00	172,216,000	
日本ゼオン	58,000	1,006.00	58,348,000	
アイカ工業	20,700	2,099.00	43,449,300	
宇部興産	377,000	186.00	70,122,000	
積水樹脂	11,000	1,373.00	15,103,000	
タキロン	19,000	431.00	8,189,000	
旭有機材工業	28,000	228.00	6,384,000	
日立化成	32,300	1,412.00	45,607,600	
ニチバン	8,000	348.00	2,784,000	
リケンテクノス	12,000	554.00	6,648,000	
大倉工業	19,000	317.00	6,023,000	
積水化成品工業	21,000	258.00	5,418,000	
群栄化学工業	21,000	400.00	8,400,000	
タイガースポリマー	3,600	439.00	1,580,400	
ミライアル	1,900	1,400.00	2,660,000	
日本化薬	52,000	1,315.00	68,380,000	
カーリットホールディングス	6,000	461.00	2,766,000	
イーピーエス	87	115,900.00	10,083,300	
パナソニック インフォメーションシステムズ	1,700	2,709.00	4,605,300	

プレステージ・インターナショナル	4,700	861.00	4,046,700	
フェイス	2,400	1,074.00	2,577,600	
アミューズ	2,400	1,818.00	4,363,200	
野村総合研究所	39,500	3,460.00	136,670,000	
ドリームインキュベータ	24	156,300.00	3,751,200	
サイバネットシステム	6,800	369.00	2,509,200	
T A C	4,800	369.00	1,771,200	
ケネディクス	74,700	360.00	26,892,000	
電通	69,700	3,815.00	265,905,500	
インテージホールディングス	4,400	1,346.00	5,922,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,100	2,102.00	6,516,200	
ぴあ	2,200	1,874.00	4,122,800	
イオンファンタジー	2,500	1,455.00	3,637,500	
ソースネクスト	3,400	662.00	2,250,800	
ネクシィーズ	2,400	1,040.00	2,496,000	
メディカルシステムネットワーク	5,200	456.00	2,371,200	
日本精化	6,300	624.00	3,931,200	
A D E K A	31,600	1,109.00	35,044,400	
日油	60,000	680.00	40,800,000	
ミヨシ油脂	26,000	140.00	3,640,000	
新日本理化	3,100	240.00	744,000	
ハリマ化成グループ	6,400	469.00	3,001,600	
花王	191,900	3,339.00	640,754,100	
第一工業製薬	14,000	319.00	4,466,000	
三洋化成工業	24,000	679.00	16,296,000	
武田薬品工業	276,400	4,780.00	1,321,192,000	
アステラス製薬	170,000	6,150.00	1,045,500,000	
大日本住友製薬	52,200	1,707.00	89,105,400	
塩野義製薬	115,800	2,034.00	235,537,200	
田辺三菱製薬	61,300	1,489.00	91,275,700	
わかもと製薬	9,000	275.00	2,475,000	
あすか製薬	9,000	890.00	8,010,000	
日本新薬	16,000	1,957.00	31,312,000	
ビオフェルミン製薬	400	2,782.00	1,112,800	
中外製薬	73,800	2,349.00	173,356,200	
科研製薬	27,000	1,564.00	42,228,000	
エーザイ	90,800	3,860.00	350,488,000	
ロート製薬	30,900	1,660.00	51,294,000	
小野薬品工業	33,500	9,450.00	316,575,000	
久光製薬	22,900	4,550.00	104,195,000	
有機合成薬品工業	5,000	270.00	1,350,000	
持田製薬	5,400	6,620.00	35,748,000	
参天製薬	26,500	4,595.00	121,767,500	
扶桑薬品工業	27,000	331.00	8,937,000	
日本ケミファ	11,000	550.00	6,050,000	
ツムラ	21,200	2,675.00	56,710,000	
日医工	16,800	1,538.00	25,838,400	
テルモ	54,000	4,255.00	229,770,000	
みらかホールディングス	19,300	4,655.00	89,841,500	
キッセイ薬品工業	13,600	2,627.00	35,727,200	
生化学工業	15,000	1,371.00	20,565,000	
栄研化学	5,500	1,756.00	9,658,000	
日水製薬	3,000	1,070.00	3,210,000	

鳥居薬品	4,700	3,240.00	15,228,000	
J C Rファーマ	4,000	2,410.00	9,640,000	
東和薬品	4,000	4,975.00	19,900,000	
富士製薬工業	2,200	1,870.00	4,114,000	
沢井製薬	11,500	6,230.00	71,645,000	
ゼリア新薬工業	11,600	2,536.00	29,417,600	
第一三共	232,600	1,683.00	391,465,800	
キョーリン製薬ホールディングス	19,700	2,147.00	42,295,900	
大幸薬品	3,600	2,245.00	8,082,000	
ダイト	2,500	1,500.00	3,750,000	
大塚ホールディングス	146,400	3,067.00	449,008,800	
大正製薬ホールディングス	17,800	7,410.00	131,898,000	
大日本塗料	46,000	159.00	7,314,000	
日本ペイント	64,000	1,497.00	95,808,000	
関西ペイント	87,000	1,310.00	113,970,000	
神東塗料	2,000	216.00	432,000	
中国塗料	21,000	557.00	11,697,000	
日本特殊塗料	5,800	721.00	4,181,800	
藤倉化成	8,900	606.00	5,393,400	
太陽ホールディングス	6,000	3,335.00	20,010,000	
D I C	265,000	281.00	74,465,000	
サカタイクス	16,000	918.00	14,688,000	
東洋インキ S Cホールディングス	66,000	471.00	31,086,000	
T & K T O K A	2,700	2,170.00	5,859,000	
アルプス技研	3,200	955.00	3,056,000	
サニックス	11,300	852.00	9,627,600	
ダイオーズ	1,700	857.00	1,456,900	
日本空調サービス	2,100	1,204.00	2,528,400	
オリエンタルランド	19,900	15,265.00	303,773,500	
ダスキン	19,900	1,897.00	37,750,300	
パーク 2 4	36,800	2,086.00	76,764,800	
明光ネットワークジャパン	8,000	1,114.00	8,912,000	
ファルコ S Dホールディングス	4,100	1,308.00	5,362,800	
クレスコ	2,100	1,048.00	2,200,800	
フジ・メディア・ホールディングス	67,500	1,752.00	118,260,000	
秀英予備校	1,600	326.00	521,600	
田谷	1,400	740.00	1,036,000	
ラウンドワン	21,300	772.00	16,443,600	
リゾートトラスト	24,900	1,691.00	42,105,900	
オービック	23,900	3,195.00	76,360,500	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	1,600	803.00	1,284,800	
ヤフー	503,200	611.00	307,455,200	
ピー・エム・エル	4,600	3,510.00	16,146,000	
ワタベウェディング	2,500	650.00	1,625,000	
トレンドマイクロ	30,700	3,310.00	101,617,000	
もしもしホットライン	12,900	968.00	12,487,200	
リソー教育	9,000	313.00	2,817,000	
日本オラクル	11,100	4,340.00	48,174,000	
早稲田アカデミー	900	799.00	719,100	
アルファシステムズ	2,400	1,375.00	3,300,000	
フューチャーアーキテクト	8,700	600.00	5,220,000	
シーエーシー	4,400	949.00	4,175,600	
ソフトバンク・テクノロジー	1,700	1,355.00	2,303,500	

トーセ	1,900	755.00	1,434,500	
ユー・エス・エス	86,100	1,408.00	121,228,800	
オービックビジネスコンサルタント	3,600	3,510.00	12,636,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	8,000	4,595.00	36,760,000	
アイティフォー	8,300	458.00	3,801,400	
東京個別指導学院	3,700	371.00	1,372,700	
東計電算	1,400	1,411.00	1,975,400	
楽天	238,300	1,466.00	349,347,800	
エクスネット	800	1,351.00	1,080,800	
テー・オー・ダブリュー	2,700	676.00	1,825,200	
大塚商会	6,300	12,600.00	79,380,000	
総合メディカル	1,800	3,830.00	6,894,000	
サイボウズ	11,900	354.00	4,212,600	
ソフトブレーン	10,000	134.00	1,340,000	
アグレックス	1,800	1,041.00	1,873,800	
セントラルスポーツ	2,300	1,501.00	3,452,300	
パラカ	600	714.00	428,400	
電通国際情報サービス	4,600	1,045.00	4,807,000	
E Mシステムズ	1,100	2,303.00	2,533,300	
ウェザーニューズ	1,900	2,570.00	4,883,000	
C I J	6,800	403.00	2,740,400	
WOWOW	2,300	3,380.00	7,774,000	
フルキャストホールディングス	6,800	334.00	2,271,200	
富士フイルムホールディングス	168,900	2,873.00	485,249,700	
コニカミノルタ	187,000	1,045.00	195,415,000	
資生堂	131,900	1,711.00	225,680,900	
ライオン	86,000	543.00	46,698,000	
高砂香料工業	26,000	574.00	14,924,000	
マダム	7,500	3,505.00	26,287,500	
ミルボン	4,500	3,405.00	15,322,500	
ファンケル	17,400	1,188.00	20,671,200	
コーセー	12,300	3,190.00	39,237,000	
ドクターシーラボ	5,300	3,025.00	16,032,500	
シーボン	600	2,345.00	1,407,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,500	3,835.00	28,762,500	
ノエビアホールディングス	5,400	1,790.00	9,666,000	
アジュバンコスメジャパン	800	959.00	767,200	
エステー	4,700	986.00	4,634,200	
コニシ	5,600	1,786.00	10,001,600	
長谷川香料	9,900	1,468.00	14,533,200	
星光PMC	4,000	877.00	3,508,000	
小林製薬	11,700	5,540.00	64,818,000	
荒川化学工業	6,000	897.00	5,382,000	
メック	6,200	946.00	5,865,200	
日本高純度化学	20	219,100.00	4,382,000	
J C U	1,100	5,720.00	6,292,000	
新田ゼラチン	4,100	937.00	3,841,700	
アース製薬	5,600	3,410.00	19,096,000	
イハラケミカル工業	12,000	728.00	8,736,000	
北興化学工業	7,000	327.00	2,289,000	
大成ラミック	2,200	2,604.00	5,728,800	
クミアイ化学工業	16,000	559.00	8,944,000	
日本農薬	17,000	1,451.00	24,667,000	

昭和シェル石油	66,800	960.00	64,128,000	
コスモ石油	204,000	197.00	40,188,000	
富士興産	2,400	690.00	1,656,000	
ニチレキ	9,000	1,085.00	9,765,000	
東燃ゼネラル石油	111,000	892.00	99,012,000	
ユシロ化学工業	4,100	1,018.00	4,173,800	
ビービー・カストロール	4,000	503.00	2,012,000	
富士石油	18,600	308.00	5,728,800	
MORESCO	1,400	1,687.00	2,361,800	
出光興産	35,000	2,155.00	75,425,000	
JXホールディングス	818,800	505.00	413,494,000	
横浜ゴム	82,000	926.00	75,932,000	
東洋ゴム工業	61,000	698.00	42,578,000	
ブリヂストン	231,300	3,581.00	828,285,300	
住友ゴム工業	57,500	1,292.00	74,290,000	
藤倉ゴム工業	4,000	1,069.00	4,276,000	
オカモト	28,000	340.00	9,520,000	
アキレス	60,000	136.00	8,160,000	
フコク	3,300	1,001.00	3,303,300	
ニッタ	7,700	2,284.00	17,586,800	
クリエートメディック	2,500	897.00	2,242,500	
東海ゴム工業	14,400	988.00	14,227,200	
三ツ星ベルト	20,000	549.00	10,980,000	
バンドー化学	27,000	393.00	10,611,000	
鬼怒川ゴム工業	14,000	446.00	6,244,000	
旭硝子	365,000	546.00	199,290,000	
日本板硝子	353,000	127.00	44,831,000	
石塚硝子	10,000	313.00	3,130,000	
有沢製作所	12,000	592.00	7,104,000	
日本山村硝子	32,000	168.00	5,376,000	
日本電気硝子	153,000	446.00	68,238,000	
オハラ	3,400	591.00	2,009,400	
住友大阪セメント	137,000	389.00	53,293,000	
太平洋セメント	425,000	373.00	158,525,000	
デイ・シイ	7,700	546.00	4,204,200	
リゾートソリューション	8,000	240.00	1,920,000	
日本ヒューム	7,000	824.00	5,768,000	
日本コンクリート工業	13,000	408.00	5,304,000	
三谷セキサン	1,600	1,279.00	2,046,400	
ジャパンパイル	5,400	896.00	4,838,400	
東海カーボン	68,000	305.00	20,740,000	
日本カーボン	42,000	187.00	7,854,000	
東洋炭素	4,200	2,037.00	8,555,400	
ノリタケカンパニーリミテド	40,000	246.00	9,840,000	
TOTO	109,000	1,461.00	159,249,000	
日本碍子	93,000	2,048.00	190,464,000	
日本特殊陶業	64,000	2,271.00	145,344,000	
ダントーホールディングス	9,000	119.00	1,071,000	
MARUWA	1,700	3,670.00	6,239,000	
品川リフラクトリーズ	20,000	215.00	4,300,000	
黒崎播磨	16,000	230.00	3,680,000	
ヨータイ	2,000	300.00	600,000	
イソライト工業	1,000	183.00	183,000	

東京窯業	10,000	211.00	2,110,000	
ニッカトー	3,100	405.00	1,255,500	
フジインコーポレーテッド	6,900	1,102.00	7,603,800	
エーアンドエーマテリアル	15,000	124.00	1,860,000	
ニチアス	35,000	683.00	23,905,000	
新日鐵住金	3,119,000	298.00	929,462,000	
神戸製鋼所	1,170,000	141.00	164,970,000	
中山製鋼所	40,000	83.00	3,320,000	
合同製鐵	37,000	166.00	6,142,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	188,200	2,059.00	387,503,800	
日新製鋼ホールディングス	31,100	978.00	30,415,800	
東京製鐵	40,500	475.00	19,237,500	
共英製鋼	7,200	2,048.00	14,745,600	
大和工業	15,500	3,015.00	46,732,500	
東京鐵鋼	15,000	386.00	5,790,000	
大阪製鐵	4,000	1,776.00	7,104,000	
淀川製鋼所	55,000	425.00	23,375,000	
東洋鋼鈹	16,000	502.00	8,032,000	
丸一鋼管	25,000	2,693.00	67,325,000	
モリ工業	12,000	396.00	4,752,000	
大同特殊鋼	120,000	471.00	56,520,000	
日本高周波鋼業	34,000	99.00	3,366,000	
日本冶金工業	57,000	255.00	14,535,000	
山陽特殊製鋼	39,000	425.00	16,575,000	
愛知製鋼	41,000	419.00	17,179,000	
日立金属	65,000	1,508.00	98,020,000	
日本金属	19,000	124.00	2,356,000	
大平洋金属	50,000	326.00	16,300,000	
日本電工	32,000	276.00	8,832,000	
栗本鐵工所	35,000	245.00	8,575,000	
虹技	3,000	189.00	567,000	
日本鑄鉄管	9,000	215.00	1,935,000	
日本製鋼所	105,000	494.00	51,870,000	
三菱製鋼	47,000	234.00	10,998,000	
日亜鋼業	11,000	341.00	3,751,000	
日本精線	5,000	422.00	2,110,000	
大紀アルミニウム工業所	13,000	237.00	3,081,000	
日本輕金属ホールディングス	164,600	139.00	22,879,400	
三井金属鉱業	190,000	263.00	49,970,000	
東邦亜鉛	44,000	321.00	14,124,000	
三菱マテリアル	452,000	322.00	145,544,000	
住友金属鉱山	191,000	1,370.00	261,670,000	
DOWAホールディングス	82,000	863.00	70,766,000	
古河機械金属	129,000	181.00	23,349,000	
エス・サイエンス	8,900	53.00	471,700	
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,700	1,539.00	11,850,300	
東邦チタニウム	12,900	632.00	8,152,800	
UACJ	91,000	394.00	35,854,000	
古河電気工業	235,000	265.00	62,275,000	
住友電気工業	277,900	1,523.00	423,241,700	
フジクラ	120,000	465.00	55,800,000	
昭和電線ホールディングス	98,000	101.00	9,898,000	
東京特殊電線	14,000	148.00	2,072,000	

タツタ電線	10,900	616.00	6,714,400	
沖電線	9,000	174.00	1,566,000	
カナレ電気	1,000	1,437.00	1,437,000	
平河ヒューテック	1,700	811.00	1,378,700	
リョービ	43,000	352.00	15,136,000	
アサヒホールディングス	11,000	1,704.00	18,744,000	
東洋製罐グループホールディングス	52,400	1,787.00	93,638,800	
ホッカンホールディングス	19,000	292.00	5,548,000	
コロナ	3,500	1,067.00	3,734,500	
横河ブリッジホールディングス	14,000	1,306.00	18,284,000	
日本橋梁	6,400	172.00	1,100,800	
駒井ハルテック	16,000	302.00	4,832,000	
高田機工	6,000	201.00	1,206,000	
三和ホールディングス	62,000	690.00	42,780,000	
文化シャッター	17,000	604.00	10,268,000	
三協立山	9,000	2,260.00	20,340,000	
東洋シャッター	2,700	596.00	1,609,200	
LIXILグループ	103,200	2,896.00	298,867,200	
日本フィルコン	4,900	425.00	2,082,500	
ノーリツ	14,400	2,072.00	29,836,800	
長府製作所	7,500	2,338.00	17,535,000	
リンナイ	11,400	8,260.00	94,164,000	
ユニプレス	11,600	1,743.00	20,218,800	
ダイニチ工業	3,800	699.00	2,656,200	
日東精工	10,000	335.00	3,350,000	
三洋工業	11,000	177.00	1,947,000	
岡部	15,400	1,301.00	20,035,400	
中国工業	1,300	750.00	975,000	
東プレ	15,000	1,235.00	18,525,000	
高周波熱錬	10,700	716.00	7,661,200	
東京製綱	54,000	162.00	8,748,000	
サンコール	2,000	643.00	1,286,000	
モリテック スチール	1,300	294.00	382,200	
パイオラックス	3,300	3,595.00	11,863,500	
日本発條	56,100	1,039.00	58,287,900	
中央発條	11,000	300.00	3,300,000	
アドバネクス	14,000	140.00	1,960,000	
三浦工業	11,400	2,634.00	30,027,600	
タクマ	23,000	884.00	20,332,000	
リブセンス	3,200	1,618.00	5,177,600	
ジャパンマテリアル	500	2,156.00	1,078,000	
E R Iホールディングス	1,500	1,155.00	1,732,500	
ツガミ	21,000	568.00	11,928,000	
オークマ	48,000	906.00	43,488,000	
東芝機械	39,000	495.00	19,305,000	
アマダ	113,000	810.00	91,530,000	
アイダエンジニアリング	18,300	1,095.00	20,038,500	
滝澤鉄工所	22,000	149.00	3,278,000	
富士機械製造	20,700	863.00	17,864,100	
牧野フライス製作所	36,000	832.00	29,952,000	
オーエスジー	30,700	1,813.00	55,659,100	
ダイジェット工業	11,000	148.00	1,628,000	
旭ダイヤモンド工業	18,700	1,161.00	21,710,700	

D M G 森精機	39,400	1,605.00	63,237,000	
ディスコ	8,300	6,590.00	54,697,000	
日東工器	4,700	1,849.00	8,690,300	
豊田自動織機	64,100	4,695.00	300,949,500	
豊和工業	4,300	756.00	3,250,800	
大阪機工	30,000	133.00	3,990,000	
石川製作所	20,000	109.00	2,180,000	
東洋機械金属	5,400	596.00	3,218,400	
津田駒工業	21,000	158.00	3,318,000	
エンシュウ	21,000	133.00	2,793,000	
島精機製作所	10,200	1,687.00	17,207,400	
日阪製作所	10,000	915.00	9,150,000	
やまびこ	3,000	3,470.00	10,410,000	
ペガサスミシン製造	8,000	392.00	3,136,000	
ナプテスコ	33,800	2,401.00	81,153,800	
三井海洋開発	6,500	2,532.00	16,458,000	
レオン自動機	8,000	531.00	4,248,000	
S M C	21,100	24,610.00	519,271,000	
新川	6,400	540.00	3,456,000	
ホソカワミクロン	13,000	604.00	7,852,000	
ユニオンツール	3,300	2,375.00	7,837,500	
オイレス工業	7,100	2,238.00	15,889,800	
日精エー・エス・ビー機械	2,000	2,132.00	4,264,000	
サトーホールディングス	8,200	2,418.00	19,827,600	
日本エアーテック	2,800	491.00	1,374,800	
日精樹脂工業	5,600	590.00	3,304,000	
ワイエイシー	3,100	566.00	1,754,600	
小松製作所	344,100	2,058.00	708,157,800	
住友重機械工業	202,000	468.00	94,536,000	
日立建機	38,100	1,940.00	73,914,000	
日工	11,000	529.00	5,819,000	
巴工業	2,600	1,609.00	4,183,400	
井関農機	75,000	281.00	21,075,000	
T O W A	6,800	481.00	3,270,800	
丸山製作所	16,000	241.00	3,856,000	
北川鉄工所	34,000	180.00	6,120,000	
シンニッタン	6,900	379.00	2,615,100	
クボタ	385,000	1,404.00	540,540,000	
荏原実業	1,800	1,353.00	2,435,400	
東洋エンジニアリング	42,000	470.00	19,740,000	
三菱化工機	23,000	164.00	3,772,000	
月島機械	12,000	1,073.00	12,876,000	
帝国電機製作所	2,500	3,080.00	7,700,000	
東京機械製作所	26,000	96.00	2,496,000	
新東工業	15,600	717.00	11,185,200	
澁谷工業	4,800	2,025.00	9,720,000	
アイチ コーポレーション	10,200	430.00	4,386,000	
小森コーポレーション	17,900	1,313.00	23,502,700	
鶴見製作所	6,000	1,299.00	7,794,000	
住友精密工業	12,000	394.00	4,728,000	
酒井重工業	15,000	387.00	5,805,000	
荏原製作所	159,000	696.00	110,664,000	
石井鐵工所	11,000	260.00	2,860,000	

西島製作所	7,800	1,122.00	8,751,600	
千代田化工建設	60,000	1,506.00	90,360,000	
ダイキン工業	96,200	5,635.00	542,087,000	
オルガノ	13,000	465.00	6,045,000	
トーヨーカネツ	41,000	285.00	11,685,000	
栗田工業	44,500	2,098.00	93,361,000	
椿本チエイン	38,000	811.00	30,818,000	
大同工業	15,000	281.00	4,215,000	
日本コンベヤ	26,000	133.00	3,458,000	
日機装	23,000	1,279.00	29,417,000	
木村化工機	7,000	489.00	3,423,000	
新興ブランテック	17,200	774.00	13,312,800	
アネスト岩田	12,000	609.00	7,308,000	
ダイフク	30,500	1,359.00	41,449,500	
加藤製作所	18,000	651.00	11,718,000	
油研工業	16,000	225.00	3,600,000	
タダノ	32,000	1,322.00	42,304,000	
フジテック	21,000	1,259.00	26,439,000	
C K D	20,900	959.00	20,043,100	
キトー	4,100	1,881.00	7,712,100	
平和	15,900	1,700.00	27,030,000	
理想科学工業	4,800	2,177.00	10,449,600	
S A N K Y O	21,400	4,060.00	86,884,000	
日本金銭機械	6,800	1,714.00	11,655,200	
マースエンジニアリング	4,100	1,821.00	7,466,100	
福島工業	4,200	1,438.00	6,039,600	
オーイズミ	2,900	948.00	2,749,200	
ダイコク電機	3,000	2,405.00	7,215,000	
アマノ	20,000	1,036.00	20,720,000	
J U K I	47,000	218.00	10,246,000	
サンデン	42,000	519.00	21,798,000	
蛇の目マシン工業	74,000	82.00	6,068,000	
ブラザー工業	91,400	1,374.00	125,583,600	
マックス	11,000	1,147.00	12,617,000	
モリタホールディングス	13,000	808.00	10,504,000	
グローリー	21,300	2,577.00	54,890,100	
新晃工業	1,800	764.00	1,375,200	
大和冷機工業	12,000	669.00	8,028,000	
セガサミーホールディングス	76,100	2,209.00	168,104,900	
日本ピストンリング	27,000	190.00	5,130,000	
リケン	27,000	458.00	12,366,000	
T P R	8,300	1,606.00	13,329,800	
ホンザキ電機	15,600	3,600.00	56,160,000	
大豊工業	5,500	999.00	5,494,500	
日本精工	157,000	1,109.00	174,113,000	
N T N	159,000	368.00	58,512,000	
ジェイテクト	75,200	1,502.00	112,950,400	
不二越	66,000	579.00	38,214,000	
ミネベア	97,000	842.00	81,674,000	
日本トムソン	23,000	515.00	11,845,000	
T H K	43,900	2,318.00	101,760,200	
ユーシン精機	3,100	2,428.00	7,526,800	
前澤給装工業	2,800	1,282.00	3,589,600	

イーグル工業	9,000	1,523.00	13,707,000	
前澤工業	6,300	321.00	2,022,300	
日本ピラー工業	8,000	710.00	5,680,000	
キッツ	30,700	482.00	14,797,400	
日立製作所	1,692,000	787.00	1,331,604,000	
東芝	1,391,000	433.00	602,303,000	
三菱電機	705,000	1,161.00	818,505,000	
富士電機	198,000	432.00	85,536,000	
東洋電機製造	14,000	337.00	4,718,000	
安川電機	78,000	1,449.00	113,022,000	
シンフォニアテクノロジー	46,000	160.00	7,360,000	
明電舎	66,000	402.00	26,532,000	
オリジン電気	11,000	311.00	3,421,000	
山洋電気	11,000	632.00	6,952,000	
デンヨー	7,600	1,504.00	11,430,400	
日立工機	20,000	746.00	14,920,000	
三櫻工業	9,700	671.00	6,508,700	
マキタ	45,900	5,640.00	258,876,000	
東芝テック	44,000	636.00	27,984,000	
芝浦メカトロニクス	13,000	231.00	3,003,000	
マブチモーター	10,100	6,070.00	61,307,000	
日本電産	38,100	11,930.00	454,533,000	
東光高岳ホールディングス	3,900	1,611.00	6,282,900	
宮越ホールディングス	2,900	265.00	768,500	
ダイヘン	41,000	419.00	17,179,000	
ヤーマン	900	1,389.00	1,250,100	
JVCケンウッド	46,800	216.00	10,108,800	
第一精工	2,600	1,251.00	3,252,600	
日新電機	15,000	512.00	7,680,000	
大崎電気工業	10,000	569.00	5,690,000	
オムロン	79,500	4,140.00	329,130,000	
日東工業	11,000	2,005.00	22,055,000	
I D E C	10,100	886.00	8,948,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	137,000	575.00	78,775,000	
サクサホールディングス	21,000	152.00	3,192,000	
メルコホールディングス	3,400	1,584.00	5,385,600	
テクノメディカ	1,800	2,112.00	3,801,600	
日本電気	973,000	305.00	296,765,000	
富士通	679,000	632.00	429,128,000	
沖電気工業	269,000	227.00	61,063,000	
岩崎通信機	31,000	92.00	2,852,000	
電気興業	20,000	676.00	13,520,000	
サンケン電気	38,000	690.00	26,220,000	
ナカヨ通信機	7,000	320.00	2,240,000	
アイホン	4,400	1,481.00	6,516,400	
ルネサスエレクトロニクス	37,400	654.00	24,459,600	
セイコーエプソン	48,300	2,885.00	139,345,500	
ワコム	54,400	610.00	33,184,000	
アルバック	12,300	1,988.00	24,452,400	
アクセル	3,900	1,658.00	6,466,200	
ピクセラ	4,200	140.00	588,000	
E I Z O	6,300	2,692.00	16,959,600	
日本信号	18,800	907.00	17,051,600	

