

【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28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：www.ssga.com

(5) 【申込手数料】

お申込み手数料は、購入申込日の翌営業日の基準価額に2.16%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。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。

詳細については販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

(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28年5月21日から平成29年5月19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：www.ssga.com

(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。

取得申込みの受け付けの中止、既に受け付けた取得申込の受け付けの取消し

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

お申込み代金の利息

お申込み代金には利息を付けません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

振替制度では、

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 () 資産複合	インデックス型 特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する商品分類

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

属性区分表

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

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

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する属性区分

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

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

ファンドの目的

当ファンドは、株式会社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。

- *1 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「日本株式インデックス・マザーファンド」に変更する予定です。
- *2 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「日本債券インデックス・マザーファンド」に変更する予定です。
- *3 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」に変更する予定です。
- *4 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「外国債券インデックス・マザー・ファンド」に変更する予定です。

■ 主な投資制限

1. マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
2. 株式、公社債および外貨建資産、それぞれの実質投資割合には制限を設けません。
3. 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
4. デリバティブ取引は、約款に定める範囲で行います。

投資対象とするマザーファンドの概要

■ ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	・ TOPIX (東証株価指数配当込み)をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

■ ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	・ NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。 ・ 債券組入比率は原則として高位を維持します。

■ ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き(MSCI コクサイ指数、円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)
投資態度	・ 日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)を主要投資対象とし、MSCI コクサイ指数(円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。 ・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

■ ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等を主要投資対象としシティ世界国債指数(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
投資態度	・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

■ 収益分配方針

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

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

■ 収益分配金に関する留意事項

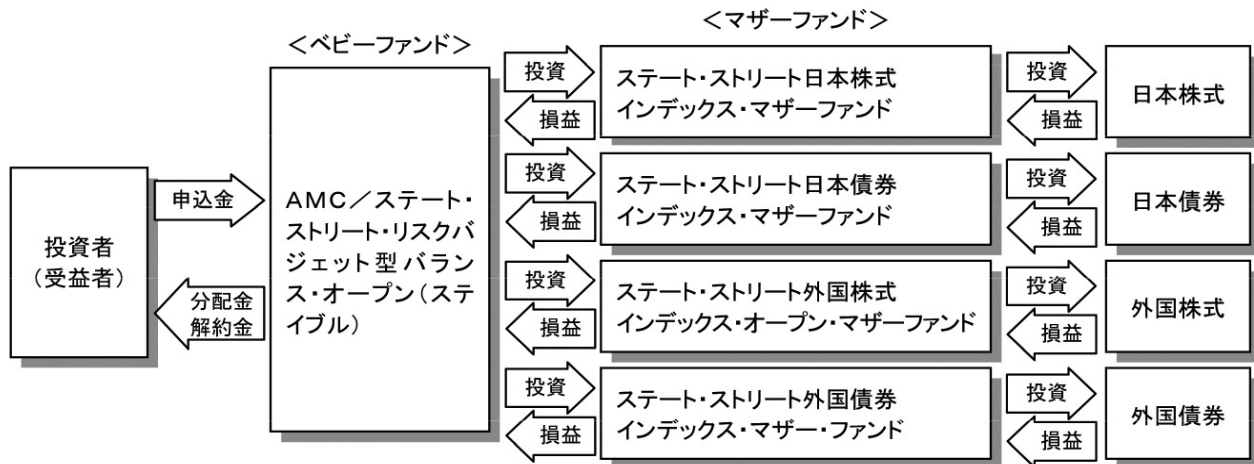
- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基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

(2) 【ファンドの沿革】

平成24年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

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



ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

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

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

- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

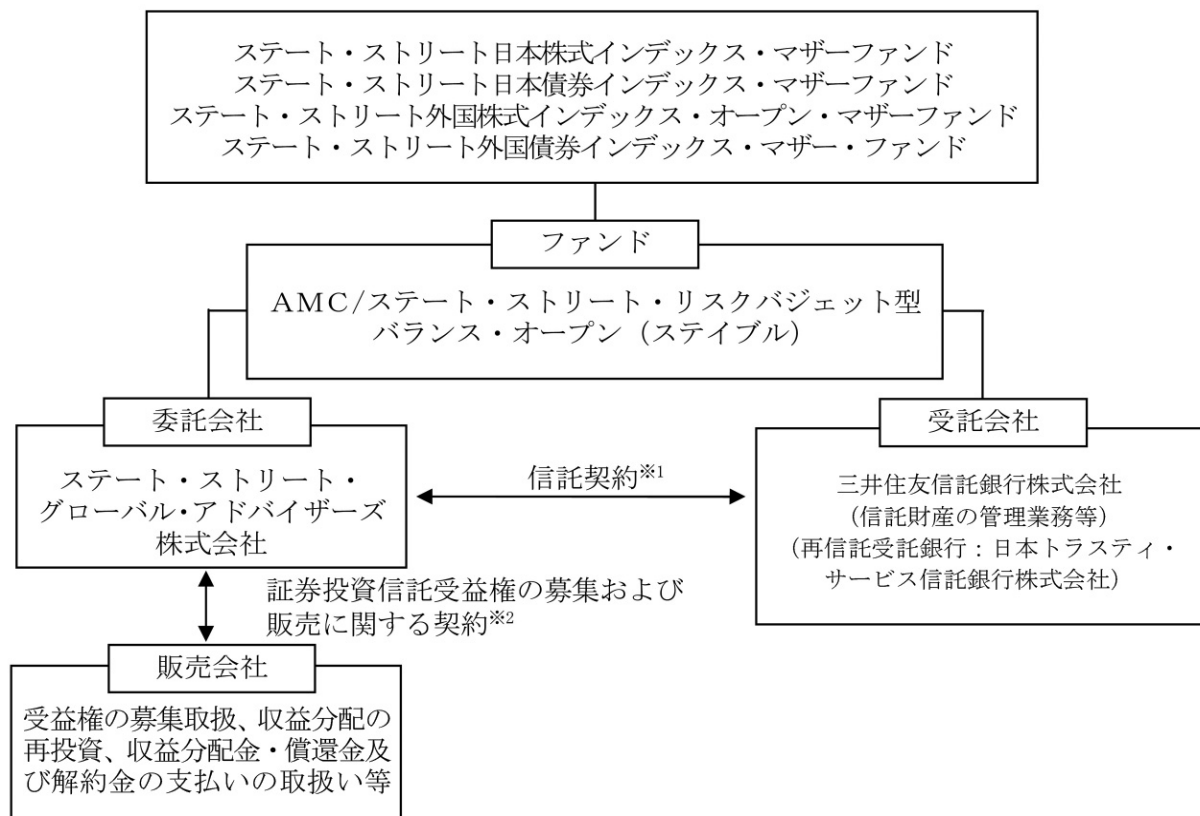
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

- 3) 販売会社

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

ファンド関係法人



1 信託契約

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

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

2 証券投資信託受益権の募集および販売に関する契約

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

委託会社の概況（平成28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28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・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	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¹）]

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

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

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

マザーファンド受益証券の組入れに伴う実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

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

（２）【投資対象】

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

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

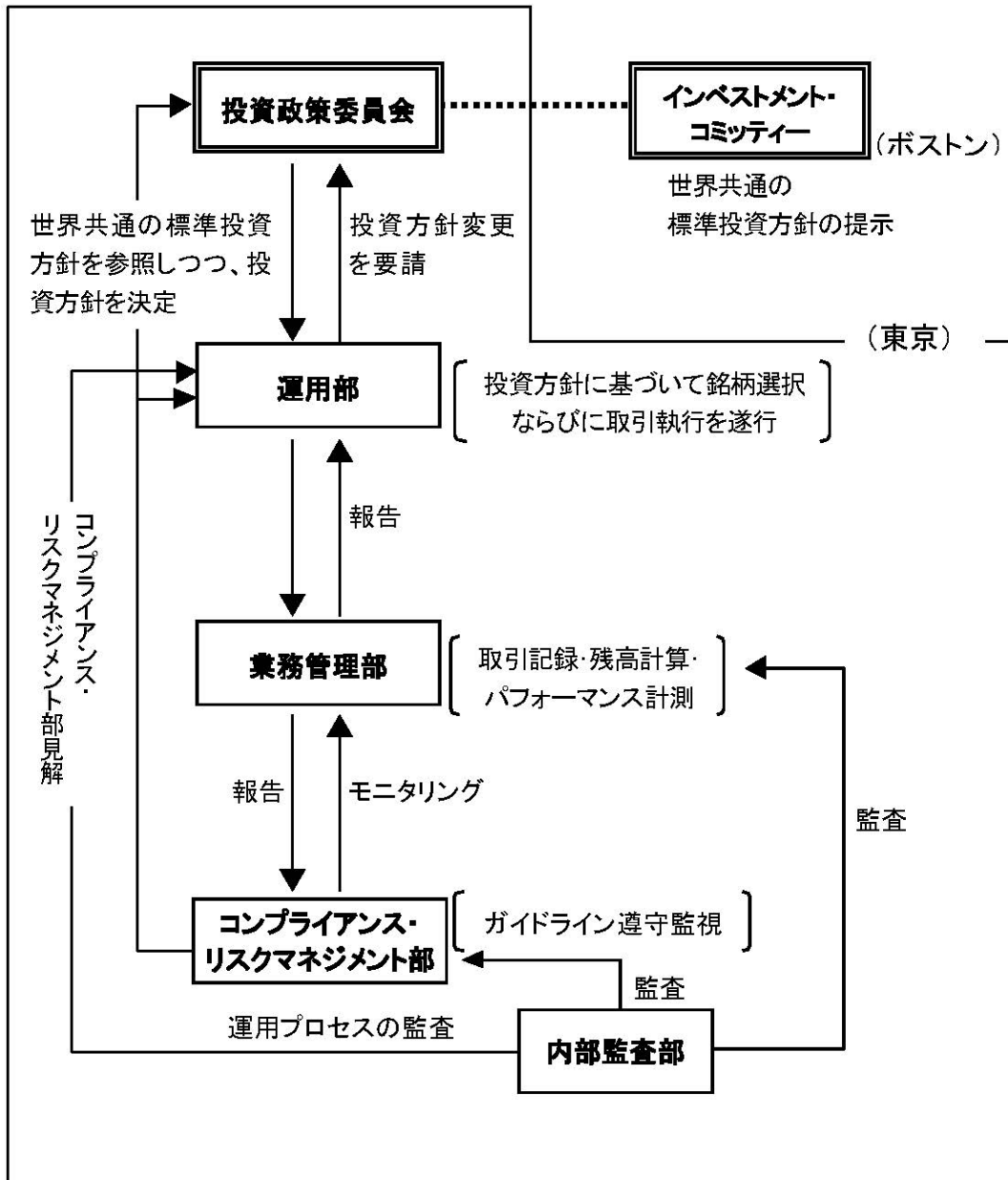
4. 手形割引市場において売買される手形

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28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券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10) コマーシャル・ペーパー

11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

13) 投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）

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、参加もしておりません。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。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。

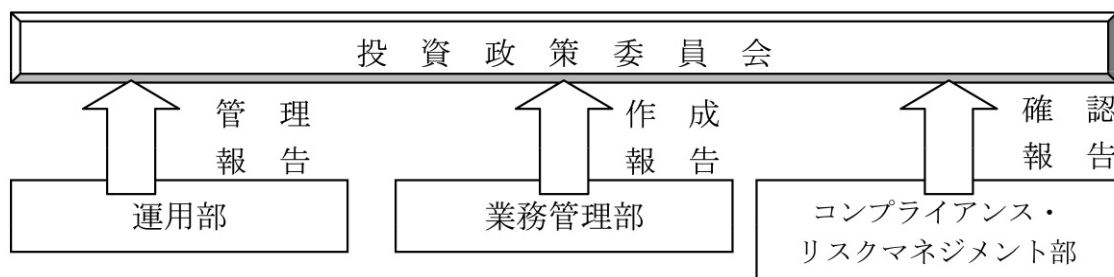
ファミリーファンド方式のリスク

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。

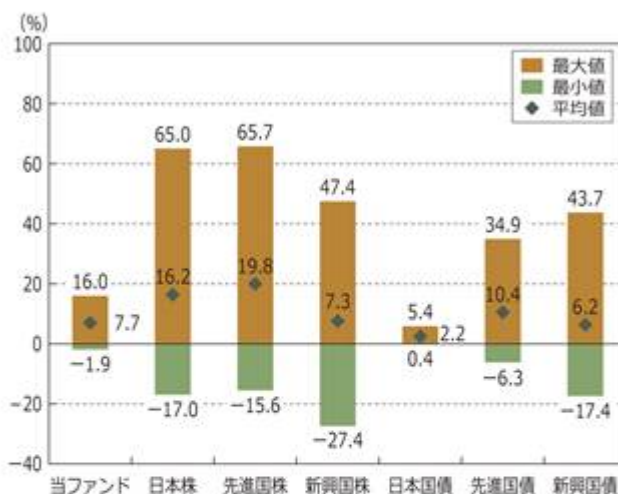
上記リスクに対する管理体制は平成28年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜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28年3月の3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23年4月～平成28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・ディバーシファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(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、購入申込日の翌営業日の基準価額に2.16%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。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。

