

【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27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】	東京都港区虎ノ門一丁目23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。

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27年5月21日から平成28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。

取得申込みの受付の中止、既に受付けた取得申込みの受付の取消し

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、株式会社トータルアセットデザイン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。

株式会社トータルアセットデザインが、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 <b>追加型</b>	国内 海外 <b>内外</b>	株式 債券 不動産投信 その他資産 ( ) <b>資産複合</b>	<b>インデックス型</b>  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	<b>年1回</b>  年2回	<b>グローバル</b>  日本				  ブル・ベア 型

中小型株	年4回	北米			日経 225	
債券			<b>ファミリー ファンド</b>	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			<b>その他 (AMCリスク バジェット型 資産配分モデル 指数)</b>	
<b>その他資産</b>	( )	中近東				その他
<b>(投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)、資産配 分変更型))</b>		(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、株式会社トータルアセットデザイン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** 株式会社トータルアセットデザイン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、株式会社トータルアセットデザイン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。

<株式会社トータルアセットデザインの概要>

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。なお、平成27年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。
- 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、株式会社トータルアセットデザイン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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。

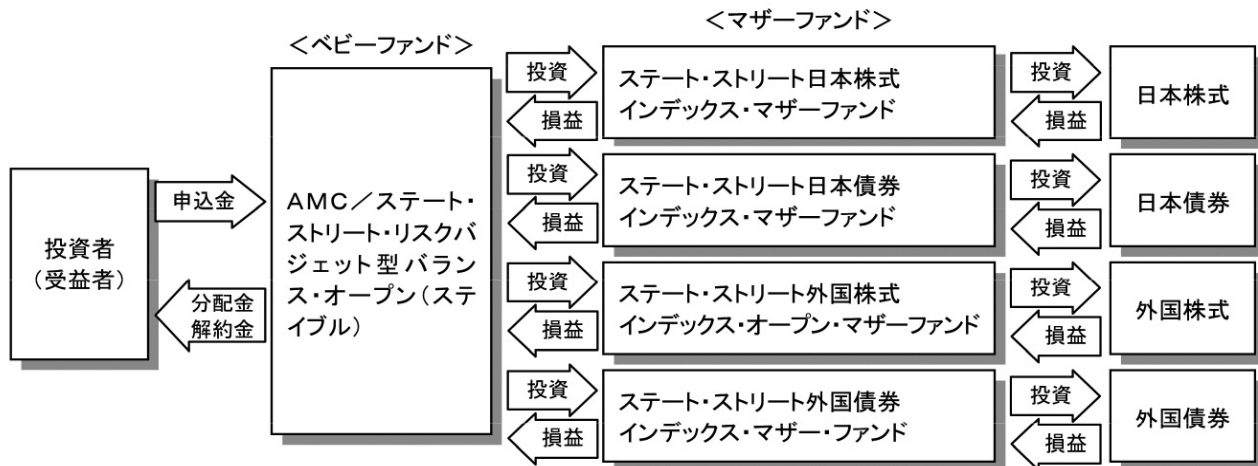


## (2) 【ファンドの沿革】

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。）

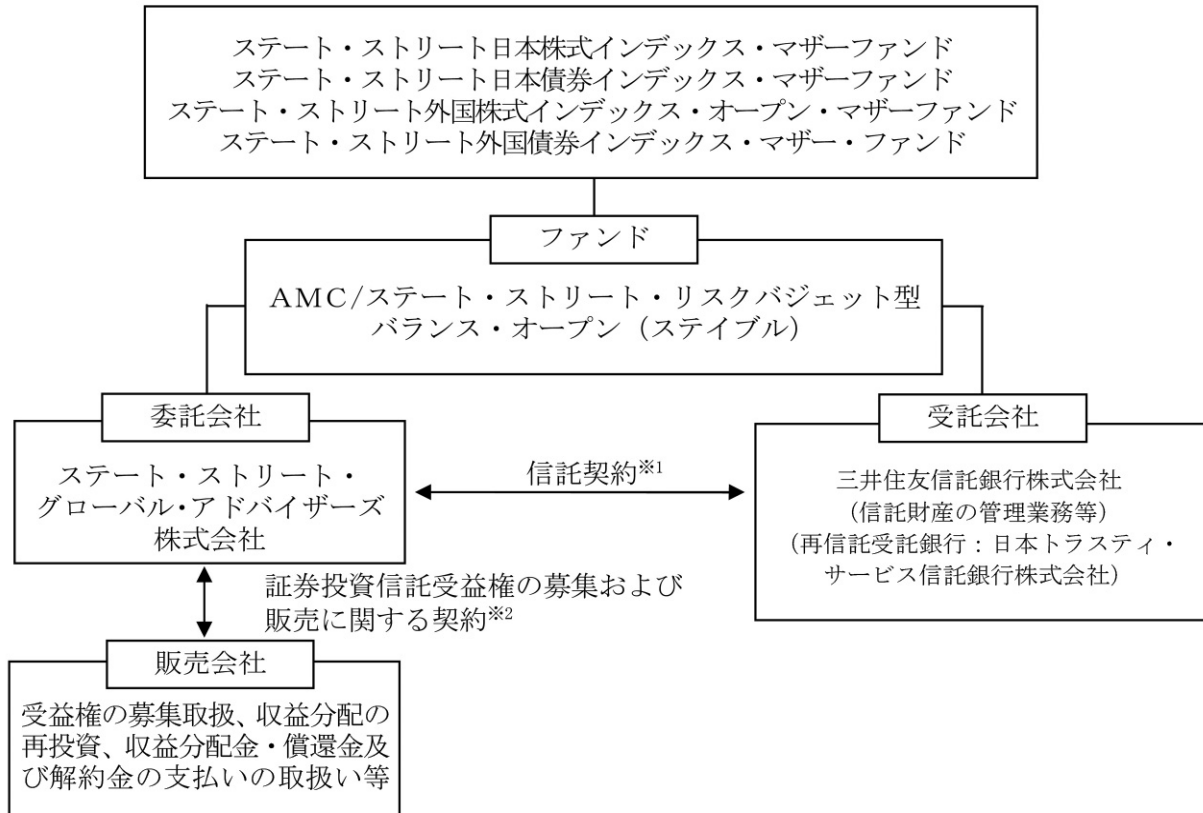
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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け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27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27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、株式会社トータルアセットデザイン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。

株式会社トータルアセットデザインが、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<sup>1</sup>）]

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<sup>2</sup>）]

<sup>1</sup> 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。

<sup>2</sup> 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、以下同じ。）を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。

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

## （２）【投資対象】

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。（信託約款等15条）

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- １２．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号までの証券または証書の性質を有するもの
- １３．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- １４．投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
- １５．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
- １６．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- １７．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
- １８．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- １９．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ２０．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

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

1. 預金

2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン

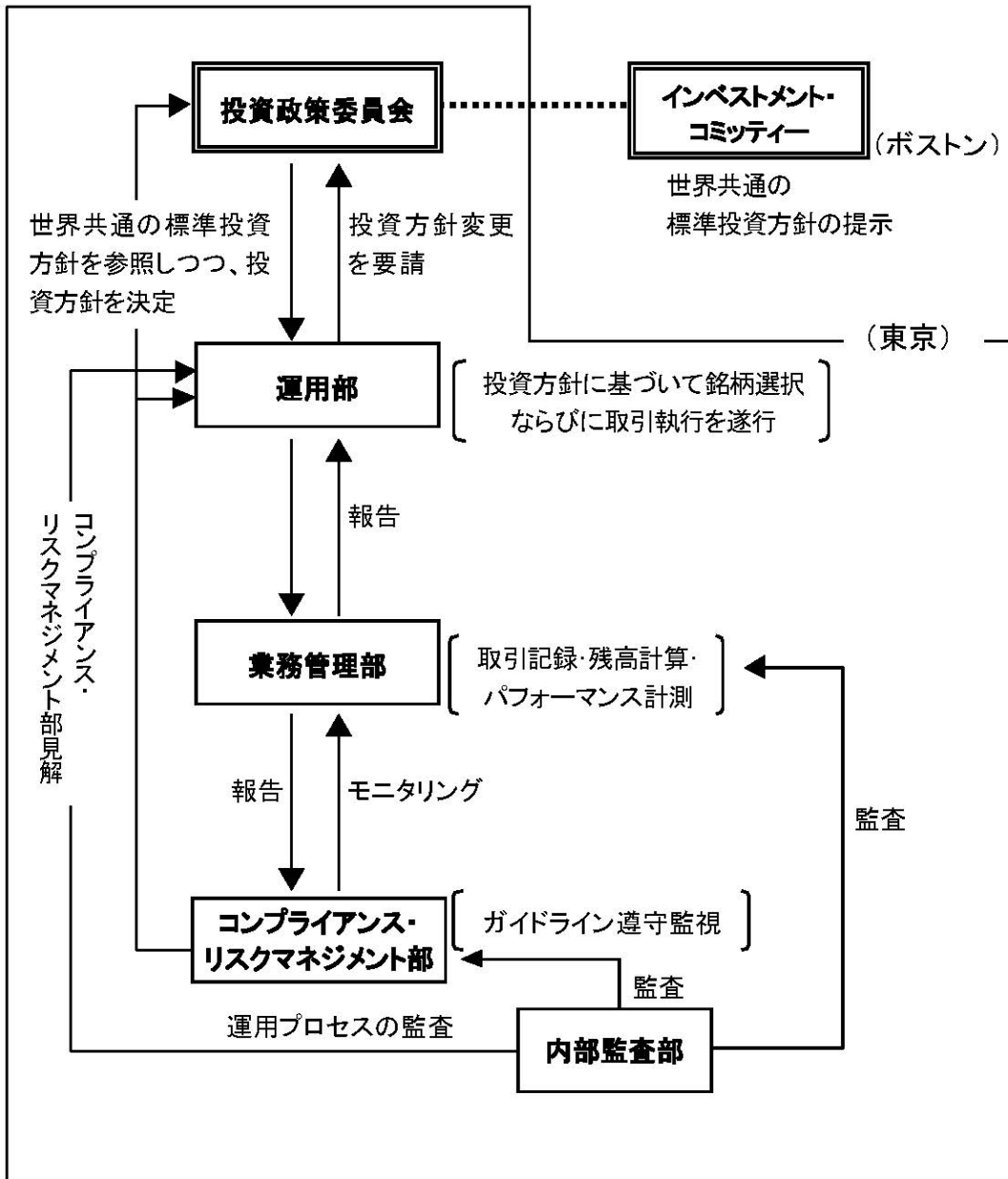
4. 手形割引市場において売買される手形

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

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

上記において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

## (3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオの管理・運用を行っています。運用モデル/プロセスは基本的に、ボストン本社を中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

ファンド担当者は、いずれも国内外の有価証券市場に精通した経験豊富な投資運用の専門家であり、資産クラス・運用戦略ごとの運用チームに配置されています。また、チーム・アプローチによって運用を行うため、特定の担当者に依存することない安定した運用体制となっています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。当委員会は、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。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、ガイドラインに対する適合性、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27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つた場合も同様です。

#### （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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（信託約款第22条）
- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
  - (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6) 有価証券の貸付の指図および範囲（信託約款第23条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
  - (b) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 7) 公社債の空売りの指図範囲（信託約款第24条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - (b) 上記（a）の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - (c) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 8) 公社債の借入れ（信託約款第25条）
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
  - (b) 上記（a）の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - (c) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
  - (d) 上記（a）の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- 9) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款第26条）
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

## 10) 外国為替予約取引の指図および範囲（信託約款第27条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額についての為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、原則として信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するため、もしくはベンチマークとの連動性を維持するための当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (d) 上記(a)および(b)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

## 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）

委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 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。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第18条の2）

委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### （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ます。）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は、約款第17条の範囲で行います。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(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せん。）

(c) 金銭債権

(d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

(a) 為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

6) 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。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第19条の2）

委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（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。）

(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。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）

委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## ■ ベンチマーク

### TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスを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、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

### MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。))が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数はMSCIが独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、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大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、明示的にも暗示的にも、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っておらず、これらに責任を負いません。シティグループは、当ファンドの管理、マーケティングまたは取引に関する義務または責任を何ら負うものではありません。

シティグループは、WGBIまたはそれに含まれるいかなるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。シティグループは、WGBIまたはそれらに含まれる一切のデータの使用により、SSGA、当ファンドの所有者あるいは所有者となる可能性のある者、またはその他の者や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗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

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。

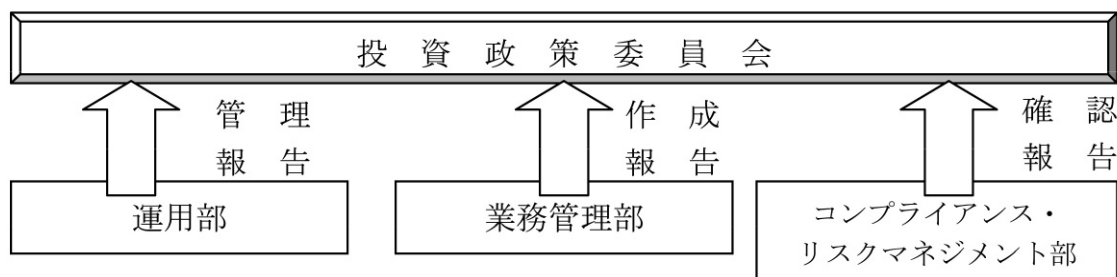
#### ファミリーファンド方式のリスク

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。

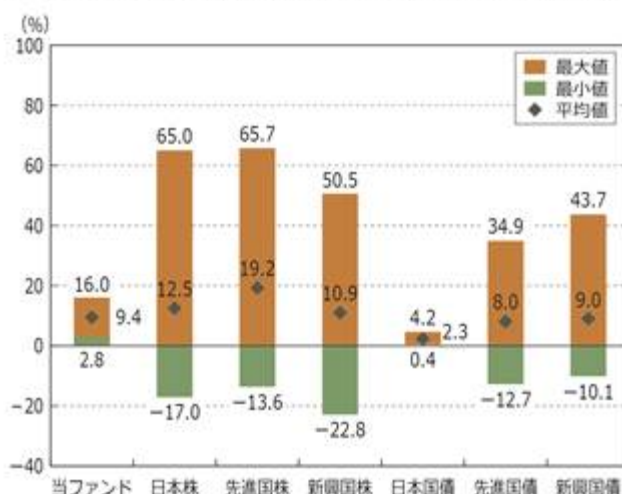


## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

### ＜ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移＞



### ＜ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較＞



※当ファンドの騰落率は、月末における税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)を用いて計算しています。  
 ※当ファンドの税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)の年間騰落率は、平成25年3月～平成27年3月の2年1ヶ月間、代表的な資産クラスを表す指数の年間騰落率は、平成22年4月～平成27年3月の5年間の各月末における直近1年前を対比して計算(1年未満の場合は年換算)しており、決算日に対応した数値とは異なります。  
 ※平均値・最大値・最小値は、同期間の各月末における年間騰落率の該当値を表示しています。  
 ※代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。

## ■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

## 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場合があります。

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27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	1,960,666,947	95.05
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		102,111,261	4.95
純資産総額		2,062,778,208	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。

## &lt;参考情報&gt;

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27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	130,705,159,460	97.50
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		3,352,080,534	2.50
純資産総額		134,057,239,994	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。

## &lt;参考情報&gt;

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27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	137,275,650,000	78.76
特殊債券	日本	15,363,078,749	8.82
地方債証券	日本	10,466,680,604	6.00
社債券	日本	9,627,837,470	5.52
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,567,504,619	0.90
純資産総額		174,300,751,442	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。

## &lt;参考情報&gt;

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27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	101,809,725,625	60.24
	イギリス	13,727,973,873	8.12
	ドイツ	6,737,814,861	3.99
	フランス	6,668,788,938	3.95
	カナダ	6,570,797,454	3.89
	スイス	6,541,060,899	3.87
	オーストラリア	4,712,005,549	2.79
	スペイン	2,464,835,664	1.46
	スウェーデン	2,170,529,517	1.28
	香港	2,132,780,554	1.26
	オランダ	1,949,158,655	1.15
	イタリア	1,644,361,307	0.97
	デンマーク	1,177,670,522	0.70
	シンガポール	950,492,146	0.56

	ベルギー	935,707,552	0.55
	フィンランド	622,045,066	0.37
	ノルウェー	450,887,864	0.27
	イスラエル	418,115,078	0.25
	アイルランド	223,502,396	0.13
	オーストリア	140,302,838	0.08
	ポルトガル	113,772,638	0.07
	ニュージーランド	110,040,287	0.07
	小計	162,272,369,283	96.02
投資証券	アメリカ	2,916,467,983	1.73
	オーストラリア	380,357,640	0.23
	フランス	248,830,334	0.15
	イギリス	237,922,171	0.14
	シンガポール	75,895,731	0.04
	香港	75,888,000	0.04
	カナダ	31,954,281	0.02
	小計	3,967,316,140	2.35
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,758,589,781	1.63
純資産総額		168,998,275,204	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・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（平成27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	アメリカ	90,348,288,160	41.48
	イタリア	21,218,811,175	9.74
	フランス	20,706,804,853	9.51
	イギリス	17,801,998,766	8.17
	ドイツ	16,757,390,617	7.69
	スペイン	11,384,112,934	5.23
	ベルギー	5,676,302,410	2.61
	オランダ	5,604,908,593	2.57
	カナダ	4,824,610,739	2.21
	オーストラリア	3,696,749,406	1.70
	オーストリア	3,461,553,704	1.59
	メキシコ	2,314,912,446	1.06
	アイルランド	1,857,233,361	0.85
	デンマーク	1,609,592,792	0.74
	フィンランド	1,318,224,601	0.61
	ポーランド	1,272,635,129	0.58
	南アフリカ	1,172,412,740	0.54
	マレーシア	1,122,805,702	0.52
	スウェーデン	1,071,944,825	0.49
	シンガポール	846,866,915	0.39
	スイス	828,167,918	0.38
ノルウェー	611,089,666	0.28	
	小計	215,507,417,452	98.93
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,327,129,847	1.07
純資産総額		217,834,547,299	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。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成27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		778,698,953	1.2017	935,835,666	1.2066	939,578,156	45.55
2	日本	親投資 信託受 益証券	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		255,250,797	2.3612	602,705,490	2.3587	602,060,054	29.19
3	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		135,022,022	2.2631	305,578,632	2.3459	316,748,161	15.35
4	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・オーブ ン・マザーファンド		47,247,125	2.1509	101,625,381	2.1648	102,280,576	4.96
									投資比率：合計	95.05

（注1）投資有価証券は4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		95.05
合計		95.05

（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27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	799,600	8,063	6,447,174,800	8,383	6,703,046,800	5.00
2	日本	株式	三菱UFJフィ ナンシャル・グ ループ	銀行業	4,589,500	757	3,474,710,450	744	3,413,211,150	2.55
3	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	302,500	7,089	2,144,422,500	6,980	2,111,450,000	1.58
4	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	521,500	3,973	2,071,919,500	3,903	2,035,414,500	1.52
5	日本	株式	三井住友フィ ナンシャルグ ループ	銀行業	432,600	4,700	2,033,003,700	4,602	1,990,608,900	1.48
6	日本	株式	みずほフィ ナンシャルグ ループ	銀行業	7,941,900	218	1,728,951,630	211	1,676,535,090	1.25
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	223,800	7,600	1,700,880,000	7,397	1,655,448,600	1.23
8	日本	株式	ファナック	電気機器	60,300	23,130	1,394,739,000	26,250	1,582,875,000	1.18

9	日本	株式	KDDI	情報・通信業	581,000	2,678	1,555,918,000	2,721	1,580,610,500	1.18
10	日本	株式	キヤノン	電気機器	336,000	3,920	1,317,120,000	4,248	1,427,328,000	1.06
11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	359,900	3,826	1,376,977,400	3,801	1,367,799,950	1.02
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	227,400	6,516	1,481,738,400	5,999	1,364,172,600	1.02
13	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	691,300	2,000	1,382,600,000	1,968	1,360,132,750	1.01
14	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	239,300	4,486	1,073,499,800	5,053	1,209,182,900	0.90
15	日本	株式	ソニー	電気機器	378,800	3,344	1,266,707,200	3,190	1,208,372,000	0.90
16	日本	株式	三菱地所	不動産業	425,000	2,706	1,149,837,500	2,787	1,184,475,000	0.88
17	日本	株式	日立製作所	電気機器	1,392,000	813	1,131,556,800	823	1,145,894,400	0.85
18	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	51,900	22,015	1,142,578,500	21,745	1,128,565,500	0.84
19	日本	株式	パナソニック	電気機器	706,200	1,500	1,059,300,000	1,577	1,113,677,400	0.83
20	日本	株式	三井不動産	不動産業	303,000	3,239	981,417,000	3,530	1,069,438,500	0.80
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	235,400	4,276	1,006,570,400	4,539	1,068,362,900	0.80
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	438,300	2,399	1,051,262,550	2,421	1,060,905,150	0.79
23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	106,200	10,055	1,067,841,000	9,640	1,023,768,000	0.76
24	日本	株式	村田製作所	電気機器	60,800	15,885	965,808,000	16,535	1,005,328,000	0.75
25	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	813,400	1,237	1,006,175,800	1,224	995,601,600	0.74
26	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	471,200	2,235	1,053,132,000	2,086	982,687,600	0.73
27	日本	株式	花王	化学	163,200	5,396	880,627,200	6,000	979,200,000	0.73
28	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	190,200	4,607	876,251,400	4,816	916,003,200	0.68
29	日本	株式	キーエンス	電気機器	13,100	60,520	792,812,000	65,600	859,360,000	0.64
30	日本	株式	信越化学工業	化学	108,800	8,069	877,907,200	7,850	854,080,000	0.64
									投資比率：合計	34.34

(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	12.81
	輸送用機器	11.44
	銀行業	8.65
	情報・通信業	6.51
	化学	6.00
	医薬品	4.91
	機械	4.88
	小売業	4.29
	食料品	4.06
	陸運業	3.98
	卸売業	3.91
	サービス業	3.10
	不動産業	2.96
	建設業	2.48
	保険業	2.43
	電気・ガス業	1.94
	その他製品	1.45
	鉄鋼	1.44
	精密機器	1.42
	証券、商品先物取引業	1.31
その他金融業	1.24	
ゴム製品	0.92	
ガラス・土石製品	0.90	
非鉄金属	0.87	

繊維製品	0.74
金属製品	0.65
空運業	0.58
石油・石炭製品	0.44
鉱業	0.39
海運業	0.30
パルプ・紙	0.22
倉庫・運輸関連業	0.21
水産・農林業	0.07
合計	97.50

（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 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX(先物) (2015年6月限)	大阪取引所	買建	172	2,681,938,608	2,654,820,000	1.98

（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27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333回利付国 債(10年)	0.600	2024/03/20	2,100,000,000	102.50	2,152,542,000	102.44	2,151,240,000	1.23
2	日本	国債 証券	第119回利付国 債(5年)	0.100	2019/06/20	2,100,000,000	100.12	2,102,688,000	100.00	2,100,000,000	1.20
3	日本	国債 証券	第332回利付国 債(10年)	0.600	2023/12/20	1,900,000,000	102.61	1,949,609,000	102.50	1,947,595,000	1.12
4	日本	国債 証券	第118回利付国 債(5年)	0.200	2019/06/20	1,800,000,000	100.55	1,809,990,000	100.41	1,807,542,000	1.04
5	日本	国債 証券	第105回利付国 債(5年)	0.200	2017/06/20	1,700,000,000	100.44	1,707,548,000	100.34	1,705,831,000	0.98
6	日本	国債 証券	第298回利付国 債(10年)	1.300	2018/12/20	1,600,000,000	104.76	1,676,160,000	104.54	1,672,656,000	0.96
7	日本	国債 証券	第335回利付国 債(10年)	0.500	2024/09/20	1,600,000,000	101.33	1,621,392,000	101.32	1,621,248,000	0.93
8	日本	国債 証券	第349回利付国 債(2年)	0.100	2017/02/15	1,600,000,000	100.18	1,602,944,000	100.13	1,602,096,000	0.92
9	日本	国債 証券	第337回利付国 債(10年)	0.300	2024/12/20	1,600,000,000	99.33	1,589,424,000	99.29	1,588,736,000	0.91
10	日本	国債 証券	第286回利付国 債(10年)	1.800	2017/06/20	1,500,000,000	104.09	1,561,440,000	103.88	1,558,275,000	0.89
11	日本	国債 証券	第101回利付国 債(5年)	0.400	2016/12/20	1,500,000,000	100.70	1,510,560,000	100.63	1,509,525,000	0.87



12	日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	0.600	2024/06/20	1,400,000,000	102.43	1,434,034,000	102.36	1,433,166,000	0.82
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	100.39	1,405,530,000	100.31	1,404,396,000	0.81
14	日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	0.300	2017/03/20	1,300,000,000	100.59	1,307,774,000	100.51	1,306,630,000	0.75
15	日本	国債証券	第121回利付国債(5年)	0.100	2019/09/20	1,300,000,000	100.09	1,301,170,000	99.95	1,299,415,000	0.75
16	日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1.400	2018/12/20	1,200,000,000	105.13	1,261,644,000	104.91	1,258,944,000	0.72
17	日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	0.800	2022/12/20	1,200,000,000	104.39	1,252,680,000	104.28	1,251,384,000	0.72
18	日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	0.600	2023/03/20	1,200,000,000	102.79	1,233,540,000	102.69	1,232,316,000	0.71
19	日本	国債証券	第111回利付国債(5年)	0.400	2018/03/20	1,200,000,000	101.16	1,213,992,000	101.02	1,212,252,000	0.70
20	日本	国債証券	第114回利付国債(5年)	0.300	2018/09/20	1,200,000,000	100.95	1,211,436,000	100.79	1,209,540,000	0.69
21	日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	0.300	2016/12/20	1,200,000,000	100.52	1,206,312,000	100.46	1,205,556,000	0.69
22	日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	1,100,000,000	106.41	1,170,587,000	106.01	1,166,132,000	0.67
23	日本	国債証券	第304回利付国債(10年)	1.300	2019/09/20	1,100,000,000	105.51	1,160,621,000	105.29	1,158,201,000	0.66
24	日本	国債証券	第295回利付国債(10年)	1.500	2018/06/20	1,100,000,000	104.87	1,153,581,000	104.63	1,151,029,000	0.66
25	日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	1,100,000,000	104.37	1,148,147,000	104.25	1,146,838,000	0.66
26	日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	1.500	2034/03/20	1,000,000,000	106.46	1,064,600,000	107.45	1,074,560,000	0.62
27	日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	1,000,000,000	107.25	1,072,570,000	106.82	1,068,290,000	0.61
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	105.85	1,058,550,000	105.60	1,056,020,000	0.61
29	日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	1,000,000,000	105.76	1,057,630,000	105.53	1,055,350,000	0.61
30	日本	国債証券	第302回利付国債(10年)	1.400	2019/06/20	1,000,000,000	105.67	1,056,780,000	105.48	1,054,800,000	0.61
										投資比率：合計	24.12

(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		78.76
特殊債券		8.82
地方債証券		6.00
社債券		5.52
合計		99.10

(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27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	261,956	14,292	3,743,827,502	15,186	3,978,033,140	2.35
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	189,100	10,880	2,057,444,269	10,290	1,945,868,707	1.15
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	348,583	5,745	2,002,723,565	4,922	1,715,782,414	1.02
4	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	125,621	13,008	1,634,128,530	12,203	1,532,986,164	0.91
5	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	220,851	6,547	1,445,880,931	6,582	1,453,577,433	0.86
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	446,739	3,183	1,422,105,732	3,019	1,348,557,795	0.80
7	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	143,577	9,028	1,296,230,672	9,240	1,326,604,099	0.78
8	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	102,409	11,635	1,191,543,052	12,176	1,246,978,477	0.74
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	167,474	7,229	1,210,741,090	7,326	1,226,841,371	0.73
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	120,579	10,867	1,310,328,749	9,940	1,198,611,015	0.71
11	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	282,296	3,743	1,056,717,346	4,206	1,187,322,861	0.70
12	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	184,519	6,079	1,121,764,863	5,903	1,089,169,601	0.64
13	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	84,500	13,083	1,105,505,717	12,846	1,085,501,618	0.64
14	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	31,276	36,013	1,126,340,586	32,977	1,031,376,141	0.61
15	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア	71,906	11,117	799,373,731	12,752	916,976,979	0.54
16	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	230,816	4,252	981,340,675	3,962	914,494,122	0.54
17	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	128,374	7,258	931,772,896	7,011	899,993,886	0.53
18	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	51,150	17,868	913,952,153	17,542	897,294,609	0.53
19	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	852,368	1,134	966,846,051	1,039	885,339,562	0.52
20	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	87,880	9,337	820,553,926	9,998	878,584,092	0.52
21	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	468,048	2,048	958,420,391	1,865	872,927,493	0.52
22	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	175,670	5,387	946,373,130	4,868	855,176,790	0.51
23	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	12,650	65,983	834,684,236	67,432	853,009,650	0.50
24	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C- W/I	ソフトウェア・サービス	12,757	65,112	830,630,098	66,337	846,266,787	0.50
25	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	134,892	6,486	874,852,169	6,206	837,082,935	0.50
26	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	158,623	5,096	808,407,795	5,220	828,041,373	0.49
27	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サービス	42,161	19,488	821,632,256	19,548	824,165,500	0.49
28	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	215,887	4,476	966,381,994	3,781	816,171,209	0.48

29	アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	67,328	12,055	811,669,633	12,100	814,663,231	0.48
30	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	58,888	11,945	703,411,153	13,775	811,187,329	0.48
									投資比率：合計	20.77

(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27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	医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	10.17
	銀行	9.18
	エネルギー	7.95
	資本財	7.05
	ソフトウェア・サービス	7.02
	食品・飲料・タバコ	6.07
	素材	4.97
	テクノロジー・ハードウェア および機器	4.52
	保険	4.25
	各種金融	3.99
	ヘルスケア機器・サービス	3.56
	小売	3.46
	メディア	3.18
	公益事業	3.15
	電気通信サービス	3.00
	食品・生活必需品小売り	2.20
	運輸	2.04
	自動車・自動車部品	1.82
	半導体・半導体製造装置	1.77
	家庭用品・パーソナル用品	1.73
耐久消費財・アパレル	1.69	
消費者サービス	1.68	
商業・専門サービス	0.89	
不動産	0.68	
	小 計	96.02
投資証券		2.35
合 計		98.37

(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27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	MINIS&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	123	12,610,780.00	12,764,940.00	1,533,962,839	0.91
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	67	2,421,116.23	2,452,200.00	319,570,704	0.19
	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	18	1,212,769.75	1,231,470.00	219,287,862	0.13
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	9	1,314,450.00	1,316,475.00	121,194,688	0.07
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	6	1,028,892.00	1,037,040.00	98,290,651	0.06
	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	9	818,590.00	816,750.00	101,636,370	0.06

(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27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。

#### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（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）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成27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	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	17,500,000	12,422	2,173,782,168	12,589	2,203,034,550	1.01
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2019/07/31	13,000,000	11,693	1,520,108,440	11,799	1,533,902,754	0.70
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	12,500,000	12,102	1,512,805,108	12,237	1,529,583,845	0.70
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2016/11/30	12,000,000	12,075	1,449,019,473	12,087	1,450,490,354	0.67
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2016/12/15	12,000,000	12,024	1,442,833,122	12,040	1,444,751,035	0.66
6	ドイツ	国債証券	GERMAN GOVERNMENT BOND	3.500	2019/07/04	8,500,000	15,119	1,285,077,049	15,066	1,280,620,691	0.59
7	ドイツ	国債証券	GERMAN GOVERNMENT BOND	6.250	2024/01/04	6,100,000	19,952	1,217,062,767	20,086	1,225,271,441	0.56
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2016/03/31	9,900,000	12,275	1,215,237,390	12,252	1,212,917,508	0.56
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2017/09/30	9,800,000	12,307	1,206,094,857	12,345	1,209,780,951	0.56
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	9,000,000	13,268	1,194,160,534	13,381	1,204,305,285	0.55
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2023/11/15	9,000,000	12,686	1,141,771,221	12,854	1,156,815,303	0.53
12	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	5.500	2029/04/25	5,400,000	20,844	1,125,575,638	21,381	1,154,547,416	0.53
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2016/03/15	9,500,000	12,027	1,142,596,788	12,028	1,142,688,118	0.52
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2016/05/15	9,500,000	12,000	1,140,005,322	12,007	1,140,633,211	0.52
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/05/31	9,300,000	12,128	1,127,885,096	12,259	1,140,111,432	0.52
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2016/04/30	9,000,000	12,343	1,110,850,278	12,316	1,108,481,727	0.51
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/08/15	8,600,000	12,599	1,083,522,899	12,709	1,092,968,741	0.50
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2016/09/30	9,000,000	12,112	1,090,063,271	12,116	1,090,398,546	0.50

19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2019/02/28	9,000,000	11,998	1,079,799,552	12,086	1,087,781,243	0.50
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2017/06/30	9,000,000	11,995	1,079,583,246	12,033	1,082,968,434	0.50
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2019/04/30	8,900,000	11,919	1,060,828,554	12,010	1,068,924,767	0.49
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2016/12/31	8,800,000	12,077	1,062,783,480	12,093	1,064,189,949	0.49
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	8,100,000	13,074	1,059,004,974	13,088	1,060,143,825	0.49
24	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT BOND	5.500	2017/07/30	7,200,000	14,658	1,055,376,190	14,646	1,054,520,456	0.48
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/11/30	8,400,000	12,177	1,022,833,203	12,297	1,032,927,483	0.47
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2024/02/15	8,000,000	12,682	1,014,523,208	12,845	1,027,607,317	0.47
27	イギリス	国債証券	UK GILT BOND	4.500	2019/03/07	5,000,000	20,246	1,012,278,090	20,311	1,015,559,030	0.47
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2017/04/30	8,200,000	12,048	987,936,316	12,078	990,399,801	0.45
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2017/02/15	7,600,000	12,957	984,711,434	12,931	982,720,457	0.45
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2019/12/31	8,200,000	11,765	964,759,849	11,873	973,618,541	0.45
										投資比率：合計	16.40

(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27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(%)
国債証券		98.93
合計		98.93

(注1) 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。

(注2) 平成27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

該当する事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

平成27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
第3期	(平成27年 2月20日)	分配付:	1,749,455,838	分配付:	1.2424
		分配落:	1,726,925,712	分配落:	1.2264
平成26年 3月末日			1,627,639,395		1.1560

4月末日	1,623,552,714	1.1521
5月末日	1,636,166,952	1.1610
6月末日	1,650,735,178	1.1734
7月末日	1,660,912,100	1.1805
8月末日	1,666,750,279	1.1846
9月末日	1,688,993,651	1.2002
10月末日	1,693,745,106	1.2034
11月末日	1,742,911,397	1.2381
12月末日	1,756,776,550	1.2478
平成27年 1月末日	1,737,854,775	1.2343
2月末日	2,059,760,751	1.2327
3月末日	2,062,778,208	1.2344

## 【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
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	0.0160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%
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	7.7%

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

## （4）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
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
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937

（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

（平成27年3月31日現在）

## 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。

## &lt;基準価額・純資産総額&gt;

基準価額	12,344円
純資産総額	2,062百万円

## 分配の推移

計算期間	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
第3期（平成27年2月20日）	160円
設定来累計	210円

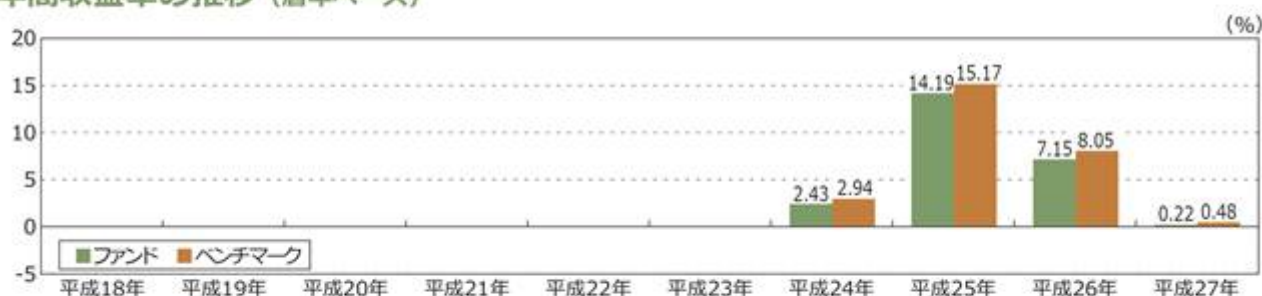
※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 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	45.55%	第333回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.600%	2024/03/20	1.23%
		第119回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2019/06/20	1.20%
		第332回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.600%	2023/12/20	1.12%
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	29.19%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.500%	2024/05/15	1.01%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	0.875%	2019/07/31	0.70%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2021/11/15	0.70%
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	15.35%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	5.00%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.55%
		ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	—	—	1.58%
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	4.96%	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	—	—	2.35%
		EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	1.15%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	1.02%

※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。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）



※ベンチマークは、株式会社トータルアセットデザイン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27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いません。

- 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）株式会社トータルアセットデザインがベンチマークである「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」の算出および提供をしないこととなった場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させるものとします。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

（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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

（ホ）上記（ハ）および上記（ニ）の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の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、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、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発送します。
- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の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であっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

### 3) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

上記1) に規定する信託契約の解約または上記2) に規定する一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、上記1) (八) に規定する投資信託の解約または上記2) (b) に規定する重大な約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません（信託約款第52条）。

### 4) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

### 5) 公告

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

### 6) 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）手続等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。

#### 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3期計算期間(平成26年2月21日から平成27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2期 (平成26年 2月20日現在)	第3期 (平成27年 2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	83,763,638	93,793,137
親投資信託受益証券	1,543,647,269	1,662,745,169
未収利息	68	25
<b>流動資産合計</b>	<b>1,627,410,975</b>	<b>1,756,538,331</b>
<b>資産合計</b>	<b>1,627,410,975</b>	<b>1,756,538,331</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	7,006,511	22,530,126
未払解約金	507	-
未払受託者報酬	280,824	465,962
未払委託者報酬	3,931,488	6,523,401
その他未払費用	56,102	93,130
<b>流動負債合計</b>	<b>11,275,432</b>	<b>29,612,619</b>
<b>負債合計</b>	<b>11,275,432</b>	<b>29,612,619</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 1,401,302,395	1 1,408,132,937
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金( )	214,833,148	318,792,775
(分配準備積立金)	42,296,022	144,921,361
<b>元本等合計</b>	<b>1,616,135,543</b>	<b>1,726,925,712</b>
<b>純資産合計</b>	<b>1,616,135,543</b>	<b>1,726,925,712</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,627,410,975</b>	<b>1,756,538,331</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期	第3期
	自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	自 平成26年 2月21日 至 平成27年 2月20日
営業収益		
受取利息	12,793	19,832
有価証券売買等損益	41,868,550	139,097,900
営業収益合計	41,881,343	139,117,732
営業費用		
受託者報酬	384,440	901,610
委託者報酬	5,382,023	12,622,454
その他費用	76,767	178,282
営業費用合計	5,843,230	13,702,346
営業利益	36,038,113	125,415,386
経常利益	36,038,113	125,415,386
当期純利益	36,038,113	125,415,386
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	43,410	95,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,331,318	214,833,148
剰余金増加額又は欠損金減少額	172,660,954	2,019,352
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	2,019,352
剰余金減少額又は欠損金増加額	147,316	849,783
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	849,783
分配金	1 7,006,511	1 22,530,126
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	214,833,148	318,792,775