京三製作所	16,000	327.00	5,232,000	
能美防災	10,000	1,079.00	10,790,000	
ホーチキ	7,000	545.00	3,815,000	
エレコム	2,600	1,469.00	3,819,400	
日本無線	16,000	321.00	5,136,000	
パナソニック	805,000	1,126.00	906,430,000	
シャープ	510,000	321.00	163,710,000	
アンリツ	39,700	1,138.00	45,178,600	
富士通ゼネラル	17,000	1,099.00	18,683,000	
日立国際電気	14,000	1,305.00	18,270,000	
ソニー	386,300	1,741.00	672,548,300	
T D K	41,700	4,285.00	178,684,500	
帝国通信工業	18,000	169.00	3,042,000	
ミツミ電機	26,600	740.00	19,684,000	
タムラ製作所	30,000	272.00	8,160,000	
アルプス電気	52,300	1,285.00	67,205,500	
池上通信機	23,000	102.00	2,346,000	
パイオニア	90,800	222.00	20,157,600	
日本電波工業	6,400	851.00	5,446,400	
日本トリム	1,500	6,460.00	9,690,000	
ローランド ディー . ジー .	3,400	3,515.00	11,951,000	
日本コロムビア	3,500	711.00	2,488,500	
フォスター電機	7,600	1,701.00	12,927,600	
クラリオン	39,000	139.00	5,421,000	
S M K	22,000	474.00	10,428,000	
ヨコオ	6,500	551.00	3,581,500	
東光	35,000	383.00	13,405,000	
ティアック	45,000	76.00	3,420,000	
ホシデン	20,100	486.00	9,768,600	
ヒロセ電機	12,300	14,710.00	180,933,000	
日本航空電子工業	17,000	1,506.00	25,602,000	
T O A	8,000	946.00	7,568,000	
古野電気	2,400	700.00	1,680,000	
ユニデン	22,000	270.00	5,940,000	
アルパイン	14,600	1,421.00	20,746,600	
スミダコーポレーション	6,100	510.00	3,111,000	
アイコム	4,100	2,287.00	9,376,700	
リオン	1,800	1,465.00	2,637,000	
船井電機	7,800	1,109.00	8,650,200	
横河電機	74,100	1,464.00	108,482,400	
新電元工業	24,000	512.00	12,288,000	
アズビル	20,700	2,420.00	50,094,000	
東亜ディーケーケー	1,900	457.00	868,300	
日本光電工業	14,700	4,105.00	60,343,500	
チノー	15,000	224.00	3,360,000	
共和電業	8,000	428.00	3,424,000	
日本電子材料	4,100	429.00	1,758,900	
堀場製作所	13,100	3,900.00	51,090,000	
アドバンテスト	48,600	1,086.00	52,779,600	
小野測器	8,000	454.00	3,632,000	
エスベック	7,900	810.00	6,399,000	
パナソニック デバイス S U N X	7,300	457.00	3,336,100	
キーエンス	16,000	42,365.00	677,840,000	

日置電機	4,000	1,387.00	5,548,000	
シスメックス	29,500	5,560.00	164,020,000	
メガチップス	6,300	1,244.00	7,837,200	
O B A R A G R O U P	4,800	3,740.00	17,952,000	
日本電産コバル電子	7,500	738.00	5,535,000	
澤藤電機	6,000	215.00	1,290,000	
デンソー	174,100	5,390.00	938,399,000	
コーセル	10,800	1,134.00	12,247,200	
新日本無線	5,000	336.00	1,680,000	
オブテックス	4,900	1,561.00	7,648,900	
千代田インテグレ	3,200	1,791.00	5,731,200	
レーザーテック	5,500	1,039.00	5,714,500	
スタンレー電気	50,700	2,244.00	113,770,800	
岩崎電気	27,000	238.00	6,426,000	
ウシオ電機	43,300	1,245.00	53,908,500	
岡谷電機産業	5,000	379.00	1,895,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	5,800	318.00	1,844,400	
日本セラミック	4,200	1,675.00	7,035,000	
遠藤照明	1,300	2,051.00	2,666,300	
日本デジタル研究所	5,300	1,390.00	7,367,000	
古河電池	5,000	697.00	3,485,000	
双信電機	4,500	382.00	1,719,000	
山一電機	7,500	508.00	3,810,000	
図研	4,200	791.00	3,322,200	
日本電子	25,000	401.00	10,025,000	
カシオ計算機	70,500	1,124.00	79,242,000	
ファナック	78,600	16,625.00	1,306,725,000	
日本シイエムケイ	15,800	253.00	3,997,400	
エンプラス	2,700	6,070.00	16,389,000	
大真空	4,000	398.00	1,592,000	
ローム	37,400	5,140.00	192,236,000	
浜松ホトニクス	27,600	4,165.00	114,954,000	
三井ハイテック	9,100	662.00	6,024,200	
新光電気工業	23,500	740.00	17,390,000	
京セラ	125,600	4,495.00	564,572,000	
協栄産業	10,000	177.00	1,770,000	
太陽誘電	34,700	1,276.00	44,277,200	
村田製作所	73,900	9,363.00	691,925,700	
ユーシン	10,700	645.00	6,901,500	
双葉電子工業	13,800	1,251.00	17,263,800	
日東電工	61,100	4,460.00	272,506,000	
北陸電気工業	29,000	141.00	4,089,000	
東海理化電機製作所	17,300	1,840.00	31,832,000	
ニチコン	22,100	847.00	18,718,700	
日本ケミコン	43,000	327.00	14,061,000	
K O A	9,700	1,099.00	10,660,300	
三井造船	276,000	197.00	54,372,000	
日立造船	53,300	584.00	31,127,200	
佐世保重工業	48,000	137.00	6,576,000	
三菱重工業	1,255,000	610.00	765,550,000	
川崎重工業	551,000	411.00	226,461,000	
I H I	484,000	453.00	219,252,000	
名村造船所	4,400	1,135.00	4,994,000	

サノヤホールディングス	2,300	234.00	538,200	
日本車輛製造	27,000	474.00	12,798,000	
ニチユ三菱フォークリフト	10,000	719.00	7,190,000	
近畿車輛	13,000	322.00	4,186,000	
F P G	4,900	846.00	4,145,400	
島根銀行	1,900	1,301.00	2,471,900	
じもとホールディングス	52,400	189.00	9,903,600	
全国保証	7,500	4,210.00	31,575,000	
足利ホールディングス	26,000	486.00	12,636,000	
日産自動車	989,100	909.00	899,091,900	
いすゞ自動車	410,000	622.00	255,020,000	
トヨタ自動車	980,800	5,860.00	5,747,488,000	
日野自動車	88,400	1,481.00	130,920,400	
三菱自動車工業	220,600	1,091.00	240,674,600	
エフテック	2,500	1,323.00	3,307,500	
G M B	300	1,350.00	405,000	
武蔵精密工業	8,000	1,919.00	15,352,000	
日産車体	35,000	1,369.00	47,915,000	
新明和工業	28,000	833.00	23,324,000	
極東開発工業	12,300	1,307.00	16,076,100	
日信工業	14,300	1,981.00	28,328,300	
トビー工業	55,000	174.00	9,570,000	
ティラド	26,000	286.00	7,436,000	
曙ブレーキ工業	34,700	460.00	15,962,000	
タチエス	10,000	1,416.00	14,160,000	
N O K	34,500	1,705.00	58,822,500	
フタバ産業	22,200	438.00	9,723,600	
カヤバ工業	56,000	484.00	27,104,000	
シロキ工業	16,000	218.00	3,488,000	
市光工業	18,000	138.00	2,484,000	
大同メタル工業	10,000	981.00	9,810,000	
プレス工業	28,000	404.00	11,312,000	
カルソニックカンセイ	50,000	540.00	27,000,000	
太平洋工業	15,100	642.00	9,694,200	
ケーヒン	15,500	1,560.00	24,180,000	
河西工業	9,000	694.00	6,246,000	
アイシン精機	64,400	3,525.00	227,010,000	
富士機工	8,000	331.00	2,648,000	
マツダ	1,050,000	479.00	502,950,000	
ダイハツ工業	75,100	1,629.00	122,337,900	
今仙電機製作所	5,700	1,340.00	7,638,000	
本田技研工業	634,200	3,652.00	2,316,098,400	
スズキ	147,300	2,587.00	381,065,100	
富士重工業	239,800	2,697.00	646,740,600	
ヤマハ発動機	107,600	1,482.00	159,463,200	
ショーワ	16,600	1,286.00	21,347,600	
小糸製作所	37,000	1,843.00	68,191,000	
T B K	8,000	525.00	4,200,000	
エクセディ	8,700	3,020.00	26,274,000	
ミツバ	13,500	1,675.00	22,612,500	
豊田合成	20,900	2,159.00	45,123,100	
愛三工業	8,000	839.00	6,712,000	
ヨロズ	5,400	2,084.00	11,253,600	

エフ・シー・シー	11,500	1,806.00	20,769,000	
新家工業	19,000	149.00	2,831,000	
シマノ	30,400	8,430.00	256,272,000	
タカタ	12,900	3,015.00	38,893,500	
テイ・エス テック	15,100	3,295.00	49,754,500	
小野建	6,600	1,275.00	8,415,000	
はるやま商事	2,900	780.00	2,262,000	
佐島電機	6,000	605.00	3,630,000	
カッパ・クリエイトホールディングス	5,300	1,976.00	10,472,800	
エコートレーディング	1,700	720.00	1,224,000	
伯東	4,400	967.00	4,254,800	
コンドーテック	5,800	691.00	4,007,800	
中山福	4,700	840.00	3,948,000	
ライトオン	5,600	672.00	3,763,200	
ナガイレーベン	9,700	1,765.00	17,120,500	
ジーンズメイト	2,600	234.00	608,400	
三菱食品	8,100	2,190.00	17,739,000	
良品計画	7,500	9,570.00	71,775,000	
三城ホールディングス	8,900	471.00	4,191,900	
松田産業	5,500	1,271.00	6,990,500	
メディカルホールディングス	69,800	1,530.00	106,794,000	
アドヴァン	3,700	1,127.00	4,169,900	
S P K	1,900	1,794.00	3,408,600	
アズワン	4,800	2,469.00	11,851,200	
スズデン	2,900	595.00	1,725,500	
尾家産業	2,600	812.00	2,111,200	
シモジマ	4,400	1,001.00	4,404,400	
ドウシシャ	7,700	1,426.00	10,980,200	
コナカ	9,700	764.00	7,410,800	
高速	4,300	882.00	3,792,600	
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,400.00	1,400,000	
G - 7ホールディングス	2,300	734.00	1,688,200	
イオン北海道	4,400	693.00	3,049,200	
コジマ	10,500	260.00	2,730,000	
ヒマラヤ	1,600	1,047.00	1,675,200	
コーナン商事	9,600	1,043.00	10,012,800	
黒田電気	9,800	1,548.00	15,170,400	
ネットワンシステムズ	26,900	661.00	17,780,900	
エコス	2,300	680.00	1,564,000	
ワタミ	8,700	1,522.00	13,241,400	
マルシェ	1,600	832.00	1,331,200	
ドンキホーテホールディングス	23,700	5,830.00	138,171,000	
丸文	6,300	569.00	3,584,700	
西松屋チェーン	14,500	739.00	10,715,500	
ゼンショーホールディングス	26,400	1,205.00	31,812,000	
ハビネット	4,500	884.00	3,978,000	
幸楽苑	4,600	1,338.00	6,154,800	
トーマンエレクトロニクス	3,700	1,655.00	6,123,500	
ハークスレイ	1,900	792.00	1,504,800	
サイゼリヤ	10,900	1,241.00	13,526,900	
エクセル	3,100	1,163.00	3,605,300	
マルカキカイ	2,400	1,241.00	2,978,400	
アルゴグラフィックス	2,600	1,662.00	4,321,200	

ガリバーインターナショナル	24,800	746.00	18,500,800	
日本エム・ディ・エム	7,300	290.00	2,117,000	
ポブラ	1,700	541.00	919,700	
ユナイテッドアローズ	7,800	3,430.00	26,754,000	
進和	4,300	1,184.00	5,091,200	
エスケイジャパン	2,100	288.00	604,800	
ダイトエレクトロン	4,200	399.00	1,675,800	
ハイデイ日高	4,000	2,480.00	9,920,000	
シークス	4,800	1,623.00	7,790,400	
京都きもの友禅	5,000	1,052.00	5,260,000	
コロワイド	23,000	1,090.00	25,070,000	
田中商事	2,900	571.00	1,655,900	
オーハシテクニカ	3,800	877.00	3,332,600	
壺番屋	2,900	3,700.00	10,730,000	
マクニカ	3,700	2,860.00	10,582,000	
白銅	2,600	924.00	2,402,400	
トップカルチャー	2,900	458.00	1,328,200	
P L A N T	900	953.00	857,700	
スギホールディングス	11,600	3,980.00	46,168,000	
島津製作所	88,000	871.00	76,648,000	
J M S	12,000	288.00	3,456,000	
クボテック	2,000	261.00	522,000	
ショットモリテックス	1,400	273.00	382,200	
長野計器	5,100	656.00	3,345,600	
ブイ・テクノロジー	15	276,600.00	4,149,000	
スター精密	13,100	1,153.00	15,104,300	
東京計器	24,000	280.00	6,720,000	
愛知時計電機	9,000	290.00	2,610,000	
東京精密	12,600	1,878.00	23,662,800	
マニー	2,300	3,720.00	8,556,000	
ニコン	132,200	1,806.00	238,753,200	
トプコン	17,200	1,511.00	25,989,200	
オリンパス	104,900	3,225.00	338,302,500	
理研計器	5,900	873.00	5,150,700	
大日本スクリーン製造	68,000	514.00	34,952,000	
キヤノン電子	6,800	1,849.00	12,573,200	
タムロン	5,700	2,425.00	13,822,500	
HOYA	171,300	2,841.00	486,663,300	
ノーリツ鋼機	6,600	621.00	4,098,600	
エー・アンド・デイ	6,600	591.00	3,900,600	
キヤノン	408,500	3,087.00	1,261,039,500	
リコー	212,800	1,236.00	263,020,800	
シチズンホールディングス	83,500	834.00	69,639,000	
リズム時計工業	33,000	132.00	4,356,000	
大研医器	1,800	1,744.00	3,139,200	
パラマウントベッドホールディングス	6,400	3,085.00	19,744,000	
S H O - B I	2,800	405.00	1,134,000	
前田工織	5,300	1,435.00	7,605,500	
永大産業	10,000	578.00	5,780,000	
アートネイチャー	2,100	2,506.00	5,262,600	
ダンロップスポーツ	4,000	1,231.00	4,924,000	
バンダイナムコホールディングス	76,300	2,254.00	171,980,200	
共立印刷	11,100	275.00	3,052,500	

フランスベッドホールディングス	48,000	187.00	8,976,000	
マーベラスAQL	11,500	630.00	7,245,000	
パイロットコーポレーション	6,500	3,445.00	22,392,500	
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,700	1,966.00	24,968,200	
トッパン・フォームズ	13,100	855.00	11,200,500	
フジシールインターナショナル	8,600	3,570.00	30,702,000	
タカラトミー	24,400	446.00	10,882,400	
廣済堂	6,100	479.00	2,921,900	
アーク	20,400	300.00	6,120,000	
レック	2,700	1,195.00	3,226,500	
タカノ	3,000	513.00	1,539,000	
プロネクス	8,300	678.00	5,627,400	
ホクシン	6,100	148.00	902,800	
ウッドワン	13,000	316.00	4,108,000	
大建工業	31,000	255.00	7,905,000	
きもと	5,500	699.00	3,844,500	
凸版印刷	200,000	731.00	146,200,000	
大日本印刷	214,000	989.00	211,646,000	
図書印刷	12,000	437.00	5,244,000	
共同印刷	24,000	274.00	6,576,000	
日本写真印刷	11,500	1,489.00	17,123,500	
光村印刷	8,000	266.00	2,128,000	
藤森工業	6,600	2,331.00	15,384,600	
宝印刷	4,700	728.00	3,421,600	
前澤化成工業	5,400	1,022.00	5,518,800	
アシックス	69,000	1,845.00	127,305,000	
ツツミ	3,700	2,323.00	8,595,100	
JSP	5,300	1,470.00	7,791,000	
ニチハ	8,600	1,259.00	10,827,400	
ローランド	6,800	1,382.00	9,397,600	
エフピコ	3,800	5,990.00	22,762,000	
小松ウオール工業	2,900	1,960.00	5,684,000	
ヤマハ	52,500	1,330.00	69,825,000	
河合楽器製作所	25,000	172.00	4,300,000	
クリナップ	7,800	823.00	6,419,400	
ピジョン	11,100	4,495.00	49,894,500	
天馬	6,400	1,350.00	8,640,000	
兼松日産農林	13,000	166.00	2,158,000	
キングジム	6,100	676.00	4,123,600	
リンテック	16,000	1,954.00	31,264,000	
TASAKI	1,700	558.00	948,600	
信越ポリマー	15,100	356.00	5,375,600	
東リ	20,000	203.00	4,060,000	
イトーキ	16,200	617.00	9,995,400	
任天堂	43,400	12,245.00	531,433,000	
三菱鉛筆	6,100	2,369.00	14,450,900	
松風	3,700	844.00	3,122,800	
タカラスタンダード	30,000	727.00	21,810,000	
コクヨ	36,600	708.00	25,912,800	
ナカバヤシ	15,000	203.00	3,045,000	
ニフコ	16,500	2,774.00	45,771,000	
グローブライド	35,000	140.00	4,900,000	
岡村製作所	28,000	836.00	23,408,000	

日本バルカー工業	32,000	274.00	8,768,000	
MUTOHホールディングス	10,000	515.00	5,150,000	
伊藤忠商事	554,800	1,270.00	704,596,000	
丸紅	608,000	712.00	432,896,000	
スクロール	9,100	296.00	2,693,600	
高島	13,000	236.00	3,068,000	
ヨンドシーホールディングス	5,800	1,585.00	9,193,000	
三陽商会	42,000	285.00	11,970,000	
長瀬産業	39,900	1,201.00	47,919,900	
ナイガイ	30,000	83.00	2,490,000	
蝶理	4,600	1,090.00	5,014,000	
豊田通商	77,800	2,314.00	180,029,200	
オンワードホールディングス	50,000	733.00	36,650,000	
三共生興	12,300	357.00	4,391,100	
兼松	147,000	166.00	24,402,000	
美津濃	37,000	555.00	20,535,000	
ツカモトコーポレーション	13,000	141.00	1,833,000	
ファミリーマート	22,400	4,600.00	103,040,000	
ルック	13,000	260.00	3,380,000	
三井物産	640,300	1,556.00	996,306,800	
日本紙パルプ商事	38,000	316.00	12,008,000	
東京エレクトロン	63,200	5,700.00	360,240,000	
日立ハイテクノロジーズ	21,400	2,403.00	51,424,200	
カメイ	9,000	766.00	6,894,000	
東都水産	12,000	215.00	2,580,000	
OUGホールディングス	4,000	200.00	800,000	
スターゼン	25,000	273.00	6,825,000	
セイコーホールディングス	45,000	433.00	19,485,000	
山善	28,300	601.00	17,008,300	
椿本興業	9,000	287.00	2,583,000	
住友商事	410,400	1,313.00	538,855,200	
日本ユニシス	17,100	1,117.00	19,100,700	
内田洋行	17,000	274.00	4,658,000	
三菱商事	542,700	1,957.00	1,062,063,900	
第一実業	17,000	442.00	7,514,000	
キヤノンマーケティングジャパン	19,700	1,301.00	25,629,700	
西華産業	26,000	246.00	6,396,000	
佐藤商事	6,400	696.00	4,454,400	
菱洋エレクトロ	8,900	1,075.00	9,567,500	
東京産業	8,000	390.00	3,120,000	
ユアサ商事	75,000	205.00	15,375,000	
神鋼商事	18,000	202.00	3,636,000	
小林産業	1,700	290.00	493,000	
阪和興業	70,000	473.00	33,110,000	
カナデン	7,000	700.00	4,900,000	
菱電商事	11,000	719.00	7,909,000	
ニプロ	37,400	865.00	32,351,000	
フルサト工業	3,600	1,125.00	4,050,000	
岩谷産業	77,000	610.00	46,970,000	
すてきナイスグループ	30,000	210.00	6,300,000	
昭光通商	25,000	142.00	3,550,000	
二チモウ	12,000	179.00	2,148,000	
極東貿易	9,000	206.00	1,854,000	

イワキ	11,000	200.00	2,200,000	
兼松エレクトロニクス	4,800	1,340.00	6,432,000	
三愛石油	17,000	517.00	8,789,000	
稲畑産業	18,100	1,022.00	18,498,200	
G S I クレオス	19,000	146.00	2,774,000	
明和産業	6,300	349.00	2,198,700	
キムラタン	87,000	11.00	957,000	
ゴールドウイン	18,000	473.00	8,514,000	
ユニ・チャーム	45,500	5,743.00	261,306,500	
デサント	17,000	672.00	11,424,000	
キング	1,300	450.00	585,000	
ワキタ	4,000	1,144.00	4,576,000	
ヤマトインターナショナル	4,500	437.00	1,966,500	
東邦ホールディングス	22,300	1,974.00	44,020,200	
サンゲツ	12,300	2,447.00	30,098,100	
ミツウロコグループホールディングス	12,200	544.00	6,636,800	
シナネン	16,000	403.00	6,448,000	
伊藤忠エネクス	16,800	562.00	9,441,600	
サンリオ	17,800	3,910.00	69,598,000	
サンワテクノス	3,500	861.00	3,013,500	
リョーサン	10,500	2,073.00	21,766,500	
新光商事	8,300	895.00	7,428,500	
トーヨー	16,000	359.00	5,744,000	
三信電気	8,200	714.00	5,854,800	
東陽テクニカ	10,000	997.00	9,970,000	
モスフードサービス	9,000	2,083.00	18,747,000	
加賀電子	6,200	1,232.00	7,638,400	
三益半導体工業	6,800	838.00	5,698,400	
ソーダニッカ	8,000	443.00	3,544,000	
立花エレテック	4,400	1,276.00	5,614,400	
木曽路	9,000	1,839.00	16,551,000	
サトレストランシステムズ	2,300	744.00	1,711,200	
千趣会	13,100	781.00	10,231,100	
タカキュー	5,500	283.00	1,556,500	
ケーヨー	12,700	463.00	5,880,100	
アデランス	9,300	1,078.00	10,025,400	
上新電機	16,000	768.00	12,288,000	
日本瓦斯	10,100	1,060.00	10,706,000	
ベスト電器	22,600	135.00	3,051,000	
マルエツ	15,000	371.00	5,565,000	
ロイヤルホールディングス	12,300	1,398.00	17,195,400	
東天紅	5,000	199.00	995,000	
いなげや	8,500	985.00	8,372,500	
島忠	15,800	2,178.00	34,412,400	
チヨダ	8,700	2,016.00	17,539,200	
ライフコーポレーション	4,800	1,500.00	7,200,000	
カスミ	15,600	685.00	10,686,000	
リンガーハット	6,500	1,506.00	9,789,000	
さが美	5,000	100.00	500,000	
MrMax	7,000	314.00	2,198,000	
テンアライド	5,200	306.00	1,591,200	
AOKIホールディングス	12,400	1,516.00	18,798,400	
オークワ	11,000	849.00	9,339,000	

コメリ	11,200	2,416.00	27,059,200	
青山商事	17,800	2,498.00	44,464,400	
しまむら	8,200	9,030.00	74,046,000	
C F S コーポレーション	5,300	431.00	2,284,300	
はせがわ	2,100	689.00	1,446,900	
高島屋	94,000	900.00	84,600,000	
松屋	14,800	894.00	13,231,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	42,000	734.00	30,828,000	
近鉄百貨店	11,000	346.00	3,806,000	
丸栄	12,000	187.00	2,244,000	
ニッセンホールディングス	12,900	414.00	5,340,600	
パルコ	6,700	914.00	6,123,800	
丸井グループ	90,500	879.00	79,549,500	
クレディセゾン	56,800	2,247.00	127,629,600	
アクシアル リテイリング	4,200	1,531.00	6,430,200	
井筒屋	39,000	78.00	3,042,000	
ダイエー	42,600	302.00	12,865,200	
イズミヤ	28,000	462.00	12,936,000	
イオン	277,700	1,260.00	349,902,000	
ユニーグループ・ホールディングス	66,700	615.00	41,020,500	
イズミ	15,500	2,943.00	45,616,500	
東武ストア	9,000	260.00	2,340,000	
平和堂	14,000	1,391.00	19,474,000	
フジ	8,200	1,731.00	14,194,200	
ヤオコー	3,700	4,320.00	15,984,000	
ゼビオ	8,500	1,885.00	16,022,500	
ケーズホールディングス	15,100	2,942.00	44,424,200	
P a l t a c	8,500	1,340.00	11,390,000	
O l y m p i c グループ	4,200	839.00	3,523,800	
日産東京販売ホールディングス	11,000	384.00	4,224,000	
新生銀行	604,000	205.00	123,820,000	
あおぞら銀行	361,000	291.00	105,051,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,268,500	603.00	3,176,905,500	
りそなホールディングス	660,900	539.00	356,225,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,366,000	491.00	670,706,000	
三井住友フィナンシャルグループ	526,000	4,765.00	2,506,390,000	
第四銀行	89,000	350.00	31,150,000	
北越銀行	74,000	198.00	14,652,000	
西日本シティ銀行	247,000	242.00	59,774,000	
千葉銀行	269,000	607.00	163,283,000	
横浜銀行	458,000	497.00	227,626,000	
常陽銀行	260,000	478.00	124,280,000	
群馬銀行	156,000	526.00	82,056,000	
武蔵野銀行	11,100	3,120.00	34,632,000	
千葉興業銀行	13,800	645.00	8,901,000	
筑波銀行	30,100	364.00	10,956,400	
東京都民銀行	12,400	996.00	12,350,400	
七十七銀行	110,000	446.00	49,060,000	
青森銀行	54,000	265.00	14,310,000	
秋田銀行	51,000	255.00	13,005,000	
山形銀行	45,000	386.00	17,370,000	
岩手銀行	4,600	4,285.00	19,711,000	
東邦銀行	62,000	300.00	18,600,000	