詳細については販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

（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。

- ・日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とし、信託報酬率およびその配分については、下記の通りとします。

		報酬額（年率）	役務の内容
信託報酬率合計		0.810%（税抜0.75%）	
配 分	委託会社	0.648%（税抜0.60%）	委託した資金の運用の対価
	販売会社	0.108%（税抜0.10%）	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	0.054%（税抜0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

- ・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、その品賃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賃料の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

（5）【課税上の取扱い】

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

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、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。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等が追加されます。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間120万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および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、平成28年4月1日より、未成年者口座内の少額上場株式等にかかる配当所得および譲渡所得等の非課税措置（ジュニアNISA）が開始され、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万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および譲渡所得が5年間非課税となります。

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の場合は上記とは異なります。

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成28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	2,434,282,854	84.13
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		459,243,728	15.87
純資産総額		2,893,526,582	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

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

(平成28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	111,476,483,870	97.21
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		3,203,781,155	2.79
純資産総額		114,680,265,025	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

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

(平成28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	108,443,988,500	79.10
特殊債券	日本	11,717,531,673	8.54
地方債証券	日本	8,677,379,844	6.33
社債券	日本	7,976,699,900	5.82
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		285,046,450	0.21
純資産総額		137,100,646,367	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

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

(平成28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	80,897,429,428	58.22
	イギリス	10,068,575,402	7.25
	フランス	5,080,878,802	3.66
	ドイツ	4,814,175,558	3.47
	カナダ	4,798,328,273	3.45
	スイス	4,763,621,149	3.43
	オーストラリア	3,372,715,097	2.43
	香港	1,704,844,185	1.23
	スペイン	1,675,254,361	1.21
	オランダ	1,642,581,559	1.18
	スウェーデン	1,567,727,967	1.13
	イタリア	1,154,125,602	0.83
	デンマーク	1,047,933,068	0.75
	ベルギー	769,261,571	0.55
	シンガポール	682,592,514	0.49

	フィンランド	527,117,536	0.38
	イスラエル	373,850,559	0.27
	ノルウェー	317,586,427	0.23
	アイルランド	257,053,520	0.19
	オーストリア	101,499,457	0.07
	ニュージーランド	88,997,374	0.06
	ポルトガル	88,324,602	0.06
	小計	125,794,474,011	90.54
投資証券	アメリカ	2,660,912,354	1.92
	オーストラリア	340,156,766	0.25
	フランス	205,800,935	0.15
	イギリス	171,041,107	0.12
	シンガポール	60,251,119	0.04
	香港	58,308,843	0.04
	カナダ	33,028,803	0.02
	小計	3,529,499,927	2.54
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		9,621,306,582	6.92
純資産総額		138,945,280,520	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28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	68,394,140,371	41.99
	イタリア	16,010,348,807	9.83
	フランス	15,967,888,568	9.80
	イギリス	12,524,141,439	7.69
	ドイツ	12,172,715,251	7.47
	スペイン	8,909,493,561	5.47
	ベルギー	4,336,771,683	2.66
	オランダ	4,026,212,057	2.47
	カナダ	3,313,517,568	2.03
	オーストラリア	2,914,409,390	1.79
	オーストリア	2,536,275,872	1.56
	メキシコ	1,567,119,804	0.96
	アイルランド	1,334,797,341	0.82
	デンマーク	1,084,764,450	0.67
	ポーランド	974,620,064	0.60
	フィンランド	973,687,432	0.60
	スウェーデン	812,401,419	0.50
	マレーシア	777,485,141	0.48
	南アフリカ	690,336,704	0.42
		シンガポール	636,225,234
	ノルウェー	501,912,875	0.31
	スイス	398,286,649	0.25
	小計	160,857,551,680	98.76
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,016,748,784	1.24
純資産総額		162,874,300,464	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28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		1,165,481,769	1.2523	1,459,532,819	1.2720	1,482,492,810	51.24
2	日本	親投資 信託受 益証券	ステート・ストリート外 国株式インデックス・ オープン・マザーファン ド		348,830,019	1.8209	635,184,581	1.9613	684,160,316	23.64
3	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		61,405,248	2.2426	137,707,409	2.2785	139,911,857	4.84
4	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		61,059,364	1.9988	122,045,456	2.0917	127,717,871	4.41
									投資比率：合計	84.13

（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		84.13
合計		84.13

（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28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	696,300	6,094	4,242,994,275	5,952	4,144,377,600	3.61
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,433,500	553	2,450,659,509	522	2,312,070,250	2.02
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	427,100	4,737	2,022,963,772	4,848	2,070,580,800	1.81
4	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	370,900	4,619	1,713,269,955	4,690	1,739,521,000	1.52
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	561,300	2,882	1,617,545,564	3,006	1,687,267,800	1.47
6	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	313,100	5,757	1,802,462,445	5,366	1,680,094,600	1.47
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	503,800	3,159	1,591,517,922	3,086	1,554,726,800	1.36
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	442,500	3,613	1,598,903,624	3,412	1,509,810,000	1.32

9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	7,788,600	181	1,408,047,828	168	1,309,263,660	1.14
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	233,500	5,474	1,278,206,514	5,136	1,199,256,000	1.05
11	日本	株式	ソニー	電気機器	395,000	2,646	1,045,107,144	2,893	1,142,735,000	1.00
12	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	231,200	4,531	1,047,559,601	4,792	1,107,910,400	0.97
13	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	426,200	2,543	1,083,935,388	2,553	1,087,875,500	0.95
14	日本	株式	キヤノン	電気機器	301,400	3,334	1,004,951,119	3,355	1,011,197,000	0.88
15	日本	株式	ファナック	電気機器	57,300	17,807	1,020,344,513	17,485	1,001,890,500	0.87
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	50,100	19,415	972,689,486	19,905	997,240,500	0.87
17	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	102,400	9,879	1,011,609,971	9,713	994,611,200	0.87
18	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	656,600	1,576	1,034,711,964	1,497	982,601,900	0.86
19	日本	株式	花王	化学	157,700	5,684	896,358,905	6,003	946,673,100	0.83
20	日本	株式	三菱地所	不動産業	411,000	2,161	888,284,728	2,091	859,195,500	0.75
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	223,900	4,002	896,090,437	3,800	850,820,000	0.74
22	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	197,900	4,185	828,223,773	4,205	832,169,500	0.73
23	日本	株式	三井不動産	不動産業	293,000	2,756	807,466,754	2,808	822,744,000	0.72
24	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	785,900	1,116	876,962,304	1,042	818,514,850	0.71
25	日本	株式	村田製作所	電気機器	58,700	14,645	859,636,444	13,570	796,559,000	0.69
26	日本	株式	三菱商事	卸売業	414,700	2,056	852,530,118	1,906	790,418,200	0.69
27	日本	株式	キーエンス	電気機器	12,700	59,959	761,481,420	61,390	779,653,000	0.68
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	1,429,000	519	742,200,589	527	752,511,400	0.66
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	597,000	1,196	714,199,018	1,180	704,161,500	0.61
30	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	176,900	4,013	709,848,675	3,975	703,177,500	0.61
									投資比率：合計	32.46

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.30
	輸送用機器	9.55
	情報・通信業	7.93
	銀行業	7.19
	化学	5.95
	医薬品	5.49
	小売業	4.94
	食料品	4.92
	機械	4.51
	陸運業	4.50
	卸売業	4.09
	サービス業	3.73
	建設業	3.09
	不動産業	2.78
	保険業	2.25
	電気・ガス業	2.08
	精密機器	1.57
	その他製品	1.53
	その他金融業	1.36
	鉄鋼	1.16
証券、商品先物取引業	1.07	
ゴム製品	0.97	
ガラス・土石製品	0.85	
非鉄金属	0.80	

繊維製品	0.73
空運業	0.68
金属製品	0.64
石油・石炭製品	0.49
鉱業	0.29
パルプ・紙	0.25
海運業	0.22
倉庫・運輸関連業	0.20
水産・農林業	0.10
合計	97.21

（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) (2016年6月限)	大阪取引所	買建	241	3,250,918,168	3,247,475,000	2.83

（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28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340回利付 国債(10年)	0.400	2025/09/20	1,700,000,000	104.66	1,779,237,000	104.57	1,777,792,000	1.30
2	日本	国債 証券	第298回利付 国債(10年)	1.300	2018/12/20	1,600,000,000	104.24	1,667,872,000	104.16	1,666,576,000	1.22
3	日本	国債 証券	第297回利付 国債(10年)	1.400	2018/12/20	1,200,000,000	104.52	1,254,264,000	104.43	1,253,208,000	0.91
4	日本	国債 証券	第339回利付 国債(10年)	0.400	2025/06/20	1,150,000,000	104.68	1,203,866,000	104.55	1,202,336,500	0.88
5	日本	国債 証券	第304回利付 国債(10年)	1.300	2019/09/20	1,100,000,000	105.37	1,159,136,000	105.26	1,157,937,000	0.84
6	日本	国債 証券	第295回利付 国債(10年)	1.500	2018/06/20	1,100,000,000	103.93	1,143,263,000	103.82	1,142,031,000	0.83
7	日本	国債 証券	第313回利付 国債(10年)	1.300	2021/03/20	1,000,000,000	107.59	1,075,940,000	107.43	1,074,320,000	0.78
8	日本	国債 証券	第305回利付 国債(10年)	1.300	2019/12/20	1,000,000,000	105.73	1,057,380,000	105.64	1,056,490,000	0.77
9	日本	国債 証券	第302回利付 国債(10年)	1.400	2019/06/20	1,000,000,000	105.35	1,053,550,000	105.23	1,052,380,000	0.77
10	日本	国債 証券	第338回利付 国債(10年)	0.400	2025/03/20	1,000,000,000	104.69	1,046,990,000	104.56	1,045,670,000	0.76
11	日本	国債 証券	第293回利付 国債(10年)	1.800	2018/06/20	1,000,000,000	104.62	1,046,210,000	104.48	1,044,870,000	0.76

12	日本	国債証券	第337回利付 国債（10年）	0.300	2024/12/20	1,000,000,000	103.77	1,037,740,000	103.65	1,036,520,000	0.76
13	日本	国債証券	第109回利付 国債（5年）	0.100	2018/03/20	1,000,000,000	100.65	1,006,520,000	100.61	1,006,190,000	0.73
14	日本	国債証券	第330回利付 国債（10年）	0.800	2023/09/20	900,000,000	107.44	966,996,000	107.29	965,619,000	0.70
15	日本	国債証券	第314回利付 国債（10年）	1.100	2021/03/20	900,000,000	106.57	959,202,000	106.43	957,879,000	0.70
16	日本	国債証券	第334回利付 国債（10年）	0.600	2024/06/20	900,000,000	106.24	956,205,000	106.10	954,918,000	0.70
17	日本	国債証券	第307回利付 国債（10年）	1.300	2020/03/20	900,000,000	106.13	955,233,000	106.00	954,054,000	0.70
18	日本	国債証券	第332回利付 国債（10年）	0.600	2023/12/20	900,000,000	106.03	954,279,000	105.89	953,037,000	0.70
19	日本	国債証券	第310回利付 国債（10年）	1.000	2020/09/20	900,000,000	105.51	949,635,000	105.35	948,204,000	0.69
20	日本	国債証券	第115回利付 国債（5年）	0.200	2018/09/20	900,000,000	101.08	909,747,000	101.05	909,468,000	0.66
21	日本	国債証券	第57回利付 国債（20年）	1.900	2022/06/20	800,000,000	113.32	906,592,000	113.06	904,512,000	0.66
22	日本	国債証券	第145回利付 国債（20年）	1.700	2033/06/20	720,000,000	123.71	890,733,600	123.51	889,329,600	0.65
23	日本	国債証券	第312回利付 国債（10年）	1.200	2020/12/20	800,000,000	106.76	854,088,000	106.60	852,872,000	0.62
24	日本	国債証券	第306回利付 国債（10年）	1.400	2020/03/20	800,000,000	106.54	852,344,000	106.40	851,248,000	0.62
25	日本	国債証券	第309回利付 国債（10年）	1.100	2020/06/20	800,000,000	105.61	844,912,000	105.52	844,160,000	0.62
26	日本	国債証券	第335回利付 国債（10年）	0.500	2024/09/20	800,000,000	105.48	843,856,000	105.34	842,760,000	0.61
27	日本	国債証券	第146回利付 国債（20年）	1.700	2033/09/20	670,000,000	123.83	829,701,200	123.53	827,704,600	0.60
28	日本	国債証券	第289回利付 国債（10年）	1.500	2017/12/20	800,000,000	103.07	824,560,000	102.92	823,432,000	0.60
29	日本	国債証券	第288回利付 国債（10年）	1.700	2017/09/20	800,000,000	102.93	823,448,000	102.78	822,240,000	0.60
30	日本	国債証券	第2回利付 国債（40年）	2.200	2049/03/20	550,000,000	142.14	781,808,500	148.73	818,037,000	0.60
										投資比率：合計	22.34