## （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2期 （平成26年 2月20日現在）	第3期 （平成27年 2月20日現在）
1 期首元本額	199,867,158円	1,401,302,395円
期中追加設定元本額	1,202,700,140円	12,384,800円
期中一部解約元本額	1,264,903円	5,554,258円
2 受益権の総数	1,401,302,395口	1,408,132,937口

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第2期 自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	第3期 自 平成26年 2月21日 至 平成27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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,322,475円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（101,997,709円）、収益調整金（173,871,414円）及び分配準備積立金（42,131,303円）より分配対象収益は341,322,901円（1万口当たり2,423円）であり、うち22,530,126円（1万口当たり160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2期 (平成26年 2月20日現在)	第3期 (平成27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	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。  (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)有価証券 売買目的有価証券 同左  (3)デリバティブ取引 同左
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)

	第2期 (平成26年 2月20日現在)	第3期 (平成27年 2月20日現在)

種 類	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	31,812,369	92,007,992
合計	31,812,369	92,007,992

（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2期 自 平成25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	第3期 自 平成26年 2月21日 至 平成27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2期 （平成26年 2月20日現在）	第3期 （平成27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）	1.1533円 （11,533円）	1.2264円 （12,264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	124,438,144	281,578,632	
	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	659,871,549	792,835,666	
	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	38,444,715	82,625,381	
	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	214,227,523	505,705,490	
合計		1,036,981,931	1,662,745,169	

（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」、「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」及び「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」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26年 2月20日現在)	(平成27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		2,414,581,267	1,475,902,143
株式	3	119,574,162,660	133,690,943,760
派生商品評価勘定			82,240,160
未収入金		133,715,221	2,553,374,683
未収配当金		119,258,894	207,948,755
未収利息		1,984	404
前払金		44,207,000	
流動資産合計		122,285,927,026	138,010,409,905
資産合計		122,285,927,026	138,010,409,905
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			86,575,000
未払解約金		34,960,000	1,091,327,000
流動負債合計		286,988,880	1,177,902,000
負債合計		286,988,880	1,177,902,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	69,146,165,476	60,470,886,080
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		52,852,772,670	76,361,621,825
元本等合計		121,998,938,146	136,832,507,905
純資産合計		121,998,938,146	136,832,507,905
負債純資産合計		122,285,927,026	138,010,409,905

(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	<p>受取配当金</p> <p>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。</p>
---------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
1 期首元本額	130,928,407,068円	69,146,165,476円
期中追加設定元本額	37,445,760,823円	40,968,810,894円
期中一部解約元本額	99,228,002,415円	49,644,090,290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)	128,244,226円	124,438,144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 >	2,435,204,689円	1,041,732,440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 >	88,320,889円	52,324,915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 >	4,576,111,851円	3,159,016,695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 >	12,116,239円	587,476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 >	55,080,601円	33,623,735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 >	42,288,048円	29,285,122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 >	16,977,424,577円	14,357,462,727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 >	1,196,985,754円	900,200,315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 >	165,511,494円	84,152,580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 >	4,454,504,084円	3,580,362,450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 >	1,736,086,316円	1,485,955,474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 >	182,581,187円	134,746,496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 >	1,323,478,764円	625,607,439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 >	10,020,162,782円	12,934,042,604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 >	277,236,331円	258,403,232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 >	2,865,109,904円	2,465,118,299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 >	757,302,006円	773,992,743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>	5,006,928,140円	4,126,883,209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>	818,421,936円	517,338,199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>	1,932,675,423円	1,381,184,988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>	5,721,159円	円
ステート・ストリート日本株式インデックス・ファンドFOF<適格機関投資家限定>	5,627,852,296円	5,465,618,307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>	32,627,252円	26,724,751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>	41,647,163円	30,585,434円
ステート・ストリート4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	27,949,777円	22,649,894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>	1,288,034,879円	1,037,519,282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>	15,381,049円	13,554,041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>	17,903,818円	17,008,923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>	264,909円	261,908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>	66,337,788円	55,449,381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>	2,648,039,935円	2,061,794,013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>	760,881,567円	652,388,567円
ステート・ストリート世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	3,561,748,643円	2,931,604,384円
AMC/ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	円	83,815,091円
フレックス資産配分戦略ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	円	5,452,822円
計	69,146,165,476円	60,470,886,080円
2 受益権の総数	69,146,165,476口	60,470,886,080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。	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	株式 568,975,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入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。</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26年 2月20日現在)	(平成27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>(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>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載していません。	(3)デリバティブ取引 同左
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	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26年 2月20日現在)	(平成27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	19,663,491,546	20,704,385,073
合計	19,663,491,546	20,704,385,073

(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

(単位：円)

区分	種 類	(平成27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	2,699,075,000		2,781,475,000	82,400,000



合 計	2,699,075,000	2,781,475,000	82,400,000
-----	---------------	---------------	------------

## (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25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	自 平成26年 2月21日 至 平成27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26年 2月20日現在 )	( 平成27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 )	1.7644円 ( 17,644円 )	2.2628円 ( 22,628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)	
いすゞ自動車	192,700	1,690.50	325,759,350	
極洋	29,000	292.00	8,468,000	
日本水産	83,600	371.00	31,015,600	
マルハニチロ	13,300	1,765.00	23,474,500	
ハウスイ	6,000	132.00	792,000	
サカタのタネ	11,100	1,964.00	21,800,400	
ホクト	7,700	2,420.00	18,634,000	
ショーボンドホールディングス	6,600	5,050.00	33,330,000	
ミライト・ホールディングス	21,300	1,320.00	28,116,000	
タマホーム	5,400	561.00	3,029,400	
サンヨーホームズ	600	651.00	390,600	
住石ホールディングス	17,800	118.00	2,100,400	
日鉄鉱業	19,000	448.00	8,512,000	
三井松島産業	44,000	135.00	5,940,000	
国際石油開発帝石	359,900	1,431.50	515,196,850	
日本海洋掘削	2,100	4,175.00	8,767,500	
石油資源開発	9,700	4,005.00	38,848,500	
K&Oエナジーグループ	4,600	1,574.00	7,240,400	
ダイセキ環境ソリューション	800	1,888.00	1,510,400	
安藤・間	45,400	711.00	32,279,400	
東急建設	24,500	757.00	18,546,500	
コムシスホールディングス	30,300	1,484.00	44,965,200	
ミサワホーム	8,100	1,048.00	8,488,800	
高松コンストラクショングループ	5,200	2,662.00	13,842,400	
東建コーポレーション	2,600	5,280.00	13,728,000	
ヤマウラ	2,900	407.00	1,180,300	
大成建設	345,000	700.00	241,500,000	
大林組	205,000	764.00	156,620,000	

清水建設	209,000	851.00	177,859,000
飛島建設	44,800	266.00	11,916,800
長谷工コーポレーション	85,300	1,114.00	95,024,200
松井建設	7,000	739.00	5,173,000
銭高組	10,000	398.00	3,980,000
鹿島建設	300,000	536.00	160,800,000
不動テトラ	52,200	263.00	13,728,600
大末建設	3,000	935.00	2,805,000
鉄建建設	42,000	460.00	19,320,000
日鉄住金テックスエンジ	13,000	561.00	7,293,000
西松建設	73,000	461.00	33,653,000
三井住友建設	276,500	174.00	48,111,000
大豊建設	19,000	646.00	12,274,000
前田建設工業	46,000	949.00	43,654,000
佐田建設	23,000	147.00	3,381,000
ナカノフドー建設	6,000	408.00	2,448,000
奥村組	65,000	580.00	37,700,000
大和小田急建設	3,600	921.00	3,315,600
東鉄工業	8,300	2,675.00	22,202,500
イチケン	7,000	336.00	2,352,000
浅沼組	24,000	161.00	3,864,000
戸田建設	85,000	457.00	38,845,000
熊谷組	85,000	391.00	33,235,000
青木あすなる建設	4,000	854.00	3,416,000
北野建設	14,000	365.00	5,110,000
植木組	8,000	277.00	2,216,000
三井ホーム	9,000	519.00	4,671,000
矢作建設工業	8,500	814.00	6,919,000
ピーエス三菱	7,100	431.00	3,060,100
東日本ハウス	8,300	569.00	4,722,700
大東建託	25,900	13,350.00	345,765,000
新日本建設	8,500	438.00	3,723,000
N I P P O	16,000	1,762.00	28,192,000
東亜道路工業	13,000	428.00	5,564,000
前田道路	21,000	1,836.00	38,556,000
日本道路	20,000	605.00	12,100,000
東亜建設工業	51,000	221.00	11,271,000
若築建設	39,000	203.00	7,917,000
東洋建設	18,300	558.00	10,211,400
五洋建設	75,500	443.00	33,446,500
大林道路	8,000	697.00	5,576,000
世紀東急工業	9,900	558.00	5,524,200
福田組	10,000	805.00	8,050,000
日本ドライケミカル	1,000	2,277.00	2,277,000
住友林業	50,300	1,227.00	61,718,100
日本基礎技術	7,900	439.00	3,468,100
日成ビルド工業	19,000	295.00	5,605,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	34,000	94.00	3,196,000
巴コーポレーション	8,900	422.00	3,755,800
パナホーム	26,000	780.00	20,280,000
大和ハウス工業	200,000	2,347.00	469,400,000
ライト工業	11,000	1,071.00	11,781,000
積水ハウス	210,200	1,610.00	338,422,000
日特建設	9,100	538.00	4,895,800
北陸電気工事	4,000	804.00	3,216,000
ユアテック	11,000	796.00	8,756,000
西部電気工業	6,000	479.00	2,874,000
四電工	6,000	461.00	2,766,000
中電工	10,000	2,045.00	20,450,000
関電工	31,000	704.00	21,824,000
きんでん	45,000	1,444.00	64,980,000

東京エネシス	8,000	871.00	6,968,000
トーエネック	9,000	592.00	5,328,000
住友電設	5,400	1,307.00	7,057,800
日本電設工業	11,300	1,860.00	21,018,000
協和エクシオ	28,900	1,166.00	33,697,400
新日本空調	5,600	975.00	5,460,000
日本工営	21,000	505.00	10,605,000
N D S	11,000	307.00	3,377,000
九電工	12,000	1,450.00	17,400,000
三機工業	14,000	854.00	11,956,000
日揮	69,000	2,559.00	176,571,000
中外炉工業	21,000	290.00	6,090,000
ヤマト	7,000	441.00	3,087,000
太平電業	9,000	849.00	7,641,000
高砂熱学工業	19,300	1,481.00	28,583,300
三晃金属工業	6,000	261.00	1,566,000
N E C ネットエスアイ	7,600	2,376.00	18,057,600
朝日工業社	8,000	437.00	3,496,000
明星工業	12,000	705.00	8,460,000
大気社	9,900	2,732.00	27,046,800
ダイダン	9,000	730.00	6,570,000
日比谷総合設備	8,900	1,725.00	15,352,500
東芝プラントシステム	11,200	1,801.00	20,171,200
日本製粉	42,000	582.00	24,444,000
日清製粉グループ本社	74,800	1,427.00	106,739,600
日東富士製粉	5,000	343.00	1,715,000
昭和産業	28,000	511.00	14,308,000
鳥越製粉	5,200	709.00	3,686,800
中部飼料	6,300	676.00	4,258,800
フィード・ワンホールディングス	40,100	118.00	4,731,800
東洋精糖	14,000	104.00	1,456,000
日本甜菜製糖	35,000	208.00	7,280,000
三井製糖	27,000	434.00	11,718,000
塩水港精糖	6,800	274.00	1,863,200
ネクスト	7,500	950.00	7,125,000
日本M & A センター	9,800	3,850.00	37,730,000
ノバレーゼ	1,500	867.00	1,300,500
アコーディア・ゴルフ	23,800	1,215.00	28,917,000
タケエイ	6,200	977.00	6,057,400
トラスト・テック	1,000	1,811.00	1,811,000
パソナグループ	5,300	705.00	3,736,500
C D S	1,000	994.00	994,000
リンクアンドモチベーション	7,700	157.00	1,208,900
G C A サヴィアン	5,000	1,429.00	7,145,000
エス・エム・エス	7,200	1,346.00	9,691,200
テンプホールディングス	12,500	3,825.00	47,812,500
リニカル	1,600	947.00	1,515,200
クックパッド	4,100	4,865.00	19,946,500
エスクリ	2,000	1,276.00	2,552,000
アイ・ケイ・ケイ	1,800	1,131.00	2,035,800
森永製菓	62,000	367.00	22,754,000
中村屋	16,000	514.00	8,224,000
江崎グリコ	15,700	5,090.00	79,913,000
名糖産業	3,200	1,163.00	3,721,600
不二家	39,000	199.00	7,761,000
山崎製パン	50,000	1,966.00	98,300,000
第一屋製パン	10,000	130.00	1,300,000
モロゾフ	11,000	377.00	4,147,000
亀田製菓	3,800	4,675.00	17,765,000
寿スピリッツ	1,600	2,604.00	4,166,400
カルビー	25,300	4,370.00	110,561,000

森永乳業	62,000	468.00	29,016,000
六甲バター	3,000	1,169.00	3,507,000
ヤクルト本社	36,600	7,200.00	263,520,000
明治ホールディングス	20,200	13,220.00	267,044,000
雪印メグミルク	16,300	1,605.00	26,161,500
プリマハム	39,000	278.00	10,842,000
日本ハム	50,000	2,744.00	137,200,000
伊藤ハム	38,000	617.00	23,446,000
林兼産業	19,000	109.00	2,071,000
丸大食品	36,000	412.00	14,832,000
米久	2,200	1,900.00	4,180,000
S Foods	4,300	2,152.00	9,253,600
学情	2,400	1,004.00	2,409,600
スタジオアリス	2,900	2,083.00	6,040,700
シミックホールディングス	2,400	2,023.00	4,855,200
システナ	5,700	873.00	4,976,100
デジタルアーツ	3,200	1,137.00	3,638,400
新日鉄住金ソリューションズ	5,100	3,410.00	17,391,000
総合警備保障	21,200	3,515.00	74,518,000
キューブシステム	2,600	634.00	1,648,400
日本駐車場開発	65,600	129.00	8,462,400
コア	2,400	922.00	2,212,800
カクコム	42,300	1,831.00	77,451,300
アイロムホールディングス	1,600	1,766.00	2,825,600
ルネサンス	3,300	1,230.00	4,059,000
ディップ	1,400	5,340.00	7,476,000
SBSホールディングス	4,300	901.00	3,874,300
オプト	2,600	655.00	1,703,000
新日本科学	5,900	912.00	5,380,800
ツクイ	7,600	966.00	7,341,600
総合臨床ホールディングス	2,600	479.00	1,245,400
キャリアデザインセンター	2,000	956.00	1,912,000
エムスリー	55,100	2,556.00	140,835,600
ツカダ・グローバルホールディング	4,500	800.00	3,600,000
アウトソーシング	2,300	1,821.00	4,188,300
ウェルネット	1,600	2,266.00	3,625,600
ディー・エヌ・エー	31,300	1,380.00	43,194,000
博報堂DYホールディングス	88,200	1,284.00	113,248,800
ぐるなび	7,400	1,871.00	13,845,400
エスアールジータカミヤ	5,100	861.00	4,391,100
一休	5,000	1,728.00	8,640,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	255.00	1,275,000
ファンコミュニケーションズ	11,100	1,134.00	12,587,400
ジェイコムホールディングス	1,400	814.00	1,139,600
PGMホールディングス	9,000	1,345.00	12,105,000
WDBホールディングス	2,100	849.00	1,782,900
ティア	1,400	569.00	796,600
バリューコマース	5,500	528.00	2,904,000
サッポロホールディングス	112,000	470.00	52,640,000
アサヒグループホールディングス	137,300	3,749.50	514,806,350
麒麟ホールディングス	292,300	1,557.50	455,257,250
宝ホールディングス	53,400	798.00	42,613,200
オエノンホールディングス	17,000	222.00	3,774,000
養命酒製造	4,000	965.00	3,860,000
コカ・コーラウエスト	23,100	1,809.00	41,787,900
コカ・コーライーストジャパン	20,700	2,037.00	42,165,900
サントリー食品インターナショナル	40,700	4,290.00	174,603,000
ダイドードリンコ	3,500	4,845.00	16,957,500
伊藤園	20,200	2,467.00	49,833,400
キーコーヒー	6,100	1,799.00	10,973,900
ユニカフェ	1,600	900.00	1,440,000

ジャパンフーズ	800	1,139.00	911,200
日清オイリオグループ	33,000	434.00	14,322,000
不二製油	18,200	1,684.00	30,648,800
かどや製油	600	2,727.00	1,636,200
J-オイルミルズ	29,000	420.00	12,180,000
ローソン	22,800	8,080.00	184,224,000
サンエー	4,600	4,270.00	19,642,000
ダイユーエイト	1,100	865.00	951,500
カワチ薬品	4,700	1,999.00	9,395,300
エービーシー・マート	8,500	6,230.00	52,955,000
ハードオフコーポレーション	2,800	1,145.00	3,206,000
高千穂交易	2,400	1,091.00	2,618,400
アスクル	6,300	2,197.00	13,841,100
ゲオホールディングス	11,400	1,287.00	14,671,800
アダストリアホールディングス	5,100	2,943.00	15,009,300
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	8,000	130.00	1,040,000
伊藤忠食品	1,400	4,065.00	5,691,000
くらコーポレーション	3,600	3,830.00	13,788,000
キャンドゥ	2,800	1,592.00	4,457,600
エレマテック	2,800	2,776.00	7,772,800
パル	3,500	3,135.00	10,972,500
JALUX	1,500	2,031.00	3,046,500
エディオン	28,000	918.00	25,704,000
あらた	13,000	328.00	4,264,000
サーラコーポレーション	5,400	598.00	3,229,200
ワッツ	2,600	888.00	2,308,800
トーマンデバイス	800	1,884.00	1,507,200
J Pホールディングス	15,800	366.00	5,782,800
あみやき亭	1,000	4,075.00	4,075,000
東京エレクトロン デバイス	1,100	1,571.00	1,728,100
ひらまつ	8,200	644.00	5,280,800
双日	402,100	179.00	71,975,900
ゲンキー	600	9,580.00	5,748,000
アルフレッサ ホールディングス	71,100	1,644.00	116,888,400
サッポロドラッグストアー	400	1,764.00	705,600
大黒天物産	1,400	4,130.00	5,782,000
ハニーズ	5,300	988.00	5,236,400
キッコーマン	56,000	3,360.00	188,160,000
味の素	158,000	2,247.00	355,026,000
キューピー	34,700	2,816.00	97,715,200
ハウス食品グループ本社	25,200	2,482.00	62,546,400
カゴメ	26,300	1,818.00	47,813,400
焼津水産化学工業	3,100	1,037.00	3,214,700
アリアケジャパン	6,300	3,120.00	19,656,000
エバラ食品工業	1,300	2,130.00	2,769,000
ニチレイ	73,000	598.00	43,654,000
横浜冷凍	15,000	833.00	12,495,000
東洋水産	35,700	4,275.00	152,617,500
イートアンド	400	1,827.00	730,800
日清食品ホールディングス	28,900	5,860.00	169,354,000
永谷園	6,000	1,188.00	7,128,000
一正蒲鉾	1,300	1,819.00	2,364,700
フジッコ	7,000	1,870.00	13,090,000
ロック・フィールド	3,600	2,246.00	8,085,600
日本たばこ産業	378,700	3,712.50	1,405,923,750
ケンコーマヨネーズ	2,200	1,625.00	3,575,000
わらべや日洋	4,000	2,024.00	8,096,000
なとり	3,300	1,622.00	5,352,600
ユーグレナ	15,000	1,792.00	26,880,000
片倉工業	8,100	1,175.00	9,517,500
ゲンゼ	52,000	323.00	16,796,000

ヒューリック	101,500	1,328.00	134,792,000
神栄	9,000	206.00	1,854,000
山下医科器械	700	1,697.00	1,187,900
ラサ商事	2,200	589.00	1,295,800
アルペン	5,400	1,861.00	10,049,400
クオール	6,000	937.00	5,622,000
アルコニックス	3,400	1,845.00	6,273,000
神戸物産	2,000	4,205.00	8,410,000
ジェイアイエヌ	4,100	3,425.00	14,042,500
ビックカメラ	26,000	1,388.00	36,088,000
D C Mホールディングス	29,500	877.00	25,871,500
MonotaRO	11,700	3,880.00	45,396,000
あいホールディングス	9,800	2,250.00	22,050,000
ディービーエックス	2,100	1,117.00	2,345,700
きちり	1,200	700.00	840,000
アークランドサービス	700	4,525.00	3,167,500
J.フロントリテイリング	76,100	1,625.00	123,662,500
ドトール・日レスホールディングス	10,700	1,782.00	19,067,400
マツモトキヨシホールディングス	13,400	4,010.00	53,734,000
ブロンコピリー	1,100	3,830.00	4,213,000
スタートトゥデイ	18,700	2,848.00	53,257,600
トレジャー・ファクトリー	600	2,765.00	1,659,000
物語コーポレーション	1,700	3,610.00	6,137,000
ココカラファイン	6,300	3,325.00	20,947,500
三越伊勢丹ホールディングス	119,600	1,791.00	214,203,600
東洋紡	252,000	164.00	41,328,000
ユニチカ	187,000	54.00	10,098,000
富士紡ホールディングス	31,000	311.00	9,641,000
日清紡ホールディングス	41,000	1,200.00	49,200,000
倉敷紡績	66,000	203.00	13,398,000
ダイワボウホールディングス	55,000	199.00	10,945,000
シキボウ	40,000	121.00	4,840,000
日東紡績	47,000	488.00	22,936,000
トヨタ紡織	21,600	1,541.00	33,285,600
ウエルシアホールディングス	5,500	4,595.00	25,272,500
クリエイトSDホールディングス	3,000	4,185.00	12,555,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11,400	980.00	11,172,000
八洲電機	4,500	575.00	2,587,500
UKCホールディングス	3,900	1,951.00	7,608,900
丸善CHIホールディングス	6,800	372.00	2,529,600
OCHIホールディングス	1,900	1,472.00	2,796,800
TOKAIホールディングス	29,700	560.00	16,632,000
エー・ピーカンパニー	1,200	2,007.00	2,408,400
三洋貿易	3,500	1,406.00	4,921,000
チムニー	1,400	2,350.00	3,290,000
ウイン・パートナーズ	2,300	1,536.00	3,532,800
ネクステージ	400	659.00	263,600
ジョイフル本田	3,300	4,215.00	13,909,500
キリン堂ホールディングス	1,500	855.00	1,282,500
すかいらーく	22,400	1,350.00	30,240,000
日本毛織	20,000	803.00	16,060,000
大東紡織	12,000	73.00	876,000
トーア紡コーポレーション	34,000	76.00	2,584,000
ダイドーリミテッド	7,500	557.00	4,177,500
東京建物不動産販売	2,900	553.00	1,603,700
三栄建築設計	2,100	917.00	1,925,700
野村不動産ホールディングス	36,100	2,102.00	75,882,200
日本商業開発	1,800	1,923.00	3,461,400
プレサンスコーポレーション	2,000	3,770.00	7,540,000
常和ホールディングス	2,500	3,940.00	9,850,000
日本管理センター	2,400	1,343.00	3,223,200

サンセイランディック	1,200	772.00	926,400
エストラスト	600	693.00	415,800
フージャースホールディングス	8,300	532.00	4,415,600
オープンハウス	3,800	2,800.00	10,640,000
東急不動産ホールディングス	157,600	822.00	129,547,200
飯田グループホールディングス	38,700	1,646.00	63,700,200
帝国繊維	6,800	1,822.00	12,389,600
ブックオフコーポレーション	3,300	911.00	3,006,300
日本コークス工業	57,200	119.00	6,806,800
ミタチ産業	1,200	740.00	888,000
あさひ	3,900	1,162.00	4,531,800
日本調剤	800	4,030.00	3,224,000
コスモス薬品	3,000	18,900.00	56,700,000
シップヘルスケアホールディングス	11,000	2,640.00	29,040,000
トーエル	3,500	717.00	2,509,500
一六堂	1,200	443.00	531,600
ソフトクリエイイトホールディングス	2,200	951.00	2,092,200
セブン&アイ・ホールディングス	251,700	4,557.00	1,146,996,900
薬王堂	1,000	2,940.00	2,940,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,200	1,579.00	6,631,800
明治電機工業	2,000	1,075.00	2,150,000
ツルハホールディングス	12,800	7,960.00	101,888,000
デリカフーズ	1,100	1,059.00	1,164,900
スターティア	500	1,527.00	763,500
サンマルクホールディングス	2,200	7,790.00	17,138,000
フェリシモ	1,500	1,022.00	1,533,000
トリドール	6,500	1,637.00	10,640,500
クスリのアオキ	2,400	7,690.00	18,456,000
帝人	261,000	386.00	100,746,000
東レ	494,000	994.10	491,085,400
クラレ	108,700	1,452.00	157,832,400
旭化成	398,000	1,205.50	479,789,000
サカイオーベックス	16,000	187.00	2,992,000
稲葉製作所	2,700	1,338.00	3,612,600
宮地エンジニアリンググループ	18,000	208.00	3,744,000
トーカロ	4,200	2,295.00	9,639,000
アルファC o	2,000	1,320.00	2,640,000
SUMCO	43,900	2,224.00	97,633,600
川田テクノロジーズ	1,200	4,120.00	4,944,000
住江織物	16,000	313.00	5,008,000
日本フェルト	3,100	580.00	1,798,000
イチカワ	5,000	276.00	1,380,000
日本バイリーン	9,000	600.00	5,400,000
エコナックホールディングス	23,000	55.00	1,265,000
日東製網	7,000	163.00	1,141,000
芦森工業	13,000	163.00	2,119,000
アツギ	53,000	117.00	6,201,000
ダイニック	11,000	180.00	1,980,000
共和レザー	4,200	789.00	3,313,800
セーレン	16,100	1,075.00	17,307,500
東海染工	8,000	130.00	1,040,000
小松精練	10,400	577.00	6,000,800
ワコールホールディングス	38,000	1,272.00	48,336,000
ホギメディカル	4,000	6,090.00	24,360,000
レナウン	14,200	116.00	1,647,200
クラウディア	1,000	1,364.00	1,364,000
T S Iホールディングス	28,900	720.00	20,808,000
I Tホールディングス	19,900	2,104.00	41,869,600
ネオス	1,300	679.00	882,700
電算システム	2,200	1,544.00	3,396,800
グリー	36,900	671.00	24,759,900

コーエーテックモホールディングス	13,800	1,710.00	23,598,000
三菱総合研究所	2,300	2,775.00	6,382,500
ボルテージ	1,200	1,056.00	1,267,200
電算	800	2,296.00	1,836,800
A G S	1,300	993.00	1,290,900
ファインデックス	900	5,350.00	4,815,000
ヒト・コミュニケーションズ	900	1,701.00	1,530,900
ブレインパッド	300	1,246.00	373,800
K L a b	6,400	1,044.00	6,681,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,900	813.00	3,170,700
イーブクイニシアティブジャパン	1,700	1,049.00	1,783,300
ネクソン	57,000	1,109.00	63,213,000
アイスタイル	1,900	701.00	1,331,900
エムアップ	1,400	762.00	1,066,800
エイチーム	600	5,110.00	3,066,000
e n i s h	1,900	1,402.00	2,663,800
コロブラ	10,700	2,750.00	29,425,000
モバイルクリエイト	3,000	747.00	2,241,000
オルトプラス	1,100	1,151.00	1,266,100
ブロードリーフ	5,000	1,820.00	9,100,000
ハーツユニテッドグループ	1,800	1,746.00	3,142,800
特種東海製紙	37,000	272.00	10,064,000
ベリサーブ	1,000	1,076.00	1,076,000
ティーガイア	6,000	1,484.00	8,904,000
豆蔵ホールディングス	4,800	623.00	2,990,400
テクマトリックス	2,400	618.00	1,483,200
GMOペイメントゲートウェイ	5,300	2,481.00	13,149,300
ザッパラス	3,900	670.00	2,613,000
インターネットイニシアティブ	9,900	2,333.00	23,096,700
GMOクラウド	1,200	884.00	1,060,800
ビットアイル	7,000	533.00	3,731,000
S R Aホールディングス	3,100	1,614.00	5,003,400
システムインテグレータ	400	505.00	202,000
パイブドピッツ	400	1,968.00	787,200
朝日ネット	6,000	526.00	3,156,000
コムチュア	900	1,997.00	1,797,300
王子ホールディングス	262,000	496.00	129,952,000
日本製紙	30,800	2,041.00	62,862,800
三菱製紙	98,000	88.00	8,624,000
北越紀州製紙	40,100	573.00	22,977,300
中越パルプ工業	24,000	271.00	6,504,000
巴川製紙所	9,000	245.00	2,205,000
大王製紙	28,000	1,019.00	28,532,000
g u m i	4,600	2,507.00	11,532,200
レンゴー	57,000	538.00	30,666,000
トーモク	20,000	291.00	5,820,000
ザ・バック	4,600	2,424.00	11,150,400
コープケミカル	11,000	106.00	1,166,000
昭和電工	424,000	157.00	66,568,000
住友化学	470,000	551.00	258,970,000
日本化成	11,000	148.00	1,628,000
住友精化	13,000	874.00	11,362,000
日産化学工業	42,600	2,275.00	96,915,000
ラサ工業	23,000	141.00	3,243,000
クレハ	45,000	547.00	24,615,000
多木化学	4,000	744.00	2,976,000
テイカ	11,000	452.00	4,972,000
石原産業	108,000	118.00	12,744,000
片倉チッカリン	4,000	309.00	1,236,000
日本曹達	41,000	701.00	28,741,000



東ソー	159,000	553.00	87,927,000
トクヤマ	99,000	266.00	26,334,000
セントラル硝子	65,000	509.00	33,085,000
東亜合成	80,000	541.00	43,280,000
ダイソー	26,000	447.00	11,622,000
関東電化工業	15,000	778.00	11,670,000
電気化学工業	132,000	454.00	59,928,000
イビデン	39,900	1,980.00	79,002,000
信越化学工業	114,500	8,231.00	942,449,500
日本カーバイド工業	21,000	239.00	5,019,000
堺化学工業	26,000	395.00	10,270,000
エア・ウォーター	56,000	2,046.00	114,576,000
大陽日酸	82,000	1,802.00	147,764,000
日本化学工業	24,000	290.00	6,960,000
日本パーカライジング	15,000	2,879.00	43,185,000
高圧ガス工業	9,000	617.00	5,553,000
チタン工業	7,000	234.00	1,638,000
四国化成工業	9,000	1,039.00	9,351,000
戸田工業	13,000	514.00	6,682,000
ステラ ケミファ	3,200	1,353.00	4,329,600
保土谷化学工業	20,000	207.00	4,140,000
日本触媒	50,000	1,637.00	81,850,000
大日精化工業	27,000	666.00	17,982,000
カネカ	86,000	785.00	67,510,000
協和発酵キリン	76,000	1,396.00	106,096,000
三菱瓦斯化学	110,000	597.00	65,670,000
三井化学	290,000	350.00	101,500,000
J S R	63,000	2,159.00	136,017,000
東京応化工業	13,200	4,120.00	54,384,000
大阪有機化学工業	5,000	516.00	2,580,000
三菱ケミカルホールディングス	399,100	625.60	249,676,960
日本合成化学工業	15,000	734.00	11,010,000
ダイセル	89,700	1,613.00	144,686,100
住友ベークライト	59,000	516.00	30,444,000
積水化学工業	148,000	1,492.00	220,816,000
日本ゼオン	55,000	1,139.00	62,645,000
アイカ工業	19,100	2,731.00	52,162,100
宇部興産	321,000	191.00	61,311,000
積水樹脂	10,000	1,665.00	16,650,000
タキロン	13,000	532.00	6,916,000
旭有機材工業	22,000	289.00	6,358,000
日立化成	31,500	2,482.00	78,183,000
ニチバン	6,000	484.00	2,904,000
リケンテクノス	10,000	450.00	4,500,000
大倉工業	15,000	359.00	5,385,000
積水化成品工業	18,000	454.00	8,172,000
群栄化学工業	17,000	345.00	5,865,000
タイガースポリマー	3,600	871.00	3,135,600
ミライアル	2,200	1,581.00	3,478,200
ダイキアクシス	600	1,099.00	659,400
ダイキョーニシカワ	1,700	3,870.00	6,579,000
日本化薬	41,000	1,546.00	63,386,000
カーリットホールディングス	5,000	655.00	3,275,000
E P Sホールディングス	8,100	1,493.00	12,093,300
パナソニック インフォメーションシステムズ	1,400	3,610.00	5,054,000
プレステージ・インターナショナル	4,700	1,040.00	4,888,000
フェイス	1,600	1,329.00	2,126,400
アミューズ	1,900	2,911.00	5,530,900
野村総合研究所	34,100	4,140.00	141,174,000
ドリームインキュベータ	2,000	2,376.00	4,752,000
サイバネットシステム	4,600	468.00	2,152,800

クイック	2,600	807.00	2,098,200
T A C	4,800	210.00	1,008,000
C E ホールディングス	800	1,218.00	974,400
ケネディクス	90,300	536.00	48,400,800
電通	71,000	5,020.00	356,420,000
インテージホールディングス	3,400	1,975.00	6,715,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,300	1,007.00	2,316,100
東邦システムサイエンス	2,000	639.00	1,278,000
びあ	2,000	2,335.00	4,670,000
イオンファンタジー	2,100	1,575.00	3,307,500
ソースネクスト	3,400	789.00	2,682,600
ネクシィーズ	2,400	607.00	1,456,800
メディカルシステムネットワーク	5,200	404.00	2,100,800
ティー・ワイ・オー	4,400	176.00	774,400
日本精化	5,100	870.00	4,437,000
A D E K A	29,400	1,487.00	43,717,800
日油	53,000	845.00	44,785,000
ミヨシ油脂	26,000	141.00	3,666,000
新日本理化	10,500	220.00	2,310,000
ハリマ化成グループ	5,200	482.00	2,506,400
花王	171,800	5,150.00	884,770,000
第一工業製薬	13,000	406.00	5,278,000
三洋化成工業	20,000	942.00	18,840,000
武田薬品工業	239,200	6,052.00	1,447,638,400
アステラス製薬	727,400	1,863.50	1,355,509,900
大日本住友製薬	45,100	1,274.00	57,457,400
塩野義製薬	99,700	3,345.00	333,496,500
田辺三菱製薬	74,300	2,006.00	149,045,800
わかもと製薬	7,000	305.00	2,135,000
あすか製薬	7,600	1,145.00	8,702,000
日本新薬	15,000	3,940.00	59,100,000
ピオフェルミン製薬	1,100	2,972.00	3,269,200
中外製薬	63,500	3,455.00	219,392,500
科研製薬	22,000	3,470.00	76,340,000
エーザイ	84,200	6,148.00	517,661,600
理研ビタミン	2,000	4,140.00	8,280,000
ロート製薬	28,900	1,534.00	44,332,600
小野薬品工業	29,000	11,630.00	337,270,000
久光製薬	18,000	4,385.00	78,930,000
有機合成薬品工業	5,000	277.00	1,385,000
持田製薬	4,600	7,130.00	32,798,000
参天製薬	23,400	7,890.00	184,626,000
扶桑薬品工業	21,000	321.00	6,741,000
日本ケミファ	8,000	573.00	4,584,000
ツムラ	20,100	2,977.00	59,837,700
日医工	14,900	2,362.00	35,193,800
テルモ	93,400	3,100.00	289,540,000
みらかホールディングス	16,700	5,670.00	94,689,000
キッセイ薬品工業	11,800	3,425.00	40,415,000
生化学工業	12,100	2,118.00	25,627,800
栄研化学	5,400	1,819.00	9,822,600
日水製薬	2,500	1,375.00	3,437,500
鳥居薬品	4,400	3,315.00	14,586,000
J C R ファーマ	4,900	2,260.00	11,074,000
東和薬品	3,300	6,540.00	21,582,000
富士製薬工業	1,700	2,311.00	3,928,700
沢井製薬	10,100	7,760.00	78,376,000
ゼリア新薬工業	13,000	1,939.00	25,207,000
第一三共	214,700	1,849.00	396,980,300
キョーリン製薬ホールディングス	17,000	2,737.00	46,529,000
大幸薬品	2,700	1,999.00	5,397,300

ダイト	2,600	2,604.00	6,770,400
大塚ホールディングス	126,700	3,655.00	463,088,500
大正製薬ホールディングス	15,300	8,070.00	123,471,000
大日本塗料	36,000	155.00	5,580,000
日本ペイントホールディングス	55,200	4,270.00	235,704,000
関西ペイント	77,000	2,065.00	159,005,000
神東塗料	2,000	216.00	432,000
中国塗料	18,000	981.00	17,658,000
日本特殊塗料	4,700	813.00	3,821,100
藤倉化成	8,400	578.00	4,855,200
太陽ホールディングス	5,200	4,245.00	22,074,000
D I C	256,000	323.00	82,688,000
サカタインクス	13,200	1,179.00	15,562,800
東洋インキS Cホールディングス	63,000	575.00	36,225,000
T & K T O K A	2,100	2,472.00	5,191,200
アルプス技研	2,700	1,786.00	4,822,200
サニックス	7,100	389.00	2,761,900
ダイオーズ	1,700	913.00	1,552,100
日本空調サービス	2,900	870.00	2,523,000
オリエンタルランド	17,200	29,720.00	511,184,000
ダスキン	18,000	1,969.00	35,442,000
パーク24	30,200	2,128.00	64,265,600
明光ネットワークジャパン	6,300	1,249.00	7,868,700
ファルコホールディングス	3,200	1,376.00	4,403,200
クレスコ	1,200	1,926.00	2,311,200
フジ・メディア・ホールディングス	62,600	1,656.00	103,665,600
秀英予備校	1,600	308.00	492,800
田谷	1,400	825.00	1,155,000
ラウンドワン	18,200	691.00	12,576,200
リゾートトラスト	23,400	2,834.00	66,315,600
オービック	20,700	4,400.00	91,080,000
ジャストシステム	8,200	695.00	5,699,000
T D Cソフトウェアエンジニアリング	1,600	1,096.00	1,753,600
ヤフー	431,000	431.00	185,761,000
ビー・エム・エル	3,800	3,395.00	12,901,000
ワタベウエディング	2,500	508.00	1,270,000
トレンドマイクロ	31,800	3,645.00	115,911,000
もしもしホットライン	12,000	1,349.00	16,188,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,300	949.00	1,233,700
リソー教育	9,000	281.00	2,529,000
日本オラクル	9,600	5,200.00	49,920,000
早稲田アカデミー	900	827.00	744,300
アルファシステムズ	1,900	1,668.00	3,169,200
フューチャーアーキテクト	6,800	709.00	4,821,200
C A C H o l d i n g s	4,000	1,070.00	4,280,000
ソフトバンク・テクノロジー	1,700	1,211.00	2,058,700
トーセ	1,900	759.00	1,442,100
ユー・エス・エス	77,000	2,072.00	159,544,000
オービックビジネスコンサルタント	3,900	4,155.00	16,204,500
伊藤忠テクノソリューションズ	6,900	4,550.00	31,395,000
アイティフォー	7,000	469.00	3,283,000
東京個別指導学院	3,700	354.00	1,309,800
東計電算	1,000	1,748.00	1,748,000
サイバーエージェント	11,600	5,740.00	66,584,000
楽天	276,700	1,963.50	543,300,450
エクスネット	800	1,491.00	1,192,800
テー・オー・ダブリュー	1,800	845.00	1,521,000
大塚商会	16,200	4,725.00	76,545,000
総合メディカル	1,500	6,380.00	9,570,000
サイボウズ	8,400	332.00	2,788,800
ソフトブレーン	10,000	191.00	1,910,000