東北銀行	38,000	148.00	5,624,000	
みちのく銀行	38,000	203.00	7,714,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	283,000	398.00	112,634,000	
静岡銀行	204,000	957.00	195,228,000	
十六銀行	87,000	330.00	28,710,000	
スルガ銀行	68,000	1,681.00	114,308,000	
八十二銀行	128,000	540.00	69,120,000	
山梨中央銀行	44,000	405.00	17,820,000	
大垣共立銀行	89,000	268.00	23,852,000	
福井銀行	63,000	228.00	14,364,000	
北國銀行	78,000	327.00	25,506,000	
清水銀行	2,600	2,453.00	6,377,800	
滋賀銀行	65,000	511.00	33,215,000	
南都銀行	68,000	348.00	23,664,000	
百五銀行	62,000	389.00	24,118,000	
京都銀行	130,000	780.00	101,400,000	
紀陽銀行	27,700	1,264.00	35,012,800	
三重銀行	31,000	210.00	6,510,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	473,000	190.00	89,870,000	
広島銀行	205,000	385.00	78,925,000	
山陰合同銀行	42,000	676.00	28,392,000	
中国銀行	52,400	1,256.00	65,814,400	
鳥取銀行	23,000	180.00	4,140,000	
伊予銀行	75,300	918.00	69,125,400	
百十四銀行	76,000	323.00	24,548,000	
四国銀行	53,000	213.00	11,289,000	
阿波銀行	57,000	484.00	27,588,000	
鹿児島銀行	48,000	580.00	27,840,000	
大分銀行	43,000	363.00	15,609,000	
宮崎銀行	49,000	278.00	13,622,000	
肥後銀行	57,000	505.00	28,785,000	
佐賀銀行	46,000	206.00	9,476,000	
十八銀行	46,000	213.00	9,798,000	
沖縄銀行	5,100	3,785.00	19,303,500	
琉球銀行	13,700	1,216.00	16,659,200	
八千代銀行	3,700	2,556.00	9,457,200	
セブン銀行	246,400	360.00	88,704,000	
みずほフィナンシャルグループ	9,004,700	212.00	1,908,996,400	
高知銀行	25,000	151.00	3,775,000	
山口フィナンシャルグループ	70,000	897.00	62,790,000	
アクリーティブ	4,200	192.00	806,400	
芙蓉総合リース	7,000	3,460.00	24,220,000	
興銀リース	11,200	2,550.00	28,560,000	
東京センチュリーリース	16,500	2,906.00	47,949,000	
SBIホールディングス	83,400	1,212.00	101,080,800	
日本証券金融	32,000	643.00	20,576,000	
アイフル	121,800	363.00	44,213,400	
日本アジア投資	51,000	104.00	5,304,000	
ポケットカード	7,500	656.00	4,920,000	
長野銀行	25,000	178.00	4,450,000	
名古屋銀行	62,000	324.00	20,088,000	
北洋銀行	106,100	392.00	41,591,200	
愛知銀行	2,700	4,530.00	12,231,000	

第三銀行	43,000	169.00	7,267,000	
中京銀行	31,000	168.00	5,208,000	
東日本銀行	33,000	261.00	8,613,000	
大光銀行	27,000	201.00	5,427,000	
愛媛銀行	43,000	210.00	9,030,000	
トマト銀行	28,000	168.00	4,704,000	
みなと銀行	65,000	168.00	10,920,000	
京葉銀行	57,000	419.00	23,883,000	
関西アーバン銀行	102,000	116.00	11,832,000	
栃木銀行	37,000	371.00	13,727,000	
北日本銀行	2,100	2,506.00	5,262,600	
東和銀行	85,000	98.00	8,330,000	
福島銀行	93,000	84.00	7,812,000	
大東銀行	46,000	104.00	4,784,000	
リコーリース	5,100	2,611.00	13,316,100	
イオンフィナンシャルサービス	40,800	2,342.00	95,553,600	
アコム	141,500	313.00	44,289,500	
ジャックス	41,000	432.00	17,712,000	
オリエントコーポレーション	149,000	208.00	30,992,000	
日立キャピタル	13,700	2,486.00	34,058,200	
アプラスフィナンシャル	8,900	120.00	1,068,000	
オリックス	429,800	1,501.00	645,129,800	
三菱UFJリース	176,200	537.00	94,619,400	
ジャフコ	9,500	5,030.00	47,785,000	
トモニホールディングス	53,100	392.00	20,815,200	
大和証券グループ本社	689,000	930.00	640,770,000	
野村ホールディングス	1,421,800	692.00	983,885,600	
岡三証券グループ	55,000	881.00	48,455,000	
丸三証券	20,600	875.00	18,025,000	
東洋証券	27,000	363.00	9,801,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	73,900	870.00	64,293,000	
光世証券	18,000	242.00	4,356,000	
水戸証券	22,000	430.00	9,460,000	
いちよし証券	13,900	1,499.00	20,836,100	
松井証券	36,300	1,078.00	39,131,400	
NK S Jホールディングス	154,500	2,632.00	406,644,000	
だいこう証券ビジネス	4,600	709.00	3,261,400	
日本取引所グループ	102,600	2,462.00	252,601,200	
マネックスグループ	75,300	400.00	30,120,000	
カブドットコム証券	28,600	523.00	14,957,800	
極東証券	8,800	1,775.00	15,620,000	
岩井コスモホールディングス	6,800	1,224.00	8,323,200	
フィデアホールディングス	43,900	187.00	8,209,300	
池田泉州ホールディングス	53,200	453.00	24,099,600	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	207,800	2,465.00	512,227,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	66,900	1,685.00	112,726,500	
マネーパートナーズグループ	5,000	252.00	1,260,000	
小林洋行	3,000	270.00	810,000	
第一生命保険	350,000	1,513.00	529,550,000	
東京海上ホールディングス	269,400	3,080.00	829,752,000	
イー・ギャランティ	2,200	2,042.00	4,492,400	
アサックス	1,400	1,308.00	1,831,200	

NECキャピタルソリューション	2,400	2,238.00	5,371,200	
T&Dホールディングス	238,500	1,241.00	295,978,500	
三井不動産	328,000	3,155.00	1,034,840,000	
三菱地所	487,000	2,474.00	1,204,838,000	
平和不動産	14,000	1,509.00	21,126,000	
東京建物	142,000	863.00	122,546,000	
ダイビル	19,000	1,071.00	20,349,000	
京阪神ビルディング	11,400	524.00	5,973,600	
住友不動産	167,000	4,265.00	712,255,000	
太平洋興発	26,000	117.00	3,042,000	
大京	112,000	232.00	25,984,000	
テーオーシー	25,400	728.00	18,491,200	
東京楽天地	12,000	453.00	5,436,000	
レオパレス21	69,900	527.00	36,837,300	
フジ住宅	9,700	675.00	6,547,500	
空港施設	9,200	755.00	6,946,000	
明和地所	3,400	443.00	1,506,200	
住友不動産販売	5,300	3,065.00	16,244,500	
ゴールドクレスト	5,800	2,098.00	12,168,400	
リコ・ホールディング	2,700	5,440.00	14,688,000	
日本エスリード	3,100	1,092.00	3,385,200	
日神不動産	9,800	375.00	3,675,000	
タカラレーベン	23,600	299.00	7,056,400	
サンヨーハウジング名古屋	3,700	1,052.00	3,892,400	
イオンモール	44,800	2,907.00	130,233,600	
ファースト住建	700	1,340.00	938,000	
ランド	4,900	14.00	68,600	
トーセイ	9,900	667.00	6,603,300	
穴吹興産	2,000	299.00	598,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	43,800	929.00	40,690,200	
サンフロンティア不動産	6,900	1,306.00	9,011,400	
エフ・ジェー・ネクスト	2,000	518.00	1,036,000	
ランドビジネス	5,000	394.00	1,970,000	
グランディハウス	5,300	324.00	1,717,200	
東武鉄道	402,000	485.00	194,970,000	
相鉄ホールディングス	118,000	364.00	42,952,000	
東京急行電鉄	415,000	625.00	259,375,000	
京浜急行電鉄	182,000	852.00	155,064,000	
小田急電鉄	227,000	904.00	205,208,000	
京王電鉄	198,000	698.00	138,204,000	
京成電鉄	106,000	889.00	94,234,000	
富士急行	20,000	899.00	17,980,000	
新京成電鉄	9,000	371.00	3,339,000	
東日本旅客鉄道	129,600	7,558.00	979,516,800	
西日本旅客鉄道	63,600	4,161.00	264,639,600	
東海旅客鉄道	63,100	11,460.00	723,126,000	
鴻池運輸	2,900	1,400.00	4,060,000	
西日本鉄道	91,000	398.00	36,218,000	
ハマキョウレックス	2,100	3,090.00	6,489,000	
サカイ引越センター	1,400	3,485.00	4,879,000	
近畿日本鉄道	712,000	357.00	254,184,000	
阪急阪神ホールディングス	475,000	535.00	254,125,000	
南海電気鉄道	149,000	369.00	54,981,000	

京阪電気鉄道	148,000	396.00	58,608,000	
神戸電鉄	7,000	338.00	2,366,000	
名糖運輸	3,500	662.00	2,317,000	
名古屋鉄道	249,000	304.00	75,696,000	
山陽電気鉄道	11,000	406.00	4,466,000	
トランコム	1,900	3,530.00	6,707,000	
日本通運	280,000	471.00	131,880,000	
ヤマトホールディングス	131,800	2,004.00	264,127,200	
山九	85,000	438.00	37,230,000	
日新	29,000	276.00	8,004,000	
丸運	4,800	229.00	1,099,200	
丸全昭和運輸	24,000	330.00	7,920,000	
センコー	30,000	501.00	15,030,000	
トナミホールディングス	17,000	200.00	3,400,000	
日本梱包運輸倉庫	21,600	1,716.00	37,065,600	
日本石油輸送	8,000	229.00	1,832,000	
福山通運	42,000	566.00	23,772,000	
セイノーホールディングス	51,000	1,003.00	51,153,000	
神奈川中央交通	9,000	504.00	4,536,000	
日立物流	13,000	1,575.00	20,475,000	
日本郵船	585,000	317.00	185,445,000	
商船三井	396,000	411.00	162,756,000	
川崎汽船	312,000	233.00	72,696,000	
N S ユナイテッド海運	32,000	246.00	7,872,000	
乾汽船	9,000	336.00	3,024,000	
明治海運	6,400	399.00	2,553,600	
飯野海運	30,900	501.00	15,480,900	
共栄タンカー	6,000	219.00	1,314,000	
第一中央汽船	57,000	93.00	5,301,000	
日本航空	59,500	4,975.00	296,012,500	
A N Aホールディングス	1,384,000	223.00	308,632,000	
スカイマーク	14,000	336.00	4,704,000	
パスコ	7,000	434.00	3,038,000	
三菱倉庫	47,000	1,387.00	65,189,000	
三井倉庫	35,000	422.00	14,770,000	
住友倉庫	47,000	513.00	24,111,000	
澁澤倉庫	16,000	328.00	5,248,000	
ヤマタネ	35,000	158.00	5,530,000	
東陽倉庫	13,000	251.00	3,263,000	
日本トランスシティ	18,000	324.00	5,832,000	
ケイヒン	15,000	149.00	2,235,000	
中央倉庫	1,500	843.00	1,264,500	
安田倉庫	6,000	996.00	5,976,000	
東洋埠頭	21,000	204.00	4,284,000	
宇徳	5,700	355.00	2,023,500	
上組	82,000	945.00	77,490,000	
サンリツ	2,100	559.00	1,173,900	
キムラユニティー	1,800	936.00	1,684,800	
キューソー流通システム	2,300	1,001.00	2,302,300	
郵船ロジスティクス	5,800	1,309.00	7,592,200	
近鉄エクスプレス	6,300	4,155.00	26,176,500	
東海運	4,300	267.00	1,148,100	
エーアイティー	2,200	746.00	1,641,200	

東京放送ホールディングス	38,000	1,089.00	41,382,000	
日本テレビホールディングス	66,700	1,628.00	108,587,600	
テレビ朝日	17,600	1,982.00	34,883,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	54,100	515.00	27,861,500	
テレビ東京ホールディングス	5,500	1,610.00	8,855,000	
コネクシオ	6,700	839.00	5,621,300	
日本電信電話	273,300	5,627.00	1,537,859,100	
K D D I	215,900	5,701.00	1,230,845,900	
光通信	6,300	8,740.00	55,062,000	
N T T ドコモ	573,000	1,648.00	944,304,000	
G M O インターネット	23,200	1,082.00	25,102,400	
学研ホールディングス	25,000	271.00	6,775,000	
ゼンリン	9,500	971.00	9,224,500	
昭文社	4,200	698.00	2,931,600	
K A D O K A W A	6,300	3,400.00	21,420,000	
インプレスホールディングス	7,100	144.00	1,022,400	
東京電力	600,500	455.00	273,227,500	
中部電力	233,200	1,224.00	285,436,800	
関西電力	287,500	1,093.00	314,237,500	
中国電力	97,800	1,382.00	135,159,600	
北陸電力	68,900	1,277.00	87,985,300	
東北電力	176,800	1,116.00	197,308,800	
四国電力	63,400	1,447.00	91,739,800	
九州電力	156,300	1,208.00	188,810,400	
北海道電力	66,800	1,020.00	68,136,000	
沖縄電力	4,500	3,345.00	15,052,500	
電源開発	43,900	3,110.00	136,529,000	
東京瓦斯	826,000	481.00	397,306,000	
大阪瓦斯	729,000	399.00	290,871,000	
東邦瓦斯	179,000	483.00	86,457,000	
北海道瓦斯	13,000	278.00	3,614,000	
西部瓦斯	84,000	231.00	19,404,000	
静岡瓦斯	19,400	575.00	11,155,000	
アイネット	3,000	760.00	2,280,000	
松竹	46,000	918.00	42,228,000	
東宝	49,800	2,018.00	100,496,400	
エイチ・アイ・エス	6,000	5,600.00	33,600,000	
東映	31,000	590.00	18,290,000	
A O I P r o .	3,700	642.00	2,375,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	49,100	3,955.00	194,190,500	
共立メンテナンス	3,900	3,675.00	14,332,500	
イチネンホールディングス	8,400	752.00	6,316,800	
建設技術研究所	4,300	1,078.00	4,635,400	
スペース	4,100	873.00	3,579,300	
アインファーマシーズ	3,800	4,935.00	18,753,000	
燦ホールディングス	1,900	1,361.00	2,585,900	
スバル興業	5,000	343.00	1,715,000	
東京テアトル	29,000	157.00	4,553,000	
よみうりランド	15,000	579.00	8,685,000	
東京都競馬	56,000	321.00	17,976,000	
常磐興産	23,000	145.00	3,335,000	
カナモト	9,000	2,681.00	24,129,000	
東京ドーム	54,000	572.00	30,888,000	

D T S	6,900	1,833.00	12,647,700	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	25,400	2,407.00	61,137,800	
シーイーシー	4,800	637.00	3,057,600	
カブコン	13,900	1,965.00	27,313,500	
西尾レントオール	1,700	3,150.00	5,355,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	48.00	1,392,000	
日本空港ビルデング	24,300	2,189.00	53,192,700	
トランス・コスモス	9,600	2,167.00	20,803,200	
乃村工藝社	14,300	780.00	11,154,000	
ジャステック	4,300	743.00	3,194,900	
S C S K	16,600	3,025.00	50,215,000	
藤田観光	20,000	322.00	6,440,000	
K N T - C Tホールディングス	25,000	187.00	4,675,000	
日本管財	2,800	1,980.00	5,544,000	
トーカイ	3,400	2,841.00	9,659,400	
白洋舎	9,000	230.00	2,070,000	
セコム	76,500	5,572.00	426,258,000	
日本システムウエア	2,500	480.00	1,200,000	
セントラル警備保障	3,500	1,002.00	3,507,000	
アイネス	10,300	732.00	7,539,600	
丹青社	9,100	483.00	4,395,300	
メイテック	10,300	2,596.00	26,738,800	
T K C	6,100	1,890.00	11,529,000	
アサツー ディ・ケイ	12,900	2,238.00	28,870,200	
富士ソフト	9,000	1,986.00	17,874,000	
応用地質	7,400	1,512.00	11,188,800	
船井総合研究所	8,200	780.00	6,396,000	
N S D	14,500	1,293.00	18,748,500	
進学会	3,400	392.00	1,332,800	
丸紅建材リース	8,000	222.00	1,776,000	
コナミ	31,800	2,465.00	78,387,000	
ベネッセホールディングス	23,500	3,845.00	90,357,500	
イオンディライト	7,500	2,052.00	15,390,000	
ナック	3,600	1,593.00	5,734,800	
福井コンピュータホールディングス	1,000	900.00	900,000	
ニチイ学館	15,100	897.00	13,544,700	
ダイセキ	11,500	1,732.00	19,918,000	
ステップ	2,600	779.00	2,025,400	
日鉄住金物産	47,000	397.00	18,659,000	
元気寿司	2,200	1,593.00	3,504,600	
トラスコ中山	8,400	2,386.00	20,042,400	
ヤマダ電機	275,900	336.00	92,702,400	
オートバックスセブン	24,500	1,572.00	38,514,000	
アークランドサカモト	5,000	1,697.00	8,485,000	
ニトリホールディングス	27,700	4,670.00	129,359,000	
グルメ杵屋	5,000	738.00	3,690,000	
愛眼	6,300	270.00	1,701,000	
ケーユーホールディングス	1,300	1,264.00	1,643,200	
吉野家ホールディングス	18,800	1,465.00	27,542,000	
加藤産業	10,600	1,861.00	19,726,600	
イノテック	6,400	450.00	2,880,000	
イエローハット	6,000	1,942.00	11,652,000	
富士エレクトロニクス	3,700	1,335.00	4,939,500	

松屋フーズ	3,600	1,837.00	6,613,200	
JBC Cホールディングス	6,300	736.00	4,636,800	
JKホールディングス	6,000	554.00	3,324,000	
サガミチェーン	9,000	943.00	8,487,000	
日伝	3,400	2,305.00	7,837,000	
関西スーパーマーケット	1,900	803.00	1,525,700	
ミロク情報サービス	4,500	387.00	1,741,500	
北沢産業	6,500	180.00	1,170,000	
杉本商事	3,900	957.00	3,732,300	
因幡電機産業	9,900	3,155.00	31,234,500	
王将フードサービス	1,400	3,275.00	4,585,000	
ブレナス	8,200	2,287.00	18,753,400	
ミニストップ	5,600	1,629.00	9,122,400	
アークス	11,800	1,926.00	22,726,800	
パロー	14,900	1,287.00	19,176,300	
バイテック	1,500	790.00	1,185,000	
ミスミグループ本社	27,100	2,865.00	77,641,500	
江守商事	1,800	1,779.00	3,202,200	
藤久	500	1,576.00	788,000	
アルテック	4,300	281.00	1,208,300	
ベルク	3,700	1,852.00	6,852,400	
大庄	3,400	1,261.00	4,287,400	
タキヒヨー	11,000	412.00	4,532,000	
ファーストリテイリング	16,200	34,525.00	559,305,000	
ソフトバンク	341,500	7,526.00	2,570,129,000	
スズケン	28,100	3,815.00	107,201,500	
サンドラッグ	13,900	4,145.00	57,615,500	
東京デリカ	3,200	1,383.00	4,425,600	
ジェコス	5,100	893.00	4,554,300	
ヤマザワ	2,100	1,555.00	3,265,500	
やまや	1,700	2,073.00	3,524,100	
ペルーナ	19,000	488.00	9,272,000	
合 計	113,770,106		119,574,162,660	

(注) 備考欄に 印を付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。

「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)	(平成26年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託			157,571
コール・ローン		365,905,138	473,031,502
国債証券		153,156,673,700	147,493,273,800
地方債証券		12,470,330,123	11,960,911,327
特殊債券		17,174,784,628	16,805,011,354
社債券		11,130,023,694	11,273,916,380
未収利息		739,638,493	685,173,785
前払費用		32,079,333	17,166,929
流動資産合計		195,069,435,109	188,708,642,648
資産合計		195,069,435,109	188,708,642,648
負債の部			
流動負債			
未払金			100,000,000
未払解約金		15,379,396	162,926,004
流動負債合計		15,379,396	262,926,004
負債合計		15,379,396	262,926,004
純資産の部			
元本等			
元本	1	170,288,187,355	160,599,147,379
剰余金			
剰余金又は欠損金()		24,765,868,358	27,846,569,265
元本等合計		195,054,055,713	188,445,716,644
純資産合計		195,054,055,713	188,445,716,644
負債純資産合計		195,069,435,109	188,708,642,648

(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	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成25年 2月20日現在)	(平成26年 2月20日現在)
1 期首元本額	164,988,864,707円	170,288,187,355円
期中追加設定元本額	22,033,591,484円	24,468,338,191円
期中一部解約元本額	16,734,268,836円	34,157,378,167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	978,211,540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	6,929,509,124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	348,556,511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	17,091,347,815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	31,639,529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	125,061,646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	88,292,416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	27,051,493,638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	253,180,285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	19,114,311,763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	4,149,296,690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	38,191,079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	1,640,882,672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	6,260,786,562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	2,530,963,155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	13,932,420,559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	1,953,807,705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 >	5,661,160,193円	5,350,929,823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 >	462,115,698円	91,505,766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	300,943,427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 >	105,840,023円	100,029,897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 >	79,912,550円	65,098,187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	465,001,160円
ステート・ストリート4資産バランス30 VA2 < 適格機関投資家限定 >	173,795,349円	125,378,618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 >	6,940,659,955円	6,685,951,483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 >	101,276,499円	107,809,589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>	58,698,664円	57,293,661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>	351,778円	422,240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>	1,959,828,493円	1,905,941,995円
ステート・ストリート日本債券インデック ス・ファンドVA3<適格機関投資家限定 >	13,216,220,385円	12,297,196,671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	1,590,296,248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>	5,153,916,479円	4,891,765,238円
ステート・ストリート世界分散ファンドV A25A<適格機関投資家限定>	19,010,599,862円	18,535,054,395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>	1,875,001円	11,686,266円
ステート・ストリート・グローバル balan ス40VA<適格機関投資家限定>	891,906,343円	677,311,450円
ステート・ストリート・グローバル balan ス40VA2<適格機関投資家限定>	4,586,452,304円	4,350,798,081円
ステート・ストリート・グローバル balan ス40VA3<適格機関投資家限定>	338,610,640円	300,728,060円
ステート・ストリート・グローバル balan ス50VA<適格機関投資家限定>	213,221,403円	170,052,435円
計	170,288,187,355円	160,599,147,379円
2 受益権の総数	170,288,187,355口	160,599,147,379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）	（平成26年 2月20日現在）
1 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。	同左
2 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>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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）	（平成26年 2月20日現在）
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,176,781,150	716,696,600
地方債証券	34,298,984	1,267,760
特殊債券	64,838,150	8,789,441
社債券	76,443,670	2,162,730
合計	1,352,361,954	722,055,551

（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	自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成25年 2月20日現在）	（平成26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）	1.1454円 （11,454円）	1.1734円 （11,734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）	200,000,000	233,628,000	
	第100回利付国債（5年）	600,000,000	603,228,000	
	第101回利付国債（20年）	300,000,000	358,419,000	
	第101回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,512,855,000	
	第102回利付国債（20年）	400,000,000	477,916,000	
	第102回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,206,912,000	
	第103回利付国債（20年）	500,000,000	590,655,000	
	第103回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,307,735,000	
	第104回利付国債（20年）	450,000,000	519,475,500	
	第104回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,404,060,000	
	第105回利付国債（20年）	200,000,000	230,764,000	
	第105回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,704,760,000	
	第106回利付国債（20年）	300,000,000	350,235,000	
	第106回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,002,660,000	
	第107回利付国債（20年）	300,000,000	345,714,000	
	第107回利付国債（5年）	2,000,000,000	2,005,320,000	
	第108回利付国債（20年）	300,000,000	337,458,000	
	第108回利付国債（5年）	800,000,000	799,080,000	
	第109回利付国債（20年）	300,000,000	336,894,000	
	第109回利付国債（5年）	1,000,000,000	998,380,000	
第110回利付国債（20年）	400,000,000	460,320,000		
第110回利付国債（5年）	500,000,000	503,230,000		
第111回利付国債（20年）	500,000,000	581,630,000		
第111回利付国債（5年）	1,500,000,000	1,515,765,000		
第112回利付国債（20年）	500,000,000	574,580,000		
第112回利付国債（5年）	600,000,000	606,432,000		
第113回利付国債（20年）	400,000,000	458,968,000		
第113回利付国債（5年）	500,000,000	503,215,000		
第114回利付国債（20年）	500,000,000	572,770,000		
第114回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,207,344,000		
第115回利付国債（20年）	400,000,000	463,976,000		
第115回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,001,580,000		
第116回利付国債（20年）	600,000,000	694,848,000		
第116回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,201,428,000		
第118回利付国債（20年）	600,000,000	676,104,000		
第122回利付国債（20年）	600,000,000	656,562,000		

第123回利付国債(20年)	500,000,000	568,140,000	
第126回利付国債(20年)	600,000,000	671,316,000	
第127回利付国債(20年)	300,000,000	331,152,000	
第128回利付国債(20年)	800,000,000	880,920,000	
第12回利付国債(30年)	300,000,000	333,282,000	
第130回利付国債(20年)	700,000,000	758,191,000	
第132回利付国債(20年)	700,000,000	744,814,000	
第133回利付国債(20年)	500,000,000	540,075,000	
第135回利付国債(20年)	600,000,000	636,504,000	
第136回利付国債(20年)	200,000,000	208,930,000	
第137回利付国債(20年)	700,000,000	740,327,000	
第139回利付国債(20年)	700,000,000	728,910,000	
第13回利付国債(30年)	300,000,000	327,162,000	
第140回利付国債(20年)	800,000,000	843,448,000	
第141回利付国債(20年)	200,000,000	210,188,000	
第142回利付国債(20年)	500,000,000	533,760,000	
第143回利付国債(20年)	400,000,000	412,660,000	
第144回利付国債(20年)	200,000,000	203,008,000	
第145回利付国債(20年)	720,000,000	752,839,200	
第146回利付国債(20年)	970,000,000	1,011,583,900	
第147回利付国債(20年)	200,000,000	204,460,000	
第14回ポーランド共和国	100,000,000	100,245,000	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	347,538,000	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	235,172,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	234,946,000	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	231,494,000	
第18回利付国債(30年)	100,000,000	113,900,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	227,868,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	374,007,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	190,958,400	
第20回利付国債(30年)	300,000,000	352,917,000	
第21回利付国債(30年)	300,000,000	341,982,000	
第22回利付国債(30年)	100,000,000	117,749,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	117,803,000	
第24回利付国債(30年)	320,000,000	377,136,000	
第25回利付国債(30年)	350,000,000	399,297,500	
第268回利付国債(10年)	100,000,000	101,522,000	
第269回利付国債(10年)	100,000,000	101,309,000	
第26回利付国債(30年)	350,000,000	406,066,500	
第270回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,422,568,000	
第271回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,014,810,000	
第272回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,224,924,000	
第273回利付国債(10年)	100,000,000	102,234,000	
第274回利付国債(10年)	300,000,000	307,764,000	
第275回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,024,070,000	
第277回利付国債(10年)	100,000,000	103,145,000	
第278回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,449,798,000	
第279回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,247,640,000	
第27回利付国債(30年)	520,000,000	614,291,600	
第280回利付国債(10年)	100,000,000	104,198,000	
第281回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,044,290,000	
第282回利付国債(10年)	900,000,000	937,269,000	
第283回利付国債(10年)	400,000,000	417,588,000	