（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(%)
国債証券		79.10
特殊債券		8.54
地方債証券		6.33
社債券		5.82
合計		99.79

（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28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	218,567	13,275	2,901,439,943	12,345	2,698,257,874	1.94
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	297,432	6,077	1,807,444,414	6,203	1,844,980,808	1.33
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	163,151	9,153	1,493,320,515	9,524	1,553,803,397	1.12
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	108,425	11,535	1,250,687,969	12,280	1,331,444,514	0.96
5	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	369,802	3,421	1,265,079,624	3,587	1,326,333,480	0.95
6	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	88,952	11,876	1,056,405,665	12,924	1,149,650,872	0.83
7	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	241,013	3,783	911,672,066	4,436	1,069,184,666	0.77
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	124,916	8,919	1,114,117,809	8,434	1,053,599,629	0.76
9	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	15,608	75,863	1,184,068,717	67,460	1,052,921,754	0.76
10	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	190,097	6,241	1,186,460,998	5,482	1,042,089,322	0.75
11	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	12,181	84,539	1,029,773,174	84,570	1,030,143,764	0.74
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	106,579	8,530	909,105,654	9,316	992,930,719	0.71
13	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	11,412	86,986	992,679,434	86,577	988,011,602	0.71
14	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	159,384	5,097	812,303,169	6,089	970,525,388	0.70
15	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	144,190	7,569	1,091,333,102	6,728	970,128,026	0.70
16	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	161,807	4,862	786,728,610	5,249	849,265,786	0.61
17	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	241,788	3,695	893,352,789	3,388	819,247,282	0.59
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	73,695	10,183	750,428,196	10,733	790,951,485	0.57
19	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	27,515	32,162	884,933,853	27,656	760,946,750	0.55
20	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	49,639	15,183	753,644,276	15,034	746,261,090	0.54
21	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	46,434	15,170	704,408,813	16,052	745,376,807	0.54
22	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	89,105	10,361	923,187,945	8,178	728,668,344	0.52
23	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア	61,486	12,973	797,648,556	11,145	685,272,463	0.49
24	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	184,728	3,883	717,290,104	3,686	680,863,590	0.49
25	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC- W/I	食品・飲料・タバコ	60,651	9,850	597,441,802	11,120	674,462,725	0.49
26	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	97,206	6,940	674,605,868	6,851	665,952,862	0.48
27	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	57,036	11,351	647,437,492	11,571	659,969,784	0.47

28	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	76,195	8,996	685,478,503	8,652	659,206,406	0.47
29	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	109,360	6,080	664,932,071	5,997	655,813,285	0.47
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	198,682	3,078	611,626,165	3,207	637,147,901	0.46
									投資比率：合計	21.47

(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28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	8.74
	ソフトウェア・サービス	8.17
	銀行	7.71
	資本財	6.85
	エネルギー	6.40
	食品・飲料・タバコ	6.13
	素材	4.24
	保険	3.92
	小売	3.72
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.63
	各種金融	3.55
	ヘルスケア機器・サービス	3.42
	公益事業	3.33
	電気通信サービス	3.22
	メディア	2.85
	家庭用品・パーソナル用品	2.18
	食品・生活必需品小売り	2.09
	半導体・半導体製造装置	1.94
	消費者サービス	1.82
	運輸	1.80
	耐久消費財・アパレル	1.77
自動車・自動車部品	1.53	
商業・専門サービス	0.89	
不動産	0.64	
	小計	90.54
投資証券		2.54
合計		93.08

(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28年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)

株価指数先物取引										
MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	547	54,981,532.50	56,209,720.00	6,333,711,249	4.56		
EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	325	9,820,235.17	9,646,000.00	1,231,794,200	0.89		
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	83	5,064,588.33	5,102,425.00	826,184,656	0.59		
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	49	3,854,527.70	3,779,860.00	441,260,856	0.32		
S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	28	4,420,014.00	4,417,840.00	383,424,333	0.28		
SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	33	4,197,600.00	4,119,225.00	355,283,156	0.26		

(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28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28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	2.000	2022/02/15	13,000,000	11,659	1,515,713,893	11,621	1,510,792,030	0.93
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2020/01/31	13,000,000	11,380	1,479,429,806	11,379	1,479,312,619	0.91
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/02/15	12,000,000	11,527	1,383,273,201	11,466	1,375,876,886	0.84
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/09/30	10,000,000	11,680	1,168,042,851	11,656	1,165,573,188	0.72
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	9,000,000	12,541	1,128,685,136	12,512	1,126,068,706	0.69
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2017/09/30	9,800,000	11,468	1,123,842,600	11,459	1,122,937,104	0.69
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	15,390	1,108,084,302	15,296	1,101,334,320	0.68
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	8,800,000	12,357	1,087,410,677	12,353	1,087,023,960	0.67
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/15	9,500,000	11,470	1,089,610,529	11,428	1,085,639,122	0.67
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2020/12/31	9,000,000	11,860	1,067,361,300	11,844	1,065,931,390	0.65
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2044/02/15	7,800,000	13,791	1,075,734,550	13,585	1,059,597,873	0.65
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2024/11/15	9,000,000	11,772	1,059,451,164	11,706	1,053,579,409	0.65
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2017/06/30	9,000,000	11,275	1,014,789,319	11,277	1,014,911,013	0.62
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	8,500,000	12,012	1,021,012,635	11,940	1,014,873,265	0.62
15	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT BOND	5.500	2017/07/30	7,400,000	13,773	1,019,176,994	13,711	1,014,634,475	0.62

16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2019/04/30	8,900,000	11,371	1,011,977,953	11,374	1,012,328,951	0.62
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2018/04/30	8,800,000	11,227	987,944,886	11,228	988,024,213	0.61
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	8,300,000	11,933	990,442,100	11,887	986,607,600	0.61
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/09/30	8,500,000	11,427	971,323,009	11,417	970,422,696	0.60
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	8,100,000	11,937	966,868,092	11,901	963,974,808	0.59
21	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	6.000	2025/10/25	4,800,000	19,483	935,176,062	19,632	942,346,315	0.58
22	イタリア	国債証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	5.000	2025/03/01	5,500,000	16,563	910,990,091	16,972	933,440,006	0.57
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2017/04/30	8,200,000	11,297	926,322,899	11,292	925,962,548	0.57
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2019/12/31	8,200,000	11,278	924,807,578	11,283	925,204,888	0.57
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2019/09/30	8,200,000	11,248	922,312,843	11,260	923,329,216	0.57
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/09/30	8,000,000	11,463	917,019,841	11,408	912,635,884	0.56
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	8,000,000	11,365	909,205,905	11,322	905,739,868	0.56
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	7,500,000	11,979	898,417,359	11,961	897,056,748	0.55
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2018/08/31	7,600,000	11,462	871,123,220	11,448	870,052,760	0.53
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	7,000,000	12,343	863,999,816	12,321	862,493,284	0.53
										投資比率：合計	19.23

(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28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		98.76
合計		98.76

(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28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28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 分配落： 1,616,135,543	分配付： 1.1583 分配落： 1.1533
第3期	（平成27年 2月20日）	分配付： 1,749,455,838 分配落： 1,726,925,712	分配付： 1.2424 分配落： 1.2264
第4期	（平成28年 2月22日）	分配付： 2,799,520,026 分配落： 2,783,188,603	分配付： 1.1999 分配落： 1.1929
平成27年 3月末日		2,062,778,208	1.2344
4月末日		2,075,542,413	1.2417
5月末日		2,101,877,471	1.2570
6月末日		2,083,380,565	1.2414
7月末日		2,106,111,099	1.2529
8月末日		2,189,467,621	1.2282
9月末日		2,175,270,688	1.2115
10月末日		2,763,783,101	1.2480
11月末日		2,810,624,016	1.2515
12月末日		2,842,246,922	1.2445
平成28年 1月末日		2,831,646,638	1.2201
2月末日		2,826,879,149	1.2023
3月末日		2,893,526,582	1.2258

【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
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	0.0070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%
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	2.2%

（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
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456

(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28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。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	12,258円
純資産総額	2,893百万円

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
第4期（平成28年2月22日）	70円
設定来累計	290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	51.24%	第340回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.400%	2025/09/20	1.30%
		第298回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.300%	2018/12/20	1.22%
		第297回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.400%	2018/12/20	0.91%
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	23.64%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	—	—	1.94%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	1.33%
		EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	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	4.84%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2022/02/15	0.93%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.375%	2020/01/31	0.91%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2025/02/15	0.84%
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	4.41%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.61%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.02%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	—	—	1.81%

※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28年は3月末までで算出しております。

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

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 1) お申込日が原則として米国もしくは英国の取引所 または銀行の休業日またはフランス及びドイツの両国の取引所または銀行の休業日に当たる場合を除き、営業時間内においていつでも、お申込日の翌営業日の基準価額にて申込取扱場所においてお申込みいただくことができます（信託約款第11条第3項）。この場合のお申込みの受付は、販売会社の毎営業日の午後3時までとし、この時間を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとさせていただきます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」といいます。以下同じとします。

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

2【換金（解約）手続等】

- 1) 委託会社は、受益権の買戻しを行いません。ただし、受益者（販売会社を含みます。以下同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口以上1口単位をもって委託会社に対して一部解約の実行を請求することができます。なお、1億円または1億口を超える大口の解約請求には、制限を設けることがあります（信託約款第45条第1項）。一部解約の請求の受付は、営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 2) 受益者が、上記1)の一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。（信託約款第45条第2項）。
- 3) 上記1)の規定にかかわらず、解約請求日が米国もしくは英国の取引所（または銀行の休業日、またはフランスおよびドイツの両国の取引所または銀行の休業日の場合は、原則として受益権の一部解約の実行を受け付けないものとします。（信託約款第45条第3項）。
- 4) 委託会社は、一部解約の申込みを受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、上記1)の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます（信託約款第44条第4項）。一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目に当該受益者に支払います（信託約款第42条第4項）。
- 5) 上記4)の一部解約の価額は、解約請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- 6) 委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天

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

- 7) 上記5)の規定により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記5)の規定に準じて計算された価額とします(信託約款第45条第7項)。
- 8) 解約価額は、販売会社又は委託会社においてご確認いただけます。ご照会方法の詳細については、3(1)3)をご参照ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

1) 基準価額の算出方法

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

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。ただし、上場している場合は、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。
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。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値) 証券会社、銀行等の提示する価額 価格情報会社の提供する価額
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。

外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の終値等で評価します。

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：www.ssga.com

（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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- （ニ）上記（ハ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- （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發します。

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

- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行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ます。）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4期計算期間(平成27年2月21日から平成28年2月22日まで)の財務諸表について、PwC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3期 (平成27年 2月20日現在)	第4期 (平成28年 2月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	446,357,532
コール・ローン	93,793,137	9,721,414
親投資信託受益証券	1,662,745,169	2,354,470,265
未収利息	25	-
流動資産合計	1,756,538,331	2,810,549,211
資産合計		
	1,756,538,331	2,810,549,211
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,530,126	16,331,423
未払受託者報酬	465,962	725,617
未払委託者報酬	6,523,401	10,158,509
その他未払費用	93,130	145,059
流動負債合計	29,612,619	27,360,608
負債合計		
	29,612,619	27,360,608
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,408,132,937	1 2,333,060,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	318,792,775	450,128,147
(分配準備積立金)	144,921,361	146,021,951
元本等合計	1,726,925,712	2,783,188,603
純資産合計		
	1,726,925,712	2,783,188,603
負債純資産合計		
	1,756,538,331	2,810,549,211