セントラルスポーツ	2,100	2,163.00	4,542,300
パラカ	2,400	1,256.00	3,014,400
電通国際情報サービス	3,600	1,144.00	4,118,400
E Mシステムズ	600	1,739.00	1,043,400
ウェザーニューズ	1,800	3,110.00	5,598,000
C I J	4,700	466.00	2,190,200
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,358.00	950,600
日本エンタープライズ	4,000	384.00	1,536,000
WOWOW	1,400	6,120.00	8,568,000
フュージョンパートナー	2,800	888.00	2,486,400
フルキャストホールディングス	6,800	570.00	3,876,000
富士フイルムホールディングス	146,100	4,002.50	584,765,250
コニカミノルタ	145,200	1,247.00	181,064,400
資生堂	113,500	1,993.50	226,262,250
ライオン	73,000	661.00	48,253,000
高砂香料工業	21,000	584.00	12,264,000
マンダム	6,500	3,970.00	25,805,000
ミルボン	3,800	3,420.00	12,996,000
ファンケル	15,000	1,741.00	26,115,000
コーセー	10,300	5,740.00	59,122,000
コタ	1,900	1,948.00	3,701,200
ドクターシーラボ	4,400	4,125.00	18,150,000
シーボン	600	2,851.00	1,710,600
ポーラ・オルビスホールディングス	7,600	5,390.00	40,964,000
ノエビアホールディングス	4,000	2,255.00	9,020,000
アジュバンコスメジャパン	800	1,009.00	807,200
エステー	4,300	1,042.00	4,480,600
アグロ カネショウ	2,000	965.00	1,930,000
コニシ	5,000	2,041.00	10,205,000
長谷川香料	8,200	1,759.00	14,423,800
星光PMC	3,400	936.00	3,182,400
小林製薬	10,500	8,000.00	84,000,000
荒川化学工業	5,400	1,363.00	7,360,200
メック	4,900	847.00	4,150,300
日本高純度化学	1,700	2,587.00	4,397,900
J C U	1,700	5,510.00	9,367,000
新田ゼラチン	4,100	805.00	3,300,500
アース製薬	4,600	3,945.00	18,147,000
イハラケミカル工業	9,900	1,378.00	13,642,200
北興化学工業	7,000	423.00	2,961,000
大成ラミック	1,800	2,894.00	5,209,200
クミアイ化学工業	13,000	898.00	11,674,000
日本農薬	14,800	1,372.00	20,305,600
昭和シェル石油	57,000	1,145.00	65,265,000
コスモ石油	176,000	178.00	31,328,000
富士興産	2,400	604.00	1,449,600
ニチレキ	8,000	983.00	7,864,000
東燃ゼネラル石油	96,000	1,124.00	107,904,000
ユシロ化学工業	3,700	1,543.00	5,709,100
ビービー・カストロール	2,500	1,271.00	3,177,500
富士石油	14,500	389.00	5,640,500
MORESCO	1,700	2,172.00	3,692,400
出光興産	30,200	2,119.00	63,993,800
J Xホールディングス	708,500	466.70	330,656,950
横浜ゴム	71,000	1,170.00	83,070,000
東洋ゴム工業	28,800	2,519.00	72,547,200
ブリヂストン	200,100	4,659.00	932,265,900
住友ゴム工業	49,700	2,092.00	103,972,400
藤倉ゴム工業	5,200	798.00	4,149,600
オカモト	22,000	469.00	10,318,000
アキレス	54,000	152.00	8,208,000

フコク	2,800	1,196.00	3,348,800
ニッタ	6,400	3,045.00	19,488,000
クリエートメディック	1,900	1,036.00	1,968,400
住友理工	11,900	1,000.00	11,900,000
三ツ星ベルト	16,000	978.00	15,648,000
バンドー化学	23,000	437.00	10,051,000
鬼怒川ゴム工業	14,000	524.00	7,336,000
旭硝子	314,000	718.00	225,452,000
日本板硝子	307,000	116.00	35,612,000
石塚硝子	10,000	230.00	2,300,000
有沢製作所	10,800	972.00	10,497,600
日本山村硝子	25,000	175.00	4,375,000
日本電気硝子	122,000	570.00	69,540,000
オハラ	2,200	580.00	1,276,000
住友大阪セメント	118,000	357.00	42,126,000
太平洋セメント	398,000	376.00	149,648,000
デイ・シイ	6,800	496.00	3,372,800
リゾートソリューション	5,000	258.00	1,290,000
日本ヒューム	6,600	875.00	5,775,000
日本コンクリート工業	10,900	483.00	5,264,700
三谷セキサン	3,200	2,039.00	6,524,800
ジャパンパイル	8,500	701.00	5,958,500
東海カーボン	56,000	361.00	20,216,000
日本カーボン	34,000	286.00	9,724,000
東洋炭素	3,500	2,332.00	8,162,000
ノリタケカンパニーリミテド	36,000	293.00	10,548,000
TOTO	94,000	1,553.00	145,982,000
日本碍子	81,000	2,332.00	188,892,000
日本特殊陶業	55,000	3,320.00	182,600,000
ダントーホールディングス	9,000	160.00	1,440,000
MARUWA	1,900	2,731.00	5,188,900
品川リフラクトリーズ	16,000	287.00	4,592,000
黒崎播磨	14,000	245.00	3,430,000
ヨータイ	3,000	380.00	1,140,000
イソライト工業	1,000	220.00	220,000
東京窯業	7,000	221.00	1,547,000
ニッカトー	3,100	413.00	1,280,300
フジインコーポレーテッド	6,200	1,881.00	11,662,200
エーアンドエーマテリアル	15,000	119.00	1,785,000
ニチアス	29,000	685.00	19,865,000
新日鐵住金	2,699,000	314.80	849,645,200
神戸製鋼所	1,103,000	221.00	243,763,000
中山製鋼所	40,000	86.00	3,440,000
合同製鐵	32,000	189.00	6,048,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	162,800	2,833.00	461,212,400
日新製鋼	27,000	1,585.00	42,795,000
東京製鐵	32,200	900.00	28,980,000
共英製鋼	6,900	2,071.00	14,289,900
大和工業	14,500	3,180.00	46,110,000
東京鐵鋼	12,000	552.00	6,624,000
大阪製鐵	4,000	2,118.00	8,472,000
淀川製鋼所	46,000	479.00	22,034,000
東洋鋼鈑	15,000	562.00	8,430,000
丸一鋼管	19,500	2,837.00	55,321,500
モリ工業	10,000	433.00	4,330,000
大同特殊鋼	107,000	518.00	55,426,000
日本高周波鋼業	24,000	117.00	2,808,000
日本冶金工業	50,300	246.00	12,373,800
山陽特殊製鋼	38,000	477.00	18,126,000
愛知製鋼	38,000	570.00	21,660,000
日立金属	65,000	1,901.00	123,565,000

日本金属	19,000	155.00	2,945,000
大平洋金属	41,000	352.00	14,432,000
新日本電工	39,200	316.00	12,387,200
栗本鐵工所	33,000	226.00	7,458,000
虹技	9,000	225.00	2,025,000
日本鑄鉄管	6,000	230.00	1,380,000
日本製鋼所	91,000	484.00	44,044,000
三菱製鋼	42,000	252.00	10,584,000
日亜鋼業	9,000	347.00	3,123,000
日本精線	5,000	673.00	3,365,000
大紀アルミニウム工業所	10,000	345.00	3,450,000
日本軽金属ホールディングス	157,100	179.00	28,120,900
三井金属鉱業	173,000	268.00	46,364,000
東邦亜鉛	36,000	375.00	13,500,000
三菱マテリアル	398,000	398.00	158,404,000
住友金属鉱山	176,000	1,810.00	318,560,000
DOWAホールディングス	76,000	958.00	72,808,000
古河機械金属	101,000	207.00	20,907,000
エス・サイエンス	37,200	52.00	1,934,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,300	2,475.00	15,592,500
東邦チタニウム	10,800	768.00	8,294,400
UACJ	74,000	333.00	24,642,000
古河電気工業	187,000	211.00	39,457,000
住友電気工業	240,400	1,547.00	371,898,800
フジクラ	89,000	499.00	44,411,000
昭和電線ホールディングス	70,000	101.00	7,070,000
東京特殊電線	800	1,547.00	1,237,600
タツタ電線	11,900	493.00	5,866,700
沖電線	6,000	337.00	2,022,000
カナレ電気	1,000	2,611.00	2,611,000
平河ヒューテック	1,700	1,402.00	2,383,400
リョービ	36,000	342.00	12,312,000
アーレスティ	5,500	652.00	3,586,000
アサヒホールディングス	9,700	1,967.00	19,079,900
東洋製罐グループホールディングス	45,300	1,596.00	72,298,800
ホッカンホールディングス	15,000	282.00	4,230,000
コロナ	3,300	1,165.00	3,844,500
横河ブリッジホールディングス	12,200	1,316.00	16,055,200
OSJBホールディングス	9,000	273.00	2,457,000
駒井ハルテック	12,000	286.00	3,432,000
高田機工	6,000	247.00	1,482,000
三和ホールディングス	61,400	837.00	51,391,800
文化シャッター	18,000	979.00	17,622,000
三協立山	7,900	1,940.00	15,326,000
アルインコ	2,600	1,100.00	2,860,000
東洋シャッター	1,500	836.00	1,254,000
LIXILグループ	94,800	2,763.00	261,932,400
日本ファイルコン	4,900	483.00	2,366,700
ノーリツ	12,700	2,025.00	25,717,500
長府製作所	6,900	3,050.00	21,045,000
リンナイ	11,800	8,380.00	98,884,000
ユニプレス	11,600	2,219.00	25,740,400
ダイニチ工業	3,100	803.00	2,489,300
日東精工	10,000	365.00	3,650,000
三洋工業	7,000	224.00	1,568,000
岡部	12,700	1,060.00	13,462,000
ジーテクト	4,200	1,084.00	4,552,800
中国工業	1,300	836.00	1,086,800
東プレ	12,400	1,723.00	21,365,200
高周波熱錬	11,100	886.00	9,834,600
東京製綱	43,000	213.00	9,159,000

サンコール	4,000	677.00	2,708,000
モリテック スチール	2,800	324.00	907,200
パイオラックス	3,200	5,380.00	17,216,000
日本発條	55,300	1,239.00	68,516,700
中央発條	8,000	348.00	2,784,000
アドバネクス	14,000	187.00	2,618,000
三浦工業	28,400	1,430.00	40,612,000
タクマ	22,000	922.00	20,284,000
テクノプロ・ホールディングス	6,900	2,423.00	16,718,700
リブセンス	3,600	677.00	2,437,200
ジャパンマテリアル	2,000	1,599.00	3,198,000
ベクトル	1,200	1,580.00	1,896,000
ウチヤマホールディングス	3,200	573.00	1,833,600
サクセスホールディングス	400	1,206.00	482,400
アサンテ	1,400	1,253.00	1,754,200
M & Aキャピタルパートナーズ	100	2,492.00	249,200
E R Iホールディングス	1,500	995.00	1,492,500
リクルートホールディングス	72,600	3,600.00	261,360,000
ツガミ	19,000	719.00	13,661,000
オークマ	41,000	1,145.00	46,945,000
東芝機械	35,000	458.00	16,030,000
アマダ	95,000	1,079.00	102,505,000
アイダエンジニアリング	14,100	1,351.00	19,049,100
滝澤鉄工所	19,000	220.00	4,180,000
富士機械製造	21,100	1,290.00	27,219,000
牧野フライス製作所	32,000	1,000.00	32,000,000
オーエスジー	29,000	2,296.00	66,584,000
ダイジェット工業	7,000	228.00	1,596,000
旭ダイヤモンド工業	17,700	1,266.00	22,408,200
D M G森精機	40,200	1,740.00	69,948,000
ディスコ	7,400	10,300.00	76,220,000
日東工器	3,700	2,181.00	8,069,700
パンチ工業	1,300	1,422.00	1,848,600
豊田自動織機	55,500	6,600.00	366,300,000
豊和工業	3,500	744.00	2,604,000
大阪機工	24,000	160.00	3,840,000
石川製作所	13,000	103.00	1,339,000
東洋機械金属	4,000	470.00	1,880,000
津田駒工業	15,000	154.00	2,310,000
エンシュウ	14,000	112.00	1,568,000
島精機製作所	9,100	2,072.00	18,855,200
日阪製作所	8,100	992.00	8,035,200
やまびこ	2,500	5,150.00	12,875,000
ベガサスミシン製造	5,700	612.00	3,488,400
ナプテスコ	38,800	3,125.00	121,250,000
三井海洋開発	6,500	1,997.00	12,980,500
レオン自動機	5,000	507.00	2,535,000
S M C	19,100	34,000.00	649,400,000
新川	5,100	691.00	3,524,100
ホソカワミクロン	11,000	634.00	6,974,000
ユニオンツール	3,200	3,375.00	10,800,000
オイレス工業	8,100	2,119.00	17,163,900
日精エー・エス・ピー機械	2,000	2,324.00	4,648,000
サトーホールディングス	8,000	2,445.00	19,560,000
日本エアーテック	1,900	678.00	1,288,200
日精樹脂工業	4,600	1,380.00	6,348,000
ワイエイシイ	3,100	655.00	2,030,500
小松製作所	316,400	2,479.50	784,513,800
住友重機械工業	174,000	738.00	128,412,000
日立建機	28,500	2,251.00	64,153,500
日工	9,000	418.00	3,762,000

巴工業	2,600	1,710.00	4,446,000
井関農機	66,000	244.00	16,104,000
T O W A	5,400	707.00	3,817,800
丸山製作所	16,000	232.00	3,712,000
北川鉄工所	29,000	244.00	7,076,000
シンニッタン	6,500	559.00	3,633,500
クボタ	308,000	1,907.00	587,356,000
荏原実業	1,900	1,402.00	2,663,800
東洋エンジニアリング	33,000	356.00	11,748,000
三菱化工機	21,000	456.00	9,576,000
月島機械	11,300	1,340.00	15,142,000
帝国電機製作所	4,100	1,223.00	5,014,300
東京機械製作所	26,000	76.00	1,976,000
新東工業	15,100	850.00	12,835,000
澁谷工業	5,400	2,231.00	12,047,400
アイチ コーポレーション	8,800	581.00	5,112,800
小森コーポレーション	15,700	1,324.00	20,786,800
鶴見製作所	4,800	2,004.00	9,619,200
住友精密工業	10,000	479.00	4,790,000
酒井重工業	13,000	297.00	3,861,000
荏原製作所	132,000	475.00	62,700,000
石井鐵工所	11,000	224.00	2,464,000
西島製作所	6,100	920.00	5,612,000
北越工業	4,700	1,062.00	4,991,400
千代田化工建設	49,000	989.00	48,461,000
ダイキン工業	88,800	7,761.00	689,176,800
オルガノ	12,000	483.00	5,796,000
トーヨーカネツ	37,000	239.00	8,843,000
栗田工業	36,100	2,976.00	107,433,600
椿本チエイン	33,000	990.00	32,670,000
大同工業	13,000	273.00	3,549,000
日本コンベヤ	19,000	228.00	4,332,000
日機装	20,000	985.00	19,700,000
木村化工機	5,700	500.00	2,850,000
新興ブランテック	14,200	951.00	13,504,200
アネスト岩田	9,500	794.00	7,543,000
ダイフク	30,000	1,491.00	44,730,000
サムコ	800	1,099.00	879,200
加藤製作所	13,000	785.00	10,205,000
油研工業	12,000	252.00	3,024,000
タダノ	29,000	1,418.00	41,122,000
フジテック	18,000	1,221.00	21,978,000
C K D	17,300	1,049.00	18,147,700
キトー	6,700	1,142.00	7,651,400
平和	13,200	2,480.00	32,736,000
理想科学工業	7,500	1,944.00	14,580,000
S A N K Y O	18,500	4,875.00	90,187,500
日本金銭機械	5,600	1,793.00	10,040,800
マースエンジニアリング	3,400	2,227.00	7,571,800
福島工業	3,300	1,683.00	5,553,900
オーイズミ	2,000	945.00	1,890,000
ダイコク電機	2,400	1,765.00	4,236,000
アマノ	20,600	1,427.00	29,396,200
J U K I	46,000	424.00	19,504,000
サンデン	37,000	601.00	22,237,000
蛇の目ミシン工業	59,000	152.00	8,968,000
ブラザー工業	78,800	2,019.00	159,097,200
マックス	9,000	1,385.00	12,465,000
モリタホールディングス	10,800	1,273.00	13,748,400
グローリー	19,500	3,175.00	61,912,500
新晃工業	4,200	1,296.00	5,443,200



大和冷機工業	8,800	725.00	6,380,000
セガサミーホールディングス	65,500	1,798.00	117,769,000
日本ピストンリング	24,000	258.00	6,192,000
リケン	26,000	475.00	12,350,000
T P R	6,900	2,938.00	20,272,200
ホシザキ電機	13,300	6,460.00	85,918,000
大豊工業	4,900	1,389.00	6,806,100
日本精工	125,000	1,597.00	199,625,000
N T N	141,000	567.00	79,947,000
ジェイテクト	64,900	1,833.00	118,961,700
不二越	56,000	672.00	37,632,000
ミネベア	91,000	1,849.00	168,259,000
日本トムソン	21,000	604.00	12,684,000
T H K	40,500	2,759.00	111,739,500
ユースン精機	2,700	2,155.00	5,818,500
前澤給装工業	2,400	1,453.00	3,487,200
イーグル工業	8,600	2,493.00	21,439,800
前澤工業	3,900	342.00	1,333,800
日本ピラー工業	6,600	936.00	6,177,600
キッツ	27,700	619.00	17,146,300
日立製作所	1,464,000	831.80	1,217,755,200
東芝	1,284,000	490.10	629,288,400
三菱電機	610,000	1,357.00	827,770,000
富士電機	169,000	542.00	91,598,000
東洋電機製造	12,000	432.00	5,184,000
安川電機	71,600	1,599.00	114,488,400
シンフォニアテクノロジー	42,000	215.00	9,030,000
明電舎	57,000	381.00	21,717,000
オリジン電気	9,000	522.00	4,698,000
山洋電気	14,000	817.00	11,438,000
デンヨー	5,600	1,930.00	10,808,000
日立工機	16,500	923.00	15,229,500
三櫻工業	7,600	776.00	5,897,600
マキタ	39,700	5,650.00	224,305,000
東芝テック	44,000	741.00	32,604,000
芝浦メカトロニクス	10,000	291.00	2,910,000
マブチモーター	18,600	5,760.00	107,136,000
日本電産	65,900	8,186.00	539,457,400
東光高岳	3,000	1,799.00	5,397,000
宮越ホールディングス	1,800	487.00	876,600
ダイヘン	34,000	570.00	19,380,000
ヤーマン	900	1,615.00	1,453,500
J V C ケンウッド	45,200	376.00	16,995,200
第一精工	2,200	2,276.00	5,007,200
日新電機	14,000	705.00	9,870,000
大崎電気工業	10,000	816.00	8,160,000
オムロン	65,800	5,110.00	336,238,000
日東工業	9,900	2,182.00	21,601,800
I D E C	7,300	1,032.00	7,533,600
不二電機工業	600	1,520.00	912,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	117,000	531.00	62,127,000
サクサホールディングス	15,000	223.00	3,345,000
メルコホールディングス	3,400	1,883.00	6,402,200
テクノメディカ	1,300	2,504.00	3,255,200
日本電気	789,000	356.00	280,884,000
富士通	588,000	712.70	419,067,600
沖電気工業	211,000	254.00	53,594,000
岩崎通信機	31,000	91.00	2,821,000
電気興業	17,000	531.00	9,027,000
サンケン電気	31,000	833.00	25,823,000
ナカヨ	6,000	386.00	2,316,000

アイホン	3,500	1,835.00	6,422,500
ルネサスエレクトロニクス	32,000	886.00	28,352,000
セイコーエプソン	41,600	4,410.00	183,456,000
ワコム	47,800	619.00	29,588,200
アルバック	10,400	1,796.00	18,678,400
アクセル	2,700	1,696.00	4,579,200
E I Z O	5,700	2,605.00	14,848,500
ジャパンディスプレイ	93,400	488.00	45,579,200
日本信号	17,000	1,206.00	20,502,000
京三製作所	14,000	380.00	5,320,000
能美防災	8,100	1,469.00	11,898,900
ホーチキ	4,000	894.00	3,576,000
エレコム	1,900	2,390.00	4,541,000
日本無線	13,000	357.00	4,641,000
パナソニック	743,100	1,458.00	1,083,439,800
シャープ	515,000	245.00	126,175,000
アンリツ	38,000	846.00	32,148,000
富士通ゼネラル	19,000	1,266.00	24,054,000
日立国際電気	16,000	1,572.00	25,152,000
ソニー	394,500	3,201.00	1,262,794,500
T D K	36,800	7,920.00	291,456,000
帝国通信工業	14,000	241.00	3,374,000
ミツミ電機	21,800	893.00	19,467,400
タムラ製作所	24,000	419.00	10,056,000
アルプス電気	48,100	2,624.00	126,214,400
池上通信機	20,000	182.00	3,640,000
パイオニア	92,800	240.00	22,272,000
日本電波工業	5,400	964.00	5,205,600
鈴木	700	929.00	650,300
日本トリム	1,400	3,435.00	4,809,000
ローランド ディー . ジー .	2,500	3,270.00	8,175,000
日本コロムビア	1,700	397.00	674,900
フォスター電機	6,300	2,884.00	18,169,200
クラリオン	32,000	389.00	12,448,000
S M K	18,000	503.00	9,054,000
ヨコオ	4,900	655.00	3,209,500
東光	14,000	345.00	4,830,000
ティアック	30,000	58.00	1,740,000
ホシデン	19,400	649.00	12,590,600
ヒロセ電機	9,800	15,360.00	150,528,000
日本航空電子工業	17,000	2,776.00	47,192,000
T O A	6,600	1,185.00	7,821,000
日立マクセル	9,200	2,066.00	19,007,200
古野電気	7,300	1,176.00	8,584,800
ユニデン	18,000	224.00	4,032,000
アルパイン	14,700	2,005.00	29,473,500
スミダコーポレーション	5,200	648.00	3,369,600
アイコム	3,400	2,777.00	9,441,800
リオン	1,800	1,516.00	2,728,800
船井電機	6,200	1,345.00	8,339,000
横河電機	60,900	1,300.00	79,170,000
新電元工業	24,000	635.00	15,240,000
アズビル	19,900	3,120.00	62,088,000
東亜ディーケーケー	1,900	669.00	1,271,100
日本光電工業	13,000	6,100.00	79,300,000
チノー	2,100	1,219.00	2,559,900
共和電業	8,000	476.00	3,808,000
日本電子材料	2,200	747.00	1,643,400
堀場製作所	11,200	4,360.00	48,832,000
アドバンテスト	41,500	1,512.00	62,748,000
小野測器	3,000	949.00	2,847,000

エスベック	6,800	1,222.00	8,309,600
パナソニック デバイスSUNX	5,600	928.00	5,196,800
キーエンス	13,800	60,300.00	832,140,000
日置電機	3,200	1,905.00	6,096,000
シスメックス	47,200	5,900.00	278,480,000
メガチップス	6,400	1,380.00	8,832,000
OBARA GROUP	4,000	6,480.00	25,920,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	3,600	728.00	2,620,800
澤藤電機	3,000	236.00	708,000
デンソー	150,600	5,540.00	834,324,000
コーセル	8,900	1,344.00	11,961,600
新日本無線	5,000	477.00	2,385,000
オプテックス	4,200	2,105.00	8,841,000
千代田インテグレ	2,700	2,242.00	6,053,400
レーザーテック	6,300	1,471.00	9,267,300
スタンレー電気	43,700	2,856.00	124,807,200
岩崎電気	20,000	228.00	4,560,000
ウシオ電機	36,900	1,466.00	54,095,400
岡谷電機産業	2,800	463.00	1,296,400
ヘリオス テクノ ホールディング	5,800	431.00	2,499,800
日本セラミック	3,500	1,583.00	5,540,500
遠藤照明	2,800	1,410.00	3,948,000
日本デジタル研究所	5,200	1,605.00	8,346,000
古河電池	4,000	939.00	3,756,000
双信電機	2,600	416.00	1,081,600
山一電機	6,900	886.00	6,113,400
函研	4,400	1,085.00	4,774,000
日本電子	26,000	572.00	14,872,000
カシオ計算機	61,100	1,898.00	115,967,800
ファナック	63,500	23,285.00	1,478,597,500
日本シイエムケイ	15,100	322.00	4,862,200
エンプラス	2,800	4,905.00	13,734,000
大真空	12,000	332.00	3,984,000
ローム	30,000	7,570.00	227,100,000
浜松ホトニクス	25,400	6,720.00	170,688,000
三井ハイテック	8,000	811.00	6,488,000
新光電気工業	23,300	908.00	21,156,400
京セラ	100,100	5,772.00	577,777,200
協栄産業	6,000	206.00	1,236,000
太陽誘電	31,800	1,385.00	44,043,000
村田製作所	64,000	13,650.00	873,600,000
ユースン	8,500	734.00	6,239,000
双葉電子工業	10,600	1,936.00	20,521,600
日東電工	49,300	7,392.00	364,425,600
北陸電気工業	26,000	197.00	5,122,000
東海理化電機製作所	16,000	2,541.00	40,656,000
ニチコン	19,400	1,044.00	20,253,600
日本ケミコン	50,000	387.00	19,350,000
KOA	8,500	1,173.00	9,970,500
三井造船	235,000	208.00	48,880,000
日立造船	47,500	687.00	32,632,500
三菱重工業	1,022,000	650.10	664,402,200
川崎重工業	443,000	562.00	248,966,000
IHI	439,000	550.00	241,450,000
名村造船所	17,200	1,161.00	19,969,200
サノヤスホールディングス	7,300	284.00	2,073,200
日本車輛製造	22,000	364.00	8,008,000
ニチュ三菱フォークリフト	6,800	696.00	4,732,800
近畿車輛	9,000	363.00	3,267,000
FPG	5,200	2,674.00	13,904,800
島根銀行	1,100	1,478.00	1,625,800

じもとホールディングス	43,400	243.00	10,546,200
全国保証	15,900	3,930.00	62,487,000
足利ホールディングス	38,300	506.00	19,379,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	7,900	3,600.00	28,440,000
日産自動車	855,900	1,206.00	1,032,215,400
トヨタ自動車	841,300	8,078.00	6,796,021,400
日野自動車	87,000	1,753.00	152,511,000
三菱自動車工業	223,400	1,085.00	242,389,000
エフテック	3,500	1,215.00	4,252,500
レシップホールディングス	1,900	872.00	1,656,800
GMB	1,100	1,318.00	1,449,800
ファルテック	700	1,638.00	1,146,600
武蔵精密工業	6,600	2,524.00	16,658,400
日産車体	26,700	1,574.00	42,025,800
新明和工業	25,000	1,240.00	31,000,000
極東開発工業	11,500	1,304.00	14,996,000
日信工業	11,300	1,860.00	21,018,000
トピー工業	51,000	284.00	14,484,000
ティラド	23,000	256.00	5,888,000
曙ブレーキ工業	25,900	448.00	11,603,200
タチエス	9,800	1,586.00	15,542,800
NOK	29,500	3,315.00	97,792,500
フタバ産業	18,700	579.00	10,827,300
カヤバ工業	69,000	455.00	31,395,000
シロキ工業	13,000	327.00	4,251,000
市光工業	14,000	241.00	3,374,000
大同メタル工業	8,600	1,183.00	10,173,800
プレス工業	30,000	462.00	13,860,000
カルソニックカンセイ	47,000	696.00	32,712,000
太平洋工業	12,500	1,015.00	12,687,500
ケーヒン	14,200	1,879.00	26,681,800
河西工業	7,500	1,005.00	7,537,500
アイシン精機	55,800	4,465.00	249,147,000
富士機工	6,800	511.00	3,474,800
マツダ	181,700	2,520.00	457,884,000
ダイハツ工業	72,700	1,726.00	125,480,200
今仙電機製作所	5,200	1,585.00	8,242,000
本田技研工業	548,800	3,964.50	2,175,717,600
スズキ	127,400	3,748.50	477,558,900
富士重工業	207,500	4,000.50	830,103,750
安永	1,900	647.00	1,229,300
ヤマハ発動機	92,700	2,768.00	256,593,600
ショーワ	14,600	1,246.00	18,191,600
小糸製作所	36,500	3,745.00	136,692,500
TBK	7,600	660.00	5,016,000
エクセディ	8,400	2,792.00	23,452,800
ミツバ	11,400	2,244.00	25,581,600
豊田合成	19,600	2,595.00	50,862,000
愛三工業	9,500	1,128.00	10,716,000
盟和産業	5,000	151.00	755,000
ヨロズ	5,700	2,370.00	13,509,000
エフ・シー・シー	9,100	1,960.00	17,836,000
新家工業	12,000	191.00	2,292,000
シマノ	26,300	16,800.00	441,840,000
タカタ	11,100	1,368.00	15,184,800
テイ・エス テック	12,800	3,345.00	42,816,000
小野建	5,100	1,080.00	5,508,000
はるやま商事	2,900	737.00	2,137,300
佐島電機	5,000	821.00	4,105,000
カップ・クリエイトホールディングス	9,400	1,147.00	10,781,800
エコートレーディング	1,700	675.00	1,147,500

伯東	4,000	1,346.00	5,384,000
コンドーテック	4,500	796.00	3,582,000
中山福	3,400	905.00	3,077,000
ライトオン	4,700	767.00	3,604,900
ナガイレーベン	8,800	2,250.00	19,800,000
ジーンズメイト	2,600	255.00	663,000
三菱食品	6,700	2,532.00	16,964,400
良品計画	7,400	14,610.00	108,114,000
三城ホールディングス	7,800	476.00	3,712,800
松田産業	4,400	1,437.00	6,322,800
メディカルホールディングス	60,100	1,490.00	89,549,000
アドヴァン	3,200	1,427.00	4,566,400
S P K	1,300	2,124.00	2,761,200
萩原電気	1,600	1,872.00	2,995,200
アズワン	4,400	3,555.00	15,642,000
スズデン	1,800	717.00	1,290,600
尾家産業	1,800	864.00	1,555,200
シモジマ	3,900	1,093.00	4,262,700
ドウシシャ	7,900	2,013.00	15,902,700
小津産業	1,300	2,101.00	2,731,300
コナカ	6,900	694.00	4,788,600
高速	3,700	902.00	3,337,400
ハウス オブ ローゼ	600	1,434.00	860,400
G - 7ホールディングス	1,200	1,080.00	1,296,000
たけびし	2,400	1,120.00	2,688,000
イオン北海道	3,600	700.00	2,520,000
コジマ	8,500	344.00	2,924,000
ヒマラヤ	1,600	1,005.00	1,608,000
コーナン商事	9,300	1,439.00	13,382,700
黒田電気	10,200	1,768.00	18,033,600
ネットワンシステムズ	24,700	789.00	19,488,300
エコス	2,300	977.00	2,247,100
ワタミ	7,100	1,145.00	8,129,500
マルシェ	1,600	912.00	1,459,200
ドンキホーテホールディングス	19,400	8,570.00	166,258,000
丸文	5,100	794.00	4,049,400
西松屋チェーン	11,900	984.00	11,709,600
ゼンショーホールディングス	30,800	1,065.00	32,802,000
ハピネット	3,500	1,340.00	4,690,000
幸楽苑	3,700	1,559.00	5,768,300
ハークスレイ	1,900	1,042.00	1,979,800
橋本総業	1,300	1,392.00	1,809,600
サイゼリヤ	9,000	2,014.00	18,126,000
エクセル	2,700	1,366.00	3,688,200
マルカキカイ	1,900	1,689.00	3,209,100
アルゴグラフィックス	2,500	1,746.00	4,365,000
ガリバーインターナショナル	18,400	929.00	17,093,600
日本エム・ディ・エム	4,900	618.00	3,028,200
ポブラ	1,700	562.00	955,400
ユナイテッドアローズ	7,800	3,650.00	28,470,000
進和	3,500	1,406.00	4,921,000
エスケイジャパン	2,100	237.00	497,700
ダイトエレクトロン	2,600	709.00	1,843,400
ハイデイ日高	3,800	3,770.00	14,326,000
シークス	3,800	2,412.00	9,165,600
京都きもの友禅	3,700	1,011.00	3,740,700
コロワイド	19,900	1,598.00	31,800,200
田中商事	1,600	695.00	1,112,000
オーハシテクニカ	3,700	1,660.00	6,142,000
壱番屋	2,700	5,120.00	13,824,000
マクニカ	3,100	3,775.00	11,702,500

白銅	1,700	1,213.00	2,062,100
トップカルチャー	2,900	503.00	1,458,700
P L A N T	1,400	1,321.00	1,849,400
スギホールディングス	10,800	5,890.00	63,612,000
島津製作所	73,000	1,250.00	91,250,000
J M S	12,000	297.00	3,564,000
クボテック	2,000	307.00	614,000
ショットモリテックス	1,400	248.00	347,200
長野計器	3,800	707.00	2,686,600
バイ・テクノロジー	1,200	2,329.00	2,794,800
スター精密	11,700	1,600.00	18,720,000
東京計器	21,000	269.00	5,649,000
愛知時計電機	9,000	327.00	2,943,000
オーバル	4,300	342.00	1,470,600
東京精密	11,100	2,548.00	28,282,800
マニー	1,700	7,200.00	12,240,000
ニコン	113,800	1,528.00	173,886,400
トプコン	18,400	2,506.00	46,110,400
オリンパス	90,800	4,280.00	388,624,000
理研計器	5,400	1,288.00	6,955,200
S C R E E Nホールディングス	58,000	809.00	46,922,000
キヤノン電子	5,600	2,344.00	13,126,400
タムロン	4,700	2,302.00	10,819,400
HOYA	145,100	4,827.50	700,470,250
ノーリツ鋼機	5,700	675.00	3,847,500
エー・アンド・デイ	5,400	480.00	2,592,000
キヤノン	353,500	3,832.50	1,354,788,750
リコー	183,300	1,226.50	224,817,450
シチズンホールディングス	74,900	932.00	69,806,800
リズム時計工業	26,000	161.00	4,186,000
大研医器	4,200	1,160.00	4,872,000
パラマウントベッドホールディングス	6,500	3,145.00	20,442,500
S H O - B I	2,800	409.00	1,145,200
前田工織	6,000	1,043.00	6,258,000
永大産業	9,000	446.00	4,014,000
アートネイチャー	4,400	1,099.00	4,835,600
ダンロップスポーツ	3,800	1,291.00	4,905,800
バンダイナムコホールディングス	67,200	2,156.00	144,883,200
共立印刷	11,500	302.00	3,473,000
フランスベッドホールディングス	43,000	186.00	7,998,000
マーベラス	10,300	1,777.00	18,303,100
パイロットコーポレーション	5,300	6,940.00	36,782,000
萩原工業	1,200	1,974.00	2,368,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,100	1,957.00	23,679,700
トッパン・フォームズ	11,000	1,256.00	13,816,000
フジシールインターナショナル	7,500	3,580.00	26,850,000
タカラトミー	22,100	665.00	14,696,500
廣済堂	6,100	508.00	3,098,800
A s - m e エステール	1,700	835.00	1,419,500
アーク	20,400	138.00	2,815,200
レック	2,100	1,410.00	2,961,000
タカノ	3,000	612.00	1,836,000
プロネクサス	6,000	799.00	4,794,000
ホクシン	6,100	135.00	823,500
ウッドワン	11,000	276.00	3,036,000
大建工業	25,000	280.00	7,000,000
きもと	12,500	295.00	3,687,500
凸版印刷	172,000	847.00	145,684,000
大日本印刷	186,000	1,144.50	212,877,000
図書印刷	10,000	327.00	3,270,000
共同印刷	19,000	393.00	7,467,000

日本写真印刷	10,400	2,353.00	24,471,200
光村印刷	5,000	271.00	1,355,000
藤森工業	5,500	3,780.00	20,790,000
宝印刷	3,600	938.00	3,376,800
前澤化成工業	4,500	1,345.00	6,052,500
アシックス	60,500	2,950.00	178,475,000
ツツミ	3,000	2,789.00	8,367,000
J S P	4,800	2,403.00	11,534,400
ニチハ	8,500	1,347.00	11,449,500
エフビコ	5,700	4,135.00	23,569,500
小松ウオール工業	1,800	2,569.00	4,624,200
ヤマハ	44,700	1,981.00	88,550,700
河合楽器製作所	2,000	2,273.00	4,546,000
クリナップ	5,500	923.00	5,076,500
ビジョン	11,500	7,940.00	91,310,000
天馬	4,900	1,768.00	8,663,200
兼松日産農林	7,000	156.00	1,092,000
キングジム	5,000	798.00	3,990,000
リンテック	14,400	2,775.00	39,960,000
T A S A K I	1,000	1,984.00	1,984,000
信越ポリマー	12,500	575.00	7,187,500
東リ	16,000	258.00	4,128,000
イトーキ	12,900	691.00	8,913,900
任天堂	37,500	12,095.00	453,562,500
三菱鉛筆	5,100	4,000.00	20,400,000
松風	2,900	1,369.00	3,970,100
タカラスタANDARD	25,000	989.00	24,725,000
コクヨ	31,600	1,018.00	32,168,800
ナカバヤシ	12,000	228.00	2,736,000
ニフコ	14,200	4,100.00	58,220,000
グローブライド	29,000	170.00	4,930,000
岡村製作所	23,700	869.00	20,595,300
日本バルカー工業	27,000	317.00	8,559,000
M U T O Hホールディングス	9,000	443.00	3,987,000
伊藤忠商事	503,700	1,306.50	658,084,050
丸紅	526,300	722.80	380,409,640
スクロール	9,100	289.00	2,629,900
高島	11,000	259.00	2,849,000
ヨンドシーホールディングス	4,600	2,021.00	9,296,600
三陽商会	34,000	308.00	10,472,000
長瀬産業	36,600	1,531.00	56,034,600
ナイガイ	21,000	64.00	1,344,000
蝶理	3,800	1,962.00	7,455,600
豊田通商	67,000	3,120.00	209,040,000
オンワードホールディングス	46,000	827.00	38,042,000
三共生興	10,000	481.00	4,810,000
兼松	122,000	176.00	21,472,000
美津濃	33,000	600.00	19,800,000
ツカモトコーポレーション	13,000	142.00	1,846,000
ファミリーマート	20,300	5,450.00	110,635,000
ルック	10,000	220.00	2,200,000
三井物産	510,200	1,613.50	823,207,700
日本紙パルプ商事	32,000	340.00	10,880,000
東京エレクトロン	51,300	9,055.00	464,521,500
日立ハイテクノロジーズ	20,800	3,665.00	76,232,000
カメイ	7,800	834.00	6,505,200
東都水産	12,000	200.00	2,400,000
O U Gホールディングス	11,000	229.00	2,519,000
スターゼン	23,000	431.00	9,913,000
セイコーホールディングス	43,000	643.00	27,649,000
山善	23,400	898.00	21,013,200