第284回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,045,120,000	
第285回利付国債(10年)	900,000,000	944,010,000	
第286回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,583,790,000	
第287回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,059,170,000	
第288回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,584,240,000	
第289回利付国債(10年)	800,000,000	841,808,000	
第28回利付国債(30年)	500,000,000	591,550,000	
第290回利付国債(10年)	500,000,000	525,575,000	
第291回利付国債(10年)	100,000,000	104,710,000	
第292回利付国債(10年)	400,000,000	425,312,000	
第293回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,071,010,000	
第294回利付国債(10年)	400,000,000	426,688,000	
第295回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,163,954,000	
第296回利付国債(10年)	100,000,000	106,103,000	
第297回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,270,548,000	
第298回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,686,416,000	
第299回利付国債(10年)	400,000,000	422,700,000	
第29回利付国債(30年)	400,000,000	465,884,000	
第2回利付国債(30年)	700,000,000	831,082,000	
第2回利付国債(40年)	700,000,000	798,826,000	
第300回利付国債(10年)	700,000,000	746,753,000	
第301回利付国債(10年)	600,000,000	641,886,000	
第302回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,064,540,000	
第303回利付国債(10年)	600,000,000	640,008,000	
第304回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,167,287,000	
第305回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,062,960,000	
第306回利付国債(10年)	800,000,000	856,504,000	
第307回利付国債(10年)	900,000,000	958,176,000	
第308回利付国債(10年)	700,000,000	746,172,000	
第309回利付国債(10年)	800,000,000	842,552,000	
第30回利付国債(30年)	500,000,000	572,865,000	
第310回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,360,814,000	
第311回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,034,210,000	
第312回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,378,182,000	
第313回利付国債(10年)	900,000,000	960,273,000	
第314回利付国債(10年)	900,000,000	947,844,000	
第315回利付国債(10年)	750,000,000	794,917,500	
第316回利付国債(10年)	900,000,000	947,484,000	
第317回利付国債(10年)	800,000,000	842,072,000	
第318回利付国債(10年)	950,000,000	992,607,500	
第319回利付国債(10年)	900,000,000	947,403,000	
第31回利付国債(30年)	500,000,000	563,120,000	
第320回利付国債(10年)	900,000,000	940,230,000	
第321回利付国債(10年)	900,000,000	939,987,000	
第322回利付国債(10年)	800,000,000	829,304,000	
第323回利付国債(10年)	900,000,000	932,094,000	
第324回利付国債(10年)	900,000,000	924,507,000	
第325回利付国債(10年)	800,000,000	821,072,000	
第326回利付国債(10年)	900,000,000	914,814,000	
第327回利付国債(10年)	800,000,000	820,272,000	
第327回利付国債(2年)	600,000,000	600,168,000	
第328回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,409,086,000	
第328回利付国債(2年)	800,000,000	800,240,000	

第329回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,329,978,000	
第329回利付国債(2年)	900,000,000	901,458,000	
第32回利付国債(30年)	750,000,000	861,622,500	
第330回利付国債(10年)	900,000,000	919,611,000	
第330回利付国債(2年)	880,000,000	881,522,400	
第331回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,203,804,000	
第331回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,360,000	
第332回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,301,807,000	
第332回利付国債(2年)	900,000,000	900,342,000	
第333回利付国債(2年)	750,000,000	750,300,000	
第334回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,300,559,000	
第335回利付国債(2年)	700,000,000	700,315,000	
第33回利付国債(20年)	100,000,000	109,540,000	
第33回利付国債(30年)	650,000,000	705,705,000	
第34回利付国債(30年)	750,000,000	846,982,500	
第35回利付国債(30年)	500,000,000	542,935,000	
第36回利付国債(20年)	300,000,000	330,711,000	
第36回利付国債(30年)	750,000,000	814,410,000	
第37回利付国債(20年)	400,000,000	442,368,000	
第37回利付国債(30年)	700,000,000	744,086,000	
第38回利付国債(20年)	100,000,000	110,394,000	
第38回利付国債(30年)	750,000,000	779,752,500	
第39回利付国債(20年)	100,000,000	109,989,000	
第39回利付国債(30年)	80,000,000	85,044,000	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	351,276,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	285,280,000	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	109,758,000	
第40回利付国債(30年)	380,000,000	394,858,000	
第41回利付国債(20年)	100,000,000	106,706,000	
第41回利付国債(30年)	250,000,000	253,765,000	
第45回利付国債(20年)	650,000,000	735,254,000	
第47回利付国債(20年)	600,000,000	675,216,000	
第48回利付国債(20年)	300,000,000	344,349,000	
第49回利付国債(20年)	100,000,000	112,347,000	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	285,232,500	
第50回利付国債(20年)	50,000,000	55,481,500	
第51回利付国債(20年)	350,000,000	391,359,500	
第52回利付国債(20年)	100,000,000	112,702,000	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	561,870,000	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	893,720,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	114,771,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	140,966,800	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	754,166,000	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	364,700,000	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	556,875,000	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	450,096,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	577,855,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	343,857,000	
第6回利付国債(30年)	200,000,000	235,098,000	
第6回利付国債(40年)	100,000,000	105,437,000	
第70回利付国債(20年)	600,000,000	706,308,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	689,454,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	345,015,000	

	第76回利付国債（20年）	200,000,000	225,924,000	
	第77回利付国債（20年）	300,000,000	342,162,000	
	第78回利付国債（20年）	250,000,000	282,795,000	
	第7回利付国債（30年）	300,000,000	346,515,000	
	第80回利付国債（20年）	100,000,000	115,286,000	
	第81回利付国債（20年）	200,000,000	228,560,000	
	第83回利付国債（20年）	300,000,000	346,413,000	
	第85回利付国債（20年）	300,000,000	346,728,000	
	第88回利付国債（20年）	400,000,000	472,040,000	
	第88回利付国債（5年）	800,000,000	803,656,000	
	第89回利付国債（20年）	400,000,000	467,244,000	
	第89回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,305,551,000	
	第8回利付国債（30年）	300,000,000	320,913,000	
	第90回利付国債（20年）	400,000,000	467,428,000	
	第90回利付国債（5年）	200,000,000	200,592,000	
	第91回利付国債（20年）	400,000,000	472,304,000	
	第91回利付国債（5年）	800,000,000	804,072,000	
	第92回利付国債（20年）	440,000,000	509,168,000	
	第92回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,003,520,000	
	第93回利付国債（20年）	400,000,000	457,860,000	
	第93回利付国債（5年）	600,000,000	604,632,000	
	第94回利付国債（20年）	300,000,000	347,160,000	
	第95回利付国債（20年）	650,000,000	768,729,000	
	第95回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,010,720,000	
	第96回利付国債（20年）	400,000,000	462,860,000	
	第96回利付国債（5年）	600,000,000	605,196,000	
	第97回利付国債（20年）	700,000,000	818,958,000	
	第97回利付国債（5年）	700,000,000	705,096,000	
	第98回利付国債（20年）	100,000,000	115,700,000	
	第98回利付国債（5年）	800,000,000	803,976,000	
	第99回利付国債（20年）	100,000,000	115,601,000	
	第99回利付国債（5年）	800,000,000	806,352,000	
	第9回利付国債（30年）	100,000,000	100,223,000	
	銘柄数：228	139,000,000,000	147,493,273,800	
地方債証券	第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,608,000	
	第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,436,000	
	第10回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	112,434,000	
	第10回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	107,051,000	
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,958,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,071,000	
	第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,048,000	
	第11回共同発行市場公募地方債	9,100,000	9,098,999	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,344,000	
	第124回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,629,000	
	第128回神奈川県公募公債	19,500,000	19,665,750	
	第129回神奈川県公募公債	30,540,000	30,853,340	
	第12回め号名古屋市公募公債	30,000,000	30,216,600	
	第12回共同発行市場公募地方債	1,600,000	1,601,904	
	第12回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,488,000	
	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,936,000	
	第133回神奈川県公募公債	8,000,000	8,127,200	
	第134回神奈川県公募公債	20,000,000	20,384,800	
	第136回神奈川県公募公債	60,000,000	61,519,200	

第138回神奈川県公募公債	7,260,000	7,498,055	
第139回神奈川県公募公債	300,000	311,247	
第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,301,000	
第141回神奈川県公募公債	5,000,000	5,213,550	
第143回神奈川県公募公債	10,000,000	10,459,400	
第144回神奈川県公募公債	40,000,000	41,905,200	
第145回神奈川県公募公債	40,000,000	42,027,600	
第147回神奈川県公募公債	50,000,000	53,021,500	
第149回神奈川県公募公債	9,000,000	9,540,090	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,296,000	
第14回共同発行市場公募地方債	8,600,000	8,630,960	
第15回共同発行市場公募地方債	3,000,000	3,015,690	
第162回神奈川県公募公債	100,000,000	107,347,000	
第16回共同発行市場公募地方債	1,000,000	1,007,360	
第188回神奈川県公募公債	100,000,000	104,347,000	
第18回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,044,400	
第1回群馬県公募公債(10年)	27,000,000	27,286,470	
第20回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,106,100	
第21回共同発行市場公募地方債	6,200,000	6,267,642	
第22回共同発行市場公募地方債	11,000,000	11,130,790	
第22回川崎市公募公債(5年)	35,500,000	35,606,500	
第23回共同発行市場公募地方債	3,200,000	3,238,688	
第25回共同発行市場公募地方債	3,500,000	3,552,325	
第267回大阪府公募公債(10年)	62,000,000	62,318,680	
第268回大阪府公募公債(10年)	2,000,000	2,014,700	
第271回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,099,500	
第275回大阪府公募公債(10年)	5,000,000	5,058,150	
第281回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,185,400	
第284回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,251,000	
第287回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,286,000	
第288回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,320,700	
第296回大阪府公募公債(10年)	30,000,000	31,419,000	
第29回共同発行市場公募地方債	1,500,000	1,528,815	
第2回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,357,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	110,734,000	
第301回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,516,300	
第305回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	42,406,800	
第309回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,548,100	
第30回共同発行市場公募地方債	1,500,000	1,527,915	
第312回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,560,600	
第316回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,709,300	
第31回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,228,400	
第320回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,748,900	
第323回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	42,842,800	
第324回大阪府公募公債(10年)	8,000,000	8,557,920	
第325回大阪府公募公債(10年)	6,000,000	6,425,880	
第326回大阪府公募公債(10年)	56,000,000	60,042,080	
第327回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,463,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,705,000	
第346回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,596,000	
第34回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,244,700	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,960,000	
第368回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,824,000	

第374回大阪府公募公債(10年)	134,000,000	137,371,440	
第37回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,622,000	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	116,403,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,895,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,664,000	
第44回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,566,000	
第45回共同発行市場公募地方債	7,800,000	8,142,498	
第468回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,332,000	
第47回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,945,000	
第480回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	102,296,000	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,779,000	
第49回共同発行市場公募地方債	115,500,000	121,522,170	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	114,853,000	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,141,000	
第56回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,289,600	
第57回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,281,750	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	118,780,000	
第606回東京都公募公債	16,000,000	15,998,400	
第608回東京都公募公債	20,000,000	20,023,000	
第60回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,533,400	
第611回東京都公募公債	36,000,000	36,208,080	
第612回東京都公募公債	15,000,000	15,080,550	
第613回東京都公募公債	10,000,000	10,083,700	
第614回東京都公募公債	1,000,000	1,007,910	
第617回東京都公募公債	10,000,000	10,106,600	
第618回東京都公募公債	10,000,000	10,110,700	
第61回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,567,800	
第620回東京都公募公債	1,100,000	1,114,652	
第621回東京都公募公債	2,500,000	2,533,825	
第622回東京都公募公債	2,000,000	2,030,700	
第623回東京都公募公債	8,300,000	8,430,725	
第626回東京都公募公債	8,600,000	8,799,434	
第628回東京都公募公債	10,000,000	10,266,700	
第629回東京都公募公債	20,000,000	20,482,400	
第62回共同発行市場公募地方債	20,000,000	21,318,200	
第631回東京都公募公債	700,000	723,282	
第634回東京都公募公債	20,000,000	20,805,600	
第637回東京都公募公債	10,000,000	10,432,100	
第63回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,730,100	
第649回東京都公募公債	2,300,000	2,428,639	
第652回東京都公募公債	1,400,000	1,481,298	
第658回東京都公募公債	10,000,000	10,760,200	
第662回東京都公募公債	10,000,000	10,672,000	
第663回東京都公募公債	100,000,000	106,432,000	
第674回東京都公募公債	100,000,000	106,306,000	
第675回東京都公募公債	100,000,000	106,747,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,244,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	103,966,000	
第704回東京都公募公債	100,000,000	103,815,000	
第709回東京都公募公債	100,000,000	102,117,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,902,000	
第719回東京都公募公債	100,000,000	102,416,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,091,000	

第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,206,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,326,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,751,000	
第82回川崎市公募公債	130,000,000	139,123,400	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,948,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,622,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,052,000	
第90回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,131,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,251,000	
平成15年度第10回大阪市公募公債	10,000,000	10,011,700	
平成15年度第10回兵庫県公募公債	10,000,000	10,011,900	
平成15年度第6回福岡市公募公債	14,900,000	14,900,447	
平成15年度第8回北海道公募公債	10,200,000	10,202,448	
平成16年度第1回横浜市公募公債	5,000,000	5,006,100	
平成16年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,107,500	
平成16年度第1回埼玉県公募公債	5,000,000	5,013,150	
平成16年度第1回兵庫県公募公債	10,000,000	10,025,600	
平成16年度第2回愛知県公募公債(10年)	11,200,000	11,314,464	
平成16年度第2回横浜市公募公債	20,000,000	20,112,000	
平成16年度第2回広島県公募公債	30,000,000	30,450,300	
平成16年度第2回北九州市公募公債	65,100,000	65,799,825	
平成16年度第3回京都府公募公債	14,200,000	14,354,070	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	16,000,000	16,149,440	
平成16年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,205,000	
平成16年度第5回埼玉県公募公債	50,000,000	50,534,000	
平成16年度第6回福岡市公募公債	16,000,000	16,190,400	
平成16年度第8回千葉県公募公債	7,000,000	7,084,630	
平成16年度第8回大阪市公募公債	6,000,000	6,069,900	
平成17年度第10回大阪市公募公債	5,000,000	5,128,700	
平成17年度第1回横浜市公募公債	18,800,000	19,041,392	
平成17年度第1回北海道公募公債	40,000,000	40,577,200	
平成17年度第2回埼玉県公募公債	13,100,000	13,294,273	
平成17年度第2回鹿児島県公募公債(10年)	12,000,000	12,393,960	
平成17年度第2回静岡県公募公債	30,900,000	31,385,439	
平成17年度第4回兵庫県公募公債	4,100,000	4,163,099	
平成17年度第5回福岡県公募公債	6,000,000	6,158,820	
平成17年度第9回兵庫県公募公債	10,000,000	10,254,900	
平成17年度第9回北海道公募公債	3,000,000	3,072,450	
平成18年度第12回北海道公募公債	100,000,000	105,121,000	
平成18年度第1回横浜市公募公債	10,000,000	10,370,700	
平成18年度第1回広島市公募公債	30,000,000	31,410,900	
平成18年度第1回堺市公募公債	40,400,000	42,329,100	
平成18年度第1回埼玉県公募公債	5,500,000	5,699,705	
平成18年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	104,384,000	
平成18年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,474,800	
平成18年度第3回大阪市公募公債	7,500,000	7,848,375	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	2,000,000	2,082,540	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	23,100,000	24,114,090	
平成18年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,506,900	
平成18年度第5回兵庫県公募公債	30,000,000	31,279,800	

平成18年度第6回福岡市公募公債	30,000,000	31,398,300	
平成18年度第7回千葉県公募公債	2,000,000	2,098,900	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	105,825,000	
平成19年度第14回北海道公募公債	10,000,000	10,580,100	
平成19年度第1回愛知県公募公債(10年)	21,700,000	22,843,156	
平成19年度第1回岡山県公募公債(10年)	42,200,000	44,638,316	
平成19年度第1回広島県公募公債	13,800,000	14,522,016	
平成19年度第1回埼玉県公募公債	13,150,000	13,827,882	
平成19年度第1回静岡県公募公債	18,300,000	19,261,848	
平成19年度第1回千葉県公募公債	2,000,000	2,104,680	
平成19年度第1回大分県公募公債	15,670,000	16,642,010	
平成19年度第2回熊本県公募公債(10年)	30,000,000	31,859,700	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	105,916,000	
平成19年度第4回大阪市公募公債	10,000,000	10,562,500	
平成19年度第5回福岡市公募公債	13,700,000	14,424,319	
平成19年度第9回大阪市公募公債	30,000,000	31,690,800	
平成19年度第9回北海道公募公債	21,000,000	22,160,250	
平成20年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,402,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	106,961,000	
平成20年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	107,127,000	
平成20年度第1回浜松市公募公債	11,000,000	11,775,940	
平成20年度第2回札幌市公募公債	22,550,000	24,234,485	
平成20年度第2回大阪市公募公債	20,000,000	21,474,200	
平成20年度第3回大阪市公募公債	30,000,000	32,079,300	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,515,000	
平成20年度第5回広島県公募公債	100,000,000	106,208,000	
平成20年度第7回千葉県公募公債	1,000,000	1,064,720	
平成20年度第7回兵庫県公募公債	10,000,000	10,682,200	
平成20年度第8回大阪市公募公債	40,000,000	42,622,800	
平成20年度第9回千葉県公募公債	13,600,000	13,610,744	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,339,000	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	107,039,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	20,000,000	21,339,200	
平成21年度第1回千葉県公募公債	40,000,000	42,681,200	
平成21年度第25回兵庫県公募公債	100,000,000	107,066,000	
平成21年度第2回京都府公募公債	100,000,000	106,403,000	
平成21年度第2回熊本県公募公債(10年)	10,000,000	10,611,100	
平成21年度第2回広島県公募公債	16,160,000	17,215,409	
平成21年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,732,800	
平成21年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,524,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	40,000,000	42,805,600	
平成21年度第3回埼玉県公募公債	20,000,000	21,494,200	
平成21年度第4回大阪市公募公債	100,000,000	107,282,000	
平成21年度第6回北海道公募公債	60,000,000	64,251,000	
平成21年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	107,269,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	12,000,000	12,513,120	

	平成22年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	110,856,000	
	平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	104,583,000	
	平成23年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	104,839,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,892,000	
	平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	101,843,000	
	平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	104,457,000	
	平成24年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	103,155,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,321,000	
	平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	102,030,000	
	平成24年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	102,190,000	
	平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	101,671,000	
	平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	30,676,500	
	平成24年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,446,000	
	平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	30,403,800	
	平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	100,692,000	
	平成24年度第9回北海道公募公債	107,400,000	109,132,362	
	平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	99,881,000	
	平成25年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,363,000	
	銘柄数: 239	11,337,730,000	11,960,911,327	
特殊債券	F89回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,558,000	
	い第723号農林債	100,000,000	100,543,000	
	い第725号農林債	110,000,000	110,387,200	
	い第730号商工債	100,000,000	101,114,000	
	い第734号商工債	200,000,000	201,838,000	
	い第746号農林債	100,000,000	100,375,000	
	い第748号農林債	100,000,000	100,378,000	
	い第757号農林債	100,000,000	100,343,000	
	い第758号農林債	100,000,000	100,547,000	
	い第763号商工債	100,000,000	100,215,000	
	い第763号農林債	100,000,000	100,024,000	
	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,283,000	
	第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,927,000	
	第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,375,000	
	第10回日本政策金融公庫	100,000,000	113,257,000	
	第10回公営企業債券	10,000,000	10,054,500	
	第10回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,600,600	
	第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,492,000	
	第11回関西国際空港	100,000,000	105,289,000	
	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,631,000	
	第11回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	104,140,000	
	第11回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,987,000	
	第11回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,335,000	
	第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,722,000	

第12回政府保証国民生活債券	17,000,000	17,016,830	
第12回政府保証東日本高速道路債券	22,000,000	23,104,840	
第12回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,275,000	
第12回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,947,000	
第13回沖縄振興開発金融公庫債券	10,000,000	10,732,800	
第13回公営企業債券	30,000,000	30,462,000	
第13回公営企業債券(20年)	10,000,000	11,424,900	
第13回政府保証西日本高速道路債券	4,000,000	4,200,160	
第13回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,046,900	
第146回政府保証阪神高速道路債券	35,000,000	35,530,250	
第14回政府保証中日本高速道路債券	5,000,000	5,289,700	
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	11,000,000	11,457,050	
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	112,384,000	
第156号商工債(3年)	100,000,000	100,071,000	
第15回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,695,800	
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	52,401,500	
第162号商工債(3年)	100,000,000	100,193,000	
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	209,120	
第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,050,100	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,980,000	52,584,457	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,716,000	
第172回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,213,000	
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	102,128,000	
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	102,179,000	
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	104,734,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	50,947,000	53,773,539	
第185回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,356,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,847,000	
第187回政府保証中小企業債券	18,000,000	18,451,980	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	100,848,000	
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	112,979,000	
第18回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,060,500	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	51,135,000	53,658,512	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,759,000	
第190回政府保証首都高速道路債券	1,000,000	1,000,800	
第191回政府保証中小企業債券	16,000,000	16,877,440	
第199回政府保証首都高速道路債券	10,000,000	10,195,400	

第19回国際協力銀行債券	100,000,000	108,012,000	
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	104,349,000	
第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	104,871,000	
第19回都市再生債券	50,000,000	53,633,500	
第1回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,611,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	65,000,000	66,697,150	
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	34,869,720	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	78,396,000	82,240,539	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,017,350	
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	208,990	
第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	105,512,000	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,611,000	
第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,632,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,398,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,143,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	113,812,000	
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	3,133,800	
第23回政府保証本州四国連絡橋債券	8,000,000	8,007,920	
第246回信金中金債(5年)	100,000,000	100,625,000	
第24回公営企業債券	70,000,000	73,489,500	
第24回政府保証中日本高速道路債券	20,000,000	21,066,600	
第251回信金中金債(5年)	100,000,000	100,318,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,682,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,964,000	119,997,579	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	20,000,000	21,418,200	
第273回信金中金債(5年)	100,000,000	100,351,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,168,000	
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	105,026,000	
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,538,000	
第284回信金中金債(5年)	100,000,000	100,745,000	
第28回一般担保住宅金融支援機構債券	20,000,000	20,058,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,402,000	66,576,069	
第28回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	97,299,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,362,000	43,791,190	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,754,000	67,908,210	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,759,000	
第2回政府保証西日本高速道路債券	13,000,000	13,579,020	
第2回政府保証中日本高速道路債券	1,000,000	1,025,370	
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	109,769,000	
第2回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	105,730,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	54,474,000	57,409,059	

第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,396,000	90,780,557	
第2号商工債(10年)	100,000,000	103,211,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,865,000	
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	10,484,500	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,685,000	68,982,671	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,109,000	71,259,691	
第325回政府保証道路債券	2,000,000	2,000,120	
第326回政府保証道路債券	41,000,000	41,051,250	
第327回政府保証道路債券	9,000,000	9,023,220	
第328回政府保証道路債券	15,000,000	15,058,200	
第329回政府保証道路債券	1,000,000	1,005,330	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,791,000	69,614,115	
第330回政府保証道路債券	30,000,000	30,225,900	
第331回政府保証道路債券	64,000,000	64,574,080	
第332回政府保証道路債券	7,000,000	7,059,640	
第333回政府保証道路債券	20,000,000	20,206,600	
第334回政府保証道路債券	1,000,000	1,010,840	
第335回政府保証道路債券	4,000,000	4,044,360	
第336回政府保証道路債券	24,000,000	24,295,200	
第338回政府保証道路債券	9,000,000	9,139,230	
第339回政府保証道路債券	1,000,000	1,015,330	
第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	3,000,000	3,148,410	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	108,778,000	
第342回東京交通債券	30,000,000	34,419,600	
第343回政府保証道路債券	6,000,000	6,097,080	
第345回政府保証道路債券	2,000,000	2,031,380	
第346回政府保証道路債券	50,000,000	50,977,500	
第347回政府保証道路債券	21,000,000	21,395,640	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	52,531,000	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,528,000	50,350,687	
第34回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,607,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	7,000,000	7,408,170	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,151,000	80,634,770	
第36回中日本高速道路	100,000,000	103,679,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,155,000	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,060,100	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,134,000	
第38回日本政策投資銀行	100,000,000	100,061,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,219,000	42,782,961	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,395,000	81,982,355	
第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,937,000	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,020,000	83,373,638	
第39回日本政策投資銀行債券	10,000,000	10,551,400	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	50,000,000	50,060,000	
第3回成田国際空港	100,000,000	104,796,000	
第3回政府保証東日本高速道路債券	17,000,000	17,717,740	

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	6,777,870	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,412,000	
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	1,061,400	
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	69,655,080	
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	1,060,440	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,798,000	87,979,620	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,750,000	179,084,307	
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	9,522,180	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,410,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,622,000	89,822,021	
第46回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,197,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,328,000	
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	71,487,720	
第48回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,338,000	
第48回中日本高速道路	100,000,000	100,916,000	
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	13,683,150	
第49回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,956,000	
第49回中日本高速道路	100,000,000	100,953,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,385,000	
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	112,453,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,365,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,945,000	
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	105,756,000	
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	11,553,630	
第55回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	105,542,000	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,480,000	93,779,805	
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	105,105,000	
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	2,129,740	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,163,000	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	109,089,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,446,000	
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	8,563,440	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,925,000	94,843,618	
第62回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,384,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,719,000	

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	106,001,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,665,000	96,233,599	
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	82,112,030	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,876,000	98,575,868	
第6回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	28,570,000	30,924,739	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,134,000	42,202,105	
第6回中小企業債券	10,000,000	10,232,500	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,260,000	98,836,880	
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	65,568,720	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,352,000	97,529,421	
第75回都市再生債券	100,000,000	100,076,000	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,551,000	
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	106,163,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,367,000	100,393,461	
第7回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,076,000	
第7回中日本高速道路	30,000,000	30,021,600	
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	70,460,280	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,919,000	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,526,000	
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	106,855,000	
第836回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,000,210	
第837回政府保証公営企業債券	28,000,000	28,034,160	
第838回政府保証公営企業債券	22,000,000	22,055,440	
第840回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,015,060	
第843回政府保証公営企業債券	42,000,000	42,356,580	
第844回政府保証公営企業債券	91,000,000	91,946,400	
第849回政府保証公営企業債券	76,000,000	77,159,760	
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	114,705,000	
第850回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,509,000	
第851回政府保証公営企業債券	24,000,000	24,360,480	
第852回政府保証公営企業債券	11,000,000	11,176,880	
第853回政府保証公営企業債券	7,000,000	7,108,290	
第854回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,019,190	
第855回政府保証公営企業債券	2,000,000	2,037,420	
第856回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,347,400	
第857回政府保証公営企業債券	21,000,000	21,553,770	
第859回政府保証公営企業債券	28,000,000	28,750,120	
第860回政府保証公営企業債券	2,000,000	2,059,520	
第861回政府保証公営企業債券	18,000,000	18,555,300	
第862回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,181,650	
第863回政府保証公営企業債券	12,000,000	12,510,480	
第865回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,406,710	
第866回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,140,010	
第867回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,172,520	