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第3期	第4期
	自 平成26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22日
営業収益		
受取利息	19,832	33,097
有価証券売買等損益	139,097,900	42,274,904
営業収益合計	139,117,732	42,241,807
営業費用		
受託者報酬	901,610	1,283,627
委託者報酬	12,622,454	17,970,548
その他費用	178,282	256,597
営業費用合計	13,702,346	19,510,772
営業利益又は営業損失（ ）	125,415,386	61,752,579
経常利益又は経常損失（ ）	125,415,386	61,752,579
当期純利益又は当期純損失（ ）	125,415,386	61,752,579
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	95,202	28,914
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	214,833,148	318,792,775
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,019,352	210,994,082
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,019,352	210,994,082
剰余金減少額又は欠損金増加額	849,783	1,603,622
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	849,783	1,603,622
分配金	1 22,530,126	1 16,331,423
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	318,792,775	450,128,147

(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。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成28年2月20日が休日のため、当計算期間は平成27年2月21日から平成28年2月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期 (平成27年 2月20日現在)	第4期 (平成28年 2月22日現在)
1 期首元本額	1,401,302,395円	1,408,132,937円
期中追加設定元本額	12,384,800円	932,006,609円
期中一部解約元本額	5,554,258円	7,079,090円
2 受益権の総数	1,408,132,937口	2,333,060,456口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期 自 平成26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	第4期 自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,936,376円)、収益調整金(304,106,196円)及び分配準備積立金(144,416,998円)より分配対象収益は466,459,570円(1万口当たり1,999円)であり、うち16,331,423円(1万口当たり70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3期 (平成27年 2月20日現在)	第4期 (平成28年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
---------------------------	---	----

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第3期 (平成27年 2月20日現在)	第4期 (平成28年 2月22日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	92,007,992	53,121,023
合計	92,007,992	53,121,023

(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3期 自 平成26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	第4期 自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22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3期 (平成27年 2月20日現在)	第4期 (平成28年 2月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2264円 (12,264円)	1.1929円 (11,929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・ストリート外国債券イン デックス・マザー・ファンド	61,405,248	137,707,409	
	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	61,059,364	122,045,456	
	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	348,830,019	635,184,581	
	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	1,165,481,769	1,459,532,819	
合計		1,636,776,400	2,354,470,265	

(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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託			1,692,250,530
コール・ローン		1,475,902,143	36,856,257
株式	3	133,690,943,760	93,167,451,910
派生商品評価勘定		82,240,160	9,000,376
未収入金		2,553,374,683	4,474,400
未収配当金		207,948,755	154,837,548
未収利息		404	1
前払金			157,245,000
差入委託証拠金			136,290,000
流動資産合計		138,010,409,905	95,358,406,022
資産合計		138,010,409,905	95,358,406,022
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			161,084,520
未払金			1,416,296
前受金		86,575,000	
未払解約金		1,091,327,000	5,748,000
流動負債合計		1,177,902,000	168,248,816
負債合計		1,177,902,000	168,248,816
純資産の部			
元本等			
元本	1	60,470,886,080	47,624,700,839
剰余金			
剰余金又は欠損金()		76,361,621,825	47,565,456,367
元本等合計		136,832,507,905	95,190,157,206
純資産合計		136,832,507,905	95,190,157,206

負債純資産合計		138,010,409,905	95,358,406,022
---------	--	-----------------	----------------

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1 期首元本額	69,146,165,476円	60,470,886,080円
期中追加設定元本額	40,968,810,894円	7,869,377,988円
期中一部解約元本額	49,644,090,290円	20,715,563,229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)	124,438,144円	61,059,364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>	1,041,732,440円	937,009,211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>	52,324,915円	28,579,358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>	3,159,016,695円	1,789,754,811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>	587,476円	565,745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 >	33,623,735円	25,497,391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 >	29,285,122円	22,517,384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 >	14,357,462,727円	11,636,116,633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>	900,200,315円	733,518,232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 >	84,152,580円	49,046,960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 >	3,580,362,450円	2,416,238,945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>	1,485,955,474円	1,256,363,868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 >	134,746,496円	102,941,007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>	625,607,439円	866,852,830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>	12,934,042,604円	9,925,735,568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>	258,403,232円	122,551,245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>	2,465,118,299円	1,057,553,586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>	773,992,743円	313,473,073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 >	4,126,883,209円	3,494,104,159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 >	517,338,199円	359,065,869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>	1,381,184,988円	1,136,069,732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>	5,465,618,307円	5,230,105,025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>	26,724,751円	24,102,902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>	30,585,434円	25,517,267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>	22,649,894円	11,657,497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>	1,037,519,282円	916,512,893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>	13,554,041円	7,244,638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>	17,008,923円	16,615,843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>	261,908円	259,894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>	55,449,381円	49,862,802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>	2,061,794,013円	1,545,606,479円
4資産インデックスバ ランスVA20<適格機関投資家限定>	652,388,567円	557,823,373円
ステート・ストリート世界分散フ ォンドVA25A<適格機関投資家限 定>	2,931,604,384円	2,563,860,098円
Tadリスクバ ジエツト型マルチ配 分戦略ファンド(ステイブル)年金 <適格機関投資家限定>	83,815,091円	228,382,598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>	5,452,822円	円
フレックス資産配分戦略ファンド< 適格機関投資家限定>	円	49,292,823円
Tadリスクバ ジエツト型マルチ配 分戦略ファンド(ステイブル)<適 格機関投資家限定>	円	63,241,736円
計	60,470,886,080円	47,624,700,839円
2 受益権の総数	60,470,886,080口	47,624,700,839口
3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託 証拠金代用有価証券として 以下の通り、差入れを行っ ております。 株式 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	<p>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。</p>
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	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(平成27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	<p>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。</p>	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	<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>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>	<p>(3)デリバティブ取引 同左</p> <p>同左</p>
---------------------------	--	-------------------------------------

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(平成27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22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	20,704,385,073	15,921,436,541
合計	20,704,385,073	15,921,436,541

(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

(単位：円)

区 分	種 類	(平成28年 2月22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	2,137,925,000		1,985,940,000	151,985,000

合 計	2,137,925,000	1,985,940,000	151,985,000
-----	---------------	---------------	-------------

(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26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2628円 (22,628円)	1.9988円 (19,988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	140,300	1,137.50	159,591,250	
極洋	23,000	262.00	6,026,000	
日本水産	62,400	546.00	34,070,400	
マル八ニチロ	10,900	2,236.00	24,372,400	
ハウスイ	6,000	109.00	654,000	
サカタのタネ	8,700	2,755.00	23,968,500	
ホクト	5,500	2,023.00	11,126,500	
ショーボンドホールディングス	5,700	3,840.00	21,888,000	
ミライト・ホールディングス	16,600	795.00	13,197,000	
タマホーム	4,400	418.00	1,839,200	
サンヨーホームズ	600	500.00	300,000	
住石ホールディングス	17,800	93.00	1,655,400	
日鉄鉱業	16,000	410.00	6,560,000	
三井松島産業	35,000	118.00	4,130,000	
国際石油開発帝石	285,900	824.90	235,838,910	
日本海洋掘削	1,600	2,029.00	3,246,400	
石油資源開発	8,600	2,544.00	21,878,400	
K&Oエナジーグループ	3,900	1,225.00	4,777,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	1,037.00	1,659,200	
安藤・間	36,000	518.00	18,648,000	
東急建設	17,500	823.00	14,402,500	
コムシスホールディングス	23,300	1,698.00	39,563,400	
ミサワホーム	6,300	660.00	4,158,000	
高松コンストラクショングループ	4,000	2,147.00	8,588,000	
東建コーポレーション	2,200	8,570.00	18,854,000	
ヤマウラ	2,900	453.00	1,313,700	
大成建設	282,000	692.00	195,144,000	

大林組	162,700	989.00	160,910,300
清水建設	166,000	865.00	143,590,000
飛鳥建設	40,600	154.00	6,252,400
長谷工コーポレーション	63,300	946.00	59,881,800
松井建設	5,800	667.00	3,868,600
銭高組	8,000	442.00	3,536,000
鹿島建設	254,000	644.00	163,576,000
不動テトラ	39,800	114.00	4,537,200
大末建設	2,500	737.00	1,842,500
鉄建建設	33,000	257.00	8,481,000
西松建設	62,000	429.00	26,598,000
三井住友建設	207,000	92.00	19,044,000
大豊建設	19,000	426.00	8,094,000
前田建設工業	33,000	751.00	24,783,000
佐田建設	4,600	403.00	1,853,800
ナカノフドー建設	4,700	526.00	2,472,200
奥村組	51,000	556.00	28,356,000
東鉄工業	6,500	3,030.00	19,695,000
イチケン	7,000	298.00	2,086,000
浅沼組	17,000	227.00	3,859,000
戸田建設	63,000	455.00	28,665,000
熊谷組	79,000	296.00	23,384,000
青木あすなる建設	4,000	664.00	2,656,000
北野建設	12,000	267.00	3,204,000
植木組	8,000	214.00	1,712,000
三井ホーム	7,000	506.00	3,542,000
矢作建設工業	7,300	731.00	5,336,300
ピーエス三菱	7,100	419.00	2,974,900
日本ハウスホールディングス	10,800	399.00	4,309,200
大東建託	20,300	15,190.00	308,357,000
新日本建設	6,300	520.00	3,276,000
N I P P O	13,000	1,689.00	21,957,000
東亜道路工業	10,000	350.00	3,500,000
前田道路	17,000	1,717.00	29,189,000
日本道路	16,000	556.00	8,896,000
東亜建設工業	45,000	243.00	10,935,000
若築建設	30,000	115.00	3,450,000
東洋建設	16,800	417.00	7,005,600
五洋建設	60,000	468.00	28,080,000
大林道路	6,200	731.00	4,532,200
世紀東急工業	8,800	467.00	4,109,600
福田組	9,000	912.00	8,208,000
日本ドライケミカル	800	2,080.00	1,664,000
住友林業	37,300	1,274.00	47,520,200
日本基礎技術	6,900	447.00	3,084,300
日成ビルド工業	15,000	369.00	5,535,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	28,000	68.00	1,904,000
巴コーポレーション	7,800	373.00	2,909,400
パナホーム	20,000	823.00	16,460,000
大和ハウス工業	160,400	3,064.00	491,465,600
ライト工業	9,700	1,096.00	10,631,200
積水ハウス	181,500	1,803.50	327,335,250
日特建設	6,200	398.00	2,467,600
北陸電気工事	2,000	765.00	1,530,000
ユアテック	8,000	787.00	6,296,000
西部電気工業	5,000	410.00	2,050,000
四電工	5,000	370.00	1,850,000
中電工	7,800	2,341.00	18,259,800
関電工	21,000	839.00	17,619,000
きんでん	32,800	1,449.00	47,527,200
東京エネシス	6,000	873.00	5,238,000

トーエネック	8,000	679.00	5,432,000	
住友電設	4,200	1,333.00	5,598,600	
日本電設工業	8,800	2,136.00	18,796,800	
協和エクシオ	21,200	1,261.00	26,733,200	
新日本空調	4,500	961.00	4,324,500	
日本工営	17,000	360.00	6,120,000	
N D S	9,000	282.00	2,538,000	
九電工	10,000	2,244.00	22,440,000	
三機工業	12,000	937.00	11,244,000	
日揮	55,000	1,710.00	94,050,000	
中外炉工業	16,000	176.00	2,816,000	
ヤマト	4,600	429.00	1,973,400	
太平電業	8,000	890.00	7,120,000	
高砂熱学工業	16,100	1,528.00	24,600,800	
三晃金属工業	6,000	265.00	1,590,000	
N E C ネットエスアイ	5,900	1,736.00	10,242,400	
朝日工業社	7,000	447.00	3,129,000	
明星工業	10,200	412.00	4,202,400	
大気社	6,600	2,538.00	16,750,800	
ダイダン	7,000	754.00	5,278,000	
日比谷総合設備	6,500	1,631.00	10,601,500	
東芝プラントシステム	8,700	1,261.00	10,970,700	
日本製粉	36,000	805.00	28,980,000	
日清製粉グループ本社	59,500	1,871.00	111,324,500	
日東富士製粉	5,000	353.00	1,765,000	
昭和産業	23,000	452.00	10,396,000	
鳥越製粉	4,600	639.00	2,939,400	
中部飼料	4,900	793.00	3,885,700	
フィード・ワン	36,100	117.00	4,223,700	
東洋精糖	9,000	101.00	909,000	
日本甜菜製糖	29,000	187.00	5,423,000	
三井製糖	21,000	480.00	10,080,000	
塩水港精糖	6,800	230.00	1,564,000	
日新製糖	800	4,325.00	3,460,000	
ネクスト	13,300	1,030.00	13,699,000	
ジェイエイシーリクルートメント	2,600	1,074.00	2,792,400	
日本M&Aセンター	7,800	5,110.00	39,858,000	
ノバレーゼ	1,500	826.00	1,239,000	
アコーディア・ゴルフ	13,900	1,098.00	15,262,200	
中広	500	670.00	335,000	
タケエイ	4,600	727.00	3,344,200	
トラスト・テック	1,000	2,388.00	2,388,000	
パソナグループ	4,000	632.00	2,528,000	
C D S	1,000	849.00	849,000	
リンクアンドモチベーション	13,100	117.00	1,532,700	
G C A サヴィアン	4,500	877.00	3,946,500	
エス・エム・エス	6,300	1,802.00	11,352,600	
テンプホールディングス	35,400	1,458.00	51,613,200	
リニカル	3,200	1,552.00	4,966,400	
クックパッド	11,200	2,016.00	22,579,200	
エスクリ	2,000	570.00	1,140,000	
アイ・ケイ・ケイ	2,800	639.00	1,789,200	
森永製菓	49,000	642.00	31,458,000	
中村屋	12,000	463.00	5,556,000	
江崎グリコ	12,500	6,060.00	75,750,000	
名糖産業	2,300	1,300.00	2,990,000	
不二家	31,000	190.00	5,890,000	
山崎製パン	40,000	2,155.00	86,200,000	
第一屋製パン	10,000	103.00	1,030,000	
モロゾフ	9,000	421.00	3,789,000	
亀田製菓	3,000	4,300.00	12,900,000	