椿本興業	6,000	302.00	1,812,000
住友商事	355,100	1,290.00	458,079,000
日本ユニシス	16,800	1,110.00	18,648,000
内田洋行	14,000	372.00	5,208,000
三菱商事	461,200	2,347.00	1,082,436,400
第一実業	15,000	599.00	8,985,000
キヤノンマーケティングジャパン	17,100	2,211.00	37,808,100
西華産業	20,000	296.00	5,920,000
佐藤商事	5,200	800.00	4,160,000
菱洋エレクトロ	7,000	1,287.00	9,009,000
東京産業	5,800	482.00	2,795,600
ユアサ商事	5,300	2,446.00	12,963,800
神鋼商事	15,000	273.00	4,095,000
小林産業	3,900	257.00	1,002,300
阪和興業	61,000	466.00	28,426,000
カナデン	6,000	855.00	5,130,000
菱電商事	10,000	846.00	8,460,000
ニプロ	38,800	1,085.00	42,098,000
フルサト工業	3,200	1,718.00	5,497,600
岩谷産業	66,000	820.00	54,120,000
すてきナイスグループ	25,000	198.00	4,950,000
昭光通商	21,000	151.00	3,171,000
ニチモウ	9,000	209.00	1,881,000
極東貿易	6,000	227.00	1,362,000
イワキ	8,000	225.00	1,800,000
兼松エレクトロニクス	3,800	1,770.00	6,726,000
三愛石油	15,000	875.00	13,125,000
稲畑産業	14,600	1,153.00	16,833,800
G S Iクレオス	19,000	129.00	2,451,000
明和産業	4,500	459.00	2,065,500
キムラタン	294,000	9.00	2,646,000
ゴールドウイン	15,000	829.00	12,435,000
ユニ・チャーム	129,300	3,300.00	426,690,000
デサント	14,500	1,385.00	20,082,500
キング	2,900	433.00	1,255,700
ワキタ	12,900	1,159.00	14,951,100
ヤマトインターナショナル	4,500	427.00	1,921,500
東邦ホールディングス	20,700	1,997.00	41,337,900
サンゲツ	10,800	3,500.00	37,800,000
ミツウロコグループホールディングス	9,500	591.00	5,614,500
シナネン	13,000	495.00	6,435,000
伊藤忠エネクス	13,400	992.00	13,292,800
サンリオ	16,800	3,400.00	57,120,000
サンワテクノス	3,700	1,224.00	4,528,800
リョーサン	10,100	2,738.00	27,653,800
新光商事	7,100	1,140.00	8,094,000
トーヨー	14,000	454.00	6,356,000
三信電気	8,300	957.00	7,943,100
東陽テクニカ	8,900	1,230.00	10,947,000
モスフードサービス	8,000	2,435.00	19,480,000
加賀電子	5,500	1,396.00	7,678,000
三益半導体工業	4,700	1,377.00	6,471,900
ソーダニッカ	6,000	537.00	3,222,000
立花エレテック	3,700	1,784.00	6,600,800
木曽路	7,400	2,126.00	15,732,400
サトレストラシステムズ	5,600	1,114.00	6,238,400
千趣会	10,900	844.00	9,199,600
タカキュー	5,500	218.00	1,199,000
ケーヨー	11,200	574.00	6,428,800
アデランス	7,100	1,097.00	7,788,700
上新電機	13,000	986.00	12,818,000



日本瓦斯	9,600	3,185.00	30,576,000
ベスト電器	18,500	151.00	2,793,500
マルエツ	15,000	497.00	7,455,000
ロイヤルホールディングス	10,200	1,840.00	18,768,000
東天紅	5,000	195.00	975,000
いなげや	6,700	1,476.00	9,889,200
島忠	14,600	3,080.00	44,968,000
チヨダ	7,200	2,722.00	19,598,400
ライフコーポレーション	3,800	1,748.00	6,642,400
カスミ	12,400	973.00	12,065,200
リンガーハット	5,900	2,188.00	12,909,200
さが美	5,000	95.00	475,000
MrMax	7,000	287.00	2,009,000
テンアライド	5,200	386.00	2,007,200
AOKIホールディングス	14,000	1,499.00	20,986,000
オークワ	9,000	977.00	8,793,000
コメリ	10,400	2,797.00	29,088,800
青山商事	15,100	3,960.00	59,796,000
しまむら	7,000	10,890.00	76,230,000
CFSコーポレーション	3,900	889.00	3,467,100
はせがわ	2,100	548.00	1,150,800
高島屋	87,000	1,084.00	94,308,000
松屋	12,300	1,811.00	22,275,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	28,400	2,165.00	61,486,000
近鉄百貨店	23,000	355.00	8,165,000
丸栄	12,000	139.00	1,668,000
ニッセンホールディングス	12,200	291.00	3,550,200
パルコ	5,600	1,039.00	5,818,400
丸井グループ	72,300	1,363.00	98,544,900
クレディセゾン	49,100	2,301.00	112,979,100
アクシアル リテイリング	4,700	3,150.00	14,805,000
井筒屋	39,000	63.00	2,457,000
イオン	248,100	1,300.00	322,530,000
ユニグループ・ホールディングス	57,400	717.00	41,155,800
イズミ	13,400	4,270.00	57,218,000
東武ストア	9,000	289.00	2,601,000
フォーバル	1,400	1,474.00	2,063,600
平和堂	12,100	2,586.00	31,290,600
フジ	6,800	2,209.00	15,021,200
ヤオコー	3,400	8,040.00	27,336,000
ゼビオ	8,300	2,200.00	18,260,000
ケーズホールディングス	13,800	3,490.00	48,162,000
Palta	9,700	1,691.00	16,402,700
Olympicグループ	3,700	837.00	3,096,900
日産東京販売ホールディングス	9,600	288.00	2,764,800
新生銀行	572,000	234.00	133,848,000
あおぞら銀行	406,000	430.00	174,580,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,828,900	765.50	3,696,522,950
りそなホールディングス	703,900	667.20	469,642,080
三井住友トラスト・ホールディングス	1,330,000	497.70	661,941,000
三井住友フィナンシャルグループ	455,100	4,672.50	2,126,454,750
第四銀行	77,000	458.00	35,266,000
北越銀行	66,000	246.00	16,236,000
西日本シティ銀行	211,000	397.00	83,767,000
千葉銀行	232,000	924.00	214,368,000
横浜銀行	416,000	760.20	316,243,200
常陽銀行	217,000	659.00	143,003,000
群馬銀行	142,000	858.00	121,836,000
武蔵野銀行	9,600	4,325.00	41,520,000
千葉興業銀行	12,600	857.00	10,798,200
筑波銀行	25,100	398.00	9,989,800

七十七銀行	101,000	735.00	74,235,000
青森銀行	48,000	381.00	18,288,000
秋田銀行	40,000	388.00	15,520,000
山形銀行	36,000	539.00	19,404,000
岩手銀行	4,200	5,380.00	22,596,000
東邦銀行	53,000	488.00	25,864,000
東北銀行	32,000	170.00	5,440,000
みちのく銀行	30,000	216.00	6,480,000
ふくおかフィナンシャルグループ	244,000	674.00	164,456,000
静岡銀行	176,000	1,227.00	215,952,000
十六銀行	75,000	468.00	35,100,000
スルガ銀行	63,500	2,484.00	157,734,000
八十二銀行	109,000	898.00	97,882,000
山梨中央銀行	39,000	525.00	20,475,000
大垣共立銀行	76,000	419.00	31,844,000
福井銀行	52,000	278.00	14,456,000
北國銀行	68,000	431.00	29,308,000
清水銀行	2,000	3,145.00	6,290,000
滋賀銀行	60,000	743.00	44,580,000
南都銀行	59,000	419.00	24,721,000
百五銀行	58,000	586.00	33,988,000
京都銀行	115,000	1,186.00	136,390,000
紀陽銀行	23,500	1,660.00	39,010,000
三重銀行	27,000	299.00	8,073,000
ほくほくフィナンシャルグループ	409,000	282.00	115,338,000
広島銀行	177,000	657.00	116,289,000
山陰合同銀行	37,000	1,036.00	38,332,000
中国銀行	43,200	1,875.00	81,000,000
鳥取銀行	19,000	261.00	4,959,000
伊予銀行	64,300	1,519.00	97,671,700
百十四銀行	67,000	434.00	29,078,000
四国銀行	47,000	260.00	12,220,000
阿波銀行	49,000	697.00	34,153,000
鹿児島銀行	42,000	829.00	34,818,000
大分銀行	37,000	452.00	16,724,000
宮崎銀行	40,000	486.00	19,440,000
肥後銀行	49,000	749.00	36,701,000
佐賀銀行	37,000	303.00	11,211,000
十八銀行	37,000	381.00	14,097,000
沖縄銀行	4,800	5,180.00	24,864,000
琉球銀行	12,600	1,843.00	23,221,800
セブン銀行	202,700	604.00	122,430,800
みずほフィナンシャルグループ	8,333,200	217.00	1,808,304,400
高知銀行	25,000	162.00	4,050,000
山口フィナンシャルグループ	60,000	1,372.00	82,320,000
アクリーティブ	4,200	270.00	1,134,000
芙蓉総合リース	6,400	4,320.00	27,648,000
興銀リース	11,300	2,486.00	28,091,800
東京センチュリーリース	14,100	3,060.00	43,146,000
SBIホールディングス	72,200	1,399.00	101,007,800
日本証券金融	28,800	651.00	18,748,800
アイフル	100,400	464.00	46,585,600
日本アジア投資	40,000	77.00	3,080,000
ポケットカード	4,300	561.00	2,412,300
長野銀行	21,000	212.00	4,452,000
名古屋銀行	55,000	472.00	25,960,000
北洋銀行	90,400	483.00	43,663,200
愛知銀行	2,200	6,050.00	13,310,000
第三銀行	34,000	208.00	7,072,000
中京銀行	24,000	218.00	5,232,000
東日本銀行	26,000	395.00	10,270,000

大光銀行	21,000	244.00	5,124,000
愛媛銀行	36,000	257.00	9,252,000
トマト銀行	23,000	190.00	4,370,000
みなと銀行	55,000	269.00	14,795,000
京葉銀行	50,000	718.00	35,900,000
関西アーバン銀行	8,400	1,328.00	11,155,200
栃木銀行	30,000	644.00	19,320,000
北日本銀行	1,900	3,055.00	5,804,500
東和銀行	84,000	105.00	8,820,000
福島銀行	74,000	95.00	7,030,000
大東銀行	38,000	152.00	5,776,000
リコーリース	4,800	3,465.00	16,632,000
イオンフィナンシャルサービス	39,400	2,583.00	101,770,200
アコム	120,600	386.00	46,551,600
ジャックス	33,000	588.00	19,404,000
オリエントコーポレーション	141,000	201.00	28,341,000
日立キャピタル	11,800	2,541.00	29,983,800
アプラスフィナンシャル	28,400	139.00	3,947,600
オリックス	426,000	1,616.50	688,629,000
三菱UFJリース	152,400	579.00	88,239,600
ジャフコ	8,200	4,680.00	38,376,000
トモニホールディングス	46,800	559.00	26,161,200
大和証券グループ本社	563,000	946.30	532,766,900
野村ホールディングス	1,230,300	721.10	887,169,330
岡三証券グループ	51,000	935.00	47,685,000
丸三証券	19,400	877.00	17,013,800
東洋証券	24,000	377.00	9,048,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	68,900	848.00	58,427,200
光世証券	14,000	241.00	3,374,000
水戸証券	18,700	446.00	8,340,200
いちよし証券	12,800	1,355.00	17,344,000
松井証券	30,500	1,095.00	33,397,500
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	133,700	3,530.00	471,961,000
だいこう証券ビジネス	3,100	813.00	2,520,300
日本取引所グループ	88,300	3,050.00	269,315,000
マネックスグループ	71,700	286.00	20,506,200
カブドットコム証券	27,000	727.00	19,629,000
極東証券	8,200	1,853.00	15,194,600
岩井コスモホールディングス	6,200	1,466.00	9,089,200
フィデアホールディングス	34,700	232.00	8,050,400
池田泉州ホールディングス	50,400	571.00	28,778,400
アニコムホールディングス	2,500	1,825.00	4,562,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	191,800	3,269.00	626,994,200
マネースクウェアHD	1,800	1,399.00	2,518,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	57,600	1,810.00	104,256,000
マネーパートナーズグループ	5,900	421.00	2,483,900
小林洋行	1,300	332.00	431,600
第一生命保険	385,500	1,822.00	702,381,000
東京海上ホールディングス	247,700	4,263.00	1,055,945,100
イー・ギャランティ	1,800	1,887.00	3,396,600
アサックス	1,000	1,677.00	1,677,000
NECキャピタルソリューション	2,400	1,946.00	4,670,400
T&Dホールディングス	219,300	1,587.00	348,029,100
三井不動産	319,000	3,375.00	1,076,625,000
三菱地所	448,000	2,713.00	1,215,424,000
平和不動産	11,500	1,701.00	19,561,500
東京建物	131,000	912.00	119,472,000
ダイビル	15,700	1,106.00	17,364,200
京阪神ビルディング	10,000	720.00	7,200,000
住友不動産	144,000	4,206.50	605,736,000

太平洋興発	26,000	100.00	2,600,000
大京	97,000	177.00	17,169,000
テーオーシー	21,000	765.00	16,065,000
東京楽天地	10,000	500.00	5,000,000
レオパレス21	65,600	702.00	46,051,200
スターツコーポレーション	7,000	1,684.00	11,788,000
フジ住宅	7,500	687.00	5,152,500
空港施設	7,100	707.00	5,019,700
明和地所	3,400	495.00	1,683,000
住友不動産販売	4,400	3,165.00	13,926,000
ゴールドクレスト	5,500	2,060.00	11,330,000
リロ・ホールディング	2,200	9,760.00	21,472,000
日本エスリード	2,300	1,214.00	2,792,200
日神不動産	8,400	495.00	4,158,000
タカラレーベン	27,000	576.00	15,552,000
サンヨーハウジング名古屋	3,300	1,316.00	4,342,800
イオンモール	38,800	2,385.00	92,538,000
ファースト住建	2,300	1,345.00	3,093,500
ランド	4,900	22.00	107,800
東祥	1,500	2,731.00	4,096,500
トーセイ	8,200	763.00	6,256,600
穴吹興産	7,000	250.00	1,750,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	37,300	1,232.00	45,953,600
サンフロンティア不動産	6,500	982.00	6,383,000
エフ・ジェー・ネクスト	4,500	539.00	2,425,500
ランドビジネス	2,600	406.00	1,055,600
グランディハウス	5,300	304.00	1,611,200
東武鉄道	326,000	591.00	192,666,000
相鉄ホールディングス	104,000	562.00	58,448,000
東京急行電鉄	331,000	826.00	273,406,000
京浜急行電鉄	167,000	977.00	163,159,000
小田急電鉄	195,000	1,250.00	243,750,000
京王電鉄	170,000	988.00	167,960,000
京成電鉄	91,000	1,504.00	136,864,000
富士急行	17,000	1,242.00	21,114,000
新京成電鉄	8,000	423.00	3,384,000
東日本旅客鉄道	111,800	10,050.00	1,123,590,000
西日本旅客鉄道	58,700	6,728.00	394,933,600
東海旅客鉄道	54,600	22,470.00	1,226,862,000
西武ホールディングス	48,500	3,155.00	153,017,500
鴻池運輸	3,800	2,420.00	9,196,000
西日本鉄道	79,000	531.00	41,949,000
ハマキョウレックス	1,900	4,125.00	7,837,500
サカイ引越センター	1,100	3,745.00	4,119,500
近畿日本鉄道	613,000	462.00	283,206,000
阪急阪神ホールディングス	409,000	738.00	301,842,000
南海電気鉄道	136,000	492.00	66,912,000
京阪電気鉄道	136,000	721.00	98,056,000
神戸電鉄	15,000	387.00	5,805,000
名糖運輸	2,200	739.00	1,625,800
名古屋鉄道	221,000	489.00	108,069,000
山陽電気鉄道	22,000	490.00	10,780,000
トランコム	1,800	5,160.00	9,288,000
日本通運	241,000	649.00	156,409,000
ヤマトホールディングス	107,200	2,752.50	295,068,000
山九	74,000	511.00	37,814,000
日新	23,000	317.00	7,291,000
丸運	4,800	261.00	1,252,800
丸全昭和運輸	21,000	407.00	8,547,000
センコー	25,000	693.00	17,325,000
トナミホールディングス	13,000	457.00	5,941,000

日本梱包運輸倉庫	19,900	1,875.00	37,312,500
日本石油輸送	8,000	243.00	1,944,000
福山通運	37,000	645.00	23,865,000
セイノーホールディングス	47,000	1,303.00	61,241,000
神奈川中央交通	7,000	598.00	4,186,000
日立物流	12,900	1,719.00	22,175,100
日本郵船	515,000	347.00	178,705,000
商船三井	319,000	429.00	136,851,000
川崎汽船	266,000	338.00	89,908,000
N S ユナイテッド海運	26,000	302.00	7,852,000
明治海運	6,400	412.00	2,636,800
飯野海運	32,000	649.00	20,768,000
共栄タンカー	6,000	246.00	1,476,000
第一中央汽船	60,000	47.00	2,820,000
日本航空	117,000	3,710.00	434,070,000
A N A ホールディングス	1,198,000	320.10	383,479,800
パスコ	5,000	340.00	1,700,000
三菱倉庫	40,000	1,824.00	72,960,000
三井倉庫ホールディングス	36,000	410.00	14,760,000
住友倉庫	45,000	698.00	31,410,000
澁澤倉庫	15,000	362.00	5,430,000
ヤマタネ	30,000	193.00	5,790,000
東陽倉庫	10,000	314.00	3,140,000
乾汽船	4,000	979.00	3,916,000
日本トランスシティ	14,000	394.00	5,516,000
ケイヒン	10,000	200.00	2,000,000
中央倉庫	3,600	975.00	3,510,000
安田倉庫	4,600	1,036.00	4,765,600
東洋埠頭	18,000	204.00	3,672,000
宇徳	4,700	649.00	3,050,300
上組	73,000	1,173.00	85,629,000
サンリツ	2,100	557.00	1,169,700
キムラユニティー	1,800	1,013.00	1,823,400
キューソー流通システム	1,500	1,386.00	2,079,000
郵船ロジスティクス	5,600	1,492.00	8,355,200
近鉄エクスプレス	5,500	4,715.00	25,932,500
東海運	4,300	291.00	1,251,300
エーアイティー	2,800	1,310.00	3,668,000
東京放送ホールディングス	36,000	1,397.00	50,292,000
日本テレビホールディングス	54,900	1,904.00	104,529,600
朝日放送	5,900	965.00	5,693,500
テレビ朝日ホールディングス	16,400	1,773.00	29,077,200
スカパーJ S A Tホールディングス	45,500	737.00	33,533,500
テレビ東京ホールディングス	4,900	2,277.00	11,157,300
コネクシオ	4,200	1,084.00	4,552,800
クロップス	200	536.00	107,200
日本電信電話	235,500	7,270.00	1,712,085,000
K D D I	203,800	8,145.00	1,659,951,000
光通信	5,400	7,830.00	42,282,000
N T T ドコモ	495,800	2,100.50	1,041,427,900
G M O インターネット	20,300	1,162.00	23,588,600
K A D O K A W A ・ D W A N G O	15,000	1,956.00	29,340,000
学研ホールディングス	20,000	265.00	5,300,000
ゼンリン	8,000	1,539.00	12,312,000
昭文社	3,500	955.00	3,342,500
インプレスホールディングス	7,100	129.00	915,900
東京電力	517,000	479.00	247,643,000
中部電力	186,500	1,469.50	274,061,750
関西電力	248,700	1,078.00	268,098,600
中国電力	84,200	1,599.00	134,635,800
北陸電力	59,700	1,640.00	97,908,000

東北電力	152,300	1,412.00	215,047,600
四国電力	54,800	1,623.00	88,940,400
九州電力	134,600	1,048.00	141,060,800
北海道電力	56,900	936.00	53,258,400
沖縄電力	4,000	4,135.00	16,540,000
電源開発	41,000	4,235.00	173,635,000
東京瓦斯	741,000	732.90	543,078,900
大阪瓦斯	631,000	488.20	308,054,200
東邦瓦斯	155,000	685.00	106,175,000
北海道瓦斯	13,000	286.00	3,718,000
西部瓦斯	69,000	272.00	18,768,000
静岡瓦斯	17,500	847.00	14,822,500
メタウォーター	2,900	2,361.00	6,846,900
アイネット	3,000	922.00	2,766,000
松竹	39,000	1,171.00	45,669,000
東宝	42,900	2,909.00	124,796,100
エイチ・アイ・エス	10,300	3,890.00	40,067,000
東映	23,000	684.00	15,732,000
AOI Pro.	2,500	834.00	2,085,000
エヌ・ティ・ティ・データ	37,200	4,660.00	173,352,000
共立メンテナンス	3,200	6,710.00	21,472,000
イチネンホールディングス	6,700	1,029.00	6,894,300
建設技術研究所	3,700	1,359.00	5,028,300
スペース	3,300	1,239.00	4,088,700
インファーマシーズ	7,200	4,375.00	31,500,000
燦ホールディングス	1,100	1,779.00	1,956,900
ピー・シー・エー	800	1,847.00	1,477,600
スバル興業	5,000	440.00	2,200,000
東京テアトル	25,000	143.00	3,575,000
よみうりランド	13,000	479.00	6,227,000
東京都競馬	44,000	317.00	13,948,000
常盤興産	23,000	152.00	3,496,000
カナモト	9,000	3,050.00	27,450,000
東京ドーム	44,000	556.00	24,464,000
D T S	6,300	2,248.00	14,162,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	21,800	2,337.00	50,946,600
シーイーシー	3,900	1,011.00	3,942,900
カブコン	15,300	2,087.00	31,931,100
西尾レントオール	5,200	3,150.00	16,380,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	46.00	1,334,000
日本空港ビルデング	20,800	5,550.00	115,440,000
トランス・コスモス	8,400	2,423.00	20,353,200
乃村工藝社	12,600	1,186.00	14,943,600
ジャステック	3,400	974.00	3,311,600
S C S K	14,300	3,140.00	44,902,000
藤田観光	23,000	496.00	11,408,000
K N T - C Tホールディングス	30,000	158.00	4,740,000
日本管財	3,100	2,659.00	8,242,900
トーカイ	2,800	3,830.00	10,724,000
白洋舎	6,000	247.00	1,482,000
セコム	61,800	7,296.00	450,892,800
日本システムウエア	2,500	912.00	2,280,000
セントラル警備保障	2,800	1,296.00	3,628,800
アイネス	8,200	860.00	7,052,000
丹青社	7,300	822.00	6,000,600
メイテック	8,700	3,545.00	30,841,500
T K C	5,100	2,249.00	11,469,900
アサツー ディ・ケイ	11,900	3,280.00	39,032,000
富士ソフト	8,400	2,536.00	21,302,400
応用地質	6,700	1,635.00	10,954,500
船井総研ホールディングス	6,900	975.00	6,727,500

NSD	12,900	1,854.00	23,916,600
進学会	3,400	475.00	1,615,000
丸紅建材リース	4,000	271.00	1,084,000
コナミ	24,400	2,320.00	56,608,000
ベネッセホールディングス	23,200	3,760.00	87,232,000
イオンデイライト	6,200	2,823.00	17,502,600
ナック	4,100	1,041.00	4,268,100
福井コンピュータホールディングス	2,000	843.00	1,686,000
ニチイ学館	12,600	1,144.00	14,414,400
ダイセキ	10,400	2,048.00	21,299,200
ステップ	2,600	843.00	2,191,800
日鉄住金物産	40,000	415.00	16,600,000
元気寿司	1,800	2,765.00	4,977,000
トラスコ中山	7,600	3,370.00	25,612,000
ヤマダ電機	237,700	512.00	121,702,400
オートバックスセブン	22,100	1,857.00	41,039,700
アークランドサカモト	4,300	2,477.00	10,651,100
ニトリホールディングス	26,000	7,600.00	197,600,000
グルメ杵屋	4,000	985.00	3,940,000
愛眼	6,300	249.00	1,568,700
ケーユーホールディングス	2,600	689.00	1,791,400
吉野家ホールディングス	17,200	1,329.00	22,858,800
加藤産業	8,800	2,382.00	20,961,600
イノテック	6,400	462.00	2,956,800
イエローハット	5,700	2,450.00	13,965,000
富士エレクトロニクス	3,000	1,547.00	4,641,000
松屋フーズ	2,900	2,499.00	7,247,100
JBCホールディングス	5,000	777.00	3,885,000
JKホールディングス	5,900	578.00	3,410,200
サガミチェーン	7,000	1,184.00	8,288,000
日伝	2,500	2,550.00	6,375,000
関西スーパーマーケット	4,700	801.00	3,764,700
ミロク情報サービス	4,500	673.00	3,028,500
北沢産業	6,500	184.00	1,196,000
杉本商事	3,400	1,307.00	4,443,800
因幡電機産業	9,000	4,080.00	36,720,000
王将フードサービス	4,500	4,520.00	20,340,000
ブレナス	6,800	2,344.00	15,939,200
ミニストップ	4,500	1,642.00	7,389,000
アークス	10,600	2,490.00	26,394,000
パロー	12,900	2,398.00	30,934,200
バイテック	1,900	1,023.00	1,943,700
ミスミグループ本社	22,400	4,355.00	97,552,000
江守グループホールディングス	2,500	882.00	2,205,000
藤久	500	1,697.00	848,500
アルテック	4,300	215.00	924,500
ベルク	2,700	3,315.00	8,950,500
大庄	3,100	1,477.00	4,578,700
タキヒヨー	10,000	435.00	4,350,000
ファーストリテイリング	12,000	42,910.00	514,920,000
ソフトバンク	318,300	7,019.00	2,234,147,700
スズケン	24,900	3,740.00	93,126,000
サンドラッグ	12,700	5,790.00	73,533,000
サックスパー ホールディングス	4,500	1,748.00	7,866,000
ジェコス	4,100	1,343.00	5,506,300
ヤマザワ	1,200	1,800.00	2,160,000
やまや	1,100	1,645.00	1,809,500
ルネサスイーストン	3,200	742.00	2,374,400
ヘルーナ	15,000	540.00	8,100,000
合計	101,357,400		133,690,943,760

(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26年 2月20日現在)	(平成27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	83,756
コール・ローン		473,031,502	218,478,289
国債証券		147,493,273,800	138,100,440,400
地方債証券		11,960,911,327	10,652,666,670
特殊債券		16,805,011,354	15,585,164,349
社債券		11,273,916,380	9,430,313,970
未収入金			351,000,000
未収利息		685,173,785	641,607,808
前払費用		17,166,929	8,703,929
流動資産合計		188,708,642,648	174,988,459,171
資産合計		188,708,642,648	174,988,459,171
負債の部			
流動負債			
未払金		100,000,000	
未払解約金		162,926,004	54,776,000
流動負債合計		262,926,004	54,776,000
負債合計		262,926,004	54,776,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	160,599,147,379	145,599,818,302
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		27,846,569,265	29,333,864,869
元本等合計		188,445,716,644	174,933,683,171
純資産合計		188,445,716,644	174,933,683,171
負債純資産合計		188,708,642,648	174,988,459,171

(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26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
1 期首元本額	170,288,187,355円	160,599,147,379円
期中追加設定元本額	24,468,338,191円	21,448,965,807円
期中一部解約元本額	34,157,378,167円	36,448,294,884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	978,211,540円	659,871,549円
ジェット型バランス・オープン（ステイブ		
ル）		
ステート・ストリート日本債券インデック	6,929,509,124円	3,213,235,438円
ス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家		
限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	348,556,511円	243,262,193円
VA30A＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	17,091,347,815円	13,548,455,587円
VA30B＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	31,639,529円	1,813,101円
VA40A＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	125,061,646円	92,688,633円
VA40B＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	88,292,416円	67,434,987円
VA50A＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	27,051,493,638円	25,593,675,326円
VA50B＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	253,180,285円	156,689,258円
VA50C＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	19,114,311,763円	17,689,205,182円
VA25A＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	4,149,296,690円	3,992,915,098円
VA37.5A＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート・バランスファンド	38,191,079円	34,277,722円
VA75A＜適格機関投資家限定＞		
ステート・ストリート4資産バランス20VA	1,640,882,672円	1,793,222,235円
<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート4資産バランス40VA	6,260,786,562円	6,414,165,897円
<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート4資産バランス30VA	2,530,963,155円	3,087,490,477円
<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファンド	13,932,420,559円	13,041,114,995円
VA35A＜適格機関投資家限定＞		

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>	1,953,807,705円	1,426,566,192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>	5,350,929,823円	4,356,938,342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>	91,505,766円	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 >	300,943,427円	289,514,750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>	100,029,897円	93,675,824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>	65,098,187円	53,814,735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 >	465,001,160円	772,629,122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>	125,378,618円	117,436,277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>	6,685,951,483円	6,230,674,441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>	107,809,589円	104,024,317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>	57,293,661円	59,037,267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>	422,240円	453,659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>	1,905,941,995円	1,796,284,662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 >	12,297,196,671円	10,111,445,386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>	1,590,296,248円	2,243,097,626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>	4,891,765,238円	4,667,031,784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>	18,535,054,395円	17,485,646,311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>	11,686,266円	21,039,605円
AMC/ステート・ストリート・リスクバ ジェット型バランス・ファンド(ステイ ブル)年金<適格機関投資家限定>	円	442,582,912円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド(年 金)	円	506,615,308円
フレックス資産配分戦略ファンド(年金) <適格機関投資家限定>	円	83,005,928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>	677,311,450円	359,271,528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>	4,350,798,081円	3,937,626,841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>	300,728,060円	246,104,759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>	170,052,435円	132,749,559円
ステート・ストリート世界株式VCファン ド<適格機関投資家限定>	円	433,033,489円
計	160,599,147,379円	145,599,818,302円

2 受益権の総数	160,599,147,379口	145,599,818,302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26年 2月20日現在）	（平成27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>(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>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。  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。	(3)デリバティブ取引 同左  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26年 2月20日現在)	(平成27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	716,696,600	1,641,506,400
地方債証券	1,267,760	63,734,735
特殊債券	8,789,441	103,924,490
社債券	2,162,730	29,016,390
合計	722,055,551	1,838,182,015

(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25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	自 平成26年 2月21日 至 平成27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26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	1.1734円	1.2015円
(1万口当たり純資産額)	(11,734円)	(12,015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	239,060,000	
	第100回利付国債(5年)	600,000,000	602,586,000	
	第101回利付国債(20年)	300,000,000	366,090,000	
	第101回利付国債(5年)	1,500,000,000	1,510,080,000	
	第102回利付国債(20年)	400,000,000	488,488,000	
	第102回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,205,880,000	
	第103回利付国債(20年)	200,000,000	241,632,000	
	第103回利付国債(5年)	1,300,000,000	1,307,371,000	
	第104回利付国債(20年)	250,000,000	295,697,500	
	第104回利付国債(5年)	1,400,000,000	1,405,054,000	
	第105回利付国債(20年)	200,000,000	236,604,000	
	第105回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,706,494,000	
	第106回利付国債(20年)	300,000,000	358,878,000	
	第106回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,230,000	
	第107回利付国債(20年)	300,000,000	354,933,000	
	第107回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,500,000	
	第108回利付国債(20年)	300,000,000	347,109,000	
	第108回利付国債(5年)	800,000,000	801,344,000	
	第109回利付国債(20年)	300,000,000	346,986,000	
	第109回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,001,680,000	
	第110回利付国債(20年)	400,000,000	473,220,000	
	第110回利付国債(5年)	500,000,000	503,900,000	
	第111回利付国債(20年)	400,000,000	478,392,000	
	第111回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,213,032,000	
	第112回利付国債(20年)	300,000,000	354,885,000	
	第112回利付国債(5年)	600,000,000	606,954,000	
	第113回利付国債(20年)	400,000,000	472,788,000	
	第113回利付国債(5年)	500,000,000	504,140,000	
	第114回利付国債(20年)	500,000,000	590,810,000	
	第114回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,210,248,000	
	第115回利付国債(20年)	400,000,000	478,308,000	
	第115回利付国債(5年)	900,000,000	904,482,000	
	第116回利付国債(20年)	500,000,000	597,730,000	
	第116回利付国債(5年)	500,000,000	502,475,000	
	第117回利付国債(5年)	600,000,000	602,916,000	
	第118回利付国債(20年)	600,000,000	700,158,000	
	第118回利付国債(5年)	1,800,000,000	1,808,514,000	
	第119回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,100,903,000	
	第120回利付国債(5年)	700,000,000	703,178,000	
	第121回利付国債(5年)	2,100,000,000	2,100,000,000	
	第122回利付国債(20年)	600,000,000	682,122,000	
第123回利付国債(20年)	500,000,000	590,030,000		
第126回利付国債(20年)	600,000,000	698,022,000		
第127回利付国債(20年)	600,000,000	689,052,000		
第128回利付国債(20年)	600,000,000	687,816,000		
第12回利付国債(30年)	300,000,000	348,948,000		
第130回利付国債(20年)	500,000,000	564,885,000		
第132回利付国債(20年)	500,000,000	555,995,000		
第133回利付国債(20年)	500,000,000	564,085,000		
第135回利付国債(20年)	300,000,000	333,039,000		
第136回利付国債(20年)	200,000,000	218,928,000		
第137回利付国債(20年)	500,000,000	554,115,000		
第139回利付国債(20年)	300,000,000	327,780,000		

第13回利付国債(30年)	300,000,000	343,704,000	
第140回利付国債(20年)	200,000,000	221,252,000	
第141回利付国債(20年)	200,000,000	220,672,000	
第142回利付国債(20年)	500,000,000	560,070,000	
第143回利付国債(20年)	400,000,000	433,736,000	
第144回利付国債(20年)	200,000,000	213,666,000	
第145回利付国債(20年)	720,000,000	791,287,200	
第146回利付国債(20年)	870,000,000	954,163,800	
第147回利付国債(20年)	560,000,000	603,181,600	
第148回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,110,931,500	
第149回利付国債(20年)	800,000,000	844,920,000	
第14回ポーランド共和国	100,000,000	100,751,000	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	363,468,000	
第150回利付国債(20年)	800,000,000	828,640,000	
第151回利付国債(20年)	100,000,000	99,840,000	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	245,588,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	245,484,000	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	241,912,000	
第18回利付国債(30年)	100,000,000	119,040,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	238,272,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	383,802,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	197,278,400	
第20回利付国債(30年)	300,000,000	368,289,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	238,234,000	
第22回利付国債(30年)	100,000,000	122,788,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	122,797,000	
第24回利付国債(30年)	320,000,000	392,963,200	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	357,060,000	
第26回利付国債(30年)	350,000,000	422,905,000	
第277回利付国債(10年)	100,000,000	101,688,000	
第278回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,426,628,000	
第279回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,225,380,000	
第27回利付国債(30年)	520,000,000	639,485,600	
第280回利付国債(10年)	100,000,000	102,476,000	
第281回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,026,080,000	
第282回利付国債(10年)	900,000,000	923,652,000	
第283回利付国債(10年)	400,000,000	411,140,000	
第284回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,030,360,000	
第285回利付国債(10年)	900,000,000	931,023,000	
第286回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,561,485,000	
第287回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,043,310,000	
第288回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,042,740,000	
第289回利付国債(10年)	800,000,000	833,008,000	
第28回利付国債(30年)	500,000,000	615,755,000	
第290回利付国債(10年)	500,000,000	520,740,000	
第291回利付国債(10年)	100,000,000	103,842,000	
第292回利付国債(10年)	400,000,000	420,264,000	
第293回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,057,960,000	
第294回利付国債(10年)	400,000,000	421,860,000	
第295回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,152,822,000	
第296回利付国債(10年)	100,000,000	105,129,000	
第297回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,260,780,000	
第298回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,674,960,000	

第299回利付国債(10年)	400,000,000	419,776,000	
第29回利付国債(30年)	400,000,000	485,956,000	
第2回利付国債(30年)	700,000,000	857,360,000	
第2回利付国債(40年)	700,000,000	826,301,000	
第300回利付国債(10年)	700,000,000	740,278,000	
第301回利付国債(10年)	600,000,000	636,384,000	
第302回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,056,340,000	
第303回利付国債(10年)	600,000,000	635,478,000	
第304回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,160,038,000	
第305回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,057,040,000	
第306回利付国債(10年)	800,000,000	852,200,000	
第307回利付国債(10年)	900,000,000	954,189,000	
第308回利付国債(10年)	700,000,000	744,233,000	
第309回利付国債(10年)	800,000,000	842,088,000	
第30回利付国債(30年)	350,000,000	418,761,000	
第310回利付国債(10年)	900,000,000	944,604,000	
第311回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,038,480,000	
第312回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,169,663,000	
第313回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,072,020,000	
第314回利付国債(10年)	900,000,000	953,973,000	
第315回利付国債(10年)	750,000,000	801,037,500	
第316回利付国債(10年)	800,000,000	849,424,000	
第317回利付国債(10年)	600,000,000	637,908,000	
第318回利付国債(10年)	250,000,000	264,167,500	
第319回利付国債(10年)	700,000,000	744,884,000	
第31回利付国債(30年)	400,000,000	470,540,000	
第320回利付国債(10年)	700,000,000	740,159,000	
第321回利付国債(10年)	300,000,000	317,382,000	
第322回利付国債(10年)	800,000,000	840,768,000	
第323回利付国債(10年)	200,000,000	210,096,000	
第324回利付国債(10年)	900,000,000	938,943,000	
第325回利付国債(10年)	800,000,000	834,544,000	
第326回利付国債(10年)	600,000,000	621,180,000	
第327回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,460,172,000	
第328回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,232,232,000	
第329回利付国債(10年)	500,000,000	521,130,000	
第32回利付国債(30年)	650,000,000	780,260,000	
第330回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,146,431,000	
第331回利付国債(10年)	500,000,000	512,745,000	
第332回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,946,455,000	
第333回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,148,951,000	
第334回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,431,570,000	
第335回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,619,968,000	
第336回利付国債(10年)	200,000,000	202,270,000	
第337回利付国債(10年)	400,000,000	396,780,000	
第33回利付国債(20年)	100,000,000	105,923,000	
第33回利付国債(30年)	550,000,000	625,080,500	
第341回利付国債(2年)	500,000,000	500,485,000	
第34回利付国債(30年)	650,000,000	766,876,500	
第35回利付国債(30年)	500,000,000	567,995,000	
第36回利付国債(20年)	300,000,000	322,794,000	
第36回利付国債(30年)	750,000,000	852,547,500	
第37回利付国債(20年)	400,000,000	431,420,000	

第37回利付国債(30年)	700,000,000	778,918,000	
第38回利付国債(20年)	100,000,000	108,128,000	
第38回利付国債(30年)	750,000,000	817,027,500	
第39回利付国債(20年)	100,000,000	107,805,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	366,804,900	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	363,072,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	295,302,500	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	107,979,000	
第40回利付国債(30年)	380,000,000	413,124,600	
第41回利付国債(20年)	100,000,000	105,754,000	
第41回利付国債(30年)	150,000,000	159,403,500	
第42回利付国債(30年)	300,000,000	318,591,000	
第43回利付国債(30年)	300,000,000	318,375,000	
第44回利付国債(30年)	400,000,000	424,204,000	
第45回利付国債(20年)	650,000,000	725,348,000	
第45回利付国債(30年)	200,000,000	202,292,000	
第47回利付国債(20年)	600,000,000	669,822,000	
第48回利付国債(20年)	300,000,000	341,673,000	
第49回利付国債(20年)	100,000,000	112,069,000	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	295,100,000	
第50回利付国債(20年)	50,000,000	55,431,000	
第51回利付国債(20年)	350,000,000	391,520,500	
第52回利付国債(20年)	100,000,000	112,875,000	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	564,105,000	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	898,728,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	119,257,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	146,179,800	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	762,608,000	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	370,604,500	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	562,230,000	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	454,984,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	582,815,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	347,046,000	
第6回利付国債(30年)	200,000,000	244,348,000	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	164,140,500	
第70回利付国債(20年)	600,000,000	712,272,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	697,548,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	349,338,000	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	229,582,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	347,283,000	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	287,442,500	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	361,041,000	
第7回利付国債(40年)	350,000,000	362,771,500	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	117,018,000	
第81回利付国債(20年)	200,000,000	232,332,000	
第83回利付国債(20年)	300,000,000	352,158,000	
第85回利付国債(20年)	300,000,000	352,548,000	
第88回利付国債(20年)	400,000,000	479,692,000	
第89回利付国債(20年)	400,000,000	475,128,000	
第8回利付国債(30年)	300,000,000	335,910,000	
第90回利付国債(20年)	400,000,000	475,932,000	
第91回利付国債(20年)	400,000,000	480,584,000	
第92回利付国債(20年)	340,000,000	401,155,800	