	第868回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,222,500	
	第872回政府保証公営企業債券	64,000,000	67,193,600	
	第873回政府保証公営企業債券	90,000,000	94,318,200	
	第874回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,442,980	
	第875回政府保証公営企業債券	74,000,000	77,733,300	
	第877回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,948,000	
	第879回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,770,000	
	第880回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,862,200	
	第881回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,227,000	
	第882回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,057,210	
	第885回政府保証公営企業債券	40,000,000	42,581,600	
	第886回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,209,970	
	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	113,100,000	
	第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	11,379,900	
	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	34,027,620	
	第8回政府保証日本政策投資銀行債券	2,000,000	2,017,800	
	第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,465,000	46,324,997	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	60,000,000	61,428,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	101,418,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,926,000	
	第90回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,634,000	
	第96回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,312,000	
	第98回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,637,000	
	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	106,197,000	
	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	110,578,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	59,248,000	63,942,219	
	第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,104,000	48,302,775	
	銘柄数:254	16,037,324,000	16,805,011,354	
社債券	第101回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	107,241,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	109,847,000	
	第11回パナソニック	100,000,000	102,898,000	
	第11回三井住友銀行	100,000,000	106,998,000	
	第11回商船三井	100,000,000	100,271,000	
	第11回電源開発	100,000,000	108,976,000	
	第12回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	106,393,000	
	第138回オリックス	100,000,000	104,660,000	
	第13回東京地下鉄	100,000,000	103,514,000	
	第14回トヨタ自動車	100,000,000	102,860,000	
	第15回ダイキン工業	100,000,000	102,823,000	
	第15回豊田自動織機	100,000,000	102,300,000	
	第16回ジェイエフイーホールディングス	100,000,000	101,764,000	
第172回オリックス	100,000,000	100,680,000		
第17回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	100,000,000	100,526,000		

第17回東日本旅客鉄道	100,000,000	112,809,000	
第17回野村ホールディングス	100,000,000	100,803,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライフ ファイゼン・ボエレン	100,000,000	101,366,000	
第18回みずほ銀行	100,000,000	111,941,000	
第19回味の素	100,000,000	100,677,000	
第1回東海旅客鉄道	50,000,000	50,006,000	
第1回日東電工	100,000,000	100,294,000	
第20回大阪瓦斯	100,000,000	109,077,000	
第21回サントリー	100,000,000	100,048,000	
第22回シティグループ・インク	100,000,000	100,631,000	
第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピ タル・コーポレーション	100,000,000	100,274,000	
第23回三菱UFJリース	100,000,000	100,655,000	
第245回四国電力	100,000,000	109,574,000	
第24回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,715,000	
第257回北海道電力	100,000,000	107,637,000	
第25回ホンダファイナンス	100,000,000	101,197,000	
第25回三井住友銀行	100,000,000	113,573,000	
第25回日本郵船	100,000,000	113,242,000	
第261回北海道電力	12,000,000	13,048,560	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	106,157,000	
第26回東海旅客鉄道	100,000,000	108,270,000	
第27回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,746,000	
第27回エヌ・ティ・ティ・データ	100,000,000	102,022,000	
第27回三井住友銀行	100,000,000	106,740,000	
第281回北陸電力	100,000,000	106,667,000	
第28回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,808,000	
第28回西日本旅客鉄道	100,000,000	112,044,000	
第28回東京瓦斯	100,000,000	116,115,000	
第2回麒麟ホールディングス	100,000,000	101,141,000	
第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・ エス・エイ	100,000,000	100,266,000	
第2回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,806,000	
第31回アサヒビール	100,000,000	100,302,000	
第32回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	107,281,000	
第32回住友商事	100,000,000	104,685,000	
第32回東日本旅客鉄道	100,000,000	114,625,000	
第33回大成建設	100,000,000	101,196,000	
第354回中国電力	100,000,000	106,590,000	
第378回東北電力	100,000,000	107,660,000	
第37回三菱化学	100,000,000	107,632,000	
第382回東北電力	10,000,000	10,856,000	
第38回野村ホールディングス	100,000,000	100,581,000	
第394回九州電力	100,000,000	105,121,000	
第39回野村ホールディングス	100,000,000	101,791,000	
第3回住友信託銀行	100,000,000	100,305,000	
第3回松下電工	100,000,000	101,863,000	
第3回西日本旅客鉄道	70,000,000	76,465,900	
第3回東日本旅客鉄道	3,000,000	3,228,120	
第3回富士フイルムホールディングス	100,000,000	101,987,000	
第400回九州電力	100,000,000	107,083,000	
第407回中部電力	100,000,000	104,478,000	

第428回東京電力	10,000,000	10,188,000	
第42回ソフトバンク	100,000,000	100,921,000	
第42回三菱電機	100,000,000	100,324,000	
第42回住友化学	100,000,000	100,429,000	
第435回東北電力	100,000,000	104,140,000	
第445回東北電力	100,000,000	106,023,000	
第450回関西電力	100,000,000	104,011,000	
第46回伊藤忠商事	100,000,000	105,525,000	
第473回関西電力	100,000,000	105,030,000	
第473回中部電力	100,000,000	102,387,000	
第47回東海旅客鉄道	100,000,000	110,536,000	
第486回中部電力	100,000,000	105,878,000	
第49回小田急電鉄	100,000,000	100,372,000	
第4回ピー・エヌ・ピー・パリバ	100,000,000	100,296,000	
第4回プレミア投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,110,000	
第4回森トラスト総合リート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,982,000	
第4回東京地下鉄	10,000,000	11,713,100	
第50回日本電信電話	100,000,000	102,207,000	
第515回東京電力	100,000,000	99,011,000	
第51回神戸製鋼所	100,000,000	100,575,000	
第520回東京電力	100,000,000	97,698,000	
第525回東京電力	100,000,000	95,398,000	
第52回東海旅客鉄道	100,000,000	112,061,000	
第52回日本電信電話	100,000,000	104,819,000	
第531回東京電力	100,000,000	94,704,000	
第536回東京電力	100,000,000	93,560,000	
第542回東京電力	100,000,000	92,715,000	
第545回東京電力	100,000,000	93,281,000	
第546回東京電力	10,000,000	9,965,700	
第55回日産自動車	100,000,000	100,525,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	113,739,000	
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	100,917,000	
第5回セブン銀行	100,000,000	100,298,000	
第5回日本たばこ産業	100,000,000	100,271,000	
第63回日本電信電話	100,000,000	100,432,000	
第65回三菱地所	100,000,000	106,548,000	
第65回東京急行電鉄	100,000,000	100,219,000	
第69回東日本旅客鉄道	100,000,000	105,406,000	
第6回みずほ銀行	100,000,000	105,180,000	
第6回りそな銀行	100,000,000	109,174,000	
第70回丸紅	100,000,000	100,438,000	
第7回オリエンタルランド	100,000,000	103,372,000	
第7回みずほコーポレート銀行	100,000,000	110,706,000	
第84回住友不動産	100,000,000	100,171,000	
第8回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,494,000	
第8回フランス相互信用連合銀行(BFCM)	100,000,000	100,115,000	
第8回日興コーディアルグループ	100,000,000	100,972,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,301,000	
第9回沖縄電力	100,000,000	102,502,000	

	第9回三菱UFJ信託銀行	100,000,000	107,446,000	
	銘柄数：115	10,875,000,000	11,273,916,380	
合計		177,250,054,000	187,533,112,861	

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。

「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)	(平成26年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		1,185,571,232	1,424,100,239
コール・ローン		2,247,093,458	4,306,956,532
株式		159,469,953,294	156,122,612,975
投資証券		3,670,223,095	3,194,913,916
派生商品評価勘定		104,432,409	229,572,567
未収入金		699,405	2,051,107
未収配当金		231,852,112	265,297,198
未収利息		4,309	3,539
差入委託証拠金		632,282,569	1,006,050,753
流動資産合計		167,542,111,883	166,551,558,826
資産合計		167,542,111,883	166,551,558,826
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		16,247,583	6,837,815
未払解約金		230,050,000	216,950,000
流動負債合計		246,297,583	223,787,815
負債合計		246,297,583	223,787,815
純資産の部			
元本等			
元本	1	129,060,389,058	98,382,507,045
剰余金			
剰余金又は欠損金()		38,235,425,242	67,945,263,966
元本等合計		167,295,814,300	166,327,771,011
純資産合計		167,295,814,300	166,327,771,011
負債純資産合計		167,542,111,883	166,551,558,826

(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	<p>株式、投資証券</p> <p>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。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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>
3 収益及び費用の計上基準	<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> <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)	(平成26年 2月20日現在)
1 期首元本額	140,608,680,472円	129,060,389,058円
期中追加設定元本額	26,878,620,365円	19,598,144,073円
期中一部解約元本額	38,426,911,779円	50,276,026,086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	9,135,027,115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	6,458,830,447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	30,689,729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	100,283,767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	4,695,022,888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	607,713,102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	49,520,396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	5,091,170,138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	7,724,588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	59,304,211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	31,149,269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	18,837,964,967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	76,076,424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	3,317,451,734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	1,690,302,902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	224,682,982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	306,432,168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	3,099,615,076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	804,624,139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	4,171,755,278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	911,300,213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>	3,715,644,034円	2,685,032,717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>	130,181,513円	19,594,771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>	96,780,521円	71,234,414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>	149,538,195円	91,046,969円
ステート・ストリート4資産バランス30 VA2<適格機関投資家限定>	108,093,752円	62,105,797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>	859,884,557円	603,910,815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>	7,486,875円	5,843,320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>	11,096,048円	7,973,187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>	142,946円	127,227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	72,986,637円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドV A 3 < 適格機関投資家限定 >	24,665,324,629円	17,861,007,137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 >	807,457,937円	567,391,973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 >	7,676,916円	37,064,529円
ワールドエクイティ・ファンドV L < 適格 機関投資家限定 >	17,073,204,681円	16,590,546,019円
計	129,060,389,058円	98,382,507,045円
2 受益権の総数	129,060,389,058口	98,382,507,045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)	(平成26年 2月20日現在)
----	-----------------	-----------------

1 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。	同左
2 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>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「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>	同左

(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)	(平成26年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	11,757,237,014	2,806,470,626
投資証券	226,150,372	172,683,632
合計	11,983,387,386	2,979,154,258

(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

(単位：円)

区分	種類	(平成26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				
	MINI S&P 500	4,231,811,015		4,303,294,048	71,483,033
	S&P 60	362,686,293		373,711,359	11,025,066
	SPI 200	294,638,910		309,580,774	14,941,864
	FTSE100INDEX	778,617,026		808,401,362	29,784,336
	FSMI INDEX	345,612,630		354,409,013	8,796,383
	EURO STOXX 50	1,019,245,050		1,047,829,536	28,584,486
	合計	7,032,610,924		7,197,226,092	164,615,168

(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

(単位：円)

区分	種類	(平成26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	4,199,186,018		4,235,195,000	36,008,982
	カナダ・ドル	243,926,700		246,360,900	2,434,200
	オーストラリア・ドル	195,490,757		202,422,000	6,931,243
	イギリス・ポンド	588,628,381		605,488,000	16,859,619
	ユーロ	30,896,800		30,912,200	15,400
	売建				
	アメリカ・ドル	715,123,894		717,795,000	2,671,106
	カナダ・ドル	47,099,724		47,057,700	42,024
	オーストラリア・ドル	32,841,342		33,123,600	282,258
	イギリス・ポンド	101,051,480		102,336,000	1,284,520
	ユーロ	28,168,000		28,102,000	66,000
	合計	6,182,413,096		6,248,792,400	58,119,584

(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	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成25年 2月20日現在)	(平成26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)	1.2963円 (12,963円)	1.6906円 (16,906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	ONE GAS INC	2,800	33.10	92,680.00
	ANADARKO PETROLEUM CORP	26,680	83.73	2,233,916.40
	APACHE CORP	20,639	84.07	1,735,120.73
	BAKER HUGHES	24,220	60.70	1,470,154.00
	CABOT OIL GAS CORP	22,200	40.07	889,554.00
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	13,408	61.57	825,530.56
	CHENIERE ENERGY INC	10,918	47.64	520,133.52
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	28,700	26.40	757,680.00
	CHEVRON CORPORATION	103,200	113.60	11,723,520.00
	CIMAREX ENERGY CO	4,700	111.84	525,648.00
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	13,800	17.26	238,188.00
	CONCHO RESOURCES INC	5,700	114.83	654,531.00
	CONOCOPHILLIPS	61,900	65.00	4,023,500.00
	CONSOL ENERGY INC	12,300	39.79	489,417.00
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,200	116.86	257,092.00
	CORE LABORATORIES N.V.	2,500	189.26	473,150.00
	DENBURY RESOURCES INC	19,000	16.19	307,610.00
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,040	64.25	1,351,820.00
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,900	47.73	186,147.00
	ENERGEN CORP	4,000	77.53	310,120.00
	ENSCO PLC CL A	12,197	51.68	630,340.96
	EOG RESOURCES INC	14,454	178.86	2,585,242.44
	EQT CORPORATION	7,900	100.01	790,079.00
	EXXON MOBIL CORPORATION	235,200	93.95	22,097,040.00
	FMC TECHNOLOGIES INC	12,400	50.52	626,448.00
	HALLIBURTON CO	44,934	54.53	2,450,251.02
	HELMERICH & PAYNE	5,700	93.93	535,401.00
	HESS CORP	16,900	80.71	1,363,999.00
	HOLLYFRONTIER CORP	9,843	45.86	451,399.98
	KINDER MORGAN INC	36,793	33.15	1,219,687.95
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	5,956	74.65	444,615.40
	MARATHON OIL CORP	38,857	33.34	1,295,492.38
	MARATHON PETROLEUM CORP	17,104	87.02	1,488,390.08
	MURPHY OIL CORP	9,500	57.59	547,105.00
	NABORS INDUSTRIES	17,166	21.15	363,060.90
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,631	76.46	1,730,366.26
	NOBLE CORP PLC	13,448	31.20	419,577.60
	NOBLE ENERGY INC	19,600	66.60	1,305,360.00
	OCCIDENTAL PETROLEUM	42,946	94.94	4,077,293.24
	OCEANEERING INTL INC	5,847	71.75	419,522.25
PEABODY ENERGY CORP	13,600	17.10	232,560.00	
PHILLIPS 66	30,860	75.27	2,322,832.20	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,324	188.04	1,377,204.96	
QEP RESOURCES INC	9,500	32.01	304,095.00	
RANGE RESOURCES CORP	8,600	87.58	753,188.00	
ROWAN COMPANIES PLC	6,898	32.12	221,563.76	
SCHLUMBERGER LTD	70,587	90.48	6,386,711.76	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	18,400	42.85	788,440.00	

SPECTRA ENERGY CORP	36,519	37.12	1,355,585.28
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	8,900	27.09	241,101.00
TESORO CORP	7,282	50.30	366,284.60
VALERO ENERGY CORP	28,726	50.50	1,450,663.00
WEATHERFORD INTL LTD	43,260	14.95	646,737.00
WHITING PETROLEUM CORP	6,600	61.35	404,910.00
WILLIAMS COS	37,341	40.50	1,512,310.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	11,496	117.08	1,345,951.68
AIRGAS INC	3,400	105.39	358,326.00
ALBEMARLE CORP	4,300	64.41	276,963.00
ALCOA INC	57,788	11.76	679,586.88
ASHLAND INC	3,955	94.82	375,013.10
AVERY DENNISON CORP	5,557	49.24	273,626.68
BALL CORP	7,400	54.91	406,334.00
CELANESE CORP DEL COM SER A	9,100	52.33	476,203.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,000	237.62	712,860.00
CROWN HOLDINGS INC	7,500	44.25	331,875.00
DOW CHEMICAL CO	64,374	46.44	2,989,528.56
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	49,078	64.26	3,153,752.28
EASTMAN CHEMICAL CO	8,000	82.05	656,400.00
ECOLAB INC	14,394	101.97	1,467,756.18
FMC CORP	7,100	72.66	515,886.00
FREEMONT MCMORAN C & G B	55,066	33.17	1,826,539.22
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	4,189	91.51	383,335.39
INT'L PAPER CO	22,290	48.71	1,085,745.90
LYONDELLBASELL INDU CL A	22,500	84.28	1,896,300.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,600	115.93	301,418.00
MEADWESTVACO CORP	9,040	35.81	323,722.40
MONSANTO CO	28,378	109.20	3,098,877.60
MOSAIC CO/THE	15,601	47.45	740,267.45
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	25,953	23.77	616,902.81
NUCOR CORP	17,284	50.67	875,780.28
OWENS-ILLINOIS INC	8,700	34.01	295,887.00
PPG INDUSTRIES	7,562	187.06	1,414,547.72
PRAXAIR	15,689	128.15	2,010,545.35
ROCK-TENN COMPANY -CL A	3,900	108.95	424,905.00
SEALED AIR CORP	10,810	32.40	350,244.00
SHERWIN-WILLIAMS CO	4,764	193.08	919,833.12
SIGMA-ALDRICH	6,268	93.77	587,750.36
VULCAN MATERIALS CO	6,956	64.92	451,583.52
3M CO	34,556	130.56	4,511,631.36
AGCO CORP	5,500	51.83	285,065.00
AMETEK INC	12,800	51.61	660,608.00
B/E AEROSPACE INC	5,518	81.49	449,661.82
BOEING CO	38,198	128.39	4,904,241.22
CATERPILLAR	34,500	96.21	3,319,245.00
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	5,177	79.96	413,952.92
CUMMINS ENGINE CO	9,700	139.98	1,357,806.00

DANAHER CORP	31,416	75.28	2,364,996.48
DEERE & CO	19,292	84.29	1,626,122.68
DOVER CORP	9,314	86.58	806,406.12
EATON CORP PLC	25,104	72.13	1,810,751.52
EMERSON ELECTRIC CO	38,008	63.27	2,404,766.16
FASTENAL CO	14,700	45.10	662,970.00
FLOWSERVE CORP	7,600	80.60	612,560.00
FLUOR CORP	8,668	80.25	695,607.00
GENERAL DYNAMICS CORP	15,796	105.26	1,662,686.96
GENERAL ELECTRIC CO	543,839	25.40	13,813,510.60
GRAINGER (WW)	3,045	248.00	755,160.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,737	92.95	3,693,554.15
ILLINOIS TOOL WORKS	22,540	79.41	1,789,901.40
INGERSOLL-RAND PLC	15,859	58.73	931,399.07
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,400	60.27	445,998.00
JOY GLOBAL INC	6,000	55.87	335,220.00
KBR INC COM	8,300	31.69	263,027.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,800	113.67	545,616.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	14,489	162.65	2,356,635.85
MASCO CORP	20,423	22.02	449,714.46
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,592	119.05	1,380,027.60
PACCAR INC	19,306	61.81	1,193,303.86
PALL CORP	6,300	84.75	533,925.00
PARKER HANNIFIN CORP	8,162	116.75	952,913.50
PENTAIR LTD REGISTERED	10,992	77.83	855,507.36
PRECISION CASTPARTS CORP	7,700	255.14	1,964,578.00
QUANTA SERVICES INC	10,700	32.10	343,470.00
RAYTHEON COMPANY	17,599	95.16	1,674,720.84
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,522	118.00	887,596.00
ROCKWELL COLLINS	6,909	78.80	544,429.20
ROPER INDUSTRIES INC	5,200	135.05	702,260.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,900	40.27	277,863.00
SPX CORP	2,444	104.83	256,204.52
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,960	80.66	642,053.60
TEXTRON	14,552	37.27	542,353.04
TRANSDIGM GROUP INC	2,800	176.58	494,424.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	46,476	114.04	5,300,123.04
XYLEM INC	10,430	37.62	392,376.60
ADT CORP/THE	11,325	31.45	356,171.25
CINTAS CORP	5,299	58.93	312,270.07
DUN & BRADSTREET CORP	1,900	95.59	181,621.00
EQUIFAX INC	6,803	69.96	475,937.88
IHS INC	3,300	117.19	386,727.00
IRON MOUNTAIN INC	7,980	28.31	225,913.80
MANPOWER GROUP	4,354	75.98	330,816.92
NIELSEN HOLDINGS N	12,230	46.38	567,227.40
REPUBLIC SERVICES INC	15,630	33.73	527,199.90
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	6,940	40.74	282,735.60

STERICYCLE INC	4,600	115.50	531,300.00
TOWERS WATSON + CO CL A	3,503	108.76	380,986.28
TYCO INTERNATIONAL LTD	25,151	41.76	1,050,305.76
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,200	65.49	537,018.00
WASTE MANAGEMENT (NEW)	24,323	41.19	1,001,864.37
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,300	53.77	446,291.00
CSX CORP	53,870	27.09	1,459,338.30
DELTA AIR LINES INC	12,400	30.57	379,068.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	11,104	41.15	456,929.60
FEDEX CORP	15,896	131.35	2,087,939.60
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	20,500	25.81	529,105.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,000	71.42	357,100.00
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	306,000	0.63	192,780.00
KANSAS CITY SOUTHERN	5,900	91.12	537,608.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,023	90.32	1,537,517.36
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,710	20.95	182,474.50
UNION PACIFIC CORP	24,700	175.87	4,343,989.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	5,327	43.28	230,552.56
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	38,457	95.18	3,660,337.26
AUTOLIV INC	5,400	94.87	512,298.00
BORGWARNER INC	12,000	59.27	711,240.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,022	65.15	1,043,833.30
FORD MOTOR COMPANY	195,521	15.25	2,981,695.25
GENERAL MOTORS CO	51,400	36.03	1,851,942.00
HARLEY-DAVIDSON	12,158	63.10	767,169.80
JOHNSON CONTROLS	36,242	49.30	1,786,730.60
TESLA MOTORS INC	4,600	193.64	890,744.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,400	80.36	514,304.00
COACH INC	14,766	47.84	706,405.44
DR HORTON INC	16,366	23.16	379,036.56
FOSSIL GROUP INC	2,700	119.15	321,705.00
GARMIN LTD	6,600	51.68	341,088.00
HASBRO INC	6,800	53.87	366,316.00
LEGGETT & PLATT INC	8,000	31.23	249,840.00
LENNAR CORP-CL A	9,112	40.94	373,045.28
LULULEMON ATHLETICA INC	6,000	51.21	307,260.00
MATTEL	18,761	35.24	661,137.64
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	10,600	97.78	1,036,468.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,100	144.04	446,524.00
NEWELL RUBBERMAID INC	16,289	31.45	512,289.05
NIKE B	37,892	74.82	2,835,079.44
POLARIS INDUSTRIES INC	3,689	129.66	478,315.74
PULTE GROUP INC	19,763	19.66	388,540.58
PVH CORP	4,200	118.20	496,440.00
RALPH LAUREN CORP	3,174	156.97	498,222.78
TOLL BROTHERS INC	9,400	37.06	348,364.00
UNDER ARMOUR INC CLASS A	4,497	107.03	481,313.91
VF CORP	19,356	56.67	1,096,904.52

WHIRLPOOL CORP	4,174	135.11	563,949.14
BLOCK (H&R)	15,384	31.41	483,211.44
CARNIVAL CORP	20,215	39.18	792,023.70
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,700	552.18	938,706.00
DARDEN RESTAURANTS	7,319	48.96	358,338.24
INT'L GAME TECHNOLOGY	14,821	14.53	215,349.13
LAS VEGAS SANDS CORP	21,800	79.69	1,737,242.00
MARRIOTT INT'L A	13,267	51.54	683,781.18
MCDONALD'S CORP	53,250	95.55	5,088,037.50
MGM RESORTS INTERNATIONAL	20,100	25.75	517,575.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,200	51.13	419,266.00
STARBUCKS CORP	40,012	73.32	2,933,679.84
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	10,213	77.92	795,796.96
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,200	69.29	498,888.00
WYNN RESORTS LTD	4,200	220.92	927,864.00
YUM! BRANDS INC	23,664	72.82	1,723,212.48
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,200	16.12	196,664.00
CBS CORP-CL B	30,017	65.82	1,975,718.94
CHARTER COMMUNICATION-A	3,152	130.44	411,146.88
COMCAST CORP-CL A	113,788	51.57	5,868,047.16
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	26,360	49.81	1,312,991.60
DIRECTV	27,656	72.94	2,017,228.64
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	8,245	81.14	668,999.30
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,545	75.41	342,738.45
DISH NETWORK CORP-A	12,197	56.52	689,374.44
DISNEY (WALT) CO NEW	90,506	78.87	7,138,208.22
INTERPUBLIC GROUP OF COS	21,716	16.70	362,657.20
LIBERTY GLOBAL PLC A	10,835	87.06	943,295.10
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	8,388	86.24	723,381.12
LIBERTY MEDIA CORP	5,073	135.21	685,920.33
NEWS CORP - CLASS A	21,956	17.59	386,206.04
OMNICOM GROUP	14,188	75.45	1,070,484.60
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,800	79.26	380,448.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	161,800	3.57	577,626.00
TIME WARNER CABLE INC-A	15,172	141.00	2,139,252.00
TIME WARNER INC	48,943	64.62	3,162,696.66
TWENTY FIRST CENTURY FOX	23,018	31.89	734,044.02
TWENTY FIRST CENTURY FOX INC	80,527	32.77	2,638,869.79
VIACOM INC-CLASS B	22,617	86.02	1,945,514.34
ADOVANCE AUTO PARTS	3,950	125.94	497,463.00
AMAZON COM INC	19,523	347.38	6,781,899.74
AUTOZONE INC	1,959	536.34	1,050,690.06
BED BATH & BEYOND INC	11,387	65.49	745,734.63
BEST BUY COMPANY INC	14,757	24.88	367,154.16
CARMAX INC	12,150	47.37	575,545.50
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,000	51.21	307,260.00
DOLLAR GENERAL CORP	17,000	57.44	976,480.00