寿スピリッツ	1,300	5,470.00	7,111,000
カルビー	20,100	4,645.00	93,364,500
森永乳業	49,000	536.00	26,264,000
六甲バター	2,600	1,791.00	4,656,600
ヤクルト本社	29,100	5,560.00	161,796,000
明治ホールディングス	32,200	9,330.00	300,426,000
雪印メグミルク	12,700	2,719.00	34,531,300
プリマハム	35,000	278.00	9,730,000
日本ハム	40,000	2,538.00	101,520,000
伊藤ハム	26,000	706.00	18,356,000
林兼産業	19,000	93.00	1,767,000
丸大食品	28,000	422.00	11,816,000
米久	1,900	2,566.00	4,875,400
S Foods	3,400	2,149.00	7,306,600
学情	2,000	1,019.00	2,038,000
スタジオアリス	2,300	2,232.00	5,133,600
シミックホールディングス	2,400	1,558.00	3,739,200
システナ	4,600	1,515.00	6,969,000
N J S	1,300	1,154.00	1,500,200
デジタルアーツ	2,400	1,936.00	4,646,400
新日鉄住金ソリューションズ	7,900	1,969.00	15,555,100
総合警備保障	16,900	5,790.00	97,851,000
キューブシステム	2,600	501.00	1,302,600
いちごグループホールディングス	39,400	361.00	14,223,400
日本駐車場開発	51,400	119.00	6,116,600
コア	2,100	1,316.00	2,763,600
カカクコム	36,700	1,978.00	72,592,600
アイロムグループ	1,600	748.00	1,196,800
ルネサンス	2,900	1,205.00	3,494,500
ディップ	5,600	2,179.00	12,202,400
S B Sホールディングス	5,300	646.00	3,423,800
オプトホールディング	3,000	587.00	1,761,000
新日本科学	5,900	365.00	2,153,500
ツクイ	5,900	1,337.00	7,888,300
キャリアデザインセンター	1,500	829.00	1,243,500
エムスリー	43,800	2,699.00	118,216,200
ツカダ・グローバルホールディング	3,900	673.00	2,624,700
アウトソーシング	2,500	2,905.00	7,262,500
ウェルネット	1,700	3,145.00	5,346,500
ディー・エヌ・エー	22,600	1,745.00	39,437,000
博報堂D Yホールディングス	70,100	1,261.00	88,396,100
ぐるなび	5,800	2,515.00	14,587,000
エスアールジータカミヤ	4,300	318.00	1,367,400
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	238.00	1,190,000
ファンコミュニケーションズ	11,500	652.00	7,498,000
ジェイコムホールディングス	1,400	2,017.00	2,823,800
W D Bホールディングス	2,100	872.00	1,831,200
ティア	2,700	625.00	1,687,500
バリューコマース	4,700	342.00	1,607,400
インフォマート	7,200	958.00	6,897,600
サッポロホールディングス	83,000	549.00	45,567,000
アサヒグループホールディングス	101,800	3,497.00	355,994,600
麒麟ホールディングス	220,000	1,499.00	329,780,000
宝ホールディングス	39,200	821.00	32,183,200
オエノンホールディングス	14,000	205.00	2,870,000
養命酒製造	1,600	1,915.00	3,064,000
コカ・コーラウエスト	18,300	2,598.00	47,543,400
コカ・コーライーストジャパン	19,200	2,052.00	39,398,400
サントリー食品インターナショナル	37,000	4,990.00	184,630,000
ダイドードリンコ	2,700	5,120.00	13,824,000
伊藤園	16,100	3,245.00	52,244,500

キーコーヒー	4,700	1,801.00	8,464,700
ユニカフェ	1,600	922.00	1,475,200
ジャパンフーズ	800	1,127.00	901,600
日清オイリオグループ	29,000	454.00	13,166,000
不二製油グループ本社	14,400	1,949.00	28,065,600
かどや製油	600	2,798.00	1,678,800
J・オイルミルズ	22,000	340.00	7,480,000
ローソン	18,100	9,170.00	165,977,000
サンエー	3,200	4,805.00	15,376,000
ダイユーエイト	1,100	705.00	775,500
カワチ薬品	3,700	1,936.00	7,163,200
エービーシー・マート	6,100	6,760.00	41,236,000
ハードオフコーポレーション	2,500	1,631.00	4,077,500
高千穂交易	1,900	871.00	1,654,900
アスクル	5,800	3,415.00	19,807,000
ゲオホールディングス	9,000	1,683.00	15,147,000
アダストリア	4,400	5,920.00	26,048,000
ジーフット	3,100	850.00	2,635,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	8,000	83.00	664,000
伊藤忠食品	1,200	4,185.00	5,022,000
くらコーポレーション	2,800	5,200.00	14,560,000
キャンドウ	2,800	1,460.00	4,088,000
エレマテック	2,400	2,149.00	5,157,600
パル	2,700	2,551.00	6,887,700
JALUX	1,500	2,047.00	3,070,500
エディオン	20,100	856.00	17,205,600
あらた	2,300	2,170.00	4,991,000
サーラコーポレーション	4,500	583.00	2,623,500
ワッツ	2,100	781.00	1,640,100
トーマンデバイス	800	1,723.00	1,378,400
ハローズ	1,500	2,657.00	3,985,500
J Pホールディングス	12,200	258.00	3,147,600
あみやき亭	900	4,325.00	3,892,500
東京エレクトロン デバイス	1,100	1,503.00	1,653,300
ひらまつ	6,400	653.00	4,179,200
フィールズ	3,100	1,733.00	5,372,300
双日	300,900	225.00	67,702,500
ゲンキー	1,000	2,802.00	2,802,000
アルフレッサ ホールディングス	60,100	1,995.00	119,899,500
サッポロドラッグストア	400	2,030.00	812,000
大黒天物産	1,100	4,710.00	5,181,000
ハニーズ	4,100	1,212.00	4,969,200
ファーマライズホールディングス	800	493.00	394,400
キッコーマン	41,000	3,810.00	156,210,000
味の素	116,000	2,880.50	334,138,000
キュービー	27,600	2,554.00	70,490,400
ハウス食品グループ本社	18,500	2,205.00	40,792,500
カゴメ	19,400	2,139.00	41,496,600
焼津水産化学工業	2,500	1,005.00	2,512,500
アリアケジャパン	4,400	6,380.00	28,072,000
ピエトロ	500	1,846.00	923,000
エバラ食品工業	1,100	1,947.00	2,141,700
ニチレイ	58,000	887.00	51,446,000
横浜冷凍	11,700	1,021.00	11,945,700
東洋水産	26,700	4,165.00	111,205,500
イトアンド	800	2,274.00	1,819,200
日清食品ホールディングス	23,000	5,410.00	124,430,000
永谷園ホールディングス	5,000	1,038.00	5,190,000
一正蒲鉾	2,100	863.00	1,812,300
フジッコ	5,200	2,199.00	11,434,800
ロック・フィールド	2,800	2,996.00	8,388,800

日本たばこ産業	321,000	4,542.00	1,457,982,000
ケンコーマヨネーズ	1,900	2,318.00	4,404,200
わらべや日洋	3,100	2,354.00	7,297,400
なとり	2,700	1,592.00	4,298,400
北の達人コーポレーション	800	522.00	417,600
ユーグレナ	18,500	1,521.00	28,138,500
片倉工業	6,300	1,181.00	7,440,300
グンゼ	41,000	286.00	11,726,000
ヒューリック	99,600	989.00	98,504,400
神栄	9,000	110.00	990,000
山下医科器械	400	1,593.00	637,200
ラサ商事	2,200	600.00	1,320,000
アルペン	4,200	1,777.00	7,463,400
クオール	5,100	1,423.00	7,257,300
アルコニックス	2,600	1,432.00	3,723,200
神戸物産	3,100	2,374.00	7,359,400
ジェイアイエヌ	3,200	4,745.00	15,184,000
ビックカメラ	24,600	889.00	21,869,400
D C Mホールディングス	23,400	840.00	19,656,000
MonotaRO	16,800	2,412.00	40,521,600
東京一番フーズ	700	516.00	361,200
ダイヤモンドダイニング	700	1,120.00	784,000
あいホールディングス	8,500	2,793.00	23,740,500
ディービーエックス	1,600	1,038.00	1,660,800
きちり	1,200	650.00	780,000
アークランドサービス	1,500	2,857.00	4,285,500
J.フロントリテイリング	60,400	1,337.00	80,754,800
ドトール・日レスホールディングス	8,300	1,798.00	14,923,400
マツモトキヨシホールディングス	9,800	5,180.00	50,764,000
broncoビリー	2,000	2,661.00	5,322,000
スタートトゥデイ	14,900	3,390.00	50,511,000
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,197.00	1,436,400
物語コーポレーション	1,300	5,220.00	6,786,000
ココカラファイン	5,000	4,385.00	21,925,000
三越伊勢丹ホールディングス	95,000	1,315.00	124,925,000
東洋紡	200,000	157.00	31,400,000
ユニチカ	146,000	51.00	7,446,000
富士紡ホールディングス	24,000	204.00	4,896,000
日清紡ホールディングス	26,800	1,110.00	29,748,000
倉敷紡績	51,000	175.00	8,925,000
ダイワボウホールディングス	43,000	200.00	8,600,000
シキボウ	31,000	107.00	3,317,000
日東紡績	33,000	363.00	11,979,000
トヨタ紡織	16,900	1,763.00	29,794,700
マクニカ・富士エレホールディングス	8,400	1,326.00	11,138,400
ウエルシアホールディングス	4,100	5,610.00	23,001,000
クリエイトSDホールディングス	7,000	2,418.00	16,926,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	8,200	957.00	7,847,400
八洲電機	4,500	519.00	2,335,500
UKCホールディングス	3,000	2,065.00	6,195,000
丸善CHIホールディングス	6,800	331.00	2,250,800
OCHIホールディングス	1,400	1,007.00	1,409,800
TOKAIホールディングス	20,800	567.00	11,793,600
ミサワ	500	496.00	248,000
エー・ピーカンパニー	800	1,147.00	917,600
三洋貿易	3,000	1,290.00	3,870,000
チムニー	1,300	2,715.00	3,529,500
シュッピン	1,400	1,011.00	1,415,400
ウイン・パートナーズ	1,800	1,449.00	2,608,200
ネクステージ	400	547.00	218,800
ジョイフル本田	7,800	2,210.00	17,238,000