	第93回利付国債(20年)	400,000,000	467,476,000	
	第94回利付国債(20年)	300,000,000	354,216,000	
	第95回利付国債(20年)	650,000,000	783,484,000	
	第95回利付国債(5年)	400,000,000	402,492,000	
	第96回利付国債(20年)	400,000,000	472,340,000	
	第97回利付国債(20年)	700,000,000	835,793,000	
	第97回利付国債(5年)	700,000,000	703,500,000	
	第98回利付国債(20年)	100,000,000	118,223,000	
	第98回利付国債(5年)	800,000,000	802,944,000	
	第99回利付国債(20年)	100,000,000	118,207,000	
	第99回利付国債(5年)	800,000,000	804,704,000	
	第9回利付国債(30年)	100,000,000	105,570,000	
	国債証券 小計	128,430,000,000	138,100,440,400	
地方債証券	第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,603,000	
	第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,631,000	
	第10回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,558,000	
	第10回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	111,864,000	
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,653,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,907,000	
	第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,910,000	
	第124回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,710,000	
	第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,735,000	
	第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,955,000	
	第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	119,991,000	
	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,326,000	
	第133回神奈川県公募公債	8,000,000	8,035,680	
	第134回神奈川県公募公債	20,000,000	20,137,600	
	第136回神奈川県公募公債	60,000,000	60,729,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,381,000	
	第138回神奈川県公募公債	7,260,000	7,388,574	
	第139回神奈川県公募公債	300,000	306,018	
	第13回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,043,000	
	第141回神奈川県公募公債	5,000,000	5,125,750	
	第143回神奈川県公募公債	10,000,000	10,308,800	
	第144回神奈川県公募公債	40,000,000	41,279,200	
	第145回神奈川県公募公債	40,000,000	41,426,400	
	第147回神奈川県公募公債	50,000,000	52,202,000	
	第149回神奈川県公募公債	9,000,000	9,409,050	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,116,000	
	第188回神奈川県公募公債	100,000,000	105,815,000	
	第23回共同発行市場公募地方債	3,200,000	3,199,680	
	第25回共同発行市場公募地方債	3,500,000	3,508,155	
	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,494,000	
	第275回大阪府公募公債(10年)	5,000,000	4,999,450	
	第281回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,067,700	
	第284回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,114,300	
	第287回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,151,900	
	第288回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,176,400	
	第296回大阪府公募公債(10年)	30,000,000	30,949,800	
	第29回共同発行市場公募地方債	1,500,000	1,510,260	
	第2回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,730,000	
	第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	116,190,000	
	第301回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,372,600	

第305回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	41,826,400	
第309回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,434,400	
第30回2号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	100,883,000	
第30回共同発行市場公募地方債	1,500,000	1,510,935	
第312回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,455,300	
第316回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,586,900	
第31回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,095,800	
第320回大阪府公募公債(10年)	10,000,000	10,637,000	
第323回大阪府公募公債(10年)	40,000,000	42,450,400	
第324回大阪府公募公債(10年)	8,000,000	8,482,400	
第325回大阪府公募公債(10年)	6,000,000	6,372,180	
第326回大阪府公募公債(10年)	56,000,000	59,533,040	
第327回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,564,000	
第346回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,258,000	
第34回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,123,100	
第368回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,909,000	
第374回大阪府公募公債(10年)	134,000,000	140,338,200	
第387回大阪府公募公債(10年)	44,040,000	44,365,896	
第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	121,611,000	
第3回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,094,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,902,000	
第45回共同発行市場公募地方債	7,800,000	8,030,880	
第468回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	105,640,000	
第47回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,440,000	
第480回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	104,122,000	
第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,376,000	
第49回共同発行市場公募地方債	15,500,000	16,077,065	
第4回横浜市公募公債(30年)	100,000,000	120,155,000	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,699,000	
第56回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,224,250	
第57回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,220,500	
第5回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	121,804,000	
第60回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,429,100	
第61回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,459,000	
第620回東京都公募公債	1,100,000	1,101,100	
第621回東京都公募公債	2,500,000	2,502,525	
第622回東京都公募公債	2,000,000	2,008,140	
第623回東京都公募公債	8,300,000	8,334,611	
第626回東京都公募公債	8,600,000	8,676,024	
第628回東京都公募公債	10,000,000	10,125,800	
第629回東京都公募公債	20,000,000	20,228,600	
第62回共同発行市場公募地方債	20,000,000	21,065,000	
第631回東京都公募公債	700,000	712,551	
第634回東京都公募公債	20,000,000	20,476,600	
第637回東京都公募公債	10,000,000	10,274,700	
第63回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,592,900	
第649回東京都公募公債	2,300,000	2,398,026	
第652回東京都公募公債	1,400,000	1,463,434	
第658回東京都公募公債	10,000,000	10,617,200	
第662回東京都公募公債	10,000,000	10,562,000	
第663回東京都公募公債	100,000,000	105,512,000	
第675回東京都公募公債	100,000,000	106,007,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,216,000	

第703回東京都公募公債	100,000,000	105,428,000	
第704回東京都公募公債	100,000,000	105,294,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,062,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,117,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,520,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,157,000	
第82回川崎市公募公債	130,000,000	138,101,600	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,392,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,213,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,621,000	
第90回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,381,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,850,000	
平成16年度第2回広島県公募公債	30,000,000	30,040,500	
平成16年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	99,992,000	
平成16年度第6回福岡市公募公債	16,000,000	15,998,720	
平成16年度第8回千葉県公募公債	7,000,000	6,999,300	
平成17年度第10回大阪市公募公債	5,000,000	5,065,450	
平成17年度第1回横浜市公募公債	18,800,000	18,818,612	
平成17年度第1回北海道公募公債	40,000,000	40,094,400	
平成17年度第2回埼玉県公募公債	13,100,000	13,143,361	
平成17年度第2回鹿児島県公募公債(10年)	12,000,000	12,214,440	
平成17年度第2回静岡県公募公債	30,900,000	31,031,634	
平成17年度第4回兵庫県公募公債	4,100,000	4,117,794	
平成17年度第5回福岡県公募公債	6,000,000	6,080,220	
平成17年度第9回兵庫県公募公債	10,000,000	10,116,700	
平成17年度第9回北海道公募公債	3,000,000	3,034,710	
平成18年度第1回横浜市公募公債	10,000,000	10,198,500	
平成18年度第1回広島市公募公債	30,000,000	30,956,700	
平成18年度第1回堺市公募公債	40,400,000	41,680,276	
平成18年度第1回埼玉県公募公債	5,500,000	5,612,255	
平成18年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	102,871,000	
平成18年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,314,100	
平成18年度第3回大阪市公募公債	7,500,000	7,714,200	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	2,000,000	2,047,720	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	23,100,000	23,756,502	
平成18年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,356,600	
平成18年度第5回兵庫県公募公債	30,000,000	30,759,300	
平成18年度第6回福岡市公募公債	30,000,000	30,948,600	
平成18年度第7回千葉県公募公債	2,000,000	2,068,800	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	104,650,000	
平成19年度第14回北海道公募公債	10,000,000	10,463,400	
平成19年度第1回愛知県公募公債(10年)	21,700,000	22,526,553	
平成19年度第1回岡山県公募公債(10年)	42,200,000	44,097,734	
平成19年度第1回広島県公募公債	13,800,000	14,323,710	
平成19年度第1回埼玉県公募公債	13,150,000	13,634,577	
平成19年度第1回静岡県公募公債	18,300,000	18,998,877	
平成19年度第1回千葉県公募公債	2,000,000	2,075,920	
平成19年度第1回大分県公募公債	15,670,000	16,416,988	
平成19年度第2回熊本県公募公債(10年)	30,000,000	31,428,900	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,328,000	
平成19年度第4回大阪市公募公債	10,000,000	10,416,200	
平成19年度第5回福岡市公募公債	13,700,000	14,288,278	
平成19年度第9回大阪市公募公債	30,000,000	31,326,900	

平成19年度第9回北海道公募公債	21,000,000	21,908,670	
平成20年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,963,000	
平成20年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	105,982,000	
平成20年度第1回浜松市公募公債	11,000,000	11,653,620	
平成20年度第2回札幌市公募公債	22,550,000	23,914,951	
平成20年度第2回大阪市公募公債	20,000,000	21,209,800	
平成20年度第3回大阪市公募公債	30,000,000	31,731,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	105,414,000	
平成20年度第5回広島県公募公債	100,000,000	105,313,000	
平成20年度第7回千葉県公募公債	1,000,000	1,055,290	
平成20年度第7回兵庫県公募公債	10,000,000	10,564,100	
平成20年度第8回大阪市公募公債	40,000,000	42,278,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,703,000	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	106,250,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	20,000,000	21,156,800	
平成21年度第1回千葉県公募公債	40,000,000	42,316,400	
平成21年度第25回兵庫県公募公債	100,000,000	106,401,000	
平成21年度第2回熊本県公募公債(10年)	10,000,000	10,553,900	
平成21年度第2回広島県公募公債	16,160,000	17,085,968	
平成21年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,650,000	
平成21年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,516,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	40,000,000	42,428,000	
平成21年度第3回埼玉県公募公債	20,000,000	21,294,600	
平成21年度第4回大阪市公募公債	100,000,000	106,469,000	
平成21年度第6回北海道公募公債	60,000,000	63,774,600	
平成21年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	106,473,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	12,000,000	12,584,880	
平成22年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	115,417,000	
平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	105,762,000	
平成23年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	106,176,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,864,000	
平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,874,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	107,661,000	
平成24年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	104,790,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,791,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	103,909,000	
平成24年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	104,009,000	
平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,674,000	
平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	31,225,500	
平成24年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,203,000	
平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	31,010,100	
平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	102,878,000	
平成24年度第9回北海道公募公債	107,400,000	111,147,186	
平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,114,000	
平成25年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,443,000	
平成25年度第7回北海道公募公債	100,000,000	103,424,000	
平成26年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	102,511,000	
地方債証券 小計	10,020,530,000	10,652,666,670	

特殊債券	F 8 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,682,000	
	い第725号農林債	10,000,000	10,016,500	
	い第730号商工債	100,000,000	100,615,000	
	い第734号商工債	200,000,000	201,154,000	
	い第746号農林債	100,000,000	100,387,000	
	い第748号農林債	100,000,000	100,413,000	
	い第757号農林債	100,000,000	100,448,000	
	い第758号農林債	100,000,000	100,629,000	
	い第763号商工債	100,000,000	100,381,000	
	い第763号農林債	100,000,000	100,267,000	
	い第772号農林債	100,000,000	99,931,000	
	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	105,870,000	
	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	106,095,000	
	第10回日本政策金融公庫	100,000,000	117,052,000	
	第10回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,461,700	
	第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,284,000	
	第11回関西国際空港	100,000,000	104,252,000	
	第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,462,000	
	第11回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	105,421,000	
	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	106,188,000	
	第12回政府保証東日本高速道路債券	22,000,000	22,896,060	
	第12回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,682,000	
	第13回沖縄振興開発金融公庫債券	10,000,000	10,635,300	
	第13回公営企業債券	30,000,000	30,039,900	
	第13回公営企業債券(20年)	10,000,000	11,619,100	
	第13回政府保証西日本高速道路債券	4,000,000	4,163,080	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,029,250	
	第146回政府保証阪神高速道路債券	35,000,000	35,119,700	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	5,000,000	5,211,700	
	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	11,269,830	
	第14回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,925,000	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,566,900	
	第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	51,514,000	
	第162号商工債(3年)	100,000,000	100,149,000	
	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	205,554	
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,035,010	
	第16回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	42,427,000	44,583,140	
	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	215,426,000	
	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	110,419,000	
	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	103,965,000	
	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	104,034,000	
第17回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	43,298,000	45,636,092		

第185回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,344,000	
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	102,939,000	
第187回政府保証中小企業債券	18,000,000	18,211,680	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,944,000	
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	113,204,000	
第18回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,045,390	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	43,506,000	45,607,774	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,394,000	
第191回政府保証中小企業債券	16,000,000	16,666,080	
第199回政府保証首都高速道路債券	10,000,000	10,070,300	
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	102,782,000	
第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	106,199,000	
第19回都市再生債券	50,000,000	52,902,500	
第1回政府保証東日本高速道路債券	65,000,000	65,763,100	
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	34,412,080	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	68,673,000	72,173,262	
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	1,038,970	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,715,000	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,900,000	
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	205,868	
第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	110,589,000	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,284,000	
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	103,067,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,967,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,431,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	115,856,000	
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	3,090,450	
第246回信金中金債(5年)	100,000,000	100,144,000	
第24回公営企業債券	70,000,000	72,312,800	
第24回政府保証中日本高速道路債券	20,000,000	20,929,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,565,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,566,000	104,000,655	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	20,000,000	21,205,800	
第273回信金中金債(5年)	100,000,000	100,387,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,384,000	
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	103,501,000	
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,582,000	
第284回信金中金債(5年)	100,000,000	100,767,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,355,000	58,404,991	
第28回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	103,077,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,025,000	36,220,633	

第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,094,000	60,184,935	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,158,000	
第2回政府保証原子力損害賠償支援機構債	100,000,000	100,207,000	
第2回政府保証西日本高速道路債券	13,000,000	13,377,780	
第2回政府保証中日本高速道路債券	1,000,000	1,012,040	
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	109,667,000	
第2回政府保証日本政策投資銀行	100,000,000	104,949,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,616,000	50,284,876	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,068,000	77,919,921	
第2号商工債(10年)	100,000,000	101,639,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,693,000	
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	10,342,600	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,732,000	60,902,936	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,730,000	62,802,338	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,137,000	60,873,188	
第338回政府保証道路債券	9,000,000	9,012,870	
第339回政府保証道路債券	1,000,000	1,002,510	
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	3,106,530	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	108,056,000	
第342回東京交通債券	30,000,000	34,495,200	
第343回政府保証道路債券	6,000,000	6,027,240	
第345回政府保証道路債券	2,000,000	2,010,220	
第346回政府保証道路債券	50,000,000	50,350,500	
第347回政府保証道路債券	21,000,000	21,152,880	
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	51,839,000	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,578,000	42,192,522	
第34回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,080,000	
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	7,297,780	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,205,000	72,662,878	
第36回中日本高速道路	100,000,000	105,208,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,790,000	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	105,503,590	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,528,000	
第38回日本政策投資銀行	100,000,000	100,113,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,485,000	35,828,280	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,285,000	75,170,745	
第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,696,000	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,917,000	76,605,141	
第39回日本政策投資銀行債券	10,000,000	10,415,300	
第3回成田国際空港	100,000,000	103,249,000	
第3回政府保証東日本高速道路債券	17,000,000	17,412,590	
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	6,689,694	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,188,000	
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	1,046,140	

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	68,785,200	
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	1,046,360	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,029,000	82,812,118	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,546,000	168,837,959	
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	9,405,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,537,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,949,000	83,345,409	
第46回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	99,970,000	
第46回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,165,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,760,000	
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	70,744,480	
第48回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,467,000	
第48回中日本高速道路	100,000,000	103,145,000	
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	13,542,360	
第49回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,019,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,186,000	
第4回公営企業債券(30年)	100,000,000	127,901,000	
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	113,410,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,271,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,597,000	
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	104,582,000	
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	11,446,820	
第55回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,824,000	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,326,000	89,289,392	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,146,000	
第57回中日本高速道路	100,000,000	100,400,000	
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	2,105,360	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,231,000	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	113,431,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,904,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,501,000	
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	8,458,720	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,319,000	89,979,788	
第62回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,062,000	
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	105,540,000	
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,044,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,593,000	92,008,427	
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	81,337,410	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,047,000	94,561,414	



第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,961,000	27,047,240	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,144,000	36,891,359	
第6回中小企業債券	10,000,000	10,197,600	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,724,000	94,068,086	
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	65,073,340	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,544,000	92,716,150	
第75回都市再生債券	100,000,000	100,110,000	
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	104,804,000	
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	105,334,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,592,000	96,749,643	
第7回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,529,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	66,000,000	69,857,700	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,433,000	97,659,451	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,131,000	
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	105,949,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,440,000	
第849回政府保証公営企業債券	76,000,000	76,079,800	
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	119,237,000	
第851回政府保証公営企業債券	24,000,000	24,076,800	
第852回政府保証公営企業債券	11,000,000	11,048,730	
第853回政府保証公営企業債券	7,000,000	7,034,090	
第854回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,006,640	
第855回政府保証公営企業債券	2,000,000	2,014,240	
第856回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,143,850	
第857回政府保証公営企業債券	21,000,000	21,249,060	
第859回政府保証公営企業債券	28,000,000	28,376,040	
第860回政府保証公営企業債券	2,000,000	2,030,900	
第861回政府保証公営企業債券	18,000,000	18,297,720	
第862回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,101,250	
第863回政府保証公営企業債券	12,000,000	12,293,760	
第865回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,245,430	
第866回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,086,430	
第867回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,109,760	
第868回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,144,350	
第872回政府保証公営企業債券	64,000,000	66,215,680	
第873回政府保証公営企業債券	90,000,000	93,039,300	
第874回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,316,170	
第875回政府保証公営企業債券	74,000,000	76,708,400	
第877回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,381,000	
第879回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,585,340	
第880回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,666,300	
第881回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,156,000	
第882回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,045,450	
第885回政府保証公営企業債券	40,000,000	42,093,200	
第886回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,170,610	
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	118,059,000	

	第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	11,928,600	
	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	33,556,050	
	第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,302,000	40,011,617	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	60,000,000	60,534,000	
	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	117,460,000	
	第9回都市再生債券	100,000,000	101,136,000	
	第9回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,243,000	
	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	105,670,000	
	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	110,634,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,668,000	55,897,542	
	第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,679,000	40,564,081	
	特殊債券 小計	14,747,553,000	15,585,164,349	
社債券	第101回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	105,747,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	111,605,000	
	第112回三菱地所	100,000,000	102,032,000	
	第11回パナソニック	100,000,000	102,647,000	
	第11回三井住友銀行	100,000,000	105,335,000	
	第11回電源開発	100,000,000	111,633,000	
	第12回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	104,669,000	
	第138回オリックス	100,000,000	103,667,000	
	第13回東京地下鉄	100,000,000	108,547,000	
	第14回トヨタ自動車	100,000,000	104,568,000	
	第14回武田薬品工業	100,000,000	101,247,000	
	第15回ダイキン工業	100,000,000	101,831,000	
	第15回豊田自動織機	100,000,000	100,872,000	
	第16回ジェイ エフ イー ホールディングス	100,000,000	101,467,000	
	第17回東日本旅客鉄道	100,000,000	112,247,000	
	第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ポエレン	100,000,000	101,293,000	
	第18回みずほ銀行	100,000,000	113,611,000	
	第20回大阪瓦斯	100,000,000	108,556,000	
	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	100,449,000	
	第23回三菱UFJリース	100,000,000	100,969,000	
	第245回四国電力	100,000,000	110,134,000	
	第257回北海道電力	100,000,000	104,194,000	
	第25回シティグループ・インク	100,000,000	100,560,000	
	第25回ホンダファイナンス	100,000,000	101,255,000	
	第25回三井住友銀行	100,000,000	114,991,000	
	第25回日本郵船	100,000,000	117,203,000	
	第261回北海道電力	12,000,000	12,796,800	
	第26回東海旅客鉄道	100,000,000	106,763,000	
	第27回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,544,000	
	第27回エヌ・ティ・ティ・データ	100,000,000	104,071,000	
第27回三井住友銀行	100,000,000	107,481,000		
第281回北陸電力	100,000,000	105,269,000		
第28回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,622,000		

第28回西日本旅客鉄道	100,000,000	115,978,000	
第28回東京瓦斯	100,000,000	118,430,000	
第2回麒麟ホールディングス	100,000,000	100,089,000	
第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ	100,000,000	100,860,000	
第32回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	107,793,000	
第32回住友商事	100,000,000	103,012,000	
第32回東日本旅客鉄道	100,000,000	115,979,000	
第33回大成建設	100,000,000	101,522,000	
第354回中国電力	100,000,000	105,228,000	
第378回東北電力	100,000,000	104,267,000	
第37回三菱化学	100,000,000	106,268,000	
第382回東北電力	10,000,000	10,624,300	
第394回九州電力	100,000,000	104,056,000	
第39回野村ホールディングス	100,000,000	101,607,000	
第3回GLP投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,917,000	
第3回松下電工	100,000,000	100,497,000	
第3回西日本旅客鉄道	70,000,000	74,242,700	
第3回東日本旅客鉄道	3,000,000	3,116,370	
第3回富士フイルムホールディングス	100,000,000	103,804,000	
第400回九州電力	100,000,000	106,735,000	
第407回中部電力	100,000,000	101,383,000	
第428回東京電力	10,000,000	10,084,100	
第42回ソフトバンク	100,000,000	101,306,000	
第445回東北電力	100,000,000	105,498,000	
第450回関西電力	100,000,000	102,592,000	
第46回伊藤忠商事	100,000,000	103,967,000	
第473回関西電力	100,000,000	104,850,000	
第473回中部電力	100,000,000	101,160,000	
第47回東海旅客鉄道	100,000,000	114,877,000	
第486回中部電力	100,000,000	104,936,000	
第492回関西電力	100,000,000	100,495,000	
第4回ビー・エヌ・ピー・パリバ	100,000,000	100,378,000	
第4回ヒューリック	100,000,000	100,371,000	
第4回プレミアム投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,168,000	
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	99,980,000	
第4回東京地下鉄	10,000,000	11,906,700	
第520回東京電力	100,000,000	100,819,000	
第525回東京電力	100,000,000	100,406,000	
第52回東海旅客鉄道	100,000,000	116,003,000	
第52回日本電信電話	100,000,000	103,382,000	
第531回東京電力	100,000,000	100,773,000	
第536回東京電力	100,000,000	100,216,000	
第545回東京電力	100,000,000	100,645,000	
第54回日立キャピタル	100,000,000	100,324,000	
第55回日産自動車	100,000,000	100,534,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	113,860,000	
第60回トヨタファイナンス	100,000,000	100,124,000	
第63回日本電信電話	100,000,000	102,349,000	
第65回三菱地所	100,000,000	111,746,000	
第69回東日本旅客鉄道	100,000,000	105,252,000	
第6回みずほ銀行	100,000,000	103,330,000	

第6回りそな銀行	100,000,000	108,286,000	
第7回オリエンタルランド	100,000,000	101,894,000	
第7回みずほコーポレート銀行	100,000,000	108,983,000	
第7回三井住友信託銀行	100,000,000	100,166,000	
第8回住友不動産	100,000,000	100,459,000	
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	100,847,000	
第8回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）	100,000,000	100,485,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,803,000	
第9回モルガン・スタンレー	100,000,000	100,539,000	
第9回沖縄電力	100,000,000	102,220,000	
第9回三菱UFJ信託銀行	100,000,000	108,016,000	
社債券 小計	9,015,000,000	9,430,313,970	
合計	162,213,083,000	173,768,585,389	

## 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26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		1,424,100,239	716,877,284
コール・ローン		4,306,956,532	4,453,072,933
株式		156,122,612,975	161,915,065,293
投資証券		3,194,913,916	3,926,195,100
派生商品評価勘定		229,572,567	253,645,558
未収入金		2,051,107	43,461,111
未収配当金		265,297,198	271,223,034
未収利息		3,539	1,220
差入委託証拠金		1,006,050,753	1,303,160,640
流動資産合計		166,551,558,826	172,882,702,173
資産合計		166,551,558,826	172,882,702,173
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,837,815	3,744,337
未払解約金		216,950,000	323,355,800
流動負債合計		223,787,815	327,100,137
負債合計		223,787,815	327,100,137
純資産の部			
元本等			
元本	1	98,382,507,045	80,290,033,338
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		67,945,263,966	92,265,568,698
元本等合計		166,327,771,011	172,555,602,036
純資産合計		166,327,771,011	172,555,602,036
負債純資産合計		166,551,558,826	172,882,702,173

(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、新株予約権証券</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> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
1 期首元本額	129,060,389,058円	98,382,507,045円
期中追加設定元本額	19,598,144,073円	21,380,624,115円
期中一部解約元本額	50,276,026,086円	39,473,097,822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	9,135,027,115円	8,064,168,654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	6,458,830,447円	6,924,147,313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	30,689,729円	36,668,594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）	100,283,767円	38,444,715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）	4,695,022,888円	3,682,692,491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）	607,713,102円	456,704,882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＞	49,520,396円	27,287,269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＞	5,091,170,138円	3,274,170,208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＞	7,724,588円	354,653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＞	59,304,211円	34,827,896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＞	31,149,269円	19,740,254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＞	18,837,964,967円	14,869,453,492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＞	76,076,424円	37,466,994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＞	3,317,451,734円	2,486,556,867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＞	1,690,302,902円	1,343,675,610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＞	224,682,982円	157,662,975円
ステート・ストリート4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	306,432,168円	266,321,849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＞	3,099,615,076円	2,540,345,430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＞	804,624,139円	786,225,250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＞	4,171,755,278円	3,231,298,517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＞	911,300,213円	538,201,982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＞	2,685,032,717円	1,789,923,358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＞	19,594,771円	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＞	71,234,414円	56,043,997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＞	91,046,969円	64,043,185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>	62,105,797円	46,544,688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>	603,910,815円	461,986,014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>	5,843,320円	4,540,789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>	7,973,187円	6,916,911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>	127,227円	113,743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>	72,986,637円	56,743,231円
ステート・ストリート外国株式インデック ス・ファンドVA3<適格機関投資家限定 >	17,861,007,137円	12,002,478,528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>	567,391,973円	453,837,467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>	37,064,529円	57,427,685円
AMC/ステート・ストリート・リスクバ ジェット型バランス・ファンド(ステイブ ル)年金<適格機関投資家限定>	円	26,333,704円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格 機関投資家限定>	16,590,546,019円	16,446,684,143円
計	98,382,507,045円	80,290,033,338円
2 受益権の総数	98,382,507,045口	80,290,033,338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26年 2月20日現在）	（平成27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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	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26年 2月20日現在）	（平成27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	2,806,470,626	4,652,464,235
投資証券	172,683,632	191,133,092
合計	2,979,154,258	4,843,597,327

（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

（単位：円）

区分	種 類	（平成27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	4,203,399,278		4,304,741,467	101,342,189
	S&P 60	263,204,381		269,449,215	6,244,834
	SPI 200	261,972,467		285,919,767	23,947,300
	FTSE100INDEX	643,802,798		655,365,983	11,563,185
	FSMI INDEX	251,839,460		276,592,662	24,753,202
	EURO STOXX 50	857,786,498		896,601,848	38,815,350
	合 計	6,482,004,882		6,688,670,942	206,666,060

（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

(単位：円)

区分	種類	(平成27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	4,531,220,133		4,555,380,060	24,159,927
	カナダ・ドル	319,471,303		320,970,400	1,499,097
	オーストラリア・ドル	230,502,450		231,514,640	1,012,190
	イギリス・ポンド	634,183,329		645,861,880	11,678,551
	ユーロ	827,660,701		834,038,790	6,378,089
	売建				
	アメリカ・ドル	1,666,260,697		1,666,980,000	719,303
	カナダ・ドル	107,881,746		108,070,200	188,454
	オーストラリア・ドル	81,221,183		81,743,760	522,577
	イギリス・ポンド	234,760,486		235,610,120	849,634
	ユーロ	320,436,735		319,649,460	787,275
	合計	8,953,598,763		8,999,819,310	43,235,161

(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25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	自 平成26年 2月21日 至 平成27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26年 2月20日現在）	（平成27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）	1.6906円 （16,906円）	2.1492円 （21,492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	EVERSOURCE ENERGY	13,971	52.50	733,477.50	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	22,480	86.10	1,935,528.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,461	41.28	101,590.08	
	APACHE CORP	16,939	66.63	1,128,645.57	
	BAKER HUGHES	19,220	64.27	1,235,269.40	
	CABOT OIL GAS CORP	19,200	27.71	532,032.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,308	48.29	449,483.32	
	CHENIERE ENERGY INC	10,411	74.95	780,304.45	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	24,400	20.40	497,760.00	
	CHEVRON CORPORATION	84,500	108.35	9,155,575.00	
	CIMAREX ENERGY CO	3,800	117.07	444,866.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	13,800	8.87	122,406.00	
	CONCHO RESOURCES INC	5,000	118.37	591,850.00	
	CONOCOPHILLIPS	54,700	67.42	3,687,874.00	
	CONSOL ENERGY INC	10,000	33.99	339,900.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,400	48.00	211,200.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,100	115.54	242,634.00	
	DENBURY RESOURCES INC	19,000	9.03	171,570.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	17,240	64.41	1,110,428.40	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,800	34.40	96,320.00	
	ENERGEN CORP	3,500	68.96	241,360.00	
	ENSCO PLC CL A	10,197	30.02	306,113.94	
	EOG RESOURCES INC	24,308	93.80	2,280,090.40	
	EQT CORPORATION	6,700	81.58	546,586.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	189,900	89.44	16,984,656.00	
	FMC TECHNOLOGIES INC	10,800	41.66	449,928.00	
	HALLIBURTON CO	37,734	44.24	1,669,352.16	
	HELMERICH & PAYNE	4,700	70.24	330,128.00	
	HESS CORP	12,200	76.48	933,056.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	9,043	41.17	372,300.31	
	KINDER MORGAN INC	80,072	42.01	3,363,824.72	
	MARATHON OIL CORP	29,757	29.01	863,250.57	
	MARATHON PETROLEUM CORP	12,504	105.65	1,321,047.60	
	MURPHY OIL CORP	7,400	50.04	370,296.00	
	NABORS INDUSTRIES	13,066	13.90	181,617.40	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	19,031	54.24	1,032,241.44		
NOBLE CORP PLC	10,948	19.51	213,595.48		
NOBLE ENERGY INC	16,000	49.70	795,200.00		

OCCIDENTAL PETROLEUM	34,646	80.61	2,792,814.06	
OCEANEERING INTL INC	5,147	52.40	269,702.80	
ONEOK INC NEW	9,100	47.50	432,250.00	
PHILLIPS 66	24,760	77.43	1,917,166.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,324	160.16	1,012,851.84	
QEP RESOURCES INC	8,000	22.79	182,320.00	
RANGE RESOURCES CORP	7,400	52.02	384,948.00	
SCHLUMBERGER LTD	57,687	86.98	5,017,615.26	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	17,000	27.52	467,840.00	
SPECTRA ENERGY CORP	29,719	36.00	1,069,884.00	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	7,300	22.04	160,892.00	
TESORO CORP	5,882	90.53	532,497.46	
VALERO ENERGY CORP	23,426	60.18	1,409,776.68	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	33,860	12.58	425,958.80	
WHITING PETROLEUM CORP	5,800	39.64	229,912.00	
WILLIAMS COS	31,441	49.41	1,553,499.81	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	9,396	156.08	1,466,527.68	
AIRGAS INC	3,100	116.52	361,212.00	
ALBEMARLE CORP	3,700	54.43	201,391.00	
ALCOA INC	51,988	16.00	831,808.00	
ASHLAND INC	3,255	126.96	413,254.80	
AVERY DENNISON CORP	4,557	53.80	245,166.60	
BALL CORP	6,000	73.85	443,100.00	
CELANESE CORP DEL COM SER A	7,100	58.01	411,871.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,200	304.38	669,636.00	
CROWN HOLDINGS INC	6,600	51.57	340,362.00	
DOW CHEMICAL CO	53,074	49.68	2,636,716.32	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	40,678	76.08	3,094,782.24	
EASTMAN CHEMICAL CO	6,800	74.69	507,892.00	
ECOLAB INC	11,994	111.77	1,340,569.38	
FMC CORP	5,800	63.73	369,634.00	
FREEPORT MCMORAN INC	45,966	21.11	970,342.26	
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	3,689	120.10	443,048.90	
INT'L PAPER CO	17,990	56.84	1,022,551.60	
LYONDELLBASELL INDU CL A	19,300	91.24	1,760,932.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,500	145.00	362,500.00	
MEADWESTVACO CORP	7,340	54.56	400,470.40	
MONSANTO CO	23,278	125.46	2,920,457.88	
MOSAIC CO/THE	14,901	53.02	790,051.02	
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	21,953	24.46	536,970.38	
NUCOR CORP	14,684	48.14	706,887.76	
OWENS-ILLINOIS INC	7,400	26.10	193,140.00	
PPG INDUSTRIES	6,062	235.50	1,427,601.00	
PRAXAIR	12,989	128.86	1,673,762.54	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	6,300	71.03	447,489.00	
SEALED AIR CORP	8,810	47.68	420,060.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO	3,664	286.76	1,050,688.64	
SIGMA-ALDRICH	5,468	138.42	756,880.56	
VULCAN MATERIALS CO	5,756	81.26	467,732.56	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,208	67.39	148,797.12	
3M CO	27,356	167.09	4,570,914.04	
AGCO CORP	4,300	50.49	217,107.00	
AMETEK INC	10,800	51.26	553,608.00	
B/E AEROSPACE INC	5,054	64.02	323,557.08	
BOEING CO	30,398	153.75	4,673,692.50	
CATERPILLAR	26,500	83.30	2,207,450.00	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	4,357	41.67	181,556.19	
CUMMINS ENGINE CO	7,700	140.80	1,084,160.00	
DANAHER CORP	28,016	87.24	2,444,115.84	

DEERE & CO	15,092	91.71	1,384,087.32
DOVER CORP	7,614	74.30	565,720.20
EATON CORP PLC	21,104	72.12	1,522,020.48
EMERSON ELECTRIC CO	31,008	58.69	1,819,859.52
FASTENAL CO	12,400	42.96	532,704.00
FLOWERVE CORP	6,000	62.57	375,420.00
FLUOR CORP	7,168	59.44	426,065.92
GENERAL DYNAMICS CORP	12,596	139.51	1,757,267.96
GENERAL ELECTRIC CO	446,739	25.01	11,172,942.39
GRAINGER (WW)	2,845	235.55	670,139.75
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	33,037	104.70	3,458,973.90
ILLINOIS TOOL WORKS	16,740	98.43	1,647,718.20
INGERSOLL-RAND PLC	11,859	67.97	806,056.23
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,400	43.81	280,384.00
JOY GLOBAL INC	5,000	44.16	220,800.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,800	131.18	498,484.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,989	201.71	2,418,301.19
MASCO CORP	16,323	26.79	437,293.17
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,792	170.13	1,495,782.96
PACCAR INC	15,706	64.49	1,012,958.47
PALL CORP	5,000	104.22	521,100.00
PARKER HANNIFIN CORP	6,562	123.25	808,766.50
PENTAIR PLC	8,506	66.95	569,476.70
PRECISION CASTPARTS CORP	6,400	214.20	1,370,880.00
QUANTA SERVICES INC	9,200	29.61	272,412.00
RAYTHEON COMPANY	13,799	108.07	1,491,257.93
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,322	117.83	744,921.26
ROCKWELL COLLINS	5,309	89.81	476,801.29
ROPER INDUSTRIES INC	4,600	167.40	770,040.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	52.68	368,760.00
SNAP-ON	2,787	145.54	405,619.98
SPX CORP	1,844	86.88	160,206.72
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,860	98.28	674,200.80
TEXTRON	12,252	44.79	548,767.08
TRANSDIGM GROUP INC	2,300	211.98	487,554.00
UNITED RENTALS INC	4,396	94.81	416,784.76
UNITED TECHNOLOGIES CORP	38,676	122.91	4,753,667.16
WABTEC CORPORATION	4,226	95.03	401,596.78
XYLEM INC	7,930	35.66	282,783.80
ADT CORP/THE	7,825	39.13	306,192.25
CINTAS CORP	4,299	81.99	352,475.01
DUN & BRADSTREET CORP	1,600	135.52	216,832.00
EQUIFAX INC	5,303	92.98	493,072.94
IHS INC	3,000	118.20	354,600.00
MANPOWER GROUP	3,754	79.04	296,716.16
NIELSEN NV	14,730	45.55	670,951.50
REPUBLIC SERVICES INC	13,030	40.58	528,757.40
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	6,240	61.26	382,262.40
STERICYCLE INC	3,900	134.09	522,951.00
TOWERS WATSON + CO CL A	3,204	131.35	420,845.40
TYCO INTERNATIONAL PLC	19,562	42.74	836,079.88
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	6,600	67.51	445,566.00
WASTE MANAGEMENT (NEW)	19,623	54.39	1,067,294.97
AMERICAN AIRLINES GROUP	8,230	49.78	409,689.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,700	71.84	481,328.00
CSX CORP	44,370	35.53	1,576,466.10
DELTA AIR LINES INC	9,700	45.92	445,424.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,904	45.61	406,111.44
FEDEX CORP	11,996	178.65	2,143,085.40

HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	20,500	23.65	484,825.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,100	82.89	339,869.50
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	253,000	0.69	175,835.00
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	117.92	601,392.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,723	111.59	1,531,349.57
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,810	43.76	341,765.60
UNION PACIFIC CORP	39,900	121.96	4,866,204.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	4,027	66.09	266,144.43
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	31,457	101.70	3,199,176.90
AUTOLIV INC	4,200	112.23	471,366.00
BORGWARNER INC	10,100	60.59	611,959.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	13,222	79.41	1,049,959.02
FORD MOTOR COMPANY	160,721	16.43	2,640,646.03
GENERAL MOTORS CO	57,000	37.51	2,138,070.00
HARLEY-DAVIDSON	9,558	63.37	605,690.46
JOHNSON CONTROLS	29,542	49.90	1,474,145.80
TESLA MOTORS INC	4,000	211.70	846,820.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	4,900	104.12	510,188.00
COACH INC	12,066	40.69	490,965.54
DR HORTON INC	14,266	27.33	389,889.78
FOSSIL GROUP INC	2,300	84.91	195,293.00
GARMIN LTD	5,000	50.72	253,600.00
HANESBRANDS INC	4,406	117.96	519,731.76
HASBRO INC	5,200	61.78	321,256.00
JARDEN CORPORATION	7,969	52.58	419,010.02
LEGGETT & PLATT INC	6,000	44.33	265,980.00
LENNAR CORP-CL A	7,512	50.24	377,402.88
LULULEMON ATHLETICA INC	5,200	66.89	347,828.00
MATTEL	15,461	25.81	399,048.41
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	9,500	69.59	661,105.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,700	172.67	466,209.00
NEWELL RUBBERMAID INC	12,589	39.77	500,664.53
NIKE B	30,692	93.70	2,875,840.40
POLARIS INDUSTRIES INC	2,789	154.68	431,402.52
PULTE GROUP INC	14,763	22.71	335,267.73
PVH CORP	3,800	108.52	412,376.00
RALPH LAUREN CORP	2,774	136.97	379,954.78
TOLL BROTHERS INC	8,000	37.57	300,560.00
UNDER ARMOUR INC CLASS A	7,594	73.83	560,665.02
VF CORP	15,256	74.45	1,135,809.20
WHIRLPOOL CORP	3,574	212.33	758,867.42
BLOCK (H&R)	12,084	35.00	422,940.00
CARNIVAL CORP	17,015	43.70	743,555.50
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,400	673.28	942,592.00
DARDEN RESTAURANTS	5,819	62.32	362,640.08
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC.	16,752	28.35	474,919.20
LAS VEGAS SANDS CORP	17,800	60.47	1,076,366.00
MARRIOTT INT'L A	10,267	83.10	853,187.70
MCDONALD'S CORP	43,650	94.19	4,111,393.50
MGM RESORTS INTERNATIONAL	17,900	22.44	401,676.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	4,293	48.41	207,824.13
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,300	76.97	561,881.00
STARBUCKS CORP	33,412	93.17	3,112,996.04
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	8,813	79.46	700,280.98
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5,500	91.35	502,425.00
WYNN RESORTS LTD	3,600	158.57	570,852.00
YUM! BRANDS INC	19,464	76.67	1,492,304.88

CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,500	19.87	188,765.00
CBS CORP-CL B	21,617	59.54	1,287,076.18
CHARTER COMMUNICATION-A	3,452	174.52	602,460.30
COMCAST CORP-CL A	95,688	57.85	5,535,550.80
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	18,960	57.50	1,090,200.00
DIRECTV	21,156	87.21	1,845,014.76
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,345	31.10	228,429.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12,235	29.96	366,560.60
DISH NETWORK CORP-A	10,197	77.56	790,879.32
DISNEY (WALT) CO NEW	72,606	103.89	7,543,037.34
INTERPUBLIC GROUP OF COS	19,216	22.31	428,708.96
LIBERTY GLOBAL PLC A	11,399	52.75	601,297.25
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	28,211	51.05	1,440,171.55
LIBERTY MEDIA CORP	3,973	38.47	152,841.31
LIBERTY MEDIA CORP-C	8,962	38.45	344,588.90
NEWS CORP - CLASS A	18,456	17.04	314,490.24
OMNICOM GROUP	11,088	77.90	863,755.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,600	72.91	262,476.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	111,794	3.87	432,642.78
TIME WARNER CABLE INC-A	12,372	147.48	1,824,622.56
TIME WARNER INC	38,043	83.92	3,192,568.56
TWENTY FIRST CENTURY FOX	20,218	33.85	684,379.30
TWENTY FIRST CENTURY FOX INC	61,827	34.80	2,151,579.60
VIACOM INC-CLASS B	16,517	69.30	1,144,710.68
ADOVANCE AUTO PARTS	3,250	153.27	498,127.50
AMAZON COM INC	17,523	378.99	6,641,129.38
AUTONATION INC	3,727	62.28	232,117.56
AUTOZONE INC	1,459	618.34	902,158.06
BED BATH & BEYOND INC	9,287	76.06	706,369.22
BEST BUY COMPANY INC	13,557	39.13	530,485.41
CARMAX INC	10,050	68.30	686,415.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,200	54.31	228,102.00
DOLLAR GENERAL CORP	13,400	70.70	947,380.00
DOLLAR TREE INC	9,100	76.70	697,970.00
EXPEDIA INC	4,727	91.30	431,575.10
FAMILY DOLLAR STORES	4,444	77.90	346,187.60
FOOT LOCKER, INC.	6,295	55.08	346,728.60
GAMESTOP CORP NEW	5,500	37.53	206,415.00
GAP	10,873	41.07	446,554.11
GENUINE PARTS CO	7,100	95.71	679,541.00
HOME DEPOT	59,888	110.94	6,643,974.72
KOHL'S CORP	9,121	68.37	623,602.77
L BRANDS INC	10,990	90.03	989,429.70
LIBERTY INTERACTIVE CORP	20,778	29.24	607,548.72
LKQ CORP	13,245	27.31	361,720.95
LOWE'S COMPANIES	43,832	72.29	3,168,615.28
MACY'S INC	15,650	63.00	985,950.00
NETFLIX INC	2,500	474.60	1,186,500.00
NORDSTROM INC	6,500	77.14	501,410.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,600	204.91	942,586.00
PETSMART INC	4,100	82.88	339,808.00
PRICELINE GROUP INC/THE	2,380	1,218.05	2,898,959.00
ROSS STORES INC	9,400	96.92	911,048.00
SIGNET JEWELERS LTD	3,364	120.00	403,680.00
STAPLES	28,339	16.82	476,661.98
TARGET CORP	26,770	76.68	2,052,723.60
TIFFANY & CO	5,725	88.65	507,521.25
TJX COMPANIES INC	30,726	67.82	2,083,837.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,300	85.57	539,091.00

TRIPADVISOR INC	5,071	88.66	449,594.86
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	2,900	136.92	397,068.00
URBAN OUTFITTERS INC	5,000	37.90	189,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	19,490	146.66	2,858,500.85
CVS HEALTH CORPORATION	51,520	102.62	5,286,982.40
KROGER CO	20,554	72.44	1,488,931.76
SYSCO CORP	25,989	38.56	1,002,135.84
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,362	77.10	3,111,910.20
WAL-MART STORES	71,684	83.52	5,987,047.68
WHOLE FOODS MARKET INC	16,000	56.63	906,080.00
ALTRIA GROUP INC	88,223	55.48	4,894,612.04
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	28,654	47.78	1,369,088.12
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,662	91.53	518,242.86
BUNGE LIMITED	6,700	82.50	552,750.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,306	46.63	433,938.78
COCA COLA ENTERPRISES	10,200	44.47	453,594.00
COCA-COLA CO	175,670	42.11	7,397,463.70
CONAGRA FOODS	19,569	34.47	674,543.43
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,500	114.78	860,850.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	8,962	78.22	701,007.64
GENERAL MILLS	27,122	53.45	1,449,670.90
HORMEL FOODS CORP	6,600	57.65	380,490.00
JM SMUCKER CO	4,688	113.88	533,869.44
KELLOGG CO	11,940	63.79	761,652.60
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	5,615	120.28	675,372.20
KRAFT FOODS GROUP INC	26,377	64.17	1,692,612.09
LORILLARD INC	15,938	67.85	1,081,393.30
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,400	75.29	406,566.00
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	8,982	104.71	940,505.22
MOLSON COORS BREWING CO-B	7,000	75.48	528,360.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	74,909	36.99	2,771,258.45
MONSTER BEVERAGE CORP	6,283	121.13	761,059.79
PEPSICO INC	67,014	98.72	6,615,622.08
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	69,533	82.62	5,744,816.46
REYNOLDS AMERICAN INC	14,100	72.78	1,026,198.00
THE HERSHEY COMPANY	6,800	105.95	720,460.00
TYSON FOODS INC-CL A	13,400	41.34	553,956.00
AVON PRODUCTS	19,538	8.73	170,566.74
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,900	84.22	496,898.00
CLOROX CO	5,924	109.28	647,374.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	40,600	70.21	2,850,526.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,800	134.49	376,572.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,700	81.08	867,556.00
HERBALIFE LTD	3,000	33.87	101,610.00
KIMBERLY-CLARK CORP	16,623	110.66	1,839,501.18
PROCTER & GAMBLE CO	120,579	85.21	10,274,536.59
ABBOTT LABORATORIES	66,809	46.61	3,113,967.49
AETNA INC	15,689	96.64	1,516,184.96
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,892	101.01	999,190.92
ANTHEM INC	12,199	142.65	1,740,187.35
BARD (C.R.) INC	3,392	175.55	595,465.60
BAXTER INTERNATIONAL	24,037	67.42	1,620,574.54
BECTON DICKINSON	8,451	143.39	1,211,788.89
BOSTON SCIENTIFIC CORP	58,577	16.45	963,591.65
CARDINAL HEALTH INC	14,884	86.17	1,282,554.28
CAREFUSION CORP	9,342	59.80	558,651.60
CERNER CORP	13,600	71.26	969,136.00
CIGNA CORP	11,732	116.19	1,363,141.08



DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	7,600	73.24	556,624.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,500	52.57	341,705.00
EDWARDS LIFESCIENCES	4,700	133.72	628,484.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	33,118	85.50	2,831,589.00
HCA HOLDINGS INC	13,364	69.60	930,134.40
HENRY SCHEIN INC	3,700	140.86	521,182.00
HOLOGIC INC	10,716	31.66	339,322.14
HUMANA	6,800	153.28	1,042,304.00
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	1,630	511.47	833,696.10
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,844	117.14	450,286.16
MCKESSON CORP	10,262	225.35	2,312,541.70
MEDTRONIC PLC	62,677	78.13	4,896,954.01
OMNICARE INC	4,700	76.89	361,383.00
PATTERSON COS INC	3,500	49.32	172,620.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,346	71.45	453,421.70
RESMED INC	6,433	65.16	419,174.28
ST JUDE MEDICAL INC	12,624	67.18	848,080.32
STRYKER CORP	15,090	94.56	1,426,910.40
THE COOPER COS INC	2,117	164.35	347,928.95
UNITED HEALTH GROUP INC	43,190	110.03	4,752,195.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,020	107.18	430,863.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,560	92.61	422,301.60
ZIMMER HOLDINGS INC	7,431	120.20	893,206.20
ABBVIE INC	70,797	59.00	4,177,023.00
ACTAVIS PLC	11,764	289.44	3,404,972.16
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,320	41.15	630,418.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,800	182.28	1,604,064.00
ALLERGAN INC	13,200	231.12	3,050,784.00
AMGEN INC	33,779	156.05	5,271,212.95
BIOGEN IDEC INC	10,533	406.73	4,284,087.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,721	104.19	700,260.99
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	73,792	59.55	4,394,313.60
CELGENE CORP	35,600	120.21	4,279,476.00
ENDO INTERNATIONAL PLC	6,442	84.99	547,505.58
GILEAD SCIENCES INC	67,328	102.73	6,916,605.44
HOSPIRA INC	7,720	87.44	675,036.80
ILLUMINA INC	6,200	202.34	1,254,508.00
INCYTE CORP	6,708	80.15	537,646.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,601	170.80	444,250.80
JOHNSON & JOHNSON	125,621	100.70	12,650,034.70
LILLY (ELI) & CO	44,694	71.12	3,178,637.28
MALLINCKRODT PLC	5,213	116.90	609,399.70
MEDIVATION INC	3,387	105.96	358,886.52
MERCK & CO	128,374	58.30	7,484,204.20
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,407	309.22	435,072.54
MYLAN INC	16,500	57.22	944,130.00
PERRIGO CO PLC	5,879	151.59	891,197.61
PFIZER	282,296	34.41	9,713,805.36
PHARMACYCLICS INC	2,775	171.34	475,468.50
QUINTILES TRANSNATIONAL	2,713	64.52	175,042.76
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,500	426.60	1,493,100.00
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	2,742	150.74	413,329.08
THERMO ELECTRON CORP	17,778	127.79	2,271,850.62
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,600	111.97	1,186,882.00
WATERS CORPORATION	3,727	119.49	445,339.23
ZOETIS INC	22,146	45.65	1,010,964.90
BANK OF AMERICA CORP	468,048	16.21	7,587,058.08
BB&T CORPORATION	31,900	37.80	1,205,820.00
CIT GROUP INC	8,500	45.88	389,980.00

CITIGROUP INC	134,892	51.12	6,895,679.04
COMERICA	7,922	45.44	359,975.68
FIFTH THIRD BANCORP	38,420	19.20	737,664.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,306	55.89	352,442.34
HUDSON CITY BANCORP INC	23,000	9.68	222,640.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,715	10.64	380,007.60
JPMORGAN CHASE & CO	167,474	59.23	9,919,485.02
KEYCORP	40,191	13.90	558,654.90
M & T BANK CORP	5,204	121.21	630,776.84
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	20,169	16.33	329,359.77
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	14,700	14.89	218,883.00
PNC BANK CORP	23,965	91.62	2,195,673.30
REGIONS FINANCIAL CORP	63,445	9.53	604,630.85
SUNTRUST BANKS	23,523	40.67	956,680.41
US BANCORP	80,081	44.32	3,549,189.92
WELLS FARGO COMPANY	220,851	54.56	12,049,630.56
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,500	217.57	543,925.00
ALLY FINANCIAL INC.	15,175	21.82	331,118.50
AMERICAN EXPRESS	41,844	78.40	3,280,569.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,328	135.85	1,131,358.80
BANK NEW YORK MELLO CORP	50,200	39.12	1,963,824.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,150	147.48	7,543,602.00
BLACKROCK INC	5,900	377.61	2,227,899.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,911	79.42	1,978,431.62
CME GROUP INC	14,150	94.18	1,332,647.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,442	59.65	1,219,365.30
EATON VANCE CORP	5,600	42.97	240,632.00
FRANKLIN RESOURCES INC	18,005	53.86	969,749.30
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,590	189.11	3,326,444.90
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,045	233.91	1,180,075.95
INVESCO LTD	19,880	39.18	778,898.40
LEGG MASON INC	4,518	58.44	264,031.92
LEUCADIA NATIONAL CORP	13,700	23.95	328,115.00
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	11,970	104.88	1,255,413.60
MOODY'S CORPORATION	8,386	97.10	814,280.60
MORGAN STANLEY	65,444	36.33	2,377,580.52
NAVIENT CORP	18,356	21.66	397,590.96
NORTHERN TRUST CORP	10,305	69.63	717,537.15
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,815	56.13	326,395.95
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,011	29.28	1,522,882.08
SEI INVESTMENTS CO COM	6,200	42.80	265,360.00
STATE STREET CORP	18,790	76.54	1,438,186.60
SYNCHRONY FINANCIAL	7,896	31.88	251,724.48
T ROWE PRICE GROUP INC	11,664	82.97	967,762.08
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	12,500	35.92	449,000.00
THE NASDAQ OMX GROUP	5,100	50.30	256,530.00
VOYA FINANCIAL INC	6,785	43.42	294,604.70
ACE LTD	14,941	113.92	1,702,078.72
AFLAC	20,068	61.78	1,239,801.04
ALLEGHANY CORP	748	478.37	357,820.76
ALLSTATE CORP	19,225	71.17	1,368,243.25
AMERICAN INT'L GROUP	63,475	54.98	3,489,855.50
AON PLC	12,255	100.28	1,228,931.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,900	60.16	354,944.00
ASSURANT INC	3,400	60.83	206,822.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,300	52.07	223,901.00
CHUBB CORP	10,670	100.96	1,077,243.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,764	52.35	354,095.40
EVEREST RE GROUP LTD	2,100	178.97	375,837.00

FNF GROUP	11,402	37.36	425,978.72	
GENWORTH FINACIAL INC-CL A	24,773	8.09	200,413.57	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	19,809	41.43	820,686.87	
LINCOLN NATIONAL CORP	12,015	58.16	698,792.40	
LOEWS CORP	15,105	42.38	640,149.90	
MARSH & MCLENNAN COS	24,093	57.09	1,375,469.37	
METLIFE INC	42,457	51.10	2,169,552.70	
PARTNERRE LTD	1,900	118.50	225,150.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,500	51.60	696,600.00	
PROGRESSIVE CORP	25,788	26.71	688,797.48	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,320	80.30	1,631,696.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,000	102.30	204,600.00	
TORCHMARK CORP	5,650	53.83	304,139.50	
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	15,035	107.99	1,623,629.65	
UNUM GROUP	11,632	34.02	395,720.64	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	7,700	47.74	367,598.00	
WR BERKLEY CORP	5,110	50.12	256,113.20	
XL GROUP PLC	11,600	35.28	409,248.00	
CBRE GROUP INC	13,684	34.56	472,919.04	
REALOGY HOLDINGS CORP	6,391	47.24	301,910.84	
ACCENTURE PLC-CL A	28,015	90.27	2,528,914.05	
ACTIVISION BLIZZARD INC	22,000	23.31	512,930.00	
ADOBE SYSTEMS	20,988	77.73	1,631,397.24	
AKAMA I TECHNOLOGIES	8,200	71.56	586,792.00	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,700	281.93	761,211.00	
ANSYS INC	4,000	86.63	346,520.00	
AUTODESK INC	10,400	61.46	639,184.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	21,303	87.73	1,868,912.19	
CA INC	14,625	32.52	475,605.00	
CITRIX SYSTEMS INC	7,167	64.29	460,766.43	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	27,000	62.00	1,674,000.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	6,333	66.89	423,614.37	
EBAY INC	49,628	57.65	2,861,054.20	
ELECTRONIC ARTS	14,424	57.14	824,187.36	
EQUINIX INC	2,466	229.41	565,725.06	
FACEBOOK INC-A	87,880	79.42	6,979,429.60	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	12,630	67.69	854,924.70	
FIREEYE INC	2,799	44.27	123,911.73	
FISERV INC	11,016	79.05	870,814.80	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,381	154.13	521,113.53	
GOOGLE INC-CL A	12,650	546.45	6,912,592.50	
GOOGLE INC-CL C-W/I	12,757	542.87	6,925,392.59	
IBM CORP	42,161	163.89	6,909,766.29	
INTUIT CORP	11,936	91.11	1,087,488.96	
LINKEDIN CORP - A	4,768	266.34	1,269,909.12	
MASTERCARD INC-CLASS A	44,600	89.20	3,978,320.00	
MICROSOFT CORP	348,583	43.50	15,163,360.50	
NETSUITE INC	1,723	99.87	172,076.01	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	13,000	14.05	182,650.00	
ORACLE CORP	158,623	44.11	6,996,860.53	
PAYCHEX INC	15,051	49.22	740,885.47	
RACKSPACE HOSTING INC	5,900	49.06	289,454.00	
RED HAT INC	8,300	69.47	576,601.00	
SALESFORCE COM INC COM	26,100	62.81	1,639,341.00	
SERVICENOW INC	5,984	78.16	467,709.44	
SYMANTEC CORP	30,500	25.59	780,647.50	
SYNOPSIS INC	7,515	46.53	349,672.95	
TERADATA CORP	6,800	45.17	307,156.00	

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,916	37.52	297,008.32
TWITTER INC	16,947	48.70	825,318.90
VANTIV INC CL A	6,987	38.46	268,720.02
VERISIGN INC	5,711	63.52	362,762.72
VISA INC-CLASS A SHARES	22,040	269.10	5,930,964.00
VMWARE INC	3,700	84.68	313,316.00
WESTERN UNION CO	24,215	19.27	466,623.05
WORKDAY INC CLASS A	4,172	91.87	383,281.64
XEROX CORP	50,433	13.75	693,453.75
YAHOO! INC	41,988	44.37	1,863,007.56
AMPHENOL CORP-CL A	13,900	56.22	781,458.00
APPLE INC	266,656	128.45	34,251,963.20
ARROW ELECTRONICS INC	4,800	62.11	298,128.00
AVNET	6,000	45.56	273,360.00
CISCO SYSTEMS	228,009	29.31	6,682,943.79
CORNING	57,188	24.65	1,409,684.20
EMC CORP	90,160	28.72	2,589,395.20
FLEXTRONICS INTL LTD	28,045	12.07	338,503.15
FLIR SYSTEMS INC	6,800	31.86	216,648.00
FS NETWORKS INC	3,400	118.32	402,288.00
HARRIS CORP	5,000	78.72	393,600.00
HEWLETT-PACKARD CO	83,222	38.38	3,194,060.36
JUNIPER NETWORKS INC	17,808	24.00	427,392.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,343	69.03	713,977.29
NETAPP INC	14,648	37.84	554,353.56
PALO ALTO NETWORKS INC	2,940	137.91	405,455.40
QUALCOMM	74,592	70.98	5,294,540.16
SANDISK CORP	9,900	82.41	815,859.00
SEAGATE TECHNOLOGY	14,500	61.46	891,170.00
TE CONNECTIVITY LTD	18,141	71.00	1,288,011.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	11,300	26.40	298,320.00
WESTERN DIGITAL CORP	9,800	109.84	1,076,432.00
AT & T INC	230,816	34.09	7,868,517.44
CENTURYLINK INC	25,249	37.59	949,109.91
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	43,629	8.19	357,321.51
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	13,100	52.86	692,466.00
SBA COMMUNICATIONS COR	5,900	121.02	714,018.00
SPRINT CORP W/I	37,012	4.88	180,618.56
T MOBILE US INC	11,608	31.85	369,714.80
VERIZON COMMUNICATIONS	184,519	48.91	9,024,824.29
WINDSTREAM HOLDINGS INC	26,000	8.67	225,420.00
AES CORPORATION	30,100	11.85	356,685.00
ALLIANT ENERGY CORP	5,000	64.55	322,750.00
AMEREN CORPORATION	10,677	42.51	453,879.27
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,656	58.41	1,264,926.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,900	53.80	425,020.00
CALPINE CORP	15,600	21.78	339,768.00
CENTERPOINT ENERGY INC	17,948	21.61	387,856.28
CMS ENERGY CORP	12,100	35.46	429,066.00
CONSOLIDATED EDISON	12,982	64.80	841,233.60
DOMINION RESOURCES INC/VA	25,864	73.79	1,908,504.56
DTE ENERGY	7,766	83.40	647,684.40
DUKE ENERGY CORP	31,405	79.17	2,486,333.85
EDISON INTERNATIONAL	13,725	64.39	883,752.75
ENTERGY CORP	8,220	79.76	655,627.20
EXELON CORP	38,109	33.42	1,273,602.78
FIRSTENERGY CORP	18,516	36.23	670,834.68
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	3,800	76.71	291,498.00
MDU RES GROUP INC	8,700	22.64	196,968.00

NEXTERA ENERGY INC	19,390	105.43	2,044,287.70		
NISOURCE INC	13,847	43.47	601,929.09		
NRG ENERGY INC COM NEW	14,800	25.34	375,032.00		
OGE ENERGY CORP	8,712	33.92	295,511.04		
PEPCO HOLDINGS INC	11,395	27.29	310,969.55		
PG&E CORP	20,934	55.05	1,152,416.70		
PINNACLE WEST CAPITAL	4,800	65.83	315,984.00		
PPL CORPORATION	29,434	35.16	1,034,899.44		
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	22,346	40.28	900,096.88		
SCANA CORP	5,900	58.27	343,793.00		
SEMPRA ENERGY	10,313	109.20	1,126,179.60		
SOUTHERN CO	39,824	46.19	1,839,470.56		
WISCONSIN ENERGY CORP	9,900	51.47	509,553.00		
XCEL ENERGY INC	22,378	36.22	810,531.16		
ALTERA CORPORATION	13,575	35.79	485,849.25		
ANALOG DEVICES	13,829	58.65	811,070.85		
APPLIED MATERIALS	54,047	24.93	1,347,391.71		
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	11,200	110.90	1,242,080.00		
BROADCOM CORP	23,920	44.90	1,074,008.00		
CREE INC	5,700	38.26	218,082.00		
INTEL CORP	220,387	34.21	7,539,439.27		
KLA-TENCOR CORPORATION	7,548	64.66	488,053.68		
LAM RESEARCH CORP	7,100	83.07	589,797.00		
LINEAR TECHNOLOGY CORP	10,949	47.87	524,183.37		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	16.40	296,840.00		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,400	34.52	428,048.00		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,760	50.53	442,642.80		
MICRON TECHNOLOGY	47,530	31.81	1,511,929.30		
NVIDIA CORP	23,800	22.17	527,765.00		
QORVO INC	6,825	65.30	445,672.50		
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	8,351	83.05	693,592.30		
TEXAS INSTRUMENTS	47,433	58.04	2,753,011.32		
XILINX INC	11,810	41.61	491,414.10		
アメリカ・ドル 小計	14,120,431		854,640,331.86 (101,787,663,524)		
カナダ・ドル	ALTAGAS LTD	5,713	45.81	261,712.53	
	ARC RESOURCES LTD	13,724	24.44	335,414.56	
	BAYTEX ENERGY CORP	7,994	22.55	180,264.70	
	CAMECO CORP	18,922	19.91	376,737.02	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	48,376	38.04	1,840,223.04	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	23,700	11.15	264,255.00	
	CENOVUS ENERGY INC	33,348	22.11	737,324.28	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	18,510	30.77	569,552.70	
	ENBRIDGE INC	37,604	61.64	2,317,910.56	
	ENCANA CORP	32,545	17.01	553,590.45	
	ENERPLUS CORP	10,918	13.49	147,283.82	
	HUSKY ENERGY INC	15,013	28.39	426,219.07	
	IMPERIAL OIL LTD	13,612	49.65	675,835.80	
	INTER PIPELINE LTD	14,787	34.05	503,497.35	
	KEYERA CORP	4,071	81.37	331,257.27	
	MEG ENERGY CORP	8,000	22.46	179,680.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,300	4.16	71,968.00	
	PARAMOUNT RESOURCES LTD.	2,627	33.29	87,452.83	
	PEMBINA PIPELINE CORP	15,007	39.86	598,179.02	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	25,142	2.94	73,917.48	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,864	35.58	244,221.12		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,117	30.10	184,121.70		

SUNCOR ENERGY INC	65,028	38.47	2,501,627.16	
TALISMAN ENERGY INC	46,384	9.62	446,214.08	
TOURMALINE OIL CORP	7,700	40.84	314,468.00	
TRANSCANADA CORP	31,430	56.16	1,765,108.80	
VERMILION ENERGY TRUST	4,600	57.16	262,936.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	9,955	38.59	384,163.45	
AGRIUM INC	6,339	135.72	860,329.08	
BARRICK GOLD CORP	51,376	16.03	823,557.28	
ELDORADO GOLD CORPORATION	30,800	6.26	192,808.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,228	13.93	365,356.04	
FRANCO NEV CORP	6,800	62.99	428,332.00	
GOLDCORP INC	35,987	26.65	959,053.55	
KINROSS GOLD CORP	53,262	3.44	183,221.28	
METHANEX CORP	4,481	64.89	290,772.09	
NEW GOLD INC	26,400	4.48	118,272.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	36,730	46.47	1,706,843.10	
SILVER WHEATON CORCOM NPV	16,300	27.12	442,056.00	
TECK RESOURCES LTD	24,708	19.53	482,547.24	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	33,539	3.88	130,131.32	
YAMANA GOLD INC	42,813	4.91	210,211.83	
BOMBARDIER INC.	69,741	2.45	170,865.45	
CAE Inc.	12,550	15.49	194,399.50	
FINNING INTERNATIONAL INC	8,102	23.04	186,670.08	
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,613	40.63	268,686.19	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,400	87.67	3,191,188.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,650	237.15	1,814,197.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,372	129.95	1,217,891.40	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,100	73.31	373,881.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,233	50.98	419,718.34	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,356	29.62	514,084.72	
THOMSON CORP	15,965	48.79	778,932.35	
CANADIAN TIRE CORP.	3,431	119.10	408,632.10	
DOLLARAMA INC	5,992	61.96	371,264.32	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	18,400	47.52	874,368.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,600	91.39	237,614.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	10,479	64.09	671,599.11	
METRO INC	11,700	35.10	410,670.00	
WESTON (GEORGE)	2,436	104.02	253,392.72	
SAPUTO INC	11,100	35.93	398,823.00	
CATAMARAN CORP	9,154	64.74	592,629.96	
VALENT PHARMACEUTICALS INTE	14,204	211.36	3,002,157.44	
BANK MONTREAL	28,683	78.48	2,251,041.84	
BANK OF NOVA SCOTIA	54,115	66.36	3,591,071.40	
CANADIAN IMPERIAL BANK	17,643	93.53	1,650,149.79	
NATIONAL BANK OF CANADA	15,046	47.79	719,048.34	
ROYAL BANK OF CANADA	64,146	77.23	4,953,995.58	
TRONTO-DOMINION BANK	81,900	54.45	4,459,455.00	
CI FINANCIAL CORP	9,853	34.81	342,982.93	
IGM FINANCIAL INC	4,733	43.60	206,358.80	
ONEX CORPORATION	4,309	73.60	317,142.40	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	957	690.00	660,330.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	13,138	35.89	471,522.82	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4,900	42.30	207,270.00	
INTACT FINANCIAL CORP	6,000	89.81	538,860.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	82,413	22.14	1,824,623.82	
POWER CORP OF CANADA	16,988	33.65	571,646.20	

	POWER FINANCIAL CORP	10,858	37.51	407,283.58	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,021	39.34	1,063,006.14	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	24,582	67.42	1,657,318.44	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,141	20.07	103,179.87	
	CGI GROUP INC	9,784	51.80	506,811.20	
	CONSTELLATION SOFTWARE	855	397.00	339,435.00	
	OPEN TEXT CORP	5,500	74.55	410,025.00	
	BLACKBERRY LTD	22,600	12.96	292,896.00	
	BCE INC	12,697	55.34	702,651.98	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	16,642	46.34	771,190.28	
	TELUS CORP	9,232	43.94	405,654.08	
	ATCO LTD -CLASS I	3,514	46.77	164,349.78	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,700	40.95	233,415.00	
	FORTIS INC	10,800	39.41	425,628.00	
	TRANSALTA CORP.	11,810	11.42	134,870.20	
	カナダ・ドル 小計	1,808,892		70,563,505.25 (6,728,935,860)	
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	6,559	36.95	242,355.05	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	48,375	12.75	616,781.25	
	SANTOS	47,096	8.24	388,071.04	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	32,782	36.13	1,184,413.66	
	WORLEYPARSONS LTD	9,546	11.40	108,824.40	
	ALUMINA LTD	118,405	1.86	220,233.30	
	AMCOR	55,460	14.29	792,523.40	
	BHP BILLITON LTD	142,787	32.50	4,640,577.50	
	BORAL LIMITED	36,559	5.98	218,622.82	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	69,110	2.51	173,466.10	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	19,225	7.59	145,917.75	
	INCITEC PIVOT LTD	77,907	3.91	304,616.37	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	21,063	13.95	293,828.85	
	NEWCREST MINING	34,845	14.02	488,526.90	
	ORICA	16,138	19.75	318,725.50	
	RIO TINTO LTD	19,263	63.64	1,225,897.32	
	LEIGHTON HOLDINGS LTD	4,540	21.36	96,974.40	
	ALS LTD	19,530	6.00	117,180.00	
	BRAMBLES LTD	71,882	10.77	774,169.14	
	SEEK LTD	15,602	17.60	274,595.20	
	ASCIANO LTD	42,054	6.49	272,930.46	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,455	5.00	467,275.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	22,105	2.70	59,683.50	
	SYDNEY AIRPORT	51,129	5.14	262,803.06	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	31,243	8.91	278,375.13	
	TRANSURBAN GROUP	83,244	9.28	772,504.32	
	CROWN RESORTS LTD	17,773	15.88	282,235.24	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,483	37.51	93,137.33	
	TABCORP HOLDINGS	33,487	4.90	164,086.30	
	TABCORP HOLDINGS LTD	2,791	4.47	12,475.77	
	TATTS GROUP LTD	67,665	3.78	255,773.70	
	REA GROUP LTD	2,606	48.89	127,407.34	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	24,179	4.20	101,551.80	
METCASH	48,836	1.58	77,160.88		
WESFARMERS LIMITED	49,862	45.18	2,252,765.16		
WOOLWORTHS LIMITED	55,862	33.00	1,843,446.00		
COCA-COLA AMATIL	27,635	10.46	289,062.10		
TREASURY WINE ESTATES LTD	28,484	5.18	147,547.12		
COCHLEAR LIMITED	2,726	91.63	249,783.38		
HEALTHSCOPE LTD.	51,528	2.77	142,732.56		

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,710	62.80	358,588.00	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	18,150	19.28	349,932.00	
	CSL LIMITED	21,046	88.67	1,866,148.82	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	122,546	35.00	4,289,110.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	15,461	14.10	218,000.10	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,189	13.41	270,734.49	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	72,133	91.14	6,574,201.62	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	105,153	37.71	3,965,319.63	
	WESTPAC BANKING	138,261	37.95	5,247,004.95	
	AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	8,403	42.45	356,707.35	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	13,304	71.55	951,901.20	
	AMP LTD	136,003	6.66	905,779.98	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	107,557	6.03	648,568.71	
	MEDIBANK PRIVATE LTD.	124,316	2.56	318,248.96	
	QBE INSURANCE GROUP	61,639	11.70	721,176.30	
	SUNCORP GROUP LTD	56,732	13.93	790,276.76	
	LEND LEASE GROUP	23,929	16.88	403,921.52	
	COMPUTERSHARE LIMITED	20,356	12.26	249,564.56	
	TELSTRA CORP	192,704	6.61	1,273,773.44	
	TPG TELECOM LTD	11,648	7.25	84,448.00	
	AGL ENERGY LIMITED	30,582	15.51	474,326.82	
	APA GROUP	48,596	8.77	426,186.92	
	AUSNET SERVICES	77,077	1.44	110,990.88	
オーストラリア・ドル	小計	3,037,316		51,633,947.11 (4,792,146,631)	
イギリス・ポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	14,410	8.78	126,591.85	
	BG GROUP PLC	151,451	9.51	1,441,056.26	
	BP PLC	819,684	4.45	3,653,331.58	
	PETROFAC	12,271	8.12	99,640.52	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	175,444	21.09	3,700,113.96	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	108,521	21.98	2,385,291.58	
	TULLOW OIL ORD GBP0.10	41,166	3.98	163,923.01	
	ANGLO AMERICAN PLC	61,823	12.23	756,095.29	
	ANTOFAGASTA PLC	18,608	7.48	139,187.84	
	BHP BILLITON PLC	93,782	15.72	1,474,253.04	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,445	27.91	179,879.95	
	FRESNILLO PLC	9,924	8.36	83,014.26	
	GLENCORE PLC	471,254	2.83	1,336,240.71	
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,395	34.37	322,906.15	
	RANDGOLD RESOURCES	3,841	50.25	193,010.25	
	REXAM PLC	31,760	5.69	180,873.20	
	RIO TINTO PLC REG	56,537	32.20	1,820,491.40	
	ASHTREAD GROUP PLC	22,011	11.28	248,284.08	
	BAE SYSTEMS PLC	139,722	5.25	734,239.11	
	BUNZL PLC	15,300	19.14	292,842.00	
	COBHAM PLC	51,512	3.41	175,655.92	
	IMI PLC	12,877	14.17	182,467.09	
	MEGGITT PLC	35,041	5.68	199,032.88	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	46,140	2.91	134,544.24	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	83,541	9.62	803,664.42	
	SMITHS GROUP PLC	17,162	11.86	203,541.32	
TRAVIS PERKINS PLC	11,240	20.12	226,148.80		
WEIR GROUP PLC/THE	9,243	18.62	172,104.66		
WOLSELEY PLC	11,759	39.75	467,420.25		
AGGREKO PLC	11,123	16.76	186,421.48		



BABCOCK INTL GROUP PLC	12,382	9.96	123,324.72
CAPITA PLC	29,048	11.61	337,247.28
EXPERIAN PLC	43,754	11.92	521,547.68
G4S PLC	70,558	2.82	199,538.02
INTERTEK GROUP PLC	7,696	25.24	194,247.04
EASYJET PLC	7,453	17.85	133,036.05
ROYAL MAIL PLC	29,110	4.28	124,707.24
GKN PLC	71,935	3.80	273,496.87
BURBERRY GROUP PLC	19,520	19.02	371,270.40
PERSIMMON PLC	13,939	17.09	238,217.51
CARNIVAL PLC	8,041	29.42	236,566.22
COMPASS GROUP PLC	74,340	11.27	837,811.80
INTERCONTINENTAL HOTELS	10,804	25.48	275,285.92
MERLIN ENTERTAINMENTS	23,482	4.11	96,651.91
TUI AG	19,387	11.71	227,021.77
WHITBREAD PLC	8,342	50.25	419,185.50
WILLIAM HILL PLC	42,152	3.90	164,772.16
BRITISH SKY BROADCASTING	45,518	9.56	435,152.08
ITV PLC	176,011	2.33	410,809.67
PEARSON	36,177	13.98	505,754.46
REED ELSEVIER PLC	50,492	11.78	594,795.76
WPP PLC	58,385	15.06	879,278.10
DIXONS CARPHONE PLC	46,718	4.41	206,306.68
KINGFISHER PLC	104,203	3.47	362,522.23
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,902	4.97	357,568.64
NEXT PLC	6,770	73.70	498,949.00
SPORTS DIRECT INTERNATIO	12,643	6.91	87,426.34
MORRISON SUPERMARKETS	91,346	1.87	170,908.36
SAINSBURY (J) PLC	58,994	2.69	158,752.85
TESCO	359,939	2.39	863,673.63
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,723	30.57	480,652.11
BRITISH AMERICAN TOBACCO	82,921	36.60	3,035,323.20
COCA COLA HBC AG CDI	10,153	11.25	114,221.25
DIAGEO	111,693	18.84	2,104,296.12
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	42,491	30.87	1,311,697.17
SABMILLER PLC	42,956	35.85	1,539,972.60
TATE & LYLE	22,098	5.85	129,273.30
UNILEVER PLC	57,018	28.05	1,599,354.90
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,870	57.05	1,647,033.50
SMITH&NEOHEW PLC	39,407	11.86	467,367.02
ASTRAZENECA PLC	56,154	44.27	2,486,218.35
GLAXOSMITHKLINE PLC	215,744	15.26	3,293,332.16
SHIRE PLC	26,172	51.35	1,343,932.20
BARCLAYS PLC	729,732	2.60	1,900,222.12
HSBC HOLDINGS PLC	852,368	6.01	5,130,402.99
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,537,886	0.77	1,960,009.35
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	111,475	3.95	441,329.52
STANDARD CHARTERED PLC	109,569	9.66	1,059,313.09
3I GROUP PLC	46,407	4.78	222,011.08
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	39,948	4.60	183,960.54
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,112	10.53	106,479.36
ICAP PLC	23,582	5.16	121,683.12
INVESTEC PLC	26,509	5.80	153,752.20
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	9,857	24.54	241,890.78
SCHRODERS PLC	5,922	30.01	177,719.22
ADMIRAL GROUP PLC	9,290	14.60	135,634.00
AVIVA PLC	130,476	5.48	715,660.86

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	65,379	3.23	211,631.82	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	64,754	4.17	270,542.21	
	LEGAL & GENERAL GROUP	262,813	2.72	716,953.86	
	OLD MUTUAL PLC	216,303	2.18	472,405.75	
	PRUDENTIAL PLC	114,053	16.04	1,829,980.38	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	46,159	4.52	208,638.68	
	STANDARD LIFE PLC	105,439	4.08	430,718.31	
	SAGE GROUP PLC/THE	47,390	4.72	223,680.80	
	BT GROUP PLC	361,584	4.36	1,579,760.49	
	INMARSAT PLC	20,170	8.89	179,311.30	
	VODAFONE GROUP PLC	1,178,715	2.28	2,692,185.06	
	CENTRICA PLC	221,936	2.57	570,597.45	
	NATIONAL GRID PLC	167,528	8.91	1,492,842.00	
	SEVERN TRENT PLC	10,913	20.33	221,861.29	
	SSE PLC	43,142	15.35	662,229.70	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,208	9.41	293,823.32	
	ARM HOLDINGS PLC	62,152	10.99	683,050.48	
	イギリス・ボンド 小計	12,578,199		77,231,048.00 (14,188,888,138)	
スイス・フラン	TRANSOCEAN LTD	15,709	16.56	260,141.04	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	391	416.75	162,949.25	
	GIVAUDAN-REG	408	1,821.00	742,968.00	
	HOLCIM LTD-REG	10,104	72.45	732,034.80	
	SIKA AG-BR	94	3,285.00	308,790.00	
	SYNGETA AG	4,121	331.90	1,367,759.90	
	ABB LTD	97,626	20.20	1,972,045.20	
	GEBERIT AG-REG	1,738	328.90	571,628.20	
	SCHINDLER HLDG AG	946	148.40	140,386.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,944	151.50	294,516.00	
	SULZER	1,048	117.50	123,140.00	
	ADECCO SA-REG	7,486	75.40	564,444.40	
	SGS S.A.	240	1,887.00	452,880.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,460	134.50	330,870.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	23,177	84.35	1,954,979.95	
	THE SWATCH GROUP	2,431	83.00	201,773.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,420	430.60	611,452.00	
	ARYZTA AG	3,798	72.85	276,684.30	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	109	973.00	106,057.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	41	5,140.00	210,740.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	60,345.00	241,380.00	
	NESTLE SA-REG	143,577	72.00	10,337,544.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,346	128.70	301,930.20	
	ACTELION CHFO.50 (REGD)	4,718	110.00	518,980.00	
	LOMZA AG-REG	2,398	113.10	271,213.80	
	NOVARTIS AG-REG SHS	102,409	97.25	9,959,275.25	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	31,276	255.60	7,994,145.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	67,719	23.12	1,565,663.28	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,257	44.83	459,821.31	
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1,347	71.25	95,973.75	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	838	279.75	234,430.50	
UBS GROUP AG	162,294	16.47	2,672,982.18		
BALOISE HOLDING AG REG	2,266	122.40	277,358.40		
SWISS LIFE HOLDING AG	1,462	228.10	333,482.20		
SWISS RE LTD	15,615	85.40	1,333,521.00		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,638	309.00	2,051,142.00		
SWISS PRIME SITE REG	2,485	85.45	212,343.25		
SWISSCOM	1,072	532.50	570,840.00		