DOLLAR TREE INC	12,100	52.19	631,499.00
EXPEDIA INC	6,227	79.62	495,793.74
FAMILY DOLLAR STORES	5,844	65.67	383,775.48
GAMESTOP CORP NEW	6,800	35.60	242,080.00
GAP	16,773	42.19	707,652.87
GENUINE PARTS CO	8,100	86.46	700,326.00
HOME DEPOT	76,388	76.45	5,839,862.60
KOHL'S CORP	11,621	51.16	594,530.36
L BRANDS INC	12,890	53.66	691,677.40
LIBERTY INTERACTIVE CORP	26,678	29.05	774,995.90
LKQ CORP	16,945	28.98	491,066.10
LOWE'S COMPANIES	55,932	46.54	2,603,075.28
MACY'S INC	19,950	53.34	1,064,133.00
NETFLIX INC	2,700	428.23	1,156,221.00
NORDSTROM INC	8,500	58.88	500,480.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,900	153.21	903,939.00
PETSMART INC	5,300	64.27	340,631.00
PRICELINE COM INC	2,780	1,273.76	3,541,052.80
ROSS STORES INC	11,900	67.80	806,820.00
SEARS HOLDINGS CORPORATION	1,856	40.98	76,058.88
STAPLES	34,239	12.98	444,422.22
TARGET CORP	31,770	57.31	1,820,738.70
TIFFANY & CO	7,225	88.39	638,617.75
TJX COMPANIES INC	38,026	59.85	2,275,856.10
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,800	65.62	511,836.00
TRIPADVISOR INC	6,371	93.76	597,344.96
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,300	87.56	288,948.00
URBAN OUTFITTERS INC	6,600	36.32	239,712.00
COSTCO WHOLESALE CORP	23,190	114.91	2,664,762.90
CVS CAREMARK CORP	65,420	70.10	4,585,942.00
KROGER CO	26,854	38.77	1,041,129.58
SAFEWAY INC	12,451	34.61	430,929.11
SYSCO CORP	31,289	35.82	1,120,771.98
WALGREEN CO	47,762	65.51	3,128,888.62
WAL-MART STORES	87,384	74.85	6,540,692.40
WHOLE FOODS MARKET INC	19,300	52.31	1,009,583.00
ALTRIA GROUP INC	106,723	35.16	3,752,380.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	36,054	39.95	1,440,357.30
BEAM INC	8,168	83.19	679,495.92
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,962	81.02	564,061.24
BUNGE LIMITED	7,700	78.40	603,680.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,506	43.55	457,536.30
COCA COLA ENTERPRISES	13,700	46.15	632,255.00
COCA-COLA CO	212,970	37.10	7,901,187.00
CONAGRA FOODS	22,069	28.94	638,676.86
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,900	80.02	712,178.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	10,962	50.96	558,623.52
GENERAL MILLS	34,022	49.27	1,676,263.94

GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	6,700	117.94	790,198.00
HORMEL FOODS CORP	7,500	45.31	339,825.00
JM SMUCKER CO	5,788	95.55	553,043.40
KELLOGG CO	13,840	59.73	826,663.20
KRAFT FOODS GROUP INC	31,577	54.56	1,722,841.12
LORILLARD INC	20,438	47.47	970,191.86
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,800	65.45	445,060.00
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,982	78.63	863,514.66
MOLSON COORS BREWING CO-B	8,500	56.12	477,020.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	90,009	34.26	3,083,708.34
MONSTER BEVERAGE CORP	7,383	73.15	540,066.45
PEPSICO INC	82,314	77.10	6,346,409.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC- W/I	86,333	79.60	6,872,106.80
REYNOLDS AMERICAN INC	17,800	47.64	847,992.00
THE HERSHEY COMPANY	8,400	106.35	893,340.00
TYSON FOODS INC-CL A	15,200	38.29	582,008.00
AVON PRODUCTS	23,238	15.10	350,893.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,800	65.56	511,368.00
CLOROX CO	7,024	86.87	610,174.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	49,400	61.53	3,039,582.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,200	96.13	307,616.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	13,000	67.39	876,070.00
HERBALIFE LTD	5,100	66.18	337,518.00
KIMBERLY-CLARK CORP	20,323	108.78	2,210,735.94
PROCTER & GAMBLE CO	146,179	78.14	11,422,427.06
ABBOTT LABORATORIES	82,709	38.76	3,205,800.84
AETNA INC	19,689	69.08	1,360,116.12
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,392	68.11	844,019.12
BARD (C.R.) INC	4,092	139.13	569,319.96
BAXTER INTERNATIONAL	28,837	69.12	1,993,213.44
BECTON DICKINSON	10,651	113.99	1,214,107.49
BOSTON SCIENTIFIC CORP	73,077	13.06	954,385.62
CARDINAL HEALTH INC	18,584	70.94	1,318,348.96
CAREFUSION CORP	11,542	41.05	473,799.10
CERNER CORP	16,800	59.89	1,006,152.00
CIGNA CORP	15,432	76.44	1,179,622.08
COVIDIEN PLC	24,357	70.78	1,723,988.46
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	9,600	66.07	634,272.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,300	44.69	326,237.00
EDWARDS LIFESCIENCES	6,000	67.02	402,120.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	43,318	76.38	3,308,628.84
HCA HOLDINGS INC	15,164	49.56	751,527.84
HENRY SCHEIN INC	4,500	116.86	525,870.00
HOLOGIC INC	15,116	21.39	323,331.24
HUMANA	8,600	101.98	877,028.00
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	2,130	439.96	937,114.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,844	92.09	446,083.96

MCKESSON CORP	12,162	177.66	2,160,700.92
MEDTRONIC INC	53,603	56.20	3,012,488.60
OMNICARE INC	5,300	60.98	323,194.00
PATTERSON COS INC	4,300	39.74	170,882.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	8,146	52.77	429,864.42
RESMED INC	8,133	46.14	375,256.62
ST JUDE MEDICAL INC	15,124	66.98	1,013,005.52
STRYKER CORP	16,490	81.64	1,346,243.60
UNITED HEALTH GROUP INC	54,190	73.55	3,985,674.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,876	82.00	399,832.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,560	81.78	454,696.80
WELLPOINT INC	15,772	87.50	1,380,050.00
ZIMMER HOLDINGS INC	8,931	94.70	845,765.70
ABBVIE INC	84,497	51.19	4,325,401.43
ACTAVIS PLC	9,199	210.56	1,936,941.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,020	55.94	1,008,038.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,300	180.41	1,858,223.00
ALLERGAN INC	15,700	125.00	1,962,500.00
AMGEN INC	40,179	123.35	4,956,079.65
BIOGEN IDEC INC	12,633	328.45	4,149,308.85
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,521	76.35	574,228.35
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,692	53.46	4,688,014.32
CELGENE CORP	21,900	163.00	3,569,700.00
FOREST LABORATORIES INC	13,100	93.98	1,231,138.00
GILEAD SCIENCES INC	81,628	82.70	6,750,635.60
HOSPIRA INC	8,520	43.78	373,005.60
ILLUMINA INC	6,600	170.16	1,123,056.00
JOHNSON & JOHNSON	150,521	91.64	13,793,744.44
LILLY (ELI) & CO	53,894	58.09	3,130,702.46
MERCK & CO	156,174	55.04	8,595,816.96
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,607	243.80	391,786.60
MYLAN INC	20,100	51.15	1,028,115.00
PERRIGO CO PLC	6,816	154.72	1,054,571.52
PFIZER	353,496	31.48	11,128,054.08
PHARMACYCLICS INC	3,339	138.86	463,653.54
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,200	324.36	1,362,312.00
THERMO ELECTRON CORP	19,178	121.81	2,336,072.18
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,500	82.60	1,032,500.00
WATERS CORPORATION	4,427	112.12	496,355.24
ZOETIS INC	27,207	29.75	809,408.25
BB&T CORPORATION	37,200	36.81	1,369,332.00
CIT GROUP INC	10,900	47.13	513,717.00
COMERICA	9,922	46.78	464,151.16
FIFTH THIRD BANCORP	46,420	21.31	989,210.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,406	49.64	218,713.84
HUDSON CITY BANCORP INC	27,800	9.10	252,980.00
KEYCORP	49,191	12.64	621,774.24
M & T BANK CORP	6,104	112.24	685,112.96

NEW YORK COMMUNITY BANCORP	22,669	15.38	348,649.22
OCWEN FINANCIAL CORP	6,161	36.28	223,521.08
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	17,000	13.91	236,470.00
PNC BANK CORP	28,265	79.67	2,251,872.55
REGIONS FINANCIAL CORP	75,845	10.10	766,034.50
SUNTRUST BANKS	29,323	36.92	1,082,605.16
US BANCORP	97,981	39.95	3,914,340.95
WELLS FARGO COMPANY	269,351	45.53	12,263,551.03
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,800	187.42	524,776.00
AMERICAN EXPRESS	51,744	88.84	4,596,936.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,828	106.66	1,154,914.48
BANK NEW YORK MELLO CORP	61,000	31.13	1,898,930.00
BANK OF AMERICA CORP	573,448	16.20	9,289,857.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,950	113.36	6,682,572.00
BLACKROCK INC	7,100	300.49	2,133,479.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	31,111	70.95	2,207,325.45
CITIGROUP INC	162,292	48.19	7,820,851.48
CME GROUP INC	17,350	74.77	1,297,259.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,442	56.85	1,503,227.70
EATON VANCE CORP	6,400	37.34	238,976.00
FRANKLIN RESOURCES INC	22,605	52.86	1,194,900.30
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,690	163.26	3,704,369.40
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP INC	6,250	211.78	1,323,625.00
INVESCO LTD	23,180	33.82	783,947.60
JPMORGAN CHASE & CO	200,974	57.26	11,507,771.24
LEGG MASON INC	6,518	43.90	286,140.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	17,700	27.62	488,874.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	13,770	80.50	1,108,485.00
MOODY'S CORPORATION	10,786	79.21	854,359.06
MORGAN STANLEY	78,044	28.96	2,260,154.24
NORTHERN TRUST CORP	12,205	61.43	749,753.15
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,415	51.68	331,527.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	61,211	25.56	1,564,553.16
SEI INVESTMENTS CO COM	8,200	33.96	278,472.00
SLM CORP	24,156	23.71	572,738.76
STATE STREET CORP	23,590	68.05	1,605,299.50
T ROWE PRICE GROUP INC	14,164	79.89	1,131,561.96
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	12,400	32.85	407,340.00
THE NASDAQ OMX GROUP	6,800	39.57	269,076.00
ACE LTD	18,041	96.67	1,744,023.47
AFLAC	24,668	62.44	1,540,269.92
ALLEGHANY CORP	848	376.35	319,144.80
ALLSTATE CORP	25,325	51.79	1,311,581.75
AMERICAN INT'L GROUP	74,675	49.25	3,677,743.75
AON PLC	15,955	84.78	1,352,664.90
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,200	55.22	397,584.00
ASSURANT INC	4,000	63.80	255,200.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,200	43.43	269,266.00

CHUBB CORP	13,970	86.05	1,202,118.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,764	46.56	408,051.84
EVEREST RE GROUP LTD	2,600	148.99	387,374.00
FIDELITY NATIONAL TITLE-CL A	12,585	32.79	412,662.15
HARTFORD FINANCIAL SVCS	23,709	34.36	814,641.24
LINCOLN NATIONAL CORP	14,515	49.60	719,944.00
LOEWS CORP	17,905	43.35	776,181.75
MARSH & MCLENNAN COS	29,093	47.57	1,383,954.01
METLIFE INC	49,557	50.76	2,515,513.32
PARTNERRE LTD	2,600	100.23	260,598.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,400	44.20	680,680.00
PROGRESSIVE CORP	31,088	23.75	738,340.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,620	84.28	2,074,973.60
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,600	93.80	243,880.00
TORCHMARK CORP	4,900	75.72	371,028.00
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	19,835	84.01	1,666,338.35
UNUM GROUP	14,232	33.49	476,629.68
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	8,600	41.78	359,308.00
WR BERKLEY CORP	6,110	40.42	246,966.20
XL GROUP PLC	15,400	29.09	447,986.00
CBRE GROUP INC	14,484	27.24	394,544.16
REALOGY HOLDINGS CORP	6,891	46.19	318,295.29
ACCENTURE PLC-CL A	34,315	83.26	2,857,066.90
ACTIVISION BLIZZARD INC	23,200	19.68	456,576.00
ADOBE SYSTEMS	25,288	67.99	1,719,331.12
AKAMAI TECHNOLOGIES	10,100	60.52	611,252.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,600	280.69	729,794.00
ANSYS INC	5,300	82.46	437,038.00
AUTODESK INC	12,000	54.47	653,640.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	25,603	76.15	1,949,668.45
CA INC	17,225	32.45	558,951.25
CITRIX SYSTEMS INC	10,067	57.24	576,235.08
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,000	99.99	1,599,840.00
COMPUTER SCIENCES CORP	7,633	62.54	477,367.82
EBAY INC	62,028	54.74	3,395,412.72
ELECTRONIC ARTS	15,824	27.91	441,647.84
EQUINIX INC	2,800	192.62	539,336.00
FACEBOOK INC-A	92,080	68.06	6,266,964.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	15,930	53.92	858,945.60
FISERV INC	14,116	56.97	804,188.52
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,737	118.74	443,731.38
GOOGLE INC-CL A	14,650	1,202.83	17,621,459.50
IBM CORP	55,561	182.95	10,164,884.95
INTUIT CORP	15,436	73.42	1,133,311.12
LEIDOS HOLDINGS INC	4,450	45.53	202,608.50
LINKEDIN CORP - A	5,168	196.32	1,014,581.76
MASTERCARD INC-CLASS A	55,600	76.65	4,261,740.00

MICROSOFT CORP	422,683	37.51	15,854,839.33
NETSUITE INC	1,723	114.62	197,490.26
NUANCE COMMUNICATIONS INC	13,000	15.03	195,390.00
ORACLE CORP	185,323	37.87	7,018,182.01
PAYCHEX INC	17,251	41.51	716,089.01
RACKSPACE HOSTING INC	5,900	34.87	205,733.00
RED HAT INC	9,900	58.63	580,437.00
SALESFORCE COM INC COM	30,000	63.02	1,890,600.00
SERVICENOW INC	6,577	66.75	439,014.75
SYMANTEC CORP	36,700	20.54	753,818.00
SYNOPSYS INC	8,715	40.76	355,223.40
TERADATA CORP	8,800	44.31	389,928.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,016	29.69	267,685.04
VANTIV INC CL A	6,448	30.36	195,761.28
VERISIGN INC	7,711	55.25	426,032.75
VISA INC-CLASS A SHARES	27,440	223.88	6,143,267.20
VMWARE INC	4,700	94.33	443,351.00
WESTERN UNION CO	30,215	16.05	484,950.75
WORKDAY INC CLASS A	3,493	97.54	340,707.22
YAHOO! INC	51,388	37.81	1,942,980.28
AMPHENOL CORP-CL A	8,300	88.55	734,965.00
APPLE INC	48,508	537.37	26,066,743.96
ARROW ELECTRONICS INC	5,900	56.15	331,285.00
AVNET	6,800	42.97	292,196.00
CISCO SYSTEMS	285,009	22.28	6,350,000.52
CORNING	79,888	18.92	1,511,480.96
EMC CORP	110,660	25.25	2,794,165.00
FLEXTRONICS INTL LTD	32,245	9.08	292,945.82
FLIR SYSTEMS INC	8,100	31.18	252,558.00
FS NETWORKS INC	4,400	109.65	482,460.00
HARRIS CORP	5,800	72.57	420,906.00
HEWLETT-PACKARD CO	102,622	29.45	3,022,217.90
JUNIPER NETWORKS INC	26,508	27.20	721,017.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,043	64.93	846,881.99
NETAPP INC	18,448	40.53	747,697.44
QUALCOMM	91,492	75.77	6,932,348.84
SANDISK CORP	13,100	74.53	976,343.00
SEAGATE TECHNOLOGY	17,500	49.03	858,025.00
TE CONNECTIVITY LTD	22,541	57.43	1,294,529.63
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,500	38.16	553,320.00
WESTERN DIGITAL CORP	11,600	85.45	991,220.00
XEROX CORP	62,133	10.68	663,580.44
AT & T INC	283,516	32.85	9,313,500.60
CENTURYLINK INC	31,549	30.90	974,864.10
CROWN CASTLE INTL CORP	16,800	74.51	1,251,768.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	55,829	4.68	261,279.72
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	8,200	38.28	313,896.00
SBA COMMUNICATIONS COR	6,900	97.69	674,061.00

SPRINT CORP W/I	45,212	8.16	368,929.92
T MOBILE US INC	8,308	31.25	259,625.00
VERIZON COMMUNICATIONS	152,699	46.53	7,105,084.47
WINDSTREAM HOLDINGS INC	29,700	7.90	234,630.00
AES CORPORATION	36,000	14.41	518,760.00
ALLIANT ENERGY CORP	5,600	53.21	297,976.00
AMEREN CORPORATION	13,777	38.27	527,245.79
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,556	50.15	1,331,783.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,500	43.63	414,485.00
CALPINE CORP	20,100	20.01	402,201.00
CENTERPOINT ENERGY INC	23,148	24.14	558,792.72
CMS ENERGY CORP	15,100	28.38	428,538.00
CONSOLIDATED EDISON	15,982	54.74	874,854.68
DOMINION RESOURCES INC/VA	30,764	70.64	2,173,168.96
DTE ENERGY	9,166	71.47	655,094.02
DUKE ENERGY CORP	37,505	71.72	2,689,858.60
EDISON INTERNATIONAL	16,225	50.70	822,607.50
ENTERGY CORP	9,320	64.46	600,767.20
EXELON CORP	46,809	29.96	1,402,397.64
FIRSTENERGY CORP	21,816	31.73	692,221.68
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,400	55.83	245,652.00
MDU RES GROUP INC	10,100	34.47	348,147.00
NEXTERA ENERGY INC	22,490	92.44	2,078,975.60
NISOURCE INC	16,247	35.40	575,143.80
NORTHEAST UTILITIES	16,471	44.44	731,971.24
NRG ENERGY INC COM NEW	18,400	28.53	524,952.00
OGE ENERGY CORP	11,112	35.58	395,364.96
ONEOK INC NEW	11,200	60.85	681,520.00
PEPCO HOLDINGS INC	12,895	20.49	264,218.55
PG&E CORP	23,434	43.23	1,013,051.82
PINNACLE WEST CAPITAL	6,500	54.36	353,340.00
PPL CORPORATION	33,334	31.61	1,053,687.74
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	27,546	34.97	963,283.62
SCANA CORP	7,100	48.50	344,350.00
SEMPRA ENERGY	12,713	92.63	1,177,605.19
SOUTHERN CO	46,324	42.17	1,953,483.08
WISCONSIN ENERGY CORP	11,800	43.47	512,946.00
XCEL ENERGY INC	26,078	29.54	770,344.12
ALTERA CORPORATION	16,575	35.75	592,556.25
ANALOG DEVICES	16,329	51.57	842,086.53
APPLIED MATERIALS	65,647	18.75	1,230,881.25
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	13,400	57.70	773,180.00
BROADCOM CORP	27,720	30.80	853,776.00
CREE INC	6,600	61.23	404,118.00
INTEL CORP	265,787	24.50	6,511,781.50
KLA-TENCOR CORPORATION	8,948	64.40	576,251.20
LAM RESEARCH CORP	8,800	51.99	457,512.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	12,149	46.04	559,339.96

	LSI CORP	30,700	11.10	340,770.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	21,200	15.77	334,324.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,300	31.28	478,584.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,660	44.90	478,634.00	
	MICRON TECHNOLOGY	54,830	25.42	1,393,778.60	
	NVIDIA CORP	31,600	18.14	573,224.00	
	TEXAS INSTRUMENTS	58,533	43.93	2,571,354.69	
	XILINX INC	14,010	50.87	712,688.70	
アメリカ・ドル	小計	16,460,703		898,087,408.83 (91,847,399,301)	
カナダ・ドル	ALTAGAS LTD	6,813	42.50	289,552.50	
	ARC RESOURCES LTD	16,988	29.51	501,315.88	
	ATHABASCA OIL CORP	19,900	7.73	153,827.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	6,263	40.88	256,031.44	
	CAMECO CORP	21,222	23.77	504,446.94	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	57,676	40.63	2,343,375.88	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	27,600	21.08	581,808.00	
	CENOVUS ENERGY INC	41,248	28.49	1,175,155.52	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	21,105	38.68	816,341.40	
	ENBRIDGE INC	42,395	47.45	2,011,642.75	
	ENCANA CORP	40,045	21.08	844,148.60	
	ENERPLUS CORP	10,582	22.02	233,015.64	
	HUSKY ENERGY INC	18,490	33.86	626,071.40	
	IMPERIAL OIL LTD	15,512	48.45	751,556.40	
	KEYERA CORP	4,571	64.93	296,795.03	
	MEG ENERGY CORP	8,000	32.35	258,800.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,300	15.85	274,205.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,294	39.66	685,880.04	
	PENGROWTH ENERGY CORP	32,313	7.55	243,963.15	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	29,939	8.97	268,552.83	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,264	36.05	297,917.20	
	SUNCOR ENERGY INC	79,828	36.98	2,952,039.44	
	TALISMAN ENERGY INC	53,984	11.85	639,710.40	
	TOURMALINE OIL CORP	8,800	50.76	446,688.00	
	TRANSCANADA CORP	37,430	49.90	1,867,757.00	
	VERMILION ENERGY TRUST	5,400	63.27	341,658.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	9,955	35.83	356,687.65	
	AGRIUM INC	8,039	97.63	784,847.57	
	BARRICK GOLD CORP	57,376	21.91	1,257,108.16	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	35,900	7.80	280,020.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	29,728	21.24	631,422.72	
	FRANCO NEV CORP	8,300	56.64	470,112.00	
GOLDCORP INC	44,287	29.50	1,306,466.50		
KINROSS GOLD CORP	67,662	5.55	375,524.10		
METHANEX CORP	5,079	70.72	359,186.88		
NEW GOLD INC	26,400	6.82	180,048.00		
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	45,830	37.24	1,706,709.20		
SILVER WHEATON CORCOM NPV	18,300	27.62	505,446.00		

TECK RESOURCES LTD	30,808	25.85	796,386.80
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	44,339	3.73	165,384.47
YAMANA GOLD INC	42,813	11.32	484,643.16
BOMBARDIER INC.	81,441	3.55	289,115.55
CAE Inc.	16,050	14.39	230,959.50
FINNING INTERNATIONAL INC	9,602	28.36	272,312.72
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,513	47.27	402,409.51
CANADIAN NATL RAILWAY CO	44,700	61.65	2,755,755.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,550	172.77	1,649,953.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,472	95.84	1,195,316.48
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,100	55.46	338,306.00
TIM HORTONS INC	7,781	57.94	450,831.14
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,656	26.03	563,705.68
THOMSON CORP	19,565	38.07	744,839.55
CANADIAN TIRE CORP.	4,131	98.57	407,192.67
DOLLARAMA INC	3,396	82.20	279,151.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,800	85.00	663,000.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,600	69.47	111,152.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,365	42.28	269,112.20
METRO INC	5,400	62.16	335,664.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	10,859	58.25	632,536.75
WESTON (GEORGE)	2,836	75.69	214,656.84
SAPUTO INC	7,200	53.89	388,008.00
CATAMARAN CORP	10,754	57.38	617,064.52
VALENT PHARMACEUTICALS INTE	16,704	160.96	2,688,675.84
BANK MONTREAL	34,283	72.27	2,477,632.41
BANK OF NOVA SCOTIA	64,715	63.70	4,122,345.50
CANADIAN IMPERIAL BANK	21,143	89.88	1,900,332.84
NATIONAL BANK OF CANADA	16,946	43.76	741,556.96
ROYAL BANK OF CANADA	76,746	72.39	5,555,642.94
TRONTO-DOMINION BANK	98,300	49.52	4,867,816.00
CI FINANCIAL CORP	8,753	35.03	306,617.59
IGM FINANCIAL INC	5,633	54.30	305,871.90
ONEX CORPORATION	5,109	58.93	301,073.37
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	547	439.97	240,663.59
GREAT-WEST LIFE CO INC	16,238	30.89	501,591.82
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4,900	46.76	229,124.00
INTACT FINANCIAL CORP	7,100	66.80	474,280.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	97,460	21.07	2,053,482.20
POWER CORP OF CANADA	18,188	30.43	553,460.84
POWER FINANCIAL CORP	14,058	34.67	487,390.86
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,121	39.37	1,303,973.77
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	30,182	44.52	1,343,702.64
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	14,718	21.29	313,346.22
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,141	17.37	89,299.17
CGI GROUP INC	10,584	35.73	378,166.32
OPEN TEXT CORP	6,200	56.27	348,874.00
BLACKBERRY LTD	26,700	10.00	267,000.00

	BCE INC	13,367	47.46	634,397.82	
	BELL ALIANT INC	4,600	26.25	120,750.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	19,742	42.76	844,167.92	
	TELUS CORP	12,232	37.86	463,103.52	
	ATCO LTD -CLASS I	4,414	50.94	224,849.16	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,000	38.86	272,020.00	
	FORTIS INC	10,800	30.74	331,992.00	
	TRANSALTA CORP.	15,410	14.82	228,376.20	
	カナダ・ドル 小計	2,142,583		77,104,868.86 (7,118,321,493)	
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,424	20.13	169,575.12	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	57,449	14.85	853,117.65	
	SANTOS	50,469	14.24	718,678.56	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	36,016	38.37	1,381,933.92	
	WORLEYPARSONS LTD	12,740	15.51	197,597.40	
	ALUMINA LTD	144,220	1.32	190,370.40	
	AMCOR	62,874	10.50	660,177.00	
	BHP BILLITON LTD	171,237	38.74	6,633,721.38	
	BORAL LIMITED	33,681	5.47	184,235.07	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	83,748	5.84	489,088.32	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	24,582	9.30	228,612.60	
	INCITEC PIVOT LTD	77,907	3.08	239,953.56	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	24,676	13.55	334,359.80	
	NEWCREST MINING	40,126	11.15	447,404.90	
	ORICA	20,823	24.28	505,582.44	
	RIO TINTO LTD	23,833	70.20	1,673,076.60	
	LEIGHTON HOLDINGS	10,276	16.41	168,629.16	
	ALS LTD	19,530	8.47	165,419.10	
	BRAMBLES LTD	81,377	9.05	736,461.85	
	SEEK LTD	18,541	15.70	291,093.70	
	ASCIANO LTD	57,374	5.70	327,031.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	105,096	5.08	533,887.68	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	70,250	1.21	85,002.50	
	SYDNEY AIRPORT	44,518	3.98	177,181.64	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	31,243	5.35	167,150.05	
	TRANSURBAN GROUP	72,940	6.99	509,850.60	
	CROWN RESORTS LTD	22,520	17.52	394,550.40	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	46,314	2.53	117,174.42	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,531	47.97	169,382.07	
	TABCORP HOLDINGS	41,797	3.59	150,051.23	
	TATTS GROUP LTD	81,410	3.03	246,672.30	
	REA GROUP LTD	2,606	46.77	121,882.62	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	39,935	3.14	125,395.90	
METCASH	48,836	3.01	146,996.36		
WESFARMERS LIMITED	52,747	43.18	2,277,615.46		
WOOLWORTHS LIMITED	66,328	36.01	2,388,471.28		
COCA-COLA AMATIL	32,389	11.32	366,643.48		
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,085	3.70	133,514.50		