キリン堂ホールディングス	1,500	1,007.00	1,510,500
ホットランド	1,400	1,040.00	1,456,000
すかいらく	14,500	1,500.00	21,750,000
綿半ホールディングス	1,300	1,325.00	1,722,500
日本毛織	16,000	741.00	11,856,000
大東紡織	12,000	57.00	684,000
トーア紡コーポレーション	2,700	462.00	1,247,400
ダイドーリミテッド	5,500	467.00	2,568,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	16,000	946.00	15,136,000
三栄建築設計	2,100	1,200.00	2,520,000
野村不動産ホールディングス	31,700	1,979.00	62,734,300
三重交通グループホールディングス	8,300	441.00	3,660,300
サムティ	2,600	1,029.00	2,675,400
ディア・ライフ	2,600	304.00	790,400
エー・ディー・ワークス	33,100	44.00	1,456,400
日本商業開発	1,800	1,747.00	3,144,600
プレサンスコーポレーション	1,600	3,545.00	5,672,000
ユニゾホールディングス	2,900	3,920.00	11,368,000
サンセイランディック	1,400	848.00	1,187,200
エストラスト	600	617.00	370,200
フージャースホールディングス	7,300	427.00	3,117,100
オープンハウス	6,700	2,106.00	14,110,200
東急不動産ホールディングス	115,600	707.00	81,729,200
飯田グループホールディングス	44,700	2,052.00	91,724,400
帝国繊維	5,200	1,474.00	7,664,800
ブックオフコーポレーション	2,600	905.00	2,353,000
日本コークス工業	42,200	76.00	3,207,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,100	692.00	761,200
ミタチ産業	1,200	614.00	736,800
あさひ	3,500	1,301.00	4,553,500
日本調剤	1,300	3,605.00	4,686,500
コスモス薬品	2,400	16,660.00	39,984,000
シップヘルスケアホールディングス	9,700	2,791.00	27,072,700
トーエル	2,900	700.00	2,030,000
一六堂	1,200	332.00	398,400
ソフトクリエイティブホールディングス	1,700	772.00	1,312,400
セブン&アイ・ホールディングス	200,000	4,556.00	911,200,000
薬王堂	800	2,582.00	2,065,600
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	4,200	2,945.00	12,369,000
明治電機工業	1,500	1,026.00	1,539,000
ツルハホールディングス	11,000	9,520.00	104,720,000
デリカフーズ	1,100	953.00	1,048,300
スターティア	1,000	523.00	523,000
サンマルクホールディングス	3,700	2,896.00	10,715,200
フェリシモ	1,500	983.00	1,474,500
トリドール	5,700	2,252.00	12,836,400
クスリのアオキ	4,300	4,890.00	21,027,000
帝人	207,000	379.00	78,453,000
東レ	368,000	913.80	336,278,400
クラレ	80,000	1,239.00	99,120,000
旭化成	316,000	656.10	207,327,600
サカイオーベックス	13,000	168.00	2,184,000
稲葉製作所	2,700	1,158.00	3,126,600
宮地エンジニアリンググループ	15,000	138.00	2,070,000
トーカロ	3,600	1,884.00	6,782,400
アルファC o	2,000	1,060.00	2,120,000
SUMCO	39,600	763.00	30,214,800
川田テクノロジーズ	900	3,150.00	2,835,000
住江織物	14,000	286.00	4,004,000
日本フェルト	3,100	454.00	1,407,400

イチカワ	3,000	271.00	813,000	
エコナックホールディングス	18,000	49.00	882,000	
日東製網	7,000	128.00	896,000	
芦森工業	13,000	149.00	1,937,000	
アツギ	41,000	109.00	4,469,000	
ダイニック	11,000	151.00	1,661,000	
共和レザー	3,700	826.00	3,056,200	
セーレン	12,600	1,064.00	13,406,400	
東海染工	8,000	117.00	936,000	
小松精練	8,200	578.00	4,739,600	
ワコールホールディングス	30,000	1,311.00	39,330,000	
ホギメディカル	3,200	5,540.00	17,728,000	
レナウン	14,200	102.00	1,448,400	
クラウディア	1,300	485.00	630,500	
T S Iホールディングス	22,500	729.00	16,402,500	
I Tホールディングス	15,800	2,511.00	39,673,800	
ネオス	1,300	430.00	559,000	
電算システム	1,900	1,528.00	2,903,200	
グリー	28,800	541.00	15,580,800	
コーエーテクモホールディングス	11,300	1,679.00	18,972,700	
三菱総合研究所	1,800	3,480.00	6,264,000	
ボルテージ	900	1,354.00	1,218,600	
電算	600	2,395.00	1,437,000	
A G S	1,000	815.00	815,000	
ファインデックス	3,400	1,014.00	3,447,600	
ヒト・コミュニケーションズ	1,200	1,732.00	2,078,400	
ブレインパッド	300	659.00	197,700	
K L a b	7,200	494.00	3,556,800	
ポルトゥワイン・ピットクルーホールディングス	2,700	970.00	2,619,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,200	503.00	603,600	
ネクソン	45,600	1,661.00	75,741,600	
アイスタイル	7,600	778.00	5,912,800	
エムアップ	1,400	476.00	666,400	
エイチーム	1,900	1,431.00	2,718,900	
テクノスジャパン	600	2,600.00	1,560,000	
e n i s h	1,500	489.00	733,500	
コロブラ	13,100	1,979.00	25,924,900	
モバイルクリエイト	3,000	399.00	1,197,000	
オルトプラス	1,100	413.00	454,300	
ブロードリーフ	4,500	1,280.00	5,760,000	
ハーツユナイテッドグループ	1,500	1,915.00	2,872,500	
ブイキューブ	2,400	1,287.00	3,088,800	
サイバーリンクス	500	759.00	379,500	
VOYAGE GROUP	1,200	1,076.00	1,291,200	
オプティム	300	4,210.00	1,263,000	
特種東海製紙	29,000	368.00	10,672,000	
ベリサーブ	500	2,214.00	1,107,000	
ティーガイア	4,700	1,204.00	5,658,800	
日本アジアグループ	4,400	508.00	2,235,200	
豆蔵ホールディングス	3,800	645.00	2,451,000	
テクマトリックス	2,000	1,486.00	2,972,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	83,200	284.00	23,628,800	
GMOペイメントゲートウェイ	4,100	6,110.00	25,051,000	
ザッパラス	3,100	392.00	1,215,200	
インターネットイニシアティブ	7,700	2,168.00	16,693,600	
さくらインターネット	2,500	1,784.00	4,460,000	
GMOクラウド	1,200	684.00	820,800	
S R Aホールディングス	2,800	2,256.00	6,316,800	
M i n o r i ソリューションズ	700	859.00	601,300	
システムインテグレータ	400	722.00	288,800	

朝日ネット	5,100	483.00	2,463,300	
コムチュア	900	1,967.00	1,770,300	
王子ホールディングス	208,000	430.00	89,440,000	
日本製紙	26,200	1,825.00	47,815,000	
三菱製紙	76,000	80.00	6,080,000	
北越紀州製紙	31,300	617.00	19,312,100	
中越パルプ工業	22,000	159.00	3,498,000	
巴川製紙所	9,000	176.00	1,584,000	
大王製紙	22,400	872.00	19,532,800	
gumi	5,400	640.00	3,456,000	
パイブHD	400	1,076.00	430,400	
レンゴー	45,000	539.00	24,255,000	
トーモク	16,000	250.00	4,000,000	
ザ・パック	3,600	2,642.00	9,511,200	
昭和電工	337,000	113.00	38,081,000	
住友化学	373,000	502.00	187,246,000	
日本化成	11,000	114.00	1,254,000	
住友精化	11,000	587.00	6,457,000	
日産化学工業	30,500	2,563.00	78,171,500	
ラサ工業	18,000	101.00	1,818,000	
クレハ	39,000	361.00	14,079,000	
多木化学	3,000	634.00	1,902,000	
テイカ	9,000	526.00	4,734,000	
石原産業	93,000	73.00	6,789,000	
片倉コープアグリ	7,000	217.00	1,519,000	
日東エフシー	3,300	835.00	2,755,500	
日本曹達	33,000	505.00	16,665,000	
東ソー	137,000	428.00	58,636,000	
トクヤマ	86,000	140.00	12,040,000	
セントラル硝子	55,000	543.00	29,865,000	
東亜合成	31,700	880.00	27,896,000	
大阪ソーダ	22,000	414.00	9,108,000	
関東電化工業	12,000	877.00	10,524,000	
デンカ	105,000	401.00	42,105,000	
イビデン	29,600	1,353.00	40,048,800	
信越化学工業	91,000	5,675.00	516,425,000	
日本カーバイド工業	18,000	119.00	2,142,000	
堺化学工業	20,000	297.00	5,940,000	
エア・ウォーター	42,000	1,583.00	66,486,000	
大陽日酸	39,000	1,006.00	39,234,000	
日本化学工業	20,000	193.00	3,860,000	
日本パーカライジング	25,800	972.00	25,077,600	
高圧ガス工業	8,000	586.00	4,688,000	
チタン工業	7,000	166.00	1,162,000	
四国化成工業	7,000	869.00	6,083,000	
戸田工業	10,000	317.00	3,170,000	
ステラ ケミファ	2,800	2,301.00	6,442,800	
保土谷化学工業	15,000	174.00	2,610,000	
日本触媒	7,400	6,790.00	50,246,000	
大日精化工業	19,000	442.00	8,398,000	
カネカ	68,000	864.00	58,752,000	
協和発酵キリン	60,700	1,616.00	98,091,200	
三菱瓦斯化学	87,000	571.00	49,677,000	
三井化学	215,000	396.00	85,140,000	
JSR	47,600	1,577.00	75,065,200	
東京応化工業	10,200	2,964.00	30,232,800	
大阪有機化学工業	4,100	615.00	2,521,500	
三菱ケミカルホールディングス	339,800	610.00	207,278,000	
日本合成化学工業	12,000	662.00	7,944,000	
ダイセル	71,300	1,515.00	108,019,500	
住友ベークライト	47,000	483.00	22,701,000	

積水化学工業	115,200	1,279.00	147,340,800	
日本ゼオン	44,000	696.00	30,624,000	
アイカ工業	15,200	2,186.00	33,227,200	
宇部興産	271,000	192.00	52,032,000	
積水樹脂	7,800	1,344.00	10,483,200	
タキロン	12,000	543.00	6,516,000	
旭有機材工業	17,000	202.00	3,434,000	
日立化成	25,000	1,869.00	46,725,000	
ニチバン	5,000	624.00	3,120,000	
リケンテクノス	8,800	359.00	3,159,200	
大倉工業	13,000	272.00	3,536,000	
積水化成成品工業	14,000	347.00	4,858,000	
群栄化学工業	13,000	267.00	3,471,000	
タイガースポリマー	3,000	607.00	1,821,000	
ミライアル	2,200	859.00	1,889,800	
ダイキアクシス	600	868.00	520,800	
ダイキョーニシカワ	6,200	1,534.00	9,510,800	
日本化薬	33,000	1,141.00	37,653,000	
カーリットホールディングス	5,000	488.00	2,440,000	
E P Sホールディングス	5,600	1,357.00	7,599,200	
レグス	800	632.00	505,600	
プレステージ・インターナショナル	4,200	1,207.00	5,069,400	
フェイス	1,600	1,193.00	1,908,800	
ハイマックス	600	1,095.00	657,000	
アミューズ	1,400	4,110.00	5,754,000	
野村総合研究所	33,500	3,845.00	128,807,500	
ドリームインキュベータ	1,700	2,166.00	3,682,200	
サイバネットシステム	3,700	912.00	3,374,400	
クイック	2,800	711.00	1,990,800	
T A C	2,500	179.00	447,500	
C Eホールディングス	800	941.00	752,800	
ケネディクス	67,700	464.00	31,412,800	
電通	56,400	5,540.00	312,456,000	
インテージホールディングス	2,600	1,426.00	3,707,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,300	461.00	1,060,300	
東邦システムサイエンス	2,000	580.00	1,160,000	
びあ	1,600	2,163.00	3,460,800	
イオンファンタジー	1,800	2,126.00	3,826,800	
ソースネクスト	2,800	452.00	1,265,600	
シーティーエス	1,300	722.00	938,600	
ネクシィーズ	1,900	695.00	1,320,500	
メディカルシステムネットワーク	5,200	425.00	2,210,000	
ティー・ワイ・オー	8,500	160.00	1,360,000	
日本精化	4,500	721.00	3,244,500	
扶桑化学工業	3,200	1,359.00	4,348,800	
A D E K A	24,900	1,495.00	37,225,500	
日油	39,000	792.00	30,888,000	
ミヨシ油脂	22,000	121.00	2,662,000	
新日本理化	8,200	144.00	1,180,800	
ハリマ化成グループ	4,100	506.00	2,074,600	
花王	136,500	5,848.00	798,252,000	
第一工業製薬	11,000	312.00	3,432,000	
ニイタカ	800	1,307.00	1,045,600	
三洋化成工業	16,000	766.00	12,256,000	
武田薬品工業	202,100	5,417.00	1,094,775,700	
アステラス製薬	568,200	1,577.00	896,051,400	
大日本住友製薬	35,800	1,236.00	44,248,800	
塩野義製薬	73,900	4,764.00	352,059,600	
田辺三菱製薬	59,100	2,031.00	120,032,100	
わかもと製薬	7,000	268.00	1,876,000	
あすか製薬	6,700	1,176.00	7,879,200	