スイス・フラン 小計		734,012		50,818,266.16 (6,378,200,586)
香港・ドル	HUTCHISON WHAMPOA	94,200	104.70	9,862,740.00
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	63,500	14.80	939,800.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	56,000	17.18	962,080.00
	MTR CORP	62,982	34.85	2,194,922.70
	LI & FUNG LTD	254,400	7.79	1,981,776.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	66,000	25.85	1,706,100.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	34,000	29.60	1,006,400.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	107,000	43.45	4,649,150.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	46,800	19.48	911,664.00
	SANDS CHINA LTD	111,321	39.75	4,425,009.75
	SHANGRI-LA ASIA	64,000	10.38	664,320.00
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	11.96	1,136,200.00
	WYNN MACAU LTD	75,361	23.95	1,804,895.95
	WH GROUP LIMITED	167,500	4.42	740,350.00
	BANK EAST ASIA	60,840	31.85	1,937,754.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	170,000	27.20	4,624,000.00
	HANG SENG BANK	33,700	144.70	4,876,390.00
	FIRST PACIFIC CO	111,000	8.01	889,110.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	49,100	177.10	8,695,610.00
	AIA GROUP LTD	535,400	44.50	23,825,300.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS	62,000	152.00	9,424,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	22.25	2,158,250.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	47,647	55.15	2,627,732.05
	HYSAN DEVELOPMENT	31,000	38.50	1,193,500.00
	KERRY PROPERTIES LTD	28,500	26.05	742,425.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	226,192	9.27	2,096,799.84
	SINO LAND	143,200	12.68	1,815,776.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	72,000	123.40	8,884,800.00
	SWIRE PACIFIC A	29,000	105.80	3,068,200.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	56,051	25.25	1,415,287.75
WHARF HOLDINGS	67,125	59.80	4,014,075.00	
WHEELOCK & CO LTD	43,000	42.80	1,840,400.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	118,000	10.02	1,182,360.00	
PCCW LIMITED	188,000	5.02	943,760.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	29,000	63.60	1,844,400.00	
CLP HOLDINGS	83,500	68.15	5,690,525.00	
HONGKONG CHINA GAS	277,698	17.50	4,859,715.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	61,000	78.35	4,779,350.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,000	76.25	762,500.00	
香港・ドル 小計		3,928,017		137,177,428.04 (2,105,673,520)
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	8.77	613,023.00
	NOBLE GROUP LTD	213,833	1.07	228,801.31
	SEMBCORP INDUSTRIES	48,560	4.24	205,894.40
	SEMBCORP MARINE LTD	37,200	3.02	112,344.00
	SINGAPORE TECH ENGR.	67,000	3.45	231,150.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	86,000	1.24	106,640.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	100,000	2.87	287,000.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	23,800	12.26	291,788.00
	GENTING SINGAPORE PLC	296,000	1.05	310,800.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINDS	78,000	4.12	321,360.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,000	42.75	213,750.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	332,960	0.42	141,508.00
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	91,000	3.29	299,390.00
	DBS GROUP HOLDING	75,989	19.45	1,477,986.05

	OVERSEA-CHINESE BANKING	128,443	10.51	1,349,935.93	
	UNITED OVERSEAS BANK	56,824	22.97	1,305,247.28	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	8.25	288,750.00	
	CAPITALAND LIMITED	112,000	3.68	412,160.00	
	CITY DEVELOPMENTS	19,000	10.28	195,320.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES	151,000	2.51	379,010.00	
	KEPPEL LAND LIMITED	38,000	4.55	172,900.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,405	7.72	165,246.60	
	SINGAPORE TELECOM	353,060	4.28	1,511,096.80	
	STARHUB LTD	24,000	4.33	103,920.00	
シンガポール・ドル 小計		2,463,974		10,725,021.37 (939,940,873)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	36,377	8.33	303,020.41	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	44,973	4.38	197,206.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,783	7.99	150,076.17	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	86,496	3.15	272,462.40	
	CONTACT ENERGY LIMITED	16,243	6.20	100,706.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD.	56,024	2.04	114,569.08	
	MIGHTY RIVER POWER LTD.	31,153	3.39	105,608.67	
ニュージーランド・ドル 小計		290,049		1,243,649.93 (111,406,161)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	10,991	122.70	1,348,595.70	
	BOLIDEN AB	12,926	163.30	2,110,815.80	
	ALFA LAVAL AB	14,263	161.60	2,304,900.80	
	ASSA ABLOY AB-B	14,760	489.90	7,230,924.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,678	270.40	8,024,931.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	17,125	249.10	4,265,837.50	
	SANDVIK AB	46,768	93.25	4,361,116.00	
	SKANSKA AB-B	17,347	206.00	3,573,482.00	
	SKF AB-B SHARES	17,342	206.00	3,572,452.00	
	VOLVO AB-B SHS	67,779	98.55	6,679,620.45	
	SECURITAS B	13,372	118.00	1,577,896.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	10,952	277.00	3,033,704.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,029	67.25	1,212,450.25	
	HENNES & MAURITZ B	42,135	358.10	15,088,543.50	
	ICA GRUPPEN AB	3,600	291.10	1,047,960.00	
	SWEDISH MATCH	9,111	255.90	2,331,504.90	
	SCA SV CELLULOSA AB-B SHS	27,025	198.40	5,361,760.00	
	ELEKTA AB-B SHS	17,304	87.00	1,505,448.00	
	GETINGE AB-B SHS	8,999	214.80	1,932,985.20	
	NORDEA BANK AB	134,727	110.20	14,846,915.40	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	67,114	101.40	6,805,359.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	22,087	399.00	8,812,713.00	
	SWEDBANK AB	40,051	211.00	8,450,761.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,176	155.30	1,269,732.80	
	INVESTOR AB SER B NPV	20,098	319.90	6,429,350.20	
	KINNEVIK INV AB	10,259	283.80	2,911,504.20	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	135,028	109.30	14,758,560.40	
	HEXAGON AB B SHS	11,152	303.40	3,383,516.80	
	MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 US D1.5	3,206	584.50	1,873,907.00	
	TELE2 AB-B SHS	15,324	96.70	1,481,830.80	
TELIASONERA	105,058	52.30	5,494,533.40		
スウェーデン・クローナ 小計		971,786		153,083,611.90 (2,164,602,272)	

ノルウェー・クローネ	ACERGY SA	12,338	77.00	950,026.00
	SEADRILL LTD	18,366	93.10	1,709,874.60
	STATOIL ASA	49,340	141.80	6,996,412.00
	NORSK HYDRO	58,691	45.19	2,652,246.29
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,191	430.40	3,525,406.40
	ORKLA ASA	38,925	59.95	2,333,553.75
	DNB ASA	45,012	124.70	5,612,996.40
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,500	132.00	1,122,000.00
	TELENOR ASA	33,140	154.40	5,116,816.00
ノルウェー・クローネ	小計	272,503		30,019,331.44 (471,303,503)
デンマーク・クローネ	NOVOZYMES A/S B SHARES	10,519	319.40	3,359,768.60
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,803	276.00	2,705,628.00
	ISS A/C	4,279	207.00	885,753.00
	"DSV, DE SAMMENSLUT VOGN"	8,411	209.90	1,765,468.90
	A P MOLLER MAERSK A/S	315	14,100.00	4,441,500.00
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	168	13,650.00	2,293,200.00
	PANDORA A/S	5,281	560.50	2,960,000.50
	CARLSBERG B	4,677	539.50	2,523,241.50
	COLOPLAST B	4,868	510.00	2,482,680.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	958	495.00	474,210.00
	NOVO NORDISK A/S-B	89,260	297.30	26,536,998.00
	DANSKE BANK A/S	28,950	172.40	4,990,980.00
	TRYG A/S	994	826.00	821,044.00
TDC A/S	35,300	49.35	1,742,055.00	
デンマーク・クローネ	小計	203,783		57,982,527.50 (1,054,122,350)
イスラエル・シェケル	DELEK GROUP LTD	283	968.00	273,944.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,712	27.50	569,580.00
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	147	1,330.00	195,510.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	38,060	217.70	8,285,662.00
	BANK HAPOLIM BM	45,583	17.78	810,465.74
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,630	13.56	808,582.80
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,788	41.78	241,822.64
	NICE SYSTEMS LTD	2,697	220.90	595,767.30
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	93,060	6.68	621,733.86
イスラエル・シェケル	小計	265,960		12,403,068.34 (384,247,057)
ユーロ	ENI SPA	112,940	16.25	1,835,275.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,690	10.38	194,095.65
	NESTE OIL OYJ	6,047	22.53	136,238.91
	OMV AG	6,306	23.82	150,208.92
	REPSOL SA	46,073	16.95	780,937.35
	SAIPEM EUR1	13,499	9.28	125,338.21
	TECHNIP SA	4,638	58.90	273,178.20
	TENARIS SA	20,564	12.91	265,481.24
	TOTAL SA	95,230	45.98	4,378,675.40
	VOPAK	3,294	49.13	161,834.22
	AIR LIQUIDE	15,296	115.50	1,766,688.00
	AKZO NOBEL	10,714	65.59	702,731.26
	ARCELORMITTAL	43,850	9.67	424,336.45
	ARKEMA	3,189	66.06	210,665.34
	BASF SE	40,841	82.71	3,377,959.11
	CRH	32,660	24.85	811,601.00
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,216	39.59	127,321.44
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,184	70.73	437,394.32
	IMERYS SA	1,606	67.42	108,276.52
	K&S AG	7,454	28.85	215,047.90
KONINKLIJKE DSM N.V	7,908	47.93	379,069.98	

LAFARGE (FRANCE)	8,587	65.95	566,312.65	
LANXESS AG	3,918	44.95	176,114.10	
LINDE	8,239	176.30	1,452,535.70	
SOLVAY	2,590	124.60	322,714.00	
STORA ENSO OYJ-R SHS	26,024	8.52	221,724.48	
SYMRISE AG	5,387	55.40	298,439.80	
THYSSENKRUPP AG	20,790	23.00	478,170.00	
UMICORE	5,256	36.88	193,867.56	
UPM-KYMMENE	23,312	16.63	387,678.56	
VOESTALPINE AG	5,300	34.52	182,982.50	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,619	33.73	256,988.87	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC Y SERV-RTS	7,619	0.47	3,642.79	
AIRBUS GROUP NV	26,077	51.99	1,355,743.23	
ALSTOM-NEW	9,437	28.68	270,653.16	
ANDRITZ AG	3,120	51.94	162,052.80	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	3,875	41.94	162,517.50	
BOUYGUES SA	8,005	34.89	279,294.45	
BRENTAG AG	6,757	51.72	349,472.04	
CIE DE SAINT-GOBAIN	20,082	41.26	828,583.32	
CNH INDUSTRIAL NV	43,155	7.64	329,919.97	
FERROVIAL SA	19,023	18.47	351,449.92	
FINMECCANICA SPA	19,937	10.30	205,351.10	
GEA GROUP AG NPV	7,992	43.28	345,933.72	
KONE OYJ	13,792	40.18	554,162.56	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	42,392	25.70	1,089,686.36	
LEGRAND PROMESSES EUR4	12,183	48.15	586,672.36	
MAN SE	1,693	95.44	161,579.92	
METSO OYJ	5,434	28.35	154,053.90	
OCI NV	3,727	31.84	118,686.31	
OSRAM LICHT AG	3,817	41.21	157,317.65	
PRYSMIAN SPA EURO.10	9,547	17.63	168,313.61	
REXEL SA	13,211	16.41	216,858.56	
SAFRAN SA	11,972	61.20	732,686.40	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,311	71.42	1,664,871.62	
SIEMENS AG	35,265	97.48	3,437,632.20	
THALES SA	4,492	51.56	231,607.52	
VALLOUREC	5,151	22.49	115,871.74	
VINCI SA	21,673	52.68	1,141,733.64	
WARTSILA OYJ	6,439	41.04	264,256.56	
ZARDOYA OTIS	6,992	10.90	76,212.80	
ZODIAC AEROSPACE	8,082	31.21	252,239.22	
BIC	1,340	130.45	174,803.00	
BUREAU VERITAS	10,721	19.92	213,562.32	
EDENRED	9,808	24.49	240,197.92	
RANDSTAD HOLDING NV	6,001	51.44	308,691.44	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	17,677	17.53	309,966.19	
ADP	1,341	107.00	143,487.00	
ATLANTIA SPA	18,910	23.00	434,930.00	
BOLLORE	25,700	4.84	124,439.40	
DEUTSCHE POST AG-REG	42,907	29.21	1,253,313.47	
FRAPORT AG NPV	1,722	54.40	93,676.80	
GROUPE EUROTUNNEL SE-REGR	20,314	11.97	243,158.58	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	46,432	7.65	355,204.80	
LUFTHANSA	10,821	13.88	150,249.58	
TNT EXPRESS NV - W/I	21,499	5.50	118,394.99	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	14,689	109.45	1,607,711.05	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	2,336	83.88	195,943.68	

CONTINENTAL	4,871	213.95	1,042,150.45	
DAIMLER AG	42,818	84.08	3,600,137.44	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	40,151	13.35	536,015.85	
MICHELIN B	8,236	85.14	701,213.04	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,789	26.32	126,046.48	
PEUGEOT SA	17,661	14.23	251,316.03	
PIRELLI & C.	10,122	13.45	136,140.90	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	7,039	81.46	573,396.94	
RENAULT SA	8,474	84.36	714,866.64	
VALEO SA	3,453	134.00	462,702.00	
VOLKSWAGEN STAMM	1,284	217.70	279,526.80	
VOLKSWAGEN VORZUG	7,212	223.15	1,609,357.80	
ADIDAS AG	9,221	67.87	625,829.27	
CHRISTIAN DIOR	2,390	170.50	407,495.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,135	289.30	328,355.50	
HUGO BOSS AG -ORD	1,654	115.60	191,202.40	
KERING	3,341	178.90	597,704.90	
LUXOTTICA GROUP SPA	7,375	53.20	392,350.00	
LVMH	12,399	160.80	1,993,759.20	
ACCOR SA	7,548	47.17	356,039.16	
SODEXO	4,314	88.12	380,149.68	
ALTICE SA	3,939	83.80	330,088.20	
AXEL SPRINGER SE	1,652	57.02	94,197.04	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,342	31.21	229,143.82	
JC DECAUX SA NPV	3,562	33.20	118,276.21	
LAGARDERE	5,230	25.06	131,063.80	
NUMERICABLE-SFR	4,568	52.17	238,312.56	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG REG	10,007	41.45	414,840.18	
PUBLICIS GROUPE	8,211	71.65	588,318.15	
REED ELSEVIER	30,881	22.39	691,425.59	
RTL GROUP	1,727	88.31	152,511.37	
SES	13,349	32.40	432,507.60	
TELENET GROUP HOLDING NV	2,648	51.10	135,312.80	
WOLTERS KLUWER CVA	13,805	28.09	387,782.45	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	48,373	27.58	1,334,127.34	
CARREFOUR	27,623	29.60	817,640.80	
CASINO ORD	2,554	81.49	208,125.46	
COLRUYT NV	3,339	41.85	139,753.84	
DELHAIZE GROUP	4,491	78.49	352,498.59	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,677	6.22	184,769.00	
JERONIMO MARTINS	10,993	10.07	110,699.51	
KONINKLIJKE AHOLD NV	39,481	16.68	658,740.48	
METRO STAMM	7,847	31.00	243,257.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	35,767	108.50	3,880,719.50	
DANONE	25,711	59.15	1,520,805.65	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	4,581	59.43	272,248.83	
HEINEKEN NV	10,172	67.16	683,151.52	
KERRY GROUP A	7,262	62.91	456,852.42	
PERNOD RICARD	9,403	103.90	976,971.70	
REMY COINTREAU	1,030	65.49	67,454.70	
UNILEVER NV CVA	72,407	37.38	2,706,935.69	
BEIERSDORF	4,414	74.68	329,637.52	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	7,877	99.61	784,627.97	
HENKEL KGAA	5,141	89.89	462,124.49	
L'OREAL	11,160	157.10	1,753,236.00	
CELESIO AG	2,182	27.11	59,164.93	

ESSILOR INTERNATIONAL	9,045	100.50	909,022.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	9,579	64.49	617,749.71	
FRESENIUS SE & CO KGaA	16,742	47.77	799,849.05	
BAYER AG	36,794	124.80	4,591,891.20	
GRIFOLS SA	6,755	36.64	247,536.97	
MERCK KGAA	5,940	87.73	521,116.20	
ORION OYJ	4,848	28.14	136,422.72	
QIAGEN N.V.	10,079	21.17	213,372.43	
SANOFI	52,910	87.84	4,647,614.40	
UCB SA	5,549	66.99	371,727.51	
BANCA INTESA SPA	516,198	2.89	1,491,812.22	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA	203,823	0.55	113,529.41	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	266,393	8.79	2,341,860.86	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	1,819,893	0.08	146,865.36	
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192			
BANCO POPOLARE SC	15,655	13.63	213,377.65	
BANCO POPULAR ESPANOL	82,100	3.99	327,907.40	
BANCO SANTANDER SA	625,233	6.45	4,035,253.78	
BANK OF IRELAND	1,206,195	0.32	385,982.40	
BANKIA SA	200,556	1.23	248,087.77	
BANKINTER, S.A.	32,073	6.77	217,166.28	
BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV	156,082	2.38	371,475.16	
BNP PARIBAS	47,071	51.43	2,420,861.53	
CAIXABANK	89,160	4.02	358,423.20	
COMMERZBANK AG	44,524	11.79	525,160.58	
CREDIT AGRICOLE SA	45,386	12.78	580,033.08	
ERSTE GROUP BANK AG	12,156	23.42	284,693.52	
ING GROUP N.V.	171,349	12.59	2,158,140.65	
INTESA SANPAOLO RSP	42,401	2.61	110,921.01	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	11,521	53.35	614,645.35	
NATIXIS	40,646	6.38	259,362.12	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,358	13.30	71,261.40	
SOCIETE GENERALE-A	32,126	40.18	1,290,822.68	
UNICREDIT SPA	194,862	5.81	1,132,148.22	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	37,272	6.88	256,431.36	
DEUTSCHE BANK AG-REG	61,220	28.86	1,767,115.30	
DEUTSCHE BOERSE AG	8,510	70.00	595,700.00	
EURAZEO NPV	1,669	64.50	107,650.50	
EXOR SPA	4,732	39.36	186,251.52	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,513	77.00	270,501.00	
MEDIOBANCA	29,217	8.17	238,848.97	
WENDEL	1,485	106.85	158,672.25	
AEGON NV	83,907	6.63	556,303.41	
AGEAS	10,008	31.74	317,703.96	
ALLIANZ	20,297	146.90	2,981,629.30	
ASSICURAZIONI GENERALI	51,697	18.38	950,190.86	
AXA	80,630	21.25	1,713,387.50	
CNP ASSURANCES	8,159	15.22	124,220.77	
DELTA LLOYD NV	8,974	17.27	155,025.85	
HANNOVER RUECK SE	2,727	83.44	227,540.88	
MAPFRE SA	44,197	3.13	138,336.61	
MUENCHENER RUECK AG-REG	7,671	181.30	1,390,752.30	
NN GROUP NV	5,745	25.15	144,486.75	
SAMPO INSURANCE CO A	19,774	43.98	869,660.52	



SCOR SE	7,415	28.60	212,106.07	
UNIPOLSAI SPA	38,014	2.53	96,403.50	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER	1,724	37.97	65,468.90	
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN SE	10,695	33.94	362,988.30	
DEUTSCHE WOHNEN AG BR	12,480	24.00	299,582.40	
IMMOFINANZ IMMOBILIEN ANLAGE	50,575	2.42	122,391.50	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	18,770	36.04	676,470.80	
ATOS	3,839	64.32	246,924.48	
CAP GEMINI SA	6,560	67.99	446,014.40	
DASSAULT SYSTEMES	5,584	60.04	335,263.36	
GEMALTO	3,783	72.62	274,721.46	
SAP SE	40,942	60.77	2,488,045.34	
UNITED INTERNET	5,845	39.60	231,491.22	
ALCATEL LUCENT	128,819	3.47	447,001.93	
NOKIA	165,973	7.12	1,182,557.62	
BELGACOM SA	6,592	35.19	232,005.44	
DEUTSCHE TELEKOM	141,038	15.65	2,207,244.70	
ELISA CORP-A SHARES	7,031	23.78	167,197.18	
ILIAD SA	1,247	233.65	291,361.55	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	146,753	3.03	445,835.61	
ORANGE S.A.	82,217	15.86	1,303,961.62	
TELECOM ITALIA SPA	463,780	1.02	474,910.72	
TELECOM ITALIA-RNC	260,935	0.84	219,576.80	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	4.63	128,024.13	
TELEFONICA S.A.	187,223	13.27	2,484,449.21	
VIVENDI SA	53,788	21.31	1,146,491.22	
E.ON SE	88,709	13.30	1,180,273.24	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	106,014	3.25	344,545.50	
ELEC DE FRANCE EURO.5	11,008	23.63	260,119.04	
ENAGAS	8,825	26.94	237,789.62	
ENEL GREEN POWER SPA	84,132	1.82	153,877.42	
ENEL SPA	291,729	3.95	1,152,329.55	
FORTUM OYJ	19,482	19.71	383,990.22	
GAS NATURAL SDG-E	15,315	20.51	314,187.22	
GDF SUEZ	64,185	18.68	1,198,975.80	
IBERDROLA SA	228,781	5.93	1,356,671.33	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,743	72.78	345,195.54	
RWE AG	22,563	23.48	529,779.24	
SNAM SPA	92,973	4.29	399,412.00	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	13,426	16.47	221,193.35	
TERNA SPA	68,618	3.94	270,492.15	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,422	16.52	304,331.44	
ASML HOLDING NV	15,864	92.23	1,463,136.72	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,785	10.11	523,546.35	
STMICROELECTRONICS NV	30,160	7.70	232,412.96	
ユーロ 小計	11,725,189		153,757,000.06 (20,807,934,818)	
合計	52,400,111		161,915,065,293 (161,915,065,293)	

(注) 1 . 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2 . 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

#### 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	16,100	352,107.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES INC	39,693	369,144.90	
		AMERICAN TOWER CORP	17,605	1,677,052.30	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	41,600	446,368.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,815	982,909.45	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,750	934,672.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,706	275,578.16	
		CROWN CASTLE INTL CORP	14,800	1,299,292.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,900	390,993.00	
		DUKE REALTY CORP	16,300	346,212.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	15,216	1,180,457.28	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,767	618,562.85	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,000	426,690.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	24,389	707,768.78	
		HCP INC	20,300	872,088.00	
		HEALTH CARE REIT INC	14,395	1,097,186.90	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	33,448	731,507.76	
		IRON MOUNTAIN INC	7,457	289,555.31	
		KIMCO REALTY CORP	18,800	495,192.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,400	245,696.00	
		MACERICH CO/THE	6,200	513,050.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	7,756	332,499.72	
		PROLOGIS INC	22,111	947,456.35	
		PUBLIC STORAGE	6,500	1,292,135.00	
		RAYONIER INC	5,650	152,889.00	
		REALTY INCOME CORP	10,174	522,841.86	
		REGENCY CENTERS CORP	4,000	261,480.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	13,784	2,616,341.04	
		SL GREEN REALTY CORP	4,400	559,548.00	
		UDR INC	11,000	350,130.00	
		VENTAS INC COM	13,600	1,038,224.00	
		VORNADO REALTY TRUST	7,459	829,888.34	
WEYERHAEUSER CO	23,391	822,427.56			
アメリカ・ドル	小計	450,466	23,977,945.06 (2,855,773,256)		
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5,913	139,073.76		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,000	205,450.00		
カナダ・ドル	小計	12,913	344,523.76 (32,853,785)		
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	43,063	329,431.95		
	FEDERATION CENTRES	69,129	199,091.52		
	GOODMAN GROUP	76,375	478,871.25		
	GPT GROUP	73,197	339,634.08		
	MIRVAC GROUP	160,291	333,405.28		
	NOVION PROPERTY GROUP	101,230	249,025.80		
	SCENTRE GROUP	235,006	888,322.68		
	STOCKLAND	102,688	486,741.12		
WESTFIELD CORP	87,067	854,997.94			
オーストラリア・ドル	小計	948,046	4,159,521.62 (386,045,201)		
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	42,489	350,321.80		
	HAMMERSON	36,387	244,702.57		
	INTU PROPERTIES PLC	42,917	156,947.46		
	LAND SECURITIES GROUP	34,859	430,160.06		
	SEGRO PLC	33,353	139,982.54		
イギリス・ポンド	小計	190,005	1,322,114.43 (242,898,863)		
香港・ドル	LINK REIT	102,000	5,115,300.00		

香港・ドル 小計		102,000	5,115,300.00 (78,519,855)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	96,013	236,191.98	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	96,000	171,360.00	
	CAPITAMALL TRUST	113,700	244,455.00	
	SUNTEC REAL ESTAIITE INVESTMENT TRUST	110,000	212,300.00	
シンガポール・ドル 小計		415,713	864,306.98 (75,747,863)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,298	121,687.50	
	GECINA SA	1,359	159,682.50	
	ICADE	1,711	133,988.41	
	KLEPIERRE	7,556	339,982.22	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,343	1,124,185.55	
ユーロ 小計		16,267	1,879,526.18 (254,356,277)	
投資証券 小計			3,926,195,100 (3,926,195,100)	
合計			3,926,195,100 (3,926,195,100)	

- (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 598銘柄	97.3%		63.1%
	投資証券 33銘柄		2.7%	
カナダ・ドル	株式 93銘柄	99.5%		4.1%
	投資証券 2銘柄		0.5%	
オーストラリア・ドル	株式 63銘柄	92.5%		3.1%
	投資証券 9銘柄		7.5%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	98.3%		8.7%
	投資証券 5銘柄		1.7%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	100.0%		3.8%
香港・ドル	株式 39銘柄	96.4%		1.4%
	投資証券 1銘柄		3.6%	
シンガポール・ドル	株式 24銘柄	92.5%		0.6%
	投資証券 4銘柄		7.5%	
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	100.0%		1.3%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
デンマーク・クローネ	株式 14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 233銘柄	98.8%		12.7%
	投資証券 5銘柄		1.2%	

(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。

「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26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		511,623,659	531,385,414
コール・ローン		347,261,627	182,629,528
国債証券		243,222,877,190	218,299,112,645
派生商品評価勘定			140,307
未収利息		2,472,159,611	2,038,791,984
前払費用		100,336,688	81,036,047
流動資産合計		246,654,258,775	221,133,095,925
資産合計		246,654,258,775	221,133,095,925
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		100,000	5,469
未払解約金		350,840,026	130,134,012
流動負債合計		350,940,026	130,139,481
負債合計		350,940,026	130,139,481
純資産の部			
元本等			
元本	1	119,668,724,561	93,621,001,523
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		126,634,594,188	127,381,954,921
元本等合計		246,303,318,749	221,002,956,444
純資産合計		246,303,318,749	221,002,956,444
負債純資産合計		246,654,258,775	221,133,095,925

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

3 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26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
1 期首元本額	147,784,834,580円	119,668,724,561円
期中追加設定元本額	13,690,295,664円	21,752,849,966円
期中一部解約元本額	41,806,405,683円	47,800,573,004円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券イン	5,012,782,889円	5,536,083,723円
デックス・オープン		
ステート・ストリートDCグローバル債	11,218,939円	14,105,595円
券インデックス・オープン		
AMC /ステート・ストリート・リスク	円	214,227,523円
バジェット型バランス・オープン(ステ		
イプル)		
ステート・ストリート海外国債インデッ	552,617,927円	288,643,752円
クス・ファンド 適格機関投資家限定		
ステート・ストリート外国債券インデッ	2,538,509,749円	3,803,950,475円
クス・ファンド/為替ヘッジ付き(年金		
1) <適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート外国債券パッシ	21,298,298,604円	13,433,881,570円
ブ・ファンド<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファン	79,783,568円	48,820,660円
ドVA30A<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファン	9,845,757,198円	6,907,498,028円
ドVA30B<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファン	6,064,555円	308,138円
ドVA40A<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファン	71,498,751円	47,228,497円
ドVA40B<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファン	12,778,034円	8,611,473円
ドVA50A<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート・バランスファン	15,497,090,344円	13,085,050,806円
ドVA50B<適格機関投資家限定>		
ステート・ストリート外国債券インデッ	1,087,407,407円	707,266,542円
クス・ファンドVA1<適格機関投資家限定		
>		
ステート・ストリート・バランスファン	62,336,683円	34,018,550円
ドVA50C<適格機関投資家限定>		

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>	9,563,517,772円	7,877,102,251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>	2,572,123,036円	2,211,370,553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>	89,037,608円	69,961,667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>	953,726,257円	920,331,570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>	3,639,229,182円	3,278,850,278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>	1,471,742,764円	1,559,416,021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>	6,832,661,030円	5,738,637,479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>	1,117,708,559円	730,048,672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>	1,754,294,267円	1,271,117,991円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	4,070,129,446円	284,233,524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>	31,423,250円	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>	143,219,138円	120,490,691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>	97,722,502円	73,674,165円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	265,857,737円	398,062,916円
ステート・ストリート4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	97,068,821円	79,842,636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>	1,170,903,054円	960,695,424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>	14,218,795円	11,957,808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>	9,893,032円	9,050,616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>	102,350円	99,863円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	23,637,467,066円	17,383,491,729円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドA<適格機関投資家限定>	199,179,099円	195,247,770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>	1,866,966,581円	1,576,831,575円
ステート・ストリート世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	3,245,788,662円	2,691,569,394円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドA/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定>	655,851,459円	922,836,213円

ステート・ストリート4資産インデックス スバランスVA50<適格機関投資家限定>	26,531,222円	43,320,766円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付きVA4 <適格機関投資家限定>	66,217,224円	58,399,546円
AMC/ステート・ストリート・リスク バジェット型バランス・ファンド(ステ イブル)年金<適格機関投資家限定>	円	143,671,028円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド (年金)	円	752,455,128円
フレックス資産配分戦略ファンド(年 金)<適格機関投資家限定>	円	128,538,917円
計	119,668,724,561円	93,621,001,523円
2 受益権の総数	119,668,724,561口	93,621,001,523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及び信用リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、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いる為替予約取引があり、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26年 2月20日現在)	(平成27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26年 2月20日現在）	（平成27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	2,062,556,052	11,339,579,671
合計	2,062,556,052	11,339,579,671

（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



## 通貨関連

(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 売建 アメリカ・ドル カナダ・ドル オーストラリア・ドル ユーロ	224,950,000 55,356,000 73,632,000 28,088,000		224,972,000 55,380,000 73,672,000 28,102,000	22,000 24,000 40,000 14,000
	合計	382,026,000		382,126,000	100,000

(単位：円)

区分	種類	(平成27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 売建 マレーシア・リングgit	8,791,650 8,791,650		8,786,181 8,651,343	5,469 140,307
	合計	17,583,300		17,437,524	134,838

(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25年 2月21日 至 平成26年 2月20日	自 平成26年 2月21日 至 平成27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26年 2月20日現在)	(平成27年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	2.0582円	2.3606円
(1万口当たり純資産額)	(20,582円)	(23,606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	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 5.25% 29/02/15	500,000	669,690.00	
		US TREASURY N/B 2.75% 16/11/30	5,000,000	5,190,250.00	
		US TREASURY N/B 4.25% 17/11/15	8,100,000	8,812,557.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 16/02/15	5,000,000	5,207,400.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	1,800,000	2,393,586.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 17/05/15	5,800,000	6,278,500.00	
		US TREASURY N/B 4.875% 16/08/15	3,500,000	3,728,060.00	
		US TREASURY N/B 5.125% 16/05/15	7,000,000	7,409,080.00	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	1,700,000	2,524,500.00	
		US TREASURY N/B 0.375% 16/03/15	9,500,000	9,508,170.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 16/03/31	9,900,000	10,112,652.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 16/04/30	9,000,000	9,243,990.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 16/04/30	7,500,000	7,647,075.00	
		US TREASURY N/B 0.25% 16/05/15	9,500,000	9,486,605.00	
		US TREASURY N/B 3.25% 16/05/31	4,100,000	4,249,896.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 16/05/31	7,000,000	7,123,620.00	
		US TREASURY N/B 0.5% 16/06/15	8,000,000	8,013,120.00	
		US TREASURY N/B 3.25% 16/06/30	7,500,000	7,787,700.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 16/07/15	6,500,000	6,518,265.00	
		US TREASURY N/B 3.0% 16/08/31	7,500,000	7,784,775.00	
		US TREASURY N/B 3.0% 16/09/30	5,500,000	5,718,295.00	
		US TREASURY N/B 1.0% 16/09/30	9,000,000	9,071,010.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 16/11/30	12,000,000	12,058,080.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 16/12/15	12,000,000	12,006,600.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 16/12/31	8,800,000	8,844,000.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 17/01/31	6,000,000	6,287,340.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 17/01/31	6,000,000	6,029,520.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 17/02/28	8,000,000	8,033,120.00	
		US TREASURY N/B 3.25% 17/03/31	6,800,000	7,160,196.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 17/04/30	8,200,000	8,221,156.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 17/05/31	5,500,000	5,479,815.00	
		US TREASURY N/B 0.75% 17/06/30	9,000,000	8,983,800.00	
		US TREASURY N/B 1.875% 17/08/31	7,500,000	7,683,375.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 17/08/31	6,500,000	6,454,825.00	
		US TREASURY N/B 1.875% 17/09/30	9,800,000	10,036,572.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 17/09/30	6,000,000	5,951,700.00	
		US TREASURY N/B 1.875% 17/10/31	6,000,000	6,145,800.00	
		US TREASURY N/B 0.75% 17/12/31	5,500,000	5,458,310.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 18/01/31	6,000,000	6,272,340.00	
		US TREASURY N/B 0.75% 18/03/31	6,200,000	6,132,668.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 18/04/30	5,000,000	5,232,400.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 18/04/30	3,600,000	3,542,328.00	
		US TREASURY N/B 2.375% 18/05/31	2,500,000	2,596,100.00	
		US TREASURY N/B 2.375% 18/06/30	3,000,000	3,114,840.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 18/07/31	2,000,000	2,068,600.00	
		US TREASURY N/B 1.5% 18/08/31	7,600,000	7,660,572.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 18/09/30	4,500,000	4,513,725.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 18/10/31	2,500,000	2,537,900.00	
		US TREASURY N/B 3.75% 18/11/15	4,000,000	4,356,560.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 18/11/30	5,000,000	5,007,400.00	
US TREASURY N/B 1.25% 18/11/30	6,800,000	6,776,608.00			
US TREASURY N/B 1.375% 18/12/31	6,000,000	5,999,520.00			
US TREASURY N/B 2.75% 19/02/15	7,000,000	7,371,350.00			
US TREASURY N/B 1.375% 19/02/28	10,000,000	9,984,400.00			
US TREASURY N/B 1.5% 19/03/31	5,000,000	5,012,100.00			
US TREASURY N/B 1.25% 19/04/30	8,900,000	8,827,732.00			
US TREASURY N/B 3.125% 19/05/15	7,000,000	7,476,350.00			

US TREASURY N/B 0.875% 19/07/31	13,000,000	12,649,650.00	
US TREASURY N/B 3.625% 19/08/15	3,500,000	3,823,470.00	
US TREASURY N/B 1.0% 19/09/30	5,000,000	4,881,250.00	
US TREASURY N/B 1.25% 19/10/31	4,000,000	3,947,200.00	
US TREASURY N/B 1.0% 19/11/30	7,500,000	7,305,450.00	
US TREASURY N/B 1.125% 19/12/31	8,200,000	8,028,292.00	
US TREASURY N/B 1.375% 20/01/31	6,500,000	6,436,040.00	
US TREASURY N/B 3.625% 20/02/15	6,800,000	7,472,588.00	
US TREASURY N/B 1.25% 20/02/29	5,000,000	4,916,400.00	
US TREASURY N/B 1.125% 20/03/31	4,900,000	4,782,841.00	
US TREASURY N/B 3.5% 20/05/15	7,000,000	7,655,690.00	
US TREASURY N/B 2.625% 20/08/15	8,600,000	9,016,584.00	
US TREASURY N/B 2.625% 20/11/15	7,500,000	7,853,925.00	
US TREASURY N/B 2.0% 20/11/30	8,400,000	8,511,552.00	
US TREASURY N/B 3.625% 21/02/15	9,000,000	9,937,260.00	
US TREASURY N/B 2.0% 21/02/28	7,400,000	7,480,956.00	
US TREASURY N/B 2.25% 21/03/31	5,500,000	5,637,060.00	
US TREASURY N/B 3.125% 21/05/15	5,500,000	5,918,110.00	
US TREASURY N/B 2.0% 21/05/31	9,300,000	9,385,746.00	
US TREASURY N/B 2.125% 21/08/15	7,000,000	7,109,900.00	
US TREASURY N/B 2.0% 21/11/15	12,500,000	12,588,875.00	
US TREASURY N/B 2.0% 22/02/15	4,900,000	4,931,752.00	
US TREASURY N/B 1.75% 22/05/15	1,000,000	988,130.00	
US TREASURY N/B 1.625% 22/08/15	2,500,000	2,445,700.00	
US TREASURY N/B 1.625% 22/11/15	4,000,000	3,901,880.00	
US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	5,000,000	5,001,150.00	
US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	4,000,000	4,146,560.00	
US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	9,000,000	9,501,300.00	
US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	14,000,000	14,774,340.00	
US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	17,500,000	18,089,225.00	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	1,500,000	1,989,840.00	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	1,200,000	1,379,256.00	
US TREASURY N/B 4.375% 39/11/15	500,000	654,845.00	
US TREASURY N/B 3.875% 40/08/15	4,000,000	4,882,520.00	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	3,500,000	4,528,930.00	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	3,400,000	4,743,782.00	
US TREASURY N/B 4.375% 41/05/15	3,000,000	3,975,000.00	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	4,000,000	4,824,080.00	
US TREASURY N/B 3.125% 41/11/15	4,500,000	4,871,970.00	
US TREASURY N/B 3.125% 42/02/15	4,800,000	5,188,512.00	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	3,500,000	3,693,585.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	4,500,000	4,520,745.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	4,200,000	4,214,448.00	
US TREASURY N/B 3.125% 43/02/15	6,500,000	7,006,285.00	
US TREASURY N/B 2.875% 43/05/15	3,800,000	3,907,768.00	
US TREASURY N/B 3.625% 43/08/15	6,300,000	7,439,922.00	
US TREASURY N/B 3.625% 44/02/15	2,500,000	2,952,925.00	
US TREASURY N/B 3.375% 44/05/15	5,000,000	5,652,350.00	
US TREASURY N/B 3.125% 44/08/15	5,700,000	6,159,990.00	
US TREASURY N/B 3.0% 44/11/15	2,900,000	3,062,661.00	
US TREASURY N/B 3.875% 18/05/15	4,000,000	4,347,520.00	
US TREASURY N/B 4.375% 38/02/15	1,100,000	1,434,818.00	
US TREASURY N/B 4.625% 17/02/15	7,600,000	8,194,320.00	
US TREASURY N/B 4.75% 17/08/15	5,500,000	6,023,765.00	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	1,000,000	1,420,000.00	
US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	1,000,000	1,373,130.00	
US TREASURY N/B 8.125% 19/08/15	6,000,000	7,736,280.00	
US TREASURY N/B 8.75% 17/05/15	5,000,000	5,884,400.00	
US TREASURY N/B 8.875% 19/02/15	650,000	841,646.00	
US TREASURY N/B 6.5% 26/11/15	1,000,000	1,440,550.00	
US TREASURY N/B 3.5% 18/02/15	5,500,000	5,891,875.00	
US TREASURY N/B 4.0% 18/08/15	4,500,000	4,928,220.00	
US TREASURY N/B 5.375% 31/02/15	2,000,000	2,772,660.00	
US TREASURY N/B 6.125% 27/11/15	1,500,000	2,129,655.00	