COCHLEAR LIMITED	2,515	55.72	140,135.80		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,357	44.23	325,400.11		
SONIC HEALTHCARE LIMITED	20,248	16.64	336,926.72		
CSL LIMITED	25,795	70.31	1,813,646.45		
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	146,114	31.85	4,653,730.90		
BANK OF QUEENSLAND LTD	16,677	12.13	202,292.01		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	23,802	11.76	279,911.52		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	85,949	75.00	6,446,175.00		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	125,065	35.26	4,409,791.90		
WESTPAC BANKING	165,379	33.24	5,497,197.96		
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	10,943	37.34	408,611.62		
MACQUARIE GROUP LIMITED	15,117	55.97	846,098.49		
AMP LTD	153,361	4.50	690,124.50		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	118,617	5.46	647,648.82		
QBE INSURANCE GROUP	63,752	11.16	711,472.32		
SUNCORP GROUP LTD	70,034	12.25	857,916.50		
LEND LEASE GROUP	30,719	11.64	357,569.16		
COMPUTERSHARE LIMITED	23,718	12.08	286,513.44		
TELSTRA CORP	237,669	5.25	1,247,762.25		
AGL ENERGY LTD	28,467	15.92	453,194.64		
APA GROUP	46,551	6.44	299,788.44		
SP AUSNET	119,187	1.28	153,155.29		
オーストラリア・ドル 小計	3,395,484		55,772,606.66 (5,137,772,525)		
イギリス・ポンド	IMI PLC	14,840	15.60	231,504.00	
	IMI PLC-C SHARES INCOME	16,961	2.00	33,922.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	54,829	3.17	173,862.75	
	MELROSE INDUSTRIES PLC-REDEMPTION SHS	64,799	0.47	30,455.53	
	AMEC	17,460	11.07	193,282.20	
	BG GROUP PLC	181,161	10.89	1,972,843.29	
	BP PLC	1,005,873	4.95	4,979,071.35	
	PETROFAC	14,609	13.30	194,299.70	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	203,892	21.80	4,445,865.06	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	133,916	23.43	3,137,651.88	
	TULLOW OIL ORD GBPO.10	47,525	7.76	368,794.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	73,857	15.89	1,173,587.73	
	ANTOFAGASTA PLC	22,240	9.59	213,281.60	
	BHP BILLITON PLC	112,415	19.65	2,208,954.75	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,610	25.17	191,543.70	
	FRESNILLO PLC	9,924	9.92	98,446.08	
	GLENCORE XSTRATA PLC	564,479	3.47	1,963,540.20	
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,085	33.10	366,913.50	
	RANDGOLD RESOURCES	4,957	48.38	239,819.66	
	REXAM PLC	40,493	5.24	212,385.78	
RIO TINTO PLC REG	67,689	36.27	2,455,418.47		
BAE SYSTEMS PLC	176,446	4.36	770,716.12		
BUNZL PLC	18,788	14.83	278,626.04		

COBHAM PLC	60,533	2.95	178,572.35
MEGGITT PLC	44,387	5.16	229,258.85
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	99,771	10.00	997,710.00
SMITHS GROUP PLC	22,345	14.10	315,064.50
TRAVIS PERKINS PLC	12,584	19.33	243,248.72
WEIR GROUP PLC/THE	12,054	22.97	276,880.38
WOLSELEY PLC	13,920	33.70	469,104.00
AGGREKO PLC	15,225	16.22	246,949.50
BABCOCK INTL GROUP PLC	20,369	14.33	291,887.77
CAPITA PLC	34,272	10.87	372,536.64
EXPERIAN PLC	54,766	10.95	599,687.70
G4S PLC	79,425	2.34	186,013.35
INTERTEK GROUP PLC	8,672	29.80	258,425.60
SERCO GROUP PLC	27,973	3.99	111,780.10
EASYJET PLC	9,142	17.47	159,710.74
GKN PLC	85,332	4.13	353,018.48
BURBERRY GROUP PLC	23,072	15.09	348,156.48
PERSIMMON PLC	15,538	14.17	220,173.46
CARNIVAL PLC	10,373	24.68	256,005.64
COMPASS GROUP PLC	95,697	9.22	882,326.34
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP INC	14,125	19.66	277,697.50
TUI TRAVEL PLC	24,446	4.41	107,953.53
WHITBREAD PLC	9,399	41.64	391,374.36
WILLIAM HILL PLC	51,016	3.45	176,413.32
BRITISH SKY BROADCASTING	56,211	9.21	517,984.36
ITV PLC	195,063	2.07	405,145.85
PEARSON	44,601	11.10	495,071.10
REED ELSEVIER PLC	64,124	9.21	590,582.04
WPP PLC	72,533	13.57	984,272.81
KINGFISHER PLC	124,394	3.94	490,112.36
MARKS & SPENCER GROUP PLC	84,460	5.01	423,144.60
NEXT PLC	8,627	64.90	559,892.30
MORRISON SUPERMARKETS	119,628	2.44	291,892.32
SAINSBURY (J) PLC	69,542	3.48	242,075.70
TESCO	429,222	3.35	1,441,112.86
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,710	29.15	545,396.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	101,430	31.26	3,171,208.95
COCA COLA HBC AG CDI	10,153	15.93	161,737.29
DIAGEO	133,768	19.02	2,544,936.20
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	51,414	23.72	1,219,540.08
SABMILLER PLC	51,112	28.16	1,439,569.48
TATE & LYLE	26,311	6.43	169,311.28
UNILEVER PLC	68,241	24.23	1,653,479.43
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,380	49.50	1,701,810.00
SMITH&NEOHEW PLC	47,026	9.53	448,157.78
ASTRAZENECA PLC	66,730	39.87	2,660,525.10
GLAXOSMITHKLINE PLC	261,342	16.81	4,394,465.73
SHIRE PLC	29,276	33.44	978,989.44

BARCLAYS PLC	813,680	2.55	2,081,393.44		
HSBC HOLDINGS PLC	995,996	6.56	6,539,709.73		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,659,919	0.81	2,160,120.21		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	112,703	3.59	405,054.58		
STANDARD CHARTERED PLC	128,874	13.16	1,695,981.84		
3I GROUP PLC	51,670	4.08	210,968.61		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	51,477	3.95	203,334.15		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,334	13.52	166,755.68		
ICAP PLC	28,630	4.18	119,816.55		
INVESTEC PLC	32,128	4.35	139,756.80		
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	9,822	20.08	197,225.76		
SCHRODERS PLC	5,922	26.09	154,504.98		
ADMIRAL GROUP PLC	11,158	14.73	164,357.34		
AVIVA PLC	160,830	4.64	746,412.03		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	47,118	2.58	121,847.14		
LEGAL & GENERAL GROUP	322,849	2.38	768,380.62		
OLD MUTUAL PLC	266,465	1.84	491,361.46		
PRUDENTIAL PLC	136,115	13.40	1,823,941.00		
RESOLUTION LTD	73,029	3.73	272,617.25		
RSA INSURANCE GROUP PLC	213,299	1.00	214,578.79		
STANDARD LIFE PLC	124,592	3.91	488,276.04		
SAGE GROUP PLC/THE	59,043	4.22	249,161.46		
BT GROUP PLC	420,395	4.13	1,736,231.35		
INMARSAT PLC	23,715	6.97	165,293.55		
VODAFONE GROUP PLC	2,586,311	2.23	5,776,525.61		
CENTRICA PLC	272,231	3.14	854,805.34		
NATIONAL GRID PLC	198,252	8.31	1,648,465.38		
SEVERN TRENT PLC	12,259	17.95	220,049.05		
SSE PLC	52,654	13.99	736,629.46		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	38,703	7.65	296,271.46		
ARM HOLDINGS PLC	76,443	9.50	726,590.71		
イギリス・ポンド 小計	15,877,198		92,991,565.63 (15,865,291,012)		
スイス・フラン	TRANSOCEAN LTD	19,649	38.29	752,360.21	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	527	338.00	178,126.00	
	GIVAUDAN-REG	434	1,381.00	599,354.00	
	HOLCIM LTD-REG	12,467	69.15	862,093.05	
	SIKA AG-BR	121	3,252.00	393,492.00	
	SYNGETA AG	4,938	329.00	1,624,602.00	
	ABB LTD	116,975	22.60	2,643,635.00	
	GEBERIT AG-REG	2,062	270.00	556,740.00	
	SCHINDLER HLDG AG	1,190	134.10	159,579.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,367	132.50	313,627.50	
	SULZER	1,340	136.40	182,776.00	
	ADECCO SA-REG	6,900	74.75	515,775.00	
	SGS S.A.	286	2,207.00	631,202.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,775	122.90	341,047.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	27,748	88.05	2,443,211.40	

	THE SWATCH GROUP	2,431	102.30	248,691.30	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,683	583.00	981,189.00	
	ARYZTA AG	4,904	72.15	353,823.60	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	109	1,087.00	118,483.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	47	4,131.00	194,157.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	49,100.00	294,600.00	
	NESTLE SA-REG	172,210	65.75	11,322,807.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,583	124.30	321,066.90	
	ACTELION CHF0.50 (REGD)	5,501	89.80	493,989.80	
	LOMZA AG-REG	2,799	92.95	260,167.05	
	NOVARTIS AG-REG SHS	122,794	73.10	8,976,241.40	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	37,506	264.70	9,927,838.20	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	80,492	28.29	2,277,118.68	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,880	41.09	488,149.20	
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1,721	74.60	128,386.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,018	223.20	227,217.60	
	UBS AG-REG	194,266	18.64	3,621,118.24	
	BALOISE HOLDING AG REG	2,525	112.40	283,810.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,626	199.30	324,061.80	
	SWISS RE LTD	18,656	83.05	1,549,380.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,908	268.40	2,122,507.20	
	SWISS PRIME SITE REG	2,856	73.20	209,059.20	
	SWISSCOM	1,219	517.00	630,223.00	
スイス・フラン	小計	876,519		57,551,707.73 (6,624,201,560)	
香港・ドル	HOPEWELL HOLDINGS	38,000	26.65	1,012,700.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	113,200	102.20	11,569,040.00	
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	79,500	11.04	877,680.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	56,000	15.12	846,720.00	
	MTR CORP	85,500	27.90	2,385,450.00	
	LI & FUNG LTD	332,400	10.42	3,463,608.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,000	23.60	1,085,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	112,000	71.60	8,019,200.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	46,800	30.15	1,411,020.00	
	SANDS CHINA LTD	131,721	57.90	7,626,645.90	
	SHANGRI-LA ASIA	98,000	13.56	1,328,880.00	
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	23.75	2,256,250.00	
	WYNN MACAU LTD	87,361	33.85	2,957,169.85	
	BANK EAST ASIA	68,840	32.85	2,261,394.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	193,000	24.40	4,709,200.00	
	HANG SENG BANK	39,900	124.20	4,955,580.00	
	FIRST PACIFIC CO	153,000	7.82	1,196,460.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	59,800	123.00	7,355,400.00	
	AIA GROUP LTD	640,600	37.90	24,278,740.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	76,000	118.50	9,006,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	127,000	21.80	2,768,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	60,043	42.25	2,536,816.75	
	HYSAN DEVELOPMENT	40,000	32.45	1,298,000.00	

	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	25.35	937,950.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	222,355	9.82	2,183,526.10	
	SINO LAND	167,200	10.66	1,782,352.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	87,000	98.15	8,539,050.00	
	SWIRE PACIFIC A	38,500	84.20	3,241,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	68,251	20.85	1,423,033.35	
	WHARF HOLDINGS	79,125	55.75	4,411,218.75	
	WHEELLOCK & CO LTD	51,000	32.75	1,670,250.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	144,000	7.98	1,149,120.00	
	PCCW LIMITED	255,000	3.61	920,550.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	47.05	1,599,700.00	
	CLP HOLDINGS	92,500	59.90	5,540,750.00	
	HONGKONG CHINA GAS	299,726	16.02	4,801,610.52	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	72,000	62.20	4,478,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,400	70.70	947,380.00	
	香港・ドル 小計	4,440,722		148,832,745.22 (1,963,103,909)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	75,900	10.51	797,709.00	
	NOBLE GROUP LTD	254,745	0.98	250,923.82	
	SEMBCORP INDUSTRIES	48,560	5.32	258,339.20	
	SEMBCORP MARINE LTD	37,200	4.09	152,148.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	78,000	3.80	296,400.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	121,000	1.15	139,150.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	127,000	1.94	246,380.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	32,800	10.10	331,280.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	346,000	1.38	479,210.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINDS	90,000	4.02	361,800.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	38.45	230,700.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	102,600	1.66	170,829.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	447,960	0.55	246,378.00	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	108,000	3.31	357,480.00	
	DBS GROUP HOLDING	93,989	16.56	1,556,457.84	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	141,240	9.60	1,355,904.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	69,056	20.60	1,422,553.60	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	48,000	6.92	332,160.00	
	CAPITALAND LIMITED	145,000	2.91	421,950.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	55,000	1.83	100,650.00	
	CITY DEVELOPMENTS	24,000	9.38	225,120.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES	141,000	2.91	410,310.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	38,000	3.27	124,260.00	
	UOL GROUP LIMITED	29,405	5.95	174,959.75	
SINGAPORE TELECOM	436,060	3.58	1,561,094.80		
STARHUB LTD	24,000	4.12	98,880.00		
	シンガポール・ドル 小計	3,120,515		12,103,027.01 (979,740,036)	

ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	36,377	9.72	353,584.44	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	65,428	3.64	238,157.92	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,783	7.69	144,441.27	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	100,654	2.43	244,589.22	
	CONTACT ENERGY LIMITED	26,702	5.15	137,515.30	
ニュージーランド・ドル 小計		247,944		1,118,288.15 (94,707,823)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	10,991	126.00	1,384,866.00	
	BOLIDEN AB	15,270	102.50	1,565,175.00	
	ALFA LAVAL AB	16,212	171.60	2,781,979.20	
	ASSA ABLOY AB-B	18,196	333.10	6,061,087.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	36,623	179.50	6,573,828.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	20,280	166.40	3,374,592.00	
	SANDVIK AB	55,958	89.20	4,991,453.60	
	SCANIA AB-B SHS	18,137	144.90	2,628,051.30	
	SKANSKA AB-B	19,561	132.20	2,585,964.20	
	SKF AB-B SHARES	20,587	172.00	3,540,964.00	
	VOLVO AB-B SHS	82,780	92.95	7,694,401.00	
	SECURITAS B	16,197	67.90	1,099,776.30	
	ELECTROLUX AB-SER B	12,242	144.00	1,762,848.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	22,013	42.08	926,307.04	
	HENNES & MAURITZ B	50,418	283.80	14,308,628.40	
	SWEDISH MATCH	11,674	214.30	2,501,738.20	
	SCA SV CELLULOSA AB-B SHS	30,842	191.00	5,890,822.00	
	ELEKTA AB-B SHS	20,784	99.85	2,075,282.40	
	GETINGE AB-B SHS	10,283	229.00	2,354,807.00	
	NORDEA BANK AB	158,519	89.35	14,163,672.65	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	82,535	86.80	7,164,038.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	27,264	326.10	8,890,790.40	
	SWEDBANK AB	47,846	176.60	8,449,603.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,176	122.10	998,289.60	
	INVESTOR AB SER B NPV	23,896	220.40	5,266,678.40	
	KINNEVIK INV AB	11,598	246.50	2,858,907.00	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	161,444	81.90	13,222,263.60	
HEXAGON AB B SHS	12,234	222.60	2,723,288.40		
MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 US D1.5	3,694	684.00	2,526,696.00		
TELE2 AB-B SHS	15,324	76.70	1,175,350.80		
TELIASONERA	129,937	49.50	6,431,881.50		
スウェーデン・クローナ 小計		1,171,515		147,974,031.69 (2,321,712,557)	

ノルウェー・クローネ	ACERGY SA	15,608	108.70	1,696,589.60	
	AKER SOLUTIONS ASA	10,301	98.60	1,015,678.60	
	SEADRILL LTD	20,372	218.50	4,451,282.00	
	STATOIL ASA	59,047	161.00	9,506,567.00	
	NORSK HYDRO	54,527	29.98	1,634,719.46	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,723	241.50	2,348,104.50	
	ORKLA ASA	43,222	46.65	2,016,306.30	
	DNB ASA	53,238	107.00	5,696,466.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,425	123.50	1,287,487.50	
	TELENOR ASA	37,166	132.10	4,909,628.60	
ノルウェー・クローネ 小計		313,629		34,562,829.56 (582,038,050)	
デンマーク・クローネ	"DSV, DE SAMMENSLUT VOGN"	9,547	168.70	1,610,578.90	
	A P MOLLER MAERSK A/S	69	64,500.00	4,450,500.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	29	61,700.00	1,789,300.00	
	CARLSBERG B	5,570	585.00	3,258,450.00	
	COLOPLAST B	5,720	435.30	2,489,916.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,422	523.50	744,417.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	106,064	240.00	25,455,360.00	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	12,170	250.30	3,046,151.00	
	DANSKE BANK A/S	34,391	139.00	4,780,349.00	
	TRYG A/S	1,561	517.00	807,037.00	
TDC A/S	33,700	52.30	1,762,510.00		
デンマーク・クローネ 小計		210,243		50,194,568.90 (945,163,732)	
イスラエル・シェケル	DELEK GROUP LTD	283	1,286.00	363,938.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	25,037	29.05	727,324.85	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	147	1,857.00	272,979.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	45,098	163.30	7,364,503.40	
	BANK HAPAOALIM BM	62,158	18.61	1,156,760.38	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,153	13.22	927,422.66	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,722	42.85	373,737.70	
	NICE SYSTEMS LTD	2,697	136.70	368,679.90	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	118,692	5.76	684,021.99	
イスラエル・シェケル 小計		332,987		12,239,367.88 (356,777,574)	
ユーロ	BANCO POPULAR ESPANOL-RIGHTS	73,000	0.04	3,058.70	
	CGG	9,279	11.38	105,595.02	
	ENI SPA	135,354	17.33	2,345,684.82	
	FUGRO NV-CVA	3,730	40.76	152,034.80	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,964	11.77	199,666.28	
	NESTE OIL OYJ	8,499	15.09	128,249.91	
	OMV AG	7,551	33.03	249,409.53	
	REPSOL SA	47,469	17.62	836,641.12	
	SAIPEM EUR1	13,499	16.39	221,248.61	
	TECHNIP SA	5,266	64.20	338,077.20	
	TENARIS SA	24,558	15.96	391,945.68	
	TOTAL SA	114,106	44.43	5,069,729.58	

VOPAK	3,934	42.79	168,355.53
AIR LIQUIDE	16,550	98.74	1,634,147.00
AKZO NOBEL	12,615	60.77	766,613.55
ARCELORMITTAL	54,419	12.15	661,190.85
ARKEMA	3,551	82.09	291,501.59
BASF SE	48,966	82.75	4,051,936.50
CRH	39,771	20.09	798,999.39
FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,046	71.91	147,127.86
HEIDELBERGCEMENT AG	7,324	57.87	423,839.88
IMERYS SA	2,171	64.17	139,313.07
K&S AG	8,717	23.53	205,111.01
KONINKLIJKE DSM N.V	8,019	48.49	388,841.31
LAFARGE (FRANCE)	9,774	54.30	530,728.20
LANXESS AG	4,702	53.52	251,651.04
LINDE	9,849	148.70	1,464,546.30
SOLVAY	3,196	113.35	362,266.60
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,789	8.22	253,085.58
THYSSENKRUPP AG	20,837	20.38	424,658.06
UMICORE	6,738	34.60	233,134.80
UPM-KYMMENE	29,700	12.80	380,160.00
VOESTALPINE AG	6,246	32.38	202,245.48
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,346	26.45	220,751.70
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUC Y SERV-R	8,346	0.42	3,551.05
AIRBUS GROUP NV	31,367	52.84	1,657,432.28
ALSTOM-NEW	12,246	19.44	238,062.24
ANDRITZ AG	3,634	43.60	158,442.40
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,407	34.71	152,966.97
BOUYGUES SA	9,870	29.35	289,733.85
BRENNTAG AG	2,923	135.10	394,897.30
CIE DE SAINT-GOBAIN	21,731	41.22	895,860.47
CNH INDUSTRIAL NV	48,740	8.18	398,693.20
FERROVIAL SA	22,821	14.37	327,937.77
FINMECCANICA SPA	19,937	7.19	143,446.71
GEA GROUP AG NPV	9,843	34.60	340,567.80
HOCHTIEF	1,672	62.12	103,864.64
KONE OYJ	16,348	31.70	518,231.60
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,877	26.32	1,391,722.64
LEGRAND PROMESSES EUR4	13,442	43.41	583,517.22
MAN SE	2,058	93.80	193,040.40
METSO OYJ	7,182	22.94	164,755.08
OCI NV	4,755	35.70	169,753.50
OSRAM LICHT AG	4,568	49.31	225,270.92
PRYSMIAN SPA EURO.10	11,413	19.18	218,901.34
REXEL SA	8,997	19.20	172,787.38
SAFRAN SA	14,394	53.51	770,222.94
SCHNEIDER	29,177	63.61	1,855,948.97
SIEMENS AG	42,280	95.18	4,024,210.40

THALES SA	5,338	46.92	250,458.96
VALLOUREC	6,093	37.40	227,908.66
VINCI SA	25,395	52.30	1,328,158.50
WARTSILA OYJ	9,215	42.56	392,190.40
ZARDOYA OTIS	6,724	12.59	84,655.16
ZODIAC AEROSPACE	1,739	131.70	229,026.30
BIC	1,604	91.35	146,525.40
BUREAU VERITAS	12,492	20.54	256,648.14
EDENRED	10,796	22.56	243,557.76
RANDSTAD HOLDING NV	6,653	49.17	327,128.01
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	20,684	17.18	355,454.54
ADP	1,341	84.50	113,314.50
ATLANTIA SPA	19,566	18.29	357,862.14
DEUTSCHE POST AG-REG	48,049	26.50	1,273,298.50
FRAPORT AG NPV	2,366	57.05	134,980.30
GROUPE EUROTUNNEL SA REGR	29,176	8.44	246,245.44
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	51,776	5.43	281,143.68
LUFTHANSA	12,926	18.46	238,678.59
TNT EXPRESS NV - W/I	21,225	6.83	145,094.10
BAYER MOTOREN WERKEUR1	17,566	85.00	1,493,110.00
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	2,706	63.21	171,046.26
CONTINENTAL	6,010	168.00	1,009,680.00
DAIMLER AG	51,286	66.20	3,395,133.20
FIAT SPA	49,573	7.46	369,814.58
MICHELIN B	9,943	86.28	857,882.04
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,017	33.07	198,982.19
PIRELLI & C.	12,396	12.36	153,214.56
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	8,040	79.86	642,074.40
RENAULT SA	10,470	73.97	774,465.90
VALEO SA	4,056	87.31	354,129.36
VOLKSWAGEN STAMM	1,668	194.55	324,509.40
VOLKSWAGEN VORZUG	7,675	201.10	1,543,442.50
ADIDAS AG	11,439	85.27	975,403.53
CHRISTIAN DIOR	2,829	142.90	404,264.10
HUGO BOSS AG -ORD	1,654	94.23	155,856.42
KERING	4,122	152.30	627,780.60
LUXOTTICA GROUP SPA	8,720	39.55	344,876.00
LVMH	13,486	136.25	1,837,467.50
ACCOR SA	8,084	36.74	297,006.16
SODEXO	5,086	76.00	386,536.00
AXEL SPRINGER SE	2,115	50.91	107,674.65
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,129	23.02	187,170.22
JC DECAUX SA NPV	3,562	32.20	114,696.40
LAGARDERE	6,405	28.99	185,712.97
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG REG	10,005	35.27	352,876.35
PUBLICIS GROUPE	9,850	68.66	676,301.00
REED ELSEVIER	36,395	15.88	578,134.57

RTL GROUP	2,041	94.23	192,323.43
SES	15,781	25.26	398,706.96
SKY DEUTSCHLAND AG	23,074	7.27	167,794.12
TELENET GROUP HOLDING NV	2,648	44.59	118,074.32
WOLTERS KLUWER CVA	16,250	20.65	335,643.75
INDITEX	11,565	104.65	1,210,277.25
AHOLD (KON.)	54,949	13.31	731,645.93
CARREFOUR	32,470	26.05	845,843.50
CASINO ORD	2,875	82.56	237,360.00
COLRUYT NV	4,231	39.40	166,701.40
DELHAIZE GROUP	5,765	50.09	288,768.85
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	35,979	6.14	220,911.06
JERONIMO MARTINS	14,408	12.97	186,943.80
METRO STAMM	7,609	31.98	243,335.82
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	42,811	74.04	3,169,726.44
DANONE	30,143	50.96	1,536,087.28
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	5,138	46.22	237,504.05
HEINEKEN NV	12,538	48.65	610,036.39
KERRY GROUP A	7,762	51.33	398,423.46
PERNOD RICARD	11,604	85.89	996,667.56
REMY COINTREAU	1,506	58.43	87,995.58
SUEDZUCKER AG	4,757	19.24	91,524.68
UNILEVER NV CVA	86,704	28.34	2,457,191.36
BEIERSDORF	5,240	74.01	387,812.40
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	9,721	84.80	824,340.80
HENKEL KGAA	6,794	77.00	523,138.00
L'OREAL	12,839	122.10	1,567,641.90
CELESIO AG	4,339	25.25	109,559.75
ESSILOR INTERNATIONAL	11,176	77.77	869,157.52
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	11,325	53.50	605,887.50
FRESENIUS SE & CO KGaA	6,818	119.00	811,342.00
BAYER AG	44,100	101.90	4,493,790.00
GRIFOLS SA	7,678	38.80	297,944.79
MERCK KGAA	3,425	122.75	420,418.75
ORION OYJ	6,268	22.74	142,534.32
QIAGEN N.V.	13,255	16.41	217,514.55
SANOFI	63,688	73.48	4,679,794.24
UCB SA	5,671	54.99	311,848.29
BANCA INTESA SPA	615,953	2.23	1,376,039.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	407,709	0.17	72,776.05
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	312,028	8.91	2,781,729.62
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	100,852	1.36	137,259.57
BANCO POPULAR ESPANOL	73,000	5.22	381,498.00
BANCO SANTANDER SA	619,888	6.49	4,026,792.44
BANK OF IRELAND	1,243,884	0.33	420,432.79
BANKIA SA	226,106	1.56	353,403.67

BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV	188,366	2.34	441,529.90
BNP PARIBAS	53,038	58.38	3,096,358.44
CAIXABANK	94,288	4.68	441,550.70
COMMERZBANK AG	47,212	12.76	602,425.12
CREDIT AGRICOLE SA	52,335	11.01	576,208.35
ERSTE GROUP BANK AG	13,400	29.15	390,610.00
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	12,203	44.68	545,291.05
NATIXIS	51,854	4.70	243,817.50
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	4,896	26.70	130,723.20
SOCIETE GENERALE-A	38,845	46.80	1,817,946.00
UNICREDIT SPA	230,175	5.90	1,359,183.37
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	49,917	6.20	309,734.98
DEUTSCHE BANK AG-REG	54,207	35.56	1,927,600.92
DEUTSCHE BOERSE AG	10,125	58.75	594,843.75
EURAZEO NPV	2,046	56.54	115,680.84
EXOR SPA	4,059	29.99	121,729.41
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	4,562	69.39	316,557.18
ING GROUP N.V.	204,120	10.47	2,138,157.00
MEDIOBANCA	25,939	7.27	188,576.53
POHJOLA BANK PLC	8,893	16.80	149,402.40
WENDEL	1,791	106.20	190,204.20
AEGON NV	97,459	6.76	659,212.67
AGEAS	11,959	32.15	384,481.85
ALLIANZ	24,289	129.65	3,149,068.85
ASSICURAZIONI GENERALI	61,754	16.78	1,036,232.12
AXA	95,357	19.79	1,887,115.03
CNP ASSURANCES	10,362	14.65	151,803.30
DELTA LLOYD NV	10,023	18.74	187,881.13
HANNOVER RUECK SE	3,190	61.58	196,440.20
MAPFRE SA	44,197	2.96	130,955.71
MUENCHENER RUECK AG-REG	9,515	158.00	1,503,370.00
SAMPO INSURANCE CO A	22,864	36.82	841,852.48
SCOR SE	9,013	25.37	228,659.81
UNIPOLSAI SPA	49,599	2.36	117,450.43
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER	2,446	36.26	88,691.96
DEUTSCHE WOHNEN AG BR	15,835	15.00	237,525.00
IMMOFINANZ IMMOBILIEN ANLAGE	50,575	3.62	183,283.80
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	19,594	31.47	616,721.15
ATOS	3,290	66.94	220,232.60
CAP GEMINI SA	7,725	53.90	416,377.50
DASSAULT SYSTEMES	3,534	83.76	296,007.84
GEMALTO	4,266	82.77	353,096.82
SAP AG	49,065	58.34	2,862,452.10
UNITED INTERNET	5,358	34.22	183,377.55
ALCATEL LUCENT	150,624	3.13	472,055.61
NOKIA	198,065	5.30	1,049,744.50
BELGACOM SA	8,446	22.53	190,330.61