日本新薬	11,600	3,880.00	45,008,000	
Bioフェルミン製薬	900	3,510.00	3,159,000	
中外製薬	50,500	3,370.00	170,185,000	
科研製薬	8,700	7,200.00	62,640,000	
エーザイ	62,500	7,000.00	437,500,000	
理研ビタミン	1,700	3,740.00	6,358,000	
ロート製薬	24,800	2,061.00	51,112,800	
小野薬品工業	23,000	19,715.00	453,445,000	
久光製薬	15,700	5,020.00	78,814,000	
有機合成薬品工業	3,000	234.00	702,000	
持田製薬	3,500	8,540.00	29,890,000	
参天製薬	93,400	1,742.00	162,702,800	
扶桑薬品工業	17,000	252.00	4,284,000	
日本ケミファ	7,000	480.00	3,360,000	
ツムラ	15,900	2,793.00	44,408,700	
日医工	11,800	2,731.00	32,225,800	
テルモ	74,300	3,885.00	288,655,500	
みらかホールディングス	12,900	4,760.00	61,404,000	
キッセイ薬品工業	9,000	2,647.00	23,823,000	
生化学工業	9,600	1,336.00	12,825,600	
栄研化学	4,200	2,138.00	8,979,600	
日水製薬	2,200	1,231.00	2,708,200	
鳥居薬品	3,400	2,341.00	7,959,400	
J C R ファーマ	3,900	2,008.00	7,831,200	
東和薬品	2,300	5,220.00	12,006,000	
富士製薬工業	1,500	2,024.00	3,036,000	
沢井製薬	8,600	7,620.00	65,532,000	
ゼリア新薬工業	10,300	1,389.00	14,306,700	
第一三共	170,600	2,259.00	385,385,400	
キョーリン製薬ホールディングス	13,500	2,127.00	28,714,500	
大幸薬品	2,400	1,345.00	3,228,000	
ダイト	2,400	2,705.00	6,492,000	
大塚ホールディングス	109,100	4,152.00	452,983,200	
大正製薬ホールディングス	12,200	8,910.00	108,702,000	
ベプチドリーム	6,200	4,255.00	26,381,000	
大日本塗料	29,000	198.00	5,742,000	
日本ペイントホールディングス	39,100	2,372.00	92,745,200	
関西ペイント	57,400	1,689.00	96,948,600	
神東塗料	2,000	179.00	358,000	
中国塗料	14,000	713.00	9,982,000	
日本特殊塗料	3,400	991.00	3,369,400	
藤倉化成	7,400	516.00	3,818,400	
太陽ホールディングス	3,700	3,685.00	13,634,500	
D I C	203,000	242.00	49,126,000	
サカタインクス	10,300	1,137.00	11,711,100	
東洋インキS Cホールディングス	50,000	447.00	22,350,000	
T & K T O K A	3,600	909.00	3,272,400	
アルプス技研	1,800	2,191.00	3,943,800	
サニックス	7,100	163.00	1,157,300	
ダイオーズ	1,100	1,005.00	1,105,500	
日本空調サービス	2,400	1,111.00	2,666,400	
オリエンタルランド	54,700	8,010.00	438,147,000	
ダスキン	14,300	2,160.00	30,888,000	
パーク24	24,000	2,943.00	70,632,000	
明光ネットワークジャパン	6,100	1,132.00	6,905,200	
ファルコホールディングス	2,400	1,267.00	3,040,800	
クレスコ	1,200	1,757.00	2,108,400	
フジ・メディア・ホールディングス	49,700	1,314.00	65,305,800	
秀英予備校	1,000	524.00	524,000	
田谷	800	687.00	549,600	
ラウンドワン	16,100	691.00	11,125,100	

リゾートトラスト	21,200	2,513.00	53,275,600
オービック	16,500	5,570.00	91,905,000
ジャストシステム	8,600	851.00	7,318,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,100	1,043.00	1,147,300
ヤフー	342,500	433.00	148,302,500
ビー・エム・エル	3,000	4,095.00	12,285,000
ワタベウェディング	1,600	441.00	705,600
トレンドマイクロ	23,200	3,860.00	89,552,000
りらいあコミュニケーションズ	8,300	982.00	8,150,600
インフォメーション・ディベロプメント	1,300	880.00	1,144,000
リソー教育	9,000	308.00	2,772,000
日本オラクル	7,600	5,380.00	40,888,000
早稲田アカデミー	900	900.00	810,000
アルファシステムズ	1,500	1,733.00	2,599,500
フューチャーアーキテクト	6,100	802.00	4,892,200
CAC Holdings	4,000	723.00	2,892,000
ソフトバンク・テクノロジー	1,300	1,300.00	1,690,000
トーセ	1,200	696.00	835,200
ユー・エス・エス	61,200	1,719.00	105,202,800
オービックビジネスコンサルタント	2,400	4,510.00	10,824,000
伊藤忠テクノソリューションズ	10,800	2,276.00	24,580,800
アイティフォー	6,000	455.00	2,730,000
東京個別指導学院	2,700	698.00	1,884,600
東計電算	1,000	1,924.00	1,924,000
サイバーエージェント	12,300	5,130.00	63,099,000
楽天	236,600	999.60	236,505,360
エクスネット	500	1,483.00	741,500
テー・オー・ダブリュー	3,600	582.00	2,095,200
大塚商会	12,800	5,470.00	70,016,000
総合メディカル	2,400	3,445.00	8,268,000
サイボウズ	7,100	303.00	2,151,300
ソフトブレーン	7,300	147.00	1,073,100
セントラルスポーツ	1,900	2,272.00	4,316,800
バラカ	1,600	1,331.00	2,129,600
電通国際情報サービス	2,900	2,103.00	6,098,700
EMシステムズ	900	2,568.00	2,311,200
ウェザーニューズ	1,400	3,545.00	4,963,000
C I J	4,700	437.00	2,053,900
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,313.00	919,100
日本エンタープライズ	4,000	229.00	916,000
WOWOW	2,400	2,564.00	6,153,600
フュージョンパートナー	2,300	519.00	1,193,700
フルキャストホールディングス	5,100	667.00	3,401,700
富士フイルムホールディングス	116,100	4,269.00	495,630,900
コニカミノルタ	120,900	922.00	111,469,800
資生堂	96,200	2,426.00	233,381,200
ライオン	58,000	1,224.00	70,992,000
高砂香料工業	3,300	2,271.00	7,494,300
マンダム	4,700	4,640.00	21,808,000
ミルボン	3,000	4,390.00	13,170,000
ファンケル	11,700	1,391.00	16,274,700
コーセー	8,200	9,560.00	78,392,000
コタ	1,900	1,423.00	2,703,700
シーズ・ホールディングス	6,800	1,841.00	12,518,800
シーボン	600	2,400.00	1,440,000
ポーラ・オルビスホールディングス	5,200	8,600.00	44,720,000
ノエビアホールディングス	3,200	3,020.00	9,664,000
アジュバンコスメジャパン	800	998.00	798,400
エステー	3,800	1,095.00	4,161,000
アグロ カネショウ	2,400	882.00	2,116,800
コニシ	3,900	2,617.00	10,206,300

長谷川香料	6,400	1,449.00	9,273,600	
星光P M C	2,900	914.00	2,650,600	
小林製薬	7,700	9,690.00	74,613,000	
荒川化学工業	4,200	927.00	3,893,400	
メック	4,100	841.00	3,448,100	
日本高純度化学	1,400	2,024.00	2,833,600	
J C U	1,500	3,290.00	4,935,000	
新田ゼラチン	3,100	711.00	2,204,100	
O A Tアグリオ	400	1,239.00	495,600	
デクセリアルズ	11,400	1,027.00	11,707,800	
アース製薬	3,600	4,050.00	14,580,000	
イハラケミカル工業	7,700	1,236.00	9,517,200	
北興化学工業	6,000	292.00	1,752,000	
大成ラミック	1,400	3,015.00	4,221,000	
クミアイ化学工業	10,400	1,148.00	11,939,200	
日本農薬	11,500	589.00	6,773,500	
昭和シェル石油	50,900	936.00	47,642,400	
富士興産	2,400	434.00	1,041,600	
ニチレキ	6,000	745.00	4,470,000	
東燃ゼネラル石油	76,000	900.00	68,400,000	
ユシロ化学工業	2,600	1,232.00	3,203,200	
ビービー・カストロール	2,000	1,227.00	2,454,000	
富士石油	13,200	276.00	3,643,200	
M O R E S C O	1,400	1,472.00	2,060,800	
出光興産	26,400	1,796.00	47,414,400	
J Xホールディングス	600,500	445.20	267,342,600	
コスモエネルギーホールディングス	15,400	1,188.00	18,295,200	
横浜ゴム	30,600	1,903.00	58,231,800	
東洋ゴム工業	22,900	1,711.00	39,181,900	
ブリヂストン	171,200	3,991.00	683,259,200	
住友ゴム工業	47,400	1,657.00	78,541,800	
藤倉ゴム工業	4,000	453.00	1,812,000	
オカモト	16,000	938.00	15,008,000	
アキレス	42,000	146.00	6,132,000	
フコク	1,700	851.00	1,446,700	
ニッタ	5,600	2,912.00	16,307,200	
クリエートメディック	1,900	804.00	1,527,600	
住友理工	10,200	994.00	10,138,800	
三ツ星ベルト	12,000	873.00	10,476,000	
バンドー化学	19,000	431.00	8,189,000	
鬼怒川ゴム工業	11,000	524.00	5,764,000	
旭硝子	268,000	545.00	146,060,000	
日本板硝子	244,000	72.00	17,568,000	
石塚硝子	8,000	217.00	1,736,000	
有沢製作所	8,000	560.00	4,480,000	
日本山村硝子	22,000	164.00	3,608,000	
日本電気硝子	105,000	532.00	55,860,000	
オハラ	2,200	519.00	1,141,800	
住友大阪セメント	100,000	412.00	41,200,000	
太平洋セメント	316,000	228.00	72,048,000	
デイ・シイ	5,400	316.00	1,706,400	
リゾートソリューション	5,000	310.00	1,550,000	
日本ヒューム	5,000	547.00	2,735,000	
日本コンクリート工業	9,700	250.00	2,425,000	
三谷セキサン	2,500	1,372.00	3,430,000	
アジアパイルホールディングス	6,400	358.00	2,291,200	
東海カーボン	44,000	273.00	12,012,000	
日本カーボン	25,000	214.00	5,350,000	
東洋炭素	2,700	1,453.00	3,923,100	
ノリタケカンパニーリミテド	28,000	243.00	6,804,000	
T O T O	37,300	3,235.00	120,665,500	

日本碍子	64,000	2,055.00	131,520,000
日本特殊陶業	43,700	2,165.00	94,610,500
ダントーホールディングス	6,000	181.00	1,086,000
MARUWA	1,700	2,489.00	4,231,300
品川リフラクトリーズ	14,000	203.00	2,842,000
黒崎播磨	12,000	234.00	2,808,000
ヨータイ	3,000	293.00	879,000
イソライト工業	1,000	177.00	177,000
東京窯業	7,000	167.00	1,169,000
ニッカトー	1,900	373.00	708,700
フジインコーポレーテッド	4,700	1,165.00	5,475,500
エアンドエーマテリアル	15,000	71.00	1,065,000
ニチアス	26,000	628.00	16,328,000
新日鐵住金	228,700	1,874.00	428,583,800
神戸製鋼所	931,000	86.00	80,066,000
中山製鋼所	40,000	65.00	2,600,000
合同製鐵	29,000	192.00	5,568,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	138,600	1,292.50	179,140,500
日新製鋼	23,100	1,166.00	26,934,600
東京製鐵	28,300	724.00	20,489,200
共英製鋼	5,400	1,701.00	9,185,400
大和工業	11,300	2,307.00	26,069,100
東京鐵鋼	11,000	389.00	4,279,000
大阪製鐵	3,100	1,727.00	5,353,700
淀川製鋼所	7,500	2,451.00	18,382,500
東洋鋼鈑	11,900	301.00	3,581,900
丸一鋼管	16,900	3,125.00	52,812,500
モリ工業	9,000	307.00	2,763,000
大同特殊鋼	85,000	409.00	34,765,000
日本高周波鋼業	24,000	72.00	1,728,000
日本冶金工業	36,500	113.00	4,124,500
山陽特殊製鋼	30,000	479.00	14,370,000
愛知製鋼	30,000	423.00	12,690,000
日立金属	58,000	1,192.00	69,136,000
日本金属	15,000	107.00	1,605,000
大平洋金属	35,000	312.00	10,920,000
新日本電工	28,200	165.00	4,653,000
栗本鐵工所	25,000	156.00	3,900,000
虹技	9,000	154.00	1,386,000
日本鑄鉄管	6,000	134.00	804,000
日本製鋼所	84,000	380.00	31,920,000
三菱製鋼	36,000	175.00	6,300,000
日亜鋼業	7,300	262.00	1,912,600
日本精線	4,000	477.00	1,908,000
大紀アルミニウム工業所	8,000	257.00	2,056,000
日本軽金属ホールディングス	114,300	168.00	19,202,400
三井金属鉱業	129,000	160.00	20,640,000
東邦亜鉛	28,000	281.00	7,868,000
三菱マテリアル	316,000	311.00	98,276,000
住友金属鉱山	140,000	1,160.50	162,470,000
DOWAホールディングス	65,000	602.00	39,130,000
古河機械金属	79,000	160.00	12,640,000
エス・サイエンス	26,800	34.00	911,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,900	1,632.00	7,996,800
東邦チタニウム	8,500	865.00	7,352,500
UACJ	70,000	214.00	14,980,000
古河電気工業	159,000	231.00	36,729,000
住友電気工業	203,000	1,340.50	272,121,500
フジクラ	70,000	466.00	32,620,000
昭和電線ホールディングス	65,000	55.00	3,575,000
東京特殊電線	800	857.00	685,600