	US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	5,000,000	6,662,900.00	
	US TREASURY N/B 7.25% 16/05/15	2,000,000	2,168,440.00	
	US TREASURY N/B 7.5% 16/11/15	2,300,000	2,573,654.00	
	US TREASURY N/B 8.0% 21/11/15	2,000,000	2,780,000.00	
	US TREASURY N/B 4.625% 16/11/15	5,000,000	5,349,200.00	
アメリカ・ドル	小計	717,050,000	752,517,821.00 (89,624,872,481)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 19/06/01	4,000,000	4,514,120.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/06/01	1,800,000	2,052,108.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	1,600,000	2,404,416.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 17/06/01	3,800,000	4,108,598.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 20/06/01	1,200,000	1,363,248.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 15/08/01	700,000	703,087.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 16/02/01	500,000	503,710.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 16/09/01	3,200,000	3,311,584.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 17/03/01	2,500,000	2,555,075.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 22/06/01	2,000,000	2,230,620.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	1,600,000	1,633,120.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	2,750,000	3,024,147.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	2,400,000	3,154,800.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 16/06/01	5,800,000	6,061,406.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 18/06/01	3,800,000	4,262,802.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	1,600,000	2,540,384.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 41/06/01	2,000,000	2,768,160.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	2,000,000	3,061,260.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 8.0% 27/06/01	1,100,000	1,889,294.00	
カナダ・ドル	小計	44,350,000	52,141,939.50 (4,972,255,350)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/07/21	2,500,000	2,641,680.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 18/10/21	1,500,000	1,572,843.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/15	2,000,000	2,241,858.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 22/07/15	2,500,000	3,084,037.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	2,500,000	3,072,127.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,400,000	2,453,388.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	1,700,000	1,806,880.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,400,000	1,620,497.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	1,400,000	1,699,737.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	1,450,000	1,525,408.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,200,000	1,463,355.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 16/06/15	2,200,000	2,281,800.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	1,000,000	1,112,473.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 19/03/15	2,100,000	2,374,570.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 21/05/15	2,500,000	3,019,917.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 17/02/15	4,000,000	4,322,692.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 18/01/21	2,300,000	2,537,932.70	
オーストラリア・ドル	小計	34,650,000	38,831,199.80 (3,603,923,653)	
イギリス・ポンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	2,700,000	3,803,206.50	
	UK GILT BOND 4.5% 19/03/07	5,000,000	5,684,720.00	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	3,200,000	4,490,979.20	
	UK GILT BOND 3.75% 19/09/07	3,900,000	4,347,057.00	
	UK GILT BOND 8.0% 21/06/07	1,700,000	2,376,763.20	
	UK GILT BOND 3.75% 21/09/07	2,600,000	2,973,191.00	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	2,500,000	3,328,657.50	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	2,000,000	2,647,904.00	
	UK GILT BOND 4.0% 16/09/07	400,000	422,098.00	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	1,800,000	2,526,048.00	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,500,000	1,940,287.50	
	UK GILT BOND 8.75% 17/08/25	1,500,000	1,806,060.00	
	UK GILT BOND 1.75% 17/01/22	1,700,000	1,739,474.00	
	UK GILT BOND 1.25% 18/07/22	2,800,000	2,826,717.60	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	3,600,000	3,750,930.00	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	2,400,000	3,192,972.00	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	2,500,000	3,242,572.50	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	2,500,000	3,250,232.50	

	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	2,000,000	2,688,440.00	
	UK GILT BOND 5.0% 18/03/07	3,400,000	3,828,128.00	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	1,900,000	2,810,472.40	
	UK GILT BOND 1.0% 17/09/07	4,500,000	4,533,628.50	
	UK GILT BOND 1.75% 22/09/07	2,600,000	2,627,060.80	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	1,500,000	1,621,845.00	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	100,000	128,703.50	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	3,200,000	3,659,724.80	
	UK GILT BOND 4.0% 22/03/07	2,300,000	2,686,563.30	
	UK GILT BOND 3.75% 20/09/07	2,900,000	3,275,486.20	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	2,400,000	3,307,970.40	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	2,400,000	3,078,950.40	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	900,000	1,126,134.00	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	2,300,000	3,333,585.50	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	1,500,000	2,120,013.00	
	UK GILT BOND 4.75% 20/03/07	3,200,000	3,745,520.00	
イギリス・ポンド 小計		81,400,000	98,922,096.30 (18,173,967,532)	
スイス・フラン	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 16/03/12	2,300,000	2,384,837.80	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/02/11	950,000	1,267,408.30	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 3.0% 18/01/08	1,200,000	1,333,730.40	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 28/04/08	1,120,000	1,678,512.64	
スイス・フラン 小計		5,570,000	6,664,489.14 (836,460,031)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.75% 16/09/01	2,150,000	2,243,187.45	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.375% 17/04/01	1,300,000	1,339,105.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.875% 30/09/01	690,000	700,699.14	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	780,000	754,104.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.875% 15/07/01	350,000	352,686.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.125% 22/09/01	950,000	1,012,332.35	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.25% 20/09/01	1,950,000	2,086,369.35	
SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	1,120,000	1,227,851.52		
シンガポール・ドル 小計		9,290,000	9,716,335.71 (851,539,661)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.502% 27/05/31	4,100,000	3,879,891.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.262% 16/09/15	2,900,000	2,938,996.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.814% 17/02/15	12,000,000	12,078,852.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.58% 18/09/28	1,300,000	1,295,964.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.378% 19/11/29	3,500,000	3,598,574.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.16% 21/07/15	2,000,000	2,043,724.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.418% 22/08/15	2,100,000	2,046,550.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	1,200,000	1,167,547.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.498% 30/04/15	1,800,000	1,867,856.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.127% 32/04/15	3,300,000	3,235,848.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.935% 43/09/30	350,000	366,840.60		
マレーシア・リンギット 小計		34,550,000	34,520,645.60 (1,128,134,698)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 4.25% 19/03/12	13,000,000	15,347,475.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.0% 16/07/12	11,600,000	12,124,088.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 22/06/01	7,400,000	9,121,957.80	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	5,500,000	5,984,467.50	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	8,800,000	13,082,176.80	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 4.5% 15/08/12	4,000,000	4,087,900.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 5.0% 20/12/01	12,700,000	16,321,976.50	
スウェーデン・クローナ 小計		63,000,000	76,070,041.60 (1,075,630,388)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 19/05/22	7,200,000	8,315,006.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/05/25	9,500,000	11,073,627.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	4,200,000	4,804,392.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	7,500,000	7,950,915.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/05/19	8,300,000	8,950,072.60	
ノルウェー・クローネ 小計		36,700,000	41,094,014.10 (645,176,021)	

デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 19/11/15	14,000,000	16,970,800.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 17/11/15	17,000,000	19,188,359.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 7.0% 24/11/10	5,500,000	9,226,167.50	
	DANISH GOVERNMENT BOND 3.0% 21/11/15	7,500,000	9,083,302.50	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15	5,500,000	6,200,931.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	17,200,000	31,463,048.40	
デンマーク・クローネ 小計		66,700,000	92,132,608.40	(1,674,970,820)
メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 15/12/17	36,000,000	37,330,740.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 17/12/14	25,000,000	27,200,575.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 18/12/13	13,000,000	14,641,809.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 20/06/11	44,000,000	49,826,172.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 21/06/10	36,000,000	38,243,808.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	31,500,000	41,699,605.50	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	10,000,000	11,369,040.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	8,500,000	10,490,589.50	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	14,500,000	20,935,665.50	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	21,800,000	27,706,819.00	
MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	14,500,000	17,215,139.50		
メキシコ・ペソ 小計		254,800,000	296,659,963.00	(2,352,513,506)
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 5.0% 16/04/25	8,000,000	8,305,016.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 18/07/25	500,000	511,700.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 20/10/25	1,150,000	1,351,676.65	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 21/10/25	2,000,000	2,456,706.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25	3,800,000	4,335,978.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	3,100,000	4,369,140.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 17/10/25	11,000,000	12,013,672.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5% 19/10/25	2,800,000	3,252,009.60	
POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 22/09/23	2,500,000	3,129,240.00		
ポーランド・ズロチ 小計		34,850,000	39,725,139.35	(1,289,478,023)
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 8.25% 17/09/15	16,500,000	17,135,382.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 7.25% 20/01/15	2,000,000	2,021,444.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.75% 21/03/31	22,000,000	21,636,252.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 10.5% 26/12/21	35,000,000	42,997,500.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 7.0% 31/02/28	6,000,000	5,453,208.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.25% 36/03/31	10,000,000	8,100,840.00	
SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 41/02/28	26,500,000	21,682,300.00		
南アフリカ・ランド 小計		118,000,000	119,026,926.00	(1,215,264,914)
ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	850,000	944,617.75	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	1,000,000	1,117,845.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.95% 19/06/18	1,300,000	1,411,892.30	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	720,000	1,087,864.56	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.2% 17/02/20	1,050,000	1,121,610.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.4% 22/11/22	500,000	619,895.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.5% 21/09/15	1,200,000	1,463,508.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.65% 22/04/20	1,200,000	1,493,565.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	580,000	1,126,731.20	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.9% 20/07/15	1,500,000	1,813,312.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.0% 16/09/15	1,300,000	1,386,235.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	1,650,000	2,684,979.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.3% 17/09/15	1,600,000	1,781,641.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.35% 19/03/15	1,800,000	2,124,142.20	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.65% 18/01/15	2,550,000	2,902,384.50	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	1,000,000	1,462,750.00		
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	1,150,000	1,925,109.20		

BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 18/06/22	1,200,000	1,252,740.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	1,600,000	1,836,963.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	1,800,000	2,132,388.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.75% 16/03/28	550,000	567,286.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.25% 16/09/28	1,900,000	2,004,519.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.5% 17/06/28	800,000	868,030.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 20/09/28	2,400,000	2,892,036.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	700,000	1,095,307.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 17/03/28	1,500,000	1,629,720.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 18/03/28	2,500,000	2,815,327.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 19/03/28	2,500,000	2,911,535.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 22/03/28	1,500,000	1,897,372.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	1,500,000	2,177,632.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 21/09/28	1,800,000	2,280,702.60	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 22/09/28	1,800,000	2,332,944.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	2,000,000	3,281,750.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,200,000	1,682,346.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	2,800,000	4,699,354.80	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 17/09/28	1,800,000	2,065,626.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,700,000	2,675,905.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.125% 18/09/15	400,000	417,286.80	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	700,000	765,483.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.75% 16/04/15	700,000	715,369.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.625% 42/07/04	590,000	815,565.85	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	550,000	690,070.70	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.375% 20/04/15	1,500,000	1,759,398.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.5% 21/04/15	700,000	844,440.10	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.875% 17/09/15	700,000	771,614.90	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	1,000,000	1,351,290.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.25% 15/07/04	450,000	457,132.95	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.375% 19/07/04	1,200,000	1,431,276.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 17/07/25	4,200,000	4,311,623.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 18/11/25	4,400,000	4,568,489.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 17/02/25	1,500,000	1,555,822.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	3,500,000	3,867,027.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 16/02/25	2,000,000	2,047,876.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 22/10/25	2,500,000	2,853,000.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	3,000,000	3,452,151.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 16/07/25	4,000,000	4,148,744.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 20/10/25	5,800,000	6,575,425.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	4,100,000	4,996,202.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 22/04/25	4,300,000	5,120,500.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 16/04/25	4,500,000	4,678,029.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 21/10/25	5,000,000	5,990,600.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	1,600,000	2,287,331.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 20/04/25	5,600,000	6,583,270.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	4,000,000	5,164,780.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 17/04/25	4,000,000	4,335,200.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 19/10/25	5,000,000	5,865,425.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 21/04/25	5,000,000	6,094,855.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 18/04/25	5,400,000	6,097,793.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	3,000,000	4,604,856.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	3,200,000	5,528,000.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 17/10/25	5,000,000	5,579,600.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 18/10/25	5,800,000	6,710,542.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 19/04/25	4,200,000	4,944,160.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	3,500,000	4,618,162.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	2,800,000	4,713,408.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	2,900,000	4,709,426.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	5,400,000	8,637,013.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	3,500,000	6,087,574.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	3,000,000	4,632,720.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 19/10/25	3,800,000	5,300,019.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	2,100,000	3,466,411.20	

GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 18/04/13	2,800,000	2,838,715.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 17/04/07	2,000,000	2,030,010.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 17/10/13	2,900,000	2,954,743.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 16/10/14	3,200,000	3,276,652.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 22/09/04	2,000,000	2,206,338.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	3,000,000	3,318,774.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	2,500,000	2,768,625.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.75% 22/07/04	3,800,000	4,261,168.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 22/01/04	3,100,000	3,513,753.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/08/15	2,300,000	2,645,982.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 21/09/04	2,000,000	2,292,128.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 21/01/04	2,600,000	2,985,782.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	2,150,000	2,969,279.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	400,000	556,406.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.75% 16/04/08	2,500,000	2,582,412.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.0% 20/07/04	4,800,000	5,592,456.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 20/01/04	3,400,000	3,960,626.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/04	3,500,000	4,221,651.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	2,000,000	3,091,498.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.5% 19/07/04	8,500,000	9,860,935.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.75% 17/01/04	2,000,000	2,147,998.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.75% 19/01/04	4,800,000	5,531,448.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 16/07/04	3,400,000	3,594,860.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 18/01/04	4,000,000	4,484,744.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	2,300,000	3,711,477.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/07/04	2,800,000	3,095,848.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 18/07/04	4,000,000	4,600,820.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	2,000,000	3,436,000.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,600,000	2,457,313.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	2,500,000	4,252,282.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,500,000	2,782,221.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	2,300,000	3,950,059.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.625% 28/01/04	2,000,000	3,264,050.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	6,100,000	9,339,032.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	700,000	1,256,879.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,500,000	2,577,717.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	550,000	614,993.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	700,000	846,979.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	1,000,000	1,238,364.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.4% 19/06/18	1,200,000	1,414,428.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 18/10/18	1,200,000	1,389,648.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/18	2,200,000	2,657,023.60	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.6% 16/04/18	2,100,000	2,210,128.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	2,200,000	3,094,652.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 17/11/01	3,050,000	3,303,784.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 18/06/01	1,100,000	1,207,951.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 16/04/15	900,000	936,481.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 16/08/01	4,800,000	5,041,526.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/03/01	4,500,000	5,218,344.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/08/01	4,200,000	4,885,104.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 17/02/01	4,800,000	5,143,526.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 20/09/01	3,200,000	3,734,272.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	3,100,000	3,902,986.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 19/02/01	5,000,000	5,722,480.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 19/09/01	5,200,000	6,020,476.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 20/03/01	3,100,000	3,624,148.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 18/02/01	4,800,000	5,371,972.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 18/08/01	4,900,000	5,565,375.90	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 19/03/01	4,500,000	5,197,941.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/02/01	1,700,000	2,005,388.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	5,400,000	6,752,538.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	3,200,000	4,086,624.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 16/09/15	3,600,000	3,850,203.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 17/05/01	4,400,000	4,825,700.00	



ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 21/09/01	4,200,000	5,154,046.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	4,600,000	5,803,820.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,600,000	2,117,424.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	2,000,000	2,888,770.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 22/03/01	2,000,000	2,508,840.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	2,600,000	3,410,087.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	2,500,000	3,531,075.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	1,700,000	2,466,904.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	3,200,000	4,652,320.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 17/08/01	4,000,000	4,473,316.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	5,000,000	7,009,700.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/09/01	2,500,000	3,247,525.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/11/01	2,500,000	3,251,172.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	3,200,000	4,838,720.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	3,500,000	5,327,182.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/11/01	4,200,000	6,356,649.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	1,800,000	2,835,968.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	2,100,000	3,383,091.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.25% 18/01/15	2,100,000	2,183,048.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.25% 19/01/15	2,000,000	2,101,738.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	600,000	668,622.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,300,000	1,485,242.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.25% 22/07/15	1,400,000	1,604,272.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 17/01/15	3,400,000	3,570,411.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	1,200,000	1,526,337.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	350,000	505,417.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/15	2,100,000	2,516,593.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.5% 20/07/15	2,000,000	2,372,724.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 23/01/15	1,000,000	1,267,920.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	2,100,000	3,470,541.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 16/07/15	500,000	528,945.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 18/07/15	3,800,000	4,327,455.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 19/07/15	2,400,000	2,824,836.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	1,800,000	2,891,700.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.5% 17/07/15	2,900,000	3,221,061.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	2,000,000	3,187,080.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.5% 23/01/15	1,300,000	2,029,599.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	900,000	997,020.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.25% 16/04/30	3,500,000	3,627,295.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.3% 16/07/30	2,400,000	2,506,891.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.75% 18/10/31	3,600,000	4,018,392.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.8% 17/01/31	2,900,000	3,098,070.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 20/04/30	2,500,000	2,902,625.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.1% 18/07/30	4,200,000	4,710,888.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	2,400,000	3,142,368.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.25% 16/10/31	3,900,000	4,165,629.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.3% 19/10/31	4,300,000	5,010,747.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,500,000	3,102,032.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.6% 19/07/30	3,500,000	4,099,375.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	1,300,000	1,674,394.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,700,000	2,421,330.40	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	6,000,000	7,677,300.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.85% 20/10/31	2,400,000	2,914,056.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,800,000	2,626,488.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	1,200,000	1,835,640.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	2,000,000	2,610,376.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 17/07/30	7,200,000	8,098,344.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 21/04/30	2,800,000	3,552,808.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	2,300,000	3,485,121.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.85% 22/01/31	2,500,000	3,281,450.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,800,000	2,569,680.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	2,500,000	3,703,600.00	
ユーロ 小計	539,690,000	671,358,350.46 (90,854,925,567)	

国債証券 小計		218,299,112,645 (218,299,112,645)	
合計		218,299,112,645 (218,299,112,645)	

(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。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 126銘柄	100.0%	41.1%
カナダ・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	2.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.7%
イギリス・ポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	8.2%
スイス・フラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%
シンガポール・ドル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.8%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	1.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカ・ランド	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 207銘柄	100.0%	41.6%

(注) 組入債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27年3月31日現在）

資産総額	2,064,555,890円
負債総額	1,777,682円
純資産総額（ - ）	2,062,778,208円
発行済口数	1,671,025,235口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2344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27年3月31日現在）

資産総額	134,439,989,634円
負債総額	382,749,640円
純資産総額（ - ）	134,057,239,994円
発行済口数	57,145,303,555口

1口当たり純資産額( / )	2.3459円
----------------	---------

## &lt; 参考情報 &gt;

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27年3月31日現在)

資産総額	175,200,438,390円
負債総額	899,686,948円
純資産総額( - )	174,300,751,442円
発行済口数	144,459,774,662口
1口当たり純資産額( / )	1.2066円

## &lt; 参考情報 &gt;

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27年3月31日現在)

資産総額	169,508,189,332円
負債総額	509,914,128円
純資産総額( - )	168,998,275,204円
発行済口数	78,064,973,118口
1口当たり純資産額( / )	2.1648円

## &lt; 参考情報 &gt;

親投資信託受益証券(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)

(平成27年3月31日現在)

資産総額	218,031,439,968円
負債総額	196,892,669円
純資産総額( - )	217,834,547,299円
発行済口数	92,353,408,759口
1口当たり純資産額( / )	2.3587円

## 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ます。）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け、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27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27年3月31日現在)。

###### 発行済株式の総数

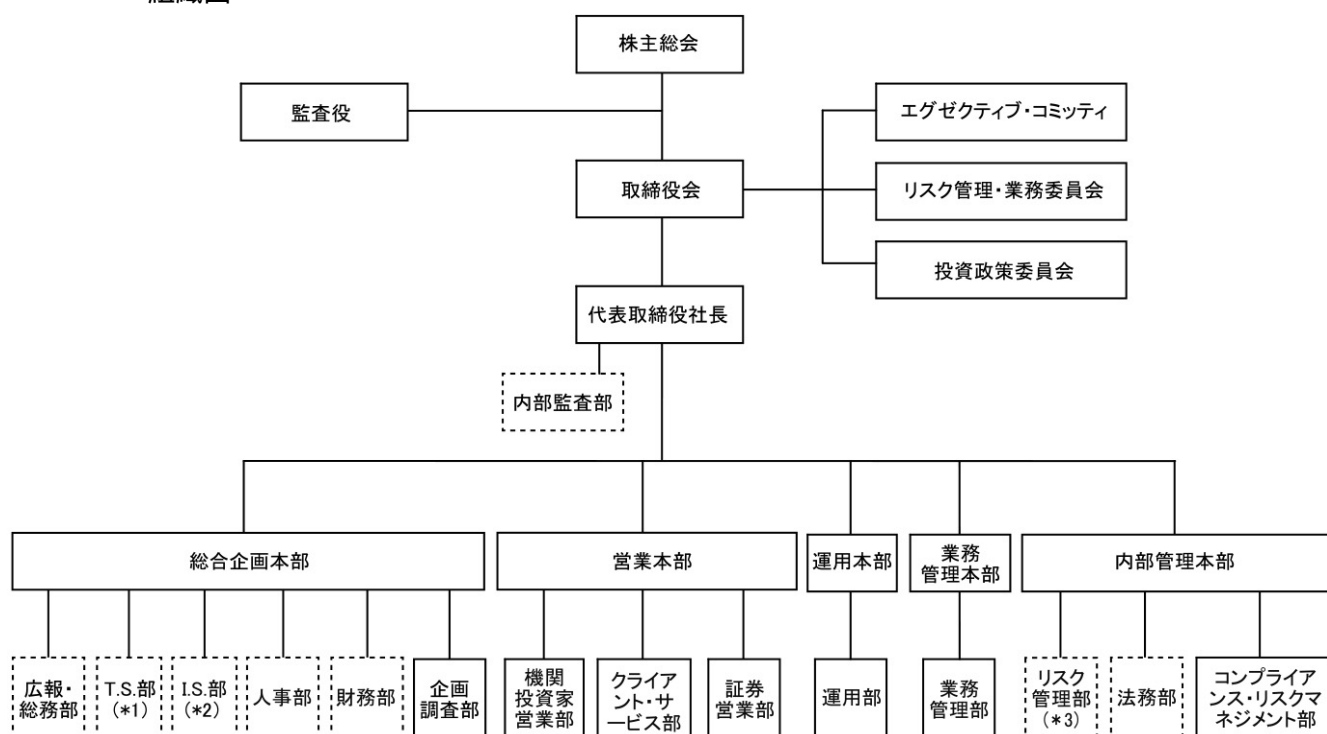
委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成27年3月31日現在)。

###### 最近5年間に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]
内部管理本部	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）
	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）を行っています。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います。

平成27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109本であり、その純資産総額は1,436,103百万円です(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則」（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17期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表ならびに第18期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）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せん。

## 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25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26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				
預金	7,198,847		7,950,582	
有価証券	52,323		34,680	
前払金	18,914		16,211	
前払費用	9,826		14,721	
未収入金	543,987		603,386	
未収委託者報酬	443,028		503,082	
未収収益	15,224		21,586	
繰延税金資産	50,078		76,778	
流動資産計	8,332,231	96.9	9,221,030	97.5
固定資産				
有形固定資産	136,869		114,512	
建物附属設備	116,383		103,804	
器具備品	15,144		8,419	
リース資産	5,341		2,289	
無形固定資産	2,025		1,407	
ソフトウェア	2,025		1,407	
投資その他の資産	125,804		116,869	
長期差入保証金	75,397		66,322	
繰延税金資産	45,557		45,696	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	264,699	3.1	232,789	2.5
資産合計	8,596,931	100.0	9,453,819	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負債の部)		%		%
流動負債				
預り金	30,901		23,420	
未払金	198,194		249,155	
未払手数料	118,440		122,594	
その他未払金	79,754		126,561	
未払費用	42,048		11,232	
未払法人税等	303,031		406,211	
未払消費税	19,248		31,826	
賞与引当金	39,149		57,068	
リース債務	1,943		4,910	
流動負債計	634,516	7.4	783,826	8.3
固定負債				
退職給付引当金	76,324		66,635	
長期リース債務	4,910		-	
固定負債計	81,234	0.9	66,635	0.7

負債合計		715,751	8.3		850,462	9.0
(純資産の部)			%			%
株主資本		7,881,180	91.7		8,603,357	91.0
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	7,462,060			8,184,237		
純資産合計		7,881,180	91.7		8,603,357	91.0
負債・純資産合計		8,596,931	100.0		9,453,819	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日		当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	1,985,885		2,386,697	
投資顧問収入	1,419,249		1,524,966	
その他営業収益	556,047		567,688	
営業収益計	3,961,182	100.0	4,479,352	100.0
営業費用				
支払手数料	489,095		583,489	
広告宣伝費	13,166		15,984	
公告費	1,220		2,082	
調査費	483,166		408,932	
調査費	292,449		280,837	
委託調査費	189,179		126,204	
図書費	1,538		1,890	
委託計算費	160,372		157,812	
営業雑経費	51,741		29,404	
通信費	6,614		5,633	
印刷費	15,237		7,614	
協会費	13,533		7,975	
諸会費	4,057		2,894	
その他	12,298		5,286	
営業費用計	1,198,762	30.3	1,197,707	26.7
一般管理費				
給料	1,352,561		1,314,409	
役員報酬	410,448		344,116	
給料・手当	753,389		692,068	
賞与	160,812		232,545	
賞与引当金繰入額	27,911		45,678	
交際費	4,388		2,778	
旅費交通費	28,270		33,064	
租税公課	21,104		23,883	
不動産賃借料	128,620		131,057	
退職給付費用	77,661		57,037	
固定資産減価償却費	24,770		22,735	
福利厚生費	73,379		79,311	
事務手数料	13,121		22,320	

諸経費		149,074			179,736	
一般管理費計		1,872,954	47.3		1,866,335	41.7
営業利益		889,465	22.5		1,415,309	31.6
営業外収益						
受取利息		-			0	
為替差益		2,744			-	
有価証券運用益		2,846			-	
事業再構築引当金戻入		-			222	
雑収入		3,275			548	
営業外収益計		8,866	0.2		771	0.0
営業外費用						
支払利息		407			280	
為替差損		-			1,184	
有価証券運用損		-			1,386	
雑損失		563			257	
営業外費用計		970	0.0		3,109	0.1
経常利益		897,362	22.7		1,412,971	31.5
特別損失						
事業再構築費用		8,453			102,702	
事務処理損失		236			953	
特別損失計		8,690	0.2		103,655	2.3
税引前当期純利益		888,671	22.4		1,309,315	29.2
法人税、住民税及び事業税		472,566	11.9		613,977	13.7
法人税等調整額		18,753	0.5		26,839	0.6
当期純利益		434,858	11.0		722,177	16.1

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金				
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	7,027,201	7,136,321	7,446,321	7,446,321
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	434,858	434,858	434,858	434,858
当期変動額合計	-	-	-	-	-	434,858	434,858	434,858	434,858
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	7,462,060	7,571,180	7,881,180	7,881,180

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金				
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	7,462,060	7,571,180	7,881,180	7,881,180
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	722,177	722,177	722,177	722,177
当期変動額合計	-	-	-	-	-	722,177	722,177	722,177	722,177
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,184,237	8,293,357	8,603,357	8,603,357

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>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。</p>				
2. 固定資産の減価償却方法	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>リース資産以外の有形固定資産</p> <p>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。</p> <table border="0" data-bbox="515 461 906 528"> <tr> <td>建物附属設備</td> <td>6～18年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>5～15年</td> </tr> </table> <p>リース資産</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。</p> <p>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</p>	建物附属設備	6～18年	器具備品	5～15年
建物附属設備	6～18年				
器具備品	5～15年				
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>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。</p>				
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>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。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p> <p>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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>過去勤務費用</p> <p>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しております。</p> <p>数理計算上の差異</p> <p>発生の翌事業年度に一括費用処理しております。</p>				
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	<p>消費税等の処理方法</p> <p>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。</p>				

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

前事業年度 (平成25年3月31現在)	当事業年度 (平成26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 75,441千円 器 具 備 品 42,781千円 リース資産 3,815千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 88,020千円 器 具 備 品 48,355千円 リース資産 6,867千円
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	2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 10,117千円
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24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
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。	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557,461千円は、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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
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.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。	同左

## ( 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	543,987	543,987	
(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。

平成26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	7,950,582	7,950,582	
(2)未収委託者報酬	503,082	503,082	
(3)未収入金	603,386	603,386	
(4)未払手数料	122,594	122,594	

### (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25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
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	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 34,680千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 700千円

## （デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
該当事項はありません。	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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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25年3月31日現在)
退職給付債務	395,579
(1)年金資産	266,835
(2)退職給付引当金	76,324
(3)未認識数理計算上の差異	17,353
(4)未認識過去勤務債務	69,773

(単位：千円)

	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
退職給付債務	391,473
(1)年金資産	278,789
(2)退職給付引当金	66,635
(3)未認識数理計算上の差異	15,002
(4)未認識過去勤務費用	61,051

## 3．年金資産の内訳

平成26年3月 31日現在における年金資産合計に対する分類ごとの比率は次の通りです。

保険資産（一般勘定）	97.2%
その他	2.7%



合計	100.0%
----	--------

## 4．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
退職給付費用	41,728
(1)勤務費用	48,367
(2)利息費用	3,955
(3)期待運用収益（減算）	1,962
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	17,353

## 5．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
退職給付債務の期首残高	395,579
勤務費用	48,367
利息費用	3,955
数理計算上の差異の発生額	16,744
退職給付の支払額	39,683
退職給付債務の期末残高	391,473

## 6．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
年金資産の期首残高	266,835
期待運用収益	1,962
数理計算上の差異の発生額	1,742
事業主からの拠出額	51,416
退職給付の支払額	39,683
年金資産の期末残高	278,789

## 7. 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
積立型制度の退職給付債務	391,473
年金資産	278,789
	112,684
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	112,684
未認識数理計算上の差異	15,002
未認識過去勤務費用	61,051
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	66,635

## 8. 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25年3月31日現在)
(1)割引率	1.0%
(2)期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	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
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
(1)割引率	1.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

## 9. 長期期待運用収益の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## 10. 確定拠出制度

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,309千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26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	10,609	賞与引当金繰入超過額	14,430
未払事業税	23,683	未払事業税	27,452
その他	17,820	その他	34,894
繰延税金資産（流動）合計	52,113	繰延税金資産（流動）合計	76,778
繰延税金負債（流動）との相殺	2,034	繰延税金負債（流動）との相殺	-
繰延税金資産（流動）の純額	50,078	繰延税金資産（流動）の純額	76,778
繰延税金資産（固定）		繰延税金資産（固定）	
退職給付引当金	28,070	退職給付引当金	24,992
その他	17,486	その他	20,704
繰延税金資産（固定）合計	45,557	繰延税金資産（固定）合計	45,696
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	45,557	繰延税金資産（固定）の純額	45,696
繰延税金資産合計	97,670	繰延税金資産合計	122,475
繰延税金負債（流動）		繰延税金負債（流動）	
その他	2,034	その他	-
繰延税金負債（流動）合計	2,034	繰延税金負債（流動）合計	-
繰延税金資産（流動）との相殺	2,034	繰延税金資産（流動）との相殺	-
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	95,635 =====	繰延税金資産の純額	122,475 =====

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	38.0%	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	12.4%	交際費等永久に損金に算入されない項目	6.3%
その他	0.6%	その他	0.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	51.0%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.8%
=====		=====	

## （税率変更に伴う影響）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が廃止されることとなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異にかかる繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の38.01%から35.64%となります。この税率変更により、繰延税金資産は5百万円減少し、法人税等調整額は5百万円増加しております。

## （企業結合関係等）

前事業年度 自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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。

## (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	119,883 201,074 171,376 295,287 547,935	未収入金 未払金 未払費用	104,719 2,898 13,381
	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	36,270 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・インテグリティ・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	1,313 2,463	-	-
	ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルグ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	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25年4月1日 至 平成26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)
						役員兼任等	事業上の関係				
当事業年度 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日											

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	51,600 190,649 113,920 268,072 557,461	未収入金 未払金	271,658 7,643
	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	35,955 4,173 134,269	前払金	16,211
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・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	825	-	-
	ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルグ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	56,645	-	-
	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	232	-	-

(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。

#### 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24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
1株当たり純資産 1,271,158円07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。	1株当たり純資産 1,387,638円26銭 1株当たり当期純利益 116,480円19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。

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24年4月 1日 至 平成25年3月31日	当事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日
当期純利益（千円）	434,858	722,177
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）	434,858	722,177
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25年4月 1日 至 平成26年3月31日
<p>本社移転について</p> <p>平成26年5月、グループの方針として、本社移転が決定いたしました。この移転により、移転費用の発生が見込まれますが、現時点ではその影響を合理的に見積もることができません。</p>

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	期 別	第18期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
		金額	構成比
%			
(資産の部)			
流動資産			
預金		8,306,323	
有価証券		39,051	
前払金		25,271	
前払費用		13,394	
未収入金		381,765	
未収委託者報酬		576,703	
未収収益		243,009	
短期差入保証金		55,420	
繰延税金資産		167,783	
流動資産計		9,808,725	99.5
固定資産			
有形固定資産		8,111	
建物附属設備	1	2,065	
器具備品	1	5,282	



リース資産	1	763		
無形固定資産			1,105	
ソフトウェア		1,105		
投資その他の資産			38,782	
長期差入保証金		6,553		
繰延税金資産		27,379		
その他投資		4,850		
固定資産計			48,000	0.5
資産合計			9,856,725	100.0
(負債の部)				%
流動負債				
預り金			25,073	
未払金			277,165	
未払手数料		128,962		
その他未払金		148,202		
未払費用			6,488	
未払法人税等			292,662	
未払消費税等	2		54,936	
賞与引当金			169,305	
リース債務			3,904	
流動負債計			829,535	8.4
固定負債				
退職給付引当金			62,772	
固定負債計			62,772	0.6
負債合計			892,307	9.1
(純資産の部)				%
株主資本			8,964,417	90.9
資本金		310,000		
利益剰余金		8,654,417		
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		8,545,297		
純資産合計			8,964,417	90.9
負債・純資産合計			9,856,725	100.0

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期別	第18期中間会計期間		
	自平成26年4月1日 至平成26年9月30日		
科目	金額		構成比
営業収益			%
委託者報酬		1,232,903	
投資顧問収入		786,101	
その他営業収益	1	113,135	
営業収益計		2,132,140	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		589,620	
支払手数料	289,516		
その他営業費用	300,104		
一般管理費	2	864,774	
営業費用・一般管理費計		1,454,395	68.2
営業利益		677,745	31.8

営業外収益		427	0.0
営業外費用		1,751	0.1
経常利益		676,421	31.7
特別損失	3	110,862	5.2
税引前中間純利益		565,558	26.5
法人税, 住民税及び事業税		277,186	13.0
法人税等調整額		72,687	3.4
中間純利益		361,060	16.9

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：千円)

	株 主 資 本							株主資本 合計	純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金				
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,184,237	8,293,357	8,603,357	8,603,357
当中間期変動額									
中間純利益	-	-	-	-	-	361,060	361,060	361,060	361,060
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	361,060	361,060	361,060	361,060
当中間期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,545,297	8,654,417	8,964,417	8,964,417

## 重要な会計方針

	第18期中間会計期間 自 平成26年4月 1日 至 平成26年9月30日
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 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 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 9～18年 器具備品 5～15年 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っております。  (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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。

4. 引当金の計上基準	<p>(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に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(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、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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 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しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	<p>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。</p>

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第18期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)							
1. 有形固定資産の減価償却累計額(減損損失累計額を含む)	<table border="1"> <tr> <td>建物付属設備</td> <td>189,758千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>51,491千円</td> </tr> <tr> <td>リース資産</td> <td>8,394千円</td> </tr> </table>	建物付属設備	189,758千円	器具備品	51,491千円	リース資産	8,394千円
建物付属設備	189,758千円						
器具備品	51,491千円						
リース資産	8,394千円						
2. 消費税等の取扱い	<p>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。</p>						

(中間損益計算書関係)

第18期中間会計期間 自 平成26年4月 1日 至 平成26年9月30日									
1. 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107,579千円は、損益計算書のその他営業収益に含まれております。									
2. 減価償却実施額	<table border="1"> <tr> <td>有形固定資産</td> <td>9,483千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td>301千円</td> </tr> <tr> <td>リース資産</td> <td>1,526千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	9,483千円	無形固定資産	301千円	リース資産	1,526千円		
有形固定資産	9,483千円								
無形固定資産	301千円								
リース資産	1,526千円								
3. 減損損失 当事業年度において、当社は以下の資産について減損損失を計上しました。	<table border="1"> <thead> <tr> <th>場所</th> <th>用途</th> <th>種類</th> <th>減損損失(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> <td> </td> </tr> </tbody> </table>	場所	用途	種類	減損損失(千円)				
場所	用途	種類	減損損失(千円)						

東京都港区	現本社	建物付属設備	95,541
-------	-----	--------	--------

当社は、平成26年9月26日開催の取締役会において、平成26年12月15日付での本社移転を決定致しました。

上記本社移転の意思決定に伴い、移転予定日以降、将来の使用が見込まれなくなったため、建物に付帯する資産の帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として、特別損失に計上しております。

なお、当該資産の回収可能価額の算定は、使用価値によっており、移転予定時までの減価償却費相当額を使用価値としております。

（中間株主資本等変動計算書関係）

第18期中間会計期間 自 平成26年4月 1日 至 平成26年9月30日				
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18期中間会計期間 自 平成26年4月 1日 至 平成26年9月30日	
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18期中間会計期間 自 平成26年4月 1日 至 平成26年9月30日			
1. 金融商品の時価等に関する事項 平成26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	8,306,323	8,306,323	
(2)未収入金	381,765	381,765	
(3)未収委託者報酬	576,703	576,703	
(4)未払手数料	128,962	128,962	

## (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年を超えるものはありません。

## (有価証券関係)

第18期中間会計期間末 (平成26年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	39,051千円
当事業年度の損益に含まれた評価差額	81千円

## (資産除去債務関係)

第18期中間会計期間末 (平成26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18期中間会計期間末 (平成26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18期中間会計期間末 (平成26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）

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

## （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18期中間会計期間

自 平成26年4月 1日

至 平成26年9月30日

1株当たり純資産額 1,445,873円78銭

1株当たり中間純利益 58,235円51銭

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

注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第18期中間会計期間	
自 平成26年4月 1日	
至 平成26年9月30日	
中間純利益（千円）	361,060
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）	361,060
期中平均株式数（株）	6,200

## （重要な後発事象）

第18期中間会計期間

自 平成26年4月 1日

至 平成26年9月30日

該当事項はありません。

#### 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26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26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26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26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26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26年6月20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 櫻井 雄一郎 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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

( ) 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27年3月25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26年2月21日から平成27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27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26年12月19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 櫻井 雄一郎 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第18期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続きの一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関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26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

( ) 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。