DEUTSCHE TELEKOM	155,666	12.20	1,899,903.53	
ELISA CORP-A SHARES	7,031	20.38	143,291.78	
ILIAD SA	1,407	182.80	257,199.60	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	170,364	2.67	454,871.88	
ORANGE S.A.	101,344	9.34	946,552.96	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA	39,358	3.32	130,668.56	
TELECOM ITALIA SPA	542,762	0.86	467,318.08	
TELECOM ITALIA-RNC	352,253	0.67	237,242.39	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,963	6.09	103,304.67	
TELEFONICA S.A.	218,015	11.36	2,476,650.40	
TELEKOM AUSTRIA AG	10,096	7.05	71,176.80	
VIVENDI SA	63,855	20.89	1,334,250.22	
ZIGGO NV	8,171	33.57	274,300.47	
E.ON SE	95,451	13.98	1,334,404.98	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	103,489	2.92	302,705.32	
ELEC DE FRANCE EURO.5	12,365	28.00	346,220.00	
ENAGAS	10,106	20.67	208,891.02	
ENEL GREEN POWER SPA	101,984	1.98	202,642.20	
ENEL SPA	348,643	3.71	1,294,162.81	
FORTUM OYJ	23,321	17.65	411,615.65	
GAS NATURAL SDG-E	19,853	18.49	367,081.97	
GDF SUEZ	70,273	17.73	1,246,291.65	
IBERDROLA SA	254,727	4.68	1,192,886.54	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,105	54.31	331,562.55	
RWE AG	26,686	29.53	788,037.58	
SNAM SPA	111,516	4.04	451,416.76	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	15,617	13.18	205,832.06	
TERNA SPA	85,816	3.70	318,205.72	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,987	12.30	233,635.03	
ASML HOLDING NV	18,937	64.87	1,228,443.19	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	57,212	7.79	445,910.32	
STMICROELECTRONICS NV	35,992	6.14	221,062.86	
ユーロ 小計	11,284,413		158,599,369.51 (22,286,383,403)	
合計	59,874,455		156,122,612,975 (156,122,612,975)	

(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 REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	27,432	385,145.28	

	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	22,200	495,282.00	
	AMERICAN TOWER CORP	20,905	1,750,793.75	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	49,200	534,312.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,415	823,365.25	
	BOSTON PROPERTIES INC	8,050	892,262.00	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,306	281,181.80	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,100	373,744.00	
	DUKE REALTY CORP	18,100	298,650.00	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	18,616	1,088,849.84	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,700	411,440.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,189	604,411.47	
	HCP INC	24,800	945,624.00	
	HEALTH CARE REIT INC	15,495	888,328.35	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	41,548	799,799.00	
	KIMCO REALTY CORP	23,200	505,760.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	6,700	247,364.00	
	MACERICH CO/THE	7,800	472,602.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	9,256	394,953.52	
	PROLOGIS INC	27,211	1,108,031.92	
	PUBLIC STORAGE	8,000	1,331,600.00	
	RAYONIER INC	7,050	317,179.50	
	REALTY INCOME CORP	11,074	471,641.66	
	REGENCY CENTERS CORP	4,600	233,450.00	
	SIMON PPTY (SIMON DEBART	16,484	2,640,407.12	
	SL GREEN REALTY CORP	5,200	505,596.00	
	UDR INC	14,100	365,895.00	
	VENTAS INC COM	15,400	953,414.00	
	VORNADO REALTY TRUST	8,859	847,451.94	
	WEYERHAEUSER CO	31,191	946,646.85	
	アメリカ・ドル 小計	491,181	21,915,182.25 (2,241,265,688)	
	カナダ・ドル			
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5,913	127,898.19	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,500	226,100.00	
	カナダ・ドル 小計	14,413	353,998.19 (32,681,112)	
	オーストラリア・ドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	95,325	187,790.25	
	DEXUS PROPERTY GROUP	236,879	253,460.53	
	FEDERATION CENTRES	88,298	209,266.26	
	GOODMAN GROUP	97,367	470,282.61	
	GPT GROUP	93,966	344,855.22	
	MIRVAC GROUP	183,614	322,242.57	
	STOCKLAND	131,310	512,109.00	
	WESTFIELD GROUP	112,396	1,167,794.44	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	161,215	502,990.80	
	オーストラリア・ドル 小計	1,200,370	3,970,791.68 (365,789,329)	

	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	48,979	339,179.57	
		HAMMERSON	36,387	207,042.03	
		INTU PROPERTIES PLC	40,531	129,577.60	
		LAND SECURITIES GROUP	41,115	443,219.70	
		SEGRO PLC	38,805	137,680.14	
イギリス・ポンド 小計			205,817	1,256,699.04 (214,405,423)	
	香港・ドル	LINK REIT	120,000	4,380,000.00	
	香港・ドル 小計			120,000	4,380,000.00 (57,772,200)
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	114,013	246,268.08	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	129,000	182,535.00	
		CAPITAMALL TRUST	135,700	249,009.50	
シンガポール・ドル 小計			378,713	677,812.58 (54,868,928)	
	ユーロ	CORIO NV	3,543	114,120.03	
		FONCIERE DES REGIONS	1,740	113,065.20	
		GECINA SA	1,207	117,308.33	
		ICADE	1,497	104,370.84	
		KLEPIERRE	5,847	195,435.97	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	5,136	979,178.40	
ユーロ 小計			18,970	1,623,478.77 (228,131,236)	
投資証券 小計				3,194,913,916 (3,194,913,916)	
合計				3,194,913,916 (3,194,913,916)	

(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 581銘柄	97.6%		59.0%
	投資証券 30銘柄		2.4%	
カナダ・ドル	株式 94銘柄	99.5%		4.5%
	投資証券 2銘柄		0.5%	
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄	93.4%		3.4%
	投資証券 9銘柄		6.6%	
イギリス・ポンド	株式 102銘柄	98.7%		10.1%
	投資証券 5銘柄		1.3%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	100.0%		4.2%
香港・ドル	株式 38銘柄	97.1%		1.3%
	投資証券 1銘柄		2.9%	
シンガポール・ドル	株式 26銘柄	94.7%		0.6%
	投資証券 3銘柄		5.3%	
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 31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%		0.6%
イスラエル・シェケル	株式	9銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式	231銘柄	99.0%		14.1%
	投資証券	6銘柄		1.0%	

(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26年3月31日現在)

資産総額	1,629,024,680円
負債総額	1,385,285円
純資産総額(-)	1,627,639,395円
発行済口数	1,407,977,951口
1口当たり純資産額(/)	1.1560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26年3月31日現在)

資産総額	123,642,598,873円
負債総額	87,152,020円
純資産総額(-)	123,555,446,853円
発行済口数	68,858,580,982口
1口当たり純資産額(/)	1.7943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26年3月31日現在)

資産総額	187,237,771,420円
負債総額	1,995,328,400円
純資産総額(-)	185,242,443,020円
発行済口数	158,118,435,869口
1口当たり純資産額(/)	1.1715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26年3月31日現在)

資産総額	167,322,367,028円
負債総額	219,572,432円
純資産総額(-)	167,102,794,596円
発行済口数	97,033,298,105口
1口当たり純資産額(/)	1.7221円

平成26年 3月 31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おりません。

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（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載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て）に支払います。

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて >

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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26年3月31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26年3月31日現在)。

発行済株式の総数

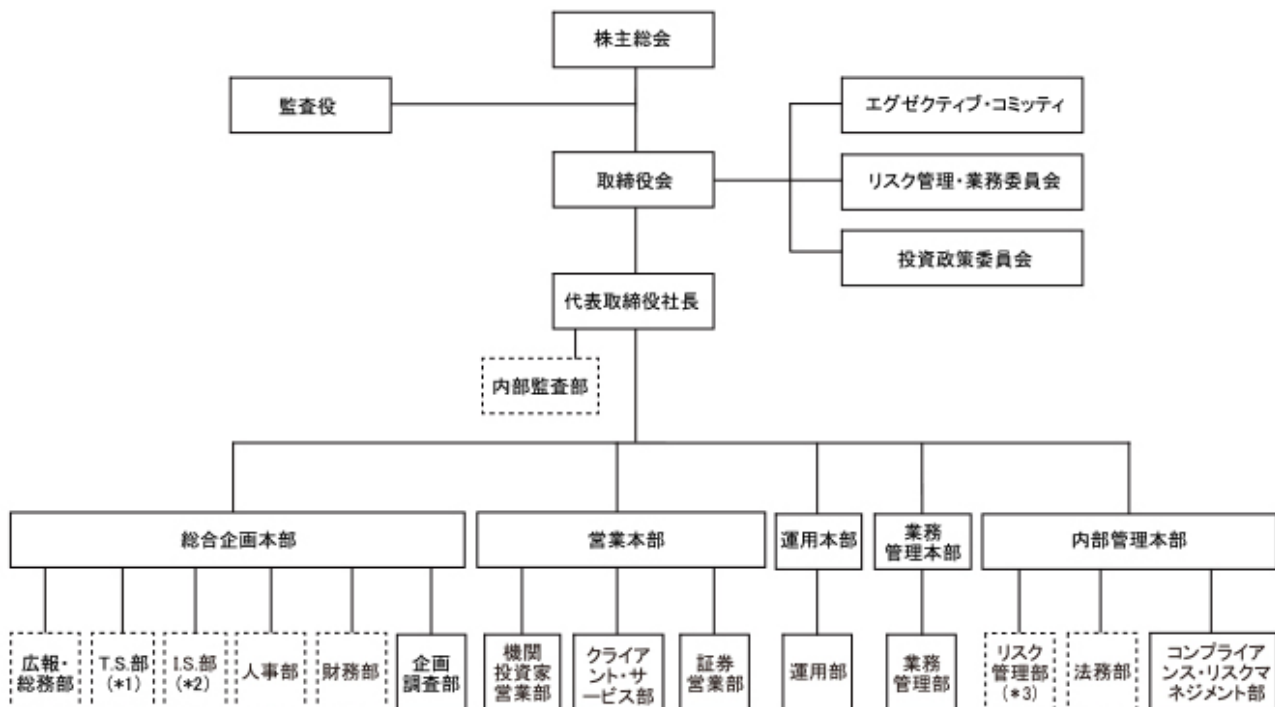
委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成26年3月31日現在)。

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



(注1) 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。

(注2) 破線で囲われた部門は関連金融機関との兼務部門

(注3) (*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、(*3)リスク管理部はITリスク管理を行う。

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]
	広報・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
	リスク管理部	ITリスク管理に関する事項(情報セキュリティ管理を除く)
	内部監査部	経営諸活動の内部統制システムの妥当性や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、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っております。

平成26年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計106本であり、その純資産総額は1,284,202百万円です（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16期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表ならびに第17期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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24年3月31日現在)		当事業年度 (平成25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	108		-	
預金	6,846,204		7,198,847	
有価証券	96,020		52,323	
前払金	24,411		18,914	
前払費用	17,419		9,826	
未収入金	354,309		543,987	
未収委託者報酬	361,180		443,028	
未収収益	37,563		15,224	
未収消費税等	25,103		-	
繰延税金資産	37,059		50,078	
流動資産計	7,799,380	96.4	8,332,231	96.9
固定資産				
有形固定資産	160,569		136,869	
建物附属設備	1 129,885		116,383	
器具備品	1 21,984		15,144	
リース資産	1 8,699		5,341	
無形固定資産	3,096		2,025	
ソフトウェア	2 3,096		2,025	
投資その他の資産	125,422		125,804	
長期差入保証金	80,749		75,397	
繰延税金資産	39,823		45,557	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	289,087	3.6	264,699	3.1
資産合計	8,088,468	100.0	8,596,931	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成24年3月31日現在)		当事業年度 (平成25年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負 債 の 部)		%		%
流動負債				
預り金	37,390		30,901	
未払金	216,365		198,194	
未払手数料	106,399		118,440	
その他未払金	109,966		79,754	
未払費用	68,177		42,048	
未払法人税等	205,843		303,031	
未払消費税	-		19,248	
賞与引当金	35,727		39,149	
リース債務	2,223		1,943	
流動負債計	565,728	7.0	634,516	7.4
固定負債				
退職給付引当金	69,969		76,324	

長期リース債務		6,448			4,910	
固定負債計		76,417	0.9		81,234	0.9
負債合計		642,146	7.9		715,751	8.3
(純資産の部)			%			%
株主資本		7,446,321	92.1		7,881,180	91.7
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	7,027,201			7,462,060		
純資産合計		7,446,321	92.1		7,881,180	91.7
負債・純資産合計		8,088,468	100.0		8,596,931	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別	前事業年度		当事業年度	
	自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日	金額	自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日	金額
科 目		構成比		構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	1,938,693		1,985,885	
投資顧問収入	1,324,526		1,419,249	
その他営業収益	248,693		556,047	
営業収益計	3,511,914	100.0	3,961,182	100.0
営業費用				
支払手数料	491,137		489,095	
広告宣伝費	14,465		13,166	
公告費	1,755		1,220	
調査費	379,325		483,166	
調査費	206,637		292,449	
委託調査費	171,141		189,179	
図書費	1,546		1,538	
委託計算費	155,279		160,372	
営業雑経費	37,603		51,741	
通信費	6,683		6,614	
印刷費	10,572		15,237	
協会費	11,049		13,533	
諸会費	3,633		4,057	
その他	5,663		12,298	
営業費用計	1,079,565	30.7	1,198,762	30.3
一般管理費				
給料	1,338,902		1,352,561	
役員報酬	413,892		410,448	
給料・手当	766,394		753,389	
賞与	116,894		160,812	
賞与引当金繰入額	41,721		27,911	
交際費	5,974		4,388	
旅費交通費	30,537		28,270	
租税公課	16,034		21,104	
不動産賃借料	125,330		128,620	
退職給付費用	62,909		77,661	
固定資産減価償却費	22,921		24,770	
福利厚生費	101,047		73,379	
事務手数料	55,825		13,121	
諸経費	117,938		149,074	
一般管理費計	1,877,421	53.5	1,872,954	47.3
営業利益	554,927	15.8	889,465	22.5
営業外収益				
為替差益	-		2,744	

有価証券運用益	-			2,846	
雑収入	7,304			3,275	
営業外収益計	7,304	0.2		8,866	0.2
営業外費用					
支払利息	70			407	
為替差損	1,769			-	
有価証券運用損	942			-	
雑損失	932			563	
営業外費用計	3,715	0.1		970	0.0
経常利益	558,516	15.9		897,362	22.7
特別損失					
事業再構築費用	36,057			8,453	
事務処理損失	3,089			236	
特別損失計	39,147	1.1		8,690	0.2
税引前当期純利益	519,369	14.8		888,671	22.4
法人税,住民税及び事業税	338,282	9.6		472,566	11.9
法人税等調整額	7,359	0.2		18,753	0.5
当期純利益	188,446	5.4		434,858	11.0

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)		(自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	
株主資本				
資本金				
当期首残高		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		6,838,754		7,027,201
当期変動額				
当期純利益		188,446		434,858
当期変動額合計		188,446		434,858
当期末残高		7,027,201		7,462,060
利益剰余金合計				
当期首残高		6,947,874		7,136,321
当期変動額				
当期純利益		188,446		434,858
当期変動額合計		188,446		434,858
当期末残高		7,136,321		7,571,180

株主資本合計		
当期首残高	7,257,874	7,446,321
当期変動額		
当期純利益	188,446	434,858
当期変動額合計	188,446	434,858
当期末残高	7,446,321	7,881,180
純資産合計		
当期首残高	7,257,874	7,446,321
当期変動額		
当期純利益	188,446	434,858
当期変動額合計	188,446	434,858
当期末残高	7,446,321	7,881,180

[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 3～15年 （ロ）リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 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りあります。 (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。
------------------------------	---

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成24年3月31現在)	当事業年度 (平成25年3月31現在)
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	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 75,441千円 器具備品 42,781千円 リース資産 3,815千円
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	2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 9,499千円
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23年4月 1日 至 平成24年3月31日	当事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日
1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 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。	1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 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としております。当事業年度に、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547,935千円は、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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

	当事業年度期首	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23年4月 1日 至 平成24年3月31日	当事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日
---------------------------------------	---------------------------------------

所有権移転外ファイナンス・リース取引	同左
リース資産の内容 社用車両であります。	
リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。	

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、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は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用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) 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年を超えるものではありません。

（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。

平成25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	7,198,847	7,198,847	
(2) 未収委託者報酬	443,028	443,028	
(3) 未収入金	534,920	534,920	

(4)未払手数料	118,440	118,440	
----------	---------	---------	--

(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) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(4)未払手数料

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年を超えるものではありません。

(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24年3月31日 現在)	当事業年度 (平成25年3月31日 現在)
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	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 52,323千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 5,353千円

(デリバティブ取引関係)

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、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24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
退職給付債務	372,119	395,579
(1)年金資産	228,989	266,835
(2)退職給付引当金	69,969	76,324
(3)未認識数理計算上の差異	5,334	17,353
(4)未認識過去勤務債務	78,494	69,773

3. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日	当事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日
退職給付費用	44,552	61,177
(1)勤務費用	54,763	55,747
(2)利息費用	3,226	3,721
(3)期待運用収益（減算）	1,253	1,679
(4)過去勤務債務の費用処理額	8,721	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,905	5,334

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

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	賞与引当金繰入超過額
11,012	10,609
未払事業税	未払事業税
14,990	23,683
その他	その他
14,803	17,820
繰延税金資産(流動)合計	繰延税金資産(流動)合計
40,805	52,113
繰延税金負債(流動)との相殺	繰延税金負債(流動)との相殺
3,746	2,034
繰延税金資産(流動)の純額	繰延税金資産(流動)の純額
37,059	50,078
繰延税金資産(固定)	繰延税金資産(固定)
退職給付引当金	退職給付引当金
25,807	28,070
その他	その他
14,015	17,486
繰延税金資産(固定)合計	繰延税金資産(固定)合計
39,823	45,557
繰延税金負債(固定)との相殺	繰延税金負債(固定)との相殺
-	-
繰延税金資産(固定)の純額	繰延税金資産(固定)の純額
39,823	45,557
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
80,628	97,670
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	事業譲受に係る調整項目
3,559	-
その他	その他
187	-
繰延税金負債(流動)合計	繰延税金負債(流動)合計
3,746	2,034
繰延税金資産(流動)との相殺	繰延税金資産(流動)との相殺
3,746	2,034
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	事業譲受に係る調整項目
-	-
繰延税金負債(固定)合計	繰延税金負債(固定)合計
-	-
繰延税金資産(固定)との相殺	繰延税金資産(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	繰延税金資産の純額
76,882	2,034
=====	
	繰延税金負債(流動)合計
	2,034
	繰延税金資産(流動)との相殺
	2,034

		繰延税金負債（流動）の純額 -
		繰延税金負債（固定） 事業譲受に係る調整項目 -
		繰延税金負債（固定）合計 -
		繰延税金資産（固定）との相殺 -
		繰延税金負債（固定）の純額 -
		繰延税金資産の純額 95,635
		=====
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
法定実効税率 40.7%		法定実効税率 38.0%
交際費等永久に損金に 算入されない項目 21.4%		交際費等永久に損金に 算入されない項目 12.4%
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 0.6%
その他 0.0%		
税効果会計適用後の 法人税等の負担率 63.7%		税効果会計適用後の 法人税等の負担率 51.0%
		=====

(企業結合関係等)

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップ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58,340千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除却費用の見積額を更新したことから、5,321千円減少しております。

（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23年4月1日 至 平成24年3月31日)

前事業年度 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日											
種類	会社等の 名称	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 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	投資顧問料の受取 ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取	173,013 135,004 147,278 252,817 228,767	未収入金 未払金 未払費用	59,214 14,977 9,050
	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	36,711 4,890 111,504	前払金 未払金	24,411 12,010
	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グ市	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) 上記の金額のうち、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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

当事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日												
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 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 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	投資顧問料 の受取 ソフトウェア 使用料の 支払 投資顧問料 の支払 人件費等の 支払 事務手数料 の受取	119,883 201,074 171,376 295,287 547,935	未収入金 未払金 未払費用	104,719 9,066
	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 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	36,270 4,052 129,797	前払金 未払金	18,914 3,174
	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	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	1,313 2,463	-	-
	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 ルグ市	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 締役に就 任	投資顧問 サービスの提 供	投資顧問料 の受取	41,935	-	-
	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	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	92	-	-

(注) 上記の金額のうち、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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。

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 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日		当事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日	
1株当たり純資産	1,201,019円51銭	1株当たり純資産	1,271,158円07銭
1株当たり当期純利益	30,394円51銭	1株当たり当期純利益	70,138円45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 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日	当事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日
当期純利益（千円）	188,446	434,858
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）	188,446	434,858
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24年4月 1日 至 平成25年3月31日
該当事項はありません。

（1）中間貸借対照表

（単位：千円）

期 別 科 目	第17期中間会計期間末 （平成25年9月30日現在）	
	金額	構成比
（資産の部）		%
流動資産		
現金	-	
預金	7,648,608	
有価証券	36,487	
前払金	29,451	
前払費用	16,137	
未収入金	665,617	
未収委託者報酬	513,009	
未収収益	180,617	
繰延税金資産	105,425	
流動資産計	9,195,353	97.4
固定資産		

有形固定資産			125,655	
建物附属設備	1	110,001		
器具備品	1	11,838		
リース資産	1	3,815		
無形固定資産			1,708	
ソフトウェア		1,708		
投資その他の資産			121,162	
長期差入保証金		70,882		
繰延税金資産		45,430		
その他投資		4,850		
固定資産計			248,526	2.6
資産合計			9,443,880	100.0
(負債の部)				%
流動負債				
預り金			50,405	
未払金			274,864	
未払手数料		135,493		
その他未払金		139,371		
未払費用			16,282	
未払法人税等			441,254	
未払消費税等	2		24,394	
賞与引当金			113,915	
リース債務			1,989	
流動負債計			923,105	9.8
固定負債				
退職給付引当金			70,403	
長期リース債務			3,904	
固定負債計			74,308	0.8
負債合計			997,414	10.6
(純資産の部)				%
株主資本			8,446,466	89.4
資本金		310,000		
利益剰余金		8,136,466		
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		8,027,346		
純資産合計			8,446,466	89.4
負債・純資産合計			9,443,880	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第17期中間会計期間 自 平成25年4月 1日 至 平成25年9月30日	
		金額	構成比
営業収益			%
委託者報酬		1,188,191	
投資顧問収入		814,179	
その他営業収益	1	567,101	
営業収益計		2,569,472	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		646,590	
支払手数料		294,215	

その他営業費用	352,374		
一般管理費 2		873,016	
営業費用・一般管理費計		1,519,606	59.1
営業利益		1,049,866	40.9
営業外収益		3,841	0.1
営業外費用		5,575	0.2
経常利益		1,048,132	40.8
特別損失		106,813	4.2
税引前中間純利益		941,318	36.6
法人税,住民税及び事業税		431,252	16.8
法人税等調整額		55,220	2.1
中間純利益		565,286	22.0

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第17期中間会計期間 (自 平成25年4月 1日 至 平成25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			7,462,060
当中間期変動額			
中間純利益			565,286
当中間期変動額合計			565,286
当中間期末残高			8,027,346
利益剰余金合計			
当期首残高			7,571,180
当中間期変動額			
中間純利益			565,286
当中間期変動額合計			565,286
当中間期末残高			8,136,466
株主資本合計			
当期首残高			7,881,180
当中間期変動額			
中間純利益			565,286

当中間期変動額合計	565,286
当中間期末残高	8,446,466
純資産合計	
前期末残高	7,881,180
当中間期変動額	
中間純利益	565,286
当中間期変動額合計	565,286
当中間期末残高	8,446,466

重要な会計方針

	第17期中間会計期間 自 平成25年4月 1日 至 平成25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 3～15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、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。また、過去勤務債務は、その発生年度の従業員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計上しております。
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せん。
------------------------------	--

注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第17期中間会計期間末 (平成25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 81,822千円 器具備品 46,087千円 リース資産 5,341千円	
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17期中間会計期間 自 平成25年4月 1日 至 平成25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としております。当中間会計期間に、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562,327千円が、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 9,688千円 無形固定資産 316千円 リース資産 1,526千円	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第17期中間会計期間 自 平成25年4月 1日 至 平成25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

(リース取引)

第17期中間会計期間 自 平成25年4月 1日 至 平成25年9月30日	
--	--

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

社用車両であります。

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。

(金融商品関係)

第17期中間会計期間

自 平成25年4月 1日

至 平成25年9月30日

1. 金融商品の時価等に関する事項

平成25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	7,648,608	7,648,608	
(2)未収入金	665,617	665,617	
(3)未収委託者報酬	513,009	513,009	
(4)未払手数料	135,493	135,493	

(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)未収委託者報酬及び、(4)未払手数料

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す。

(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年を超えるものではありません。

(有価証券関係)

第17期中間会計期間末

(平成25年9月30日現在)

売買目的の有価証券

貸借対照表計上額 36,487千円

当事業年度の損益に含まれた評価差額 4,845千円

(資産除去債務関係)

第17期中間会計期間末

(平成25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17期中間会計期間末

(平成25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17期中間会計期間末
(平成25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17期中間会計期間

自 平成25年4月 1日

至 平成25年9月30日

1株当たり純資産額 1,362,333円33銭

1株当たり中間純利益 91,175円25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、記載していません。

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17期中間会計期間	
自 平成25年4月 1日	
至 平成25年9月30日	
中間純利益(千円)	565,286
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)	565,286
期中平均株式数(株)	6,200

（重要な後発事象）

第17期中間会計期間 自 平成25年4月 1日 至 平成25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25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。

（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25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25年3月末現在)	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。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (平成25年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937百万円 (平成25年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

当ファンドの販売会社として受益権の募集・売出しの取扱い等を行います。

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6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 公認会計士 丘本 正彦 印

業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印

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、「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25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

() 上記は、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。

独立監査人の監査報告書

平成26年4月2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25年2月21日から平成26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26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。XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月26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 櫻井 雄一郎 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25年4月1日から平成26年3月31日までの第17期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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、分析的な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25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25年4月1日から平成25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。