タツタ電線	10,900	329.00	3,586,100	
沖電線	6,000	196.00	1,176,000	
カナレ電気	1,000	1,693.00	1,693,000	
平河ヒューテック	2,600	964.00	2,506,400	
リョービ	31,000	407.00	12,617,000	
アーレスティ	5,700	655.00	3,733,500	
アサヒホールディングス	7,600	1,440.00	10,944,000	
東洋製罐グループホールディングス	36,000	1,971.00	70,956,000	
ホッカインホールディングス	13,000	289.00	3,757,000	
コロナ	2,800	1,000.00	2,800,000	
横河ブリッジホールディングス	9,500	1,058.00	10,051,000	
OSJBホールディングス	9,000	219.00	1,971,000	
駒井ハルテック	10,000	224.00	2,240,000	
高田機工	6,000	186.00	1,116,000	
三和ホールディングス	51,300	719.00	36,884,700	
文化シャッター	14,000	905.00	12,670,000	
三協立山	6,200	1,299.00	8,053,800	
アルインコ	2,600	987.00	2,566,200	
東洋シャッター	1,500	543.00	814,500	
LIXILグループ	70,600	2,393.00	168,945,800	
日本ファイルコン	3,800	416.00	1,580,800	
ノーリツ	9,900	1,894.00	18,750,600	
長府製作所	5,400	2,490.00	13,446,000	
リンナイ	9,400	9,740.00	91,556,000	
ユニプレス	10,000	1,783.00	17,830,000	
ダイニチ工業	3,100	609.00	1,887,900	
日東精工	7,000	302.00	2,114,000	
三洋工業	7,000	149.00	1,043,000	
岡部	10,400	678.00	7,051,200	
ジーテクト	5,100	1,172.00	5,977,200	
中国工業	800	646.00	516,800	
東プレ	9,700	2,055.00	19,933,500	
高周波熱錬	9,700	817.00	7,924,900	
東京製綱	34,000	139.00	4,726,000	
サンコール	3,200	473.00	1,513,600	
モリテック スチール	2,800	248.00	694,400	
パイオラックス	2,500	5,230.00	13,075,000	
日本発條	47,600	1,020.00	48,552,000	
中央発條	8,000	263.00	2,104,000	
アドパネクス	1,100	1,253.00	1,378,300	
三浦工業	22,600	1,810.00	40,906,000	
タクマ	19,000	870.00	16,530,000	
テクノプロ・ホールディングス	8,200	3,070.00	25,174,000	
インターワークス	700	646.00	452,200	
リブセンス	3,600	389.00	1,400,400	
ジャパンマテリアル	2,500	2,216.00	5,540,000	
ベクトル	1,200	2,588.00	3,105,600	
ウチヤマホールディングス	2,400	491.00	1,178,400	
サクセスホールディングス	400	1,078.00	431,200	
キャリアリンク	600	1,528.00	916,800	
IBJ	3,000	405.00	1,215,000	
アサンテ	2,000	1,496.00	2,992,000	
N・フィールド	1,900	1,098.00	2,086,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	200	1,587.00	317,400	
ライドオン・エクスプレス	900	1,752.00	1,576,800	
ERIホールディングス	1,500	810.00	1,215,000	
アビスト	500	1,981.00	990,500	
ウィルグループ	800	896.00	716,800	
日本ビューホテル	600	1,502.00	901,200	
リクルートホールディングス	101,900	3,380.00	344,422,000	
エラン	400	1,007.00	402,800	

ツガミ	14,000	399.00	5,586,000	
オークマ	33,000	862.00	28,446,000	
東芝機械	27,000	370.00	9,990,000	
アマダホールディングス	73,900	1,089.00	80,477,100	
アイダエンジニアリング	13,200	864.00	11,404,800	
滝澤鉄工所	15,000	124.00	1,860,000	
富士機械製造	16,500	1,077.00	17,770,500	
牧野フライス製作所	25,000	722.00	18,050,000	
オーエスジー	23,000	1,912.00	43,976,000	
ダイジェット工業	7,000	130.00	910,000	
旭ダイヤモンド工業	13,800	976.00	13,468,800	
D M G 森精機	27,900	973.00	27,146,700	
ソディック	9,500	738.00	7,011,000	
ディスコ	6,500	10,780.00	70,070,000	
日東工器	2,900	2,071.00	6,005,900	
パンチ工業	2,300	690.00	1,587,000	
日本郵政	111,200	1,391.00	154,679,200	
ベルシステム24ホールディングス	6,900	958.00	6,610,200	
豊田自動織機	44,100	4,780.00	210,798,000	
豊和工業	3,500	540.00	1,890,000	
O K K	21,000	112.00	2,352,000	
石川製作所	13,000	68.00	884,000	
東洋機械金属	4,000	322.00	1,288,000	
津田駒工業	15,000	98.00	1,470,000	
エンシュウ	14,000	79.00	1,106,000	
島精機製作所	7,100	1,716.00	12,183,600	
フリュー	700	3,200.00	2,240,000	
日阪製作所	6,300	805.00	5,071,500	
やまびこ	8,800	750.00	6,600,000	
ペガサスミシン製造	4,600	490.00	2,254,000	
ナブテスコ	27,000	2,219.00	59,913,000	
三井海洋開発	5,900	1,475.00	8,702,500	
レオン自動機	4,000	605.00	2,420,000	
S M C	15,200	27,365.00	415,948,000	
新川	5,100	398.00	2,029,800	
ホソカワミクロン	9,000	528.00	4,752,000	
ユニオンツール	2,200	2,430.00	5,346,000	
オイレス工業	6,600	1,777.00	11,728,200	
日精エー・エス・ビー機械	2,000	1,806.00	3,612,000	
サトーホールディングス	6,900	2,492.00	17,194,800	
日本エアーテック	1,900	691.00	1,312,900	
日精樹脂工業	3,600	680.00	2,448,000	
ワイエイシイ	2,300	619.00	1,423,700	
小松製作所	248,500	1,741.50	432,762,750	
住友重機械工業	148,000	464.00	68,672,000	
日立建機	22,600	1,637.00	36,996,200	
日工	8,000	325.00	2,600,000	
巴工業	2,300	1,423.00	3,272,900	
井関農機	51,000	180.00	9,180,000	
T O W A	4,700	692.00	3,252,400	
丸山製作所	12,000	165.00	1,980,000	
北川鉄工所	25,000	206.00	5,150,000	
シンニッタン	4,400	588.00	2,587,200	
タカキタ	1,300	518.00	673,400	
クボタ	243,700	1,449.00	353,121,300	
荏原実業	1,400	1,210.00	1,694,000	
東洋エンジニアリング	29,000	263.00	7,627,000	
三菱化工機	18,000	223.00	4,014,000	
月島機械	9,800	1,007.00	9,868,600	
帝国電機製作所	4,100	662.00	2,714,200	
東京機械製作所	26,000	39.00	1,014,000	

新東工業	11,400	909.00	10,362,600
澁谷工業	4,200	1,332.00	5,594,400
アイチ コーポレーション	7,000	772.00	5,404,000
小森コーポレーション	12,300	1,202.00	14,784,600
鶴見製作所	3,700	1,758.00	6,504,600
住友精密工業	9,000	344.00	3,096,000
酒井重工業	11,000	176.00	1,936,000
荏原製作所	112,000	426.00	47,712,000
石井鐵工所	9,000	146.00	1,314,000
西島製作所	5,500	969.00	5,329,500
北越工業	5,900	642.00	3,787,800
千代田化工建設	39,000	847.00	33,033,000
ダイキン工業	70,500	7,809.00	550,534,500
オルガノ	9,000	413.00	3,717,000
トーヨーカネツ	27,000	240.00	6,480,000
栗田工業	30,400	2,546.00	77,398,400
椿本チエイン	29,000	627.00	18,183,000
大同工業	11,000	190.00	2,090,000
日本コンベヤ	19,000	118.00	2,242,000
日機装	18,000	834.00	15,012,000
木村化工機	4,100	360.00	1,476,000
新興ブランテック	11,000	880.00	9,680,000
アネスト岩田	8,300	863.00	7,162,900
ダイフク	25,200	1,754.00	44,200,800
サムコ	800	801.00	640,800
加藤製作所	12,000	374.00	4,488,000
油研工業	10,000	186.00	1,860,000
タダノ	23,000	974.00	22,402,000
フジテック	14,000	1,173.00	16,422,000
C K D	13,400	781.00	10,465,400
キトー	5,700	743.00	4,235,100
平和	15,000	2,360.00	35,400,000
理想科学工業	5,300	1,786.00	9,465,800
S A N K Y O	13,500	4,250.00	57,375,000
日本金銭機械	4,400	989.00	4,351,600
マースエンジニアリング	2,700	1,947.00	5,256,900
福島工業	3,000	2,264.00	6,792,000
オーイズミ	2,000	475.00	950,000
ダイコク電機	2,100	1,218.00	2,557,800
竹内製作所	7,100	1,437.00	10,202,700
アマノ	14,900	1,583.00	23,586,700
J U K I	7,100	862.00	6,120,200
サンデンホールディングス	29,000	291.00	8,439,000
蛇の目ミシン工業	4,500	537.00	2,416,500
ブラザー工業	62,600	1,198.00	74,994,800
マックス	7,000	1,190.00	8,330,000
モリタホールディングス	8,400	1,244.00	10,449,600
グローリー	16,500	3,790.00	62,535,000
新晃工業	3,300	1,696.00	5,596,800
大和冷機工業	8,100	920.00	7,452,000
セガサミーホールディングス	52,000	1,196.00	62,192,000
日本ピストンリング	2,200	1,503.00	3,306,600
リケン	23,000	355.00	8,165,000
T P R	5,900	2,652.00	15,646,800
ツバキ・ナカシマ	4,500	1,563.00	7,033,500
ホシザキ電機	10,600	8,590.00	91,054,000
大豊工業	4,200	1,087.00	4,565,400
日本精工	99,400	1,048.00	104,171,200
N T N	120,000	362.00	43,440,000
ジェイテクト	51,600	1,550.00	79,980,000
不二越	45,000	378.00	17,010,000

ミネベア	78,000	792.00	61,776,000
日本トムソン	16,000	379.00	6,064,000
THK	32,200	1,969.00	63,401,800
ユーシン精機	2,000	1,724.00	3,448,000
前澤給装工業	2,000	1,369.00	2,738,000
イーグル工業	5,900	1,402.00	8,271,800
前澤工業	3,900	272.00	1,060,800
日本ビラー工業	5,200	912.00	4,742,400
キッツ	23,900	470.00	11,233,000
日立製作所	1,236,000	476.60	589,077,600
東芝	1,020,000	183.50	187,170,000
三菱電機	517,000	1,134.00	586,278,000
富士電機	146,000	382.00	55,772,000
東洋電機製造	9,000	319.00	2,871,000
安川電機	60,100	1,281.00	76,988,100
シンフォニアテクノロジー	33,000	144.00	4,752,000
明電舎	44,000	464.00	20,416,000
オリジン電気	8,000	255.00	2,040,000
山洋電気	12,000	500.00	6,000,000
デンヨー	4,600	1,171.00	5,386,600
日立工機	12,800	740.00	9,472,000
三櫻工業	6,000	564.00	3,384,000
マキタ	31,600	6,760.00	213,616,000
東芝テック	34,000	352.00	11,968,000
芝浦メカトロニクス	7,000	191.00	1,337,000
マブチモーター	13,900	4,620.00	64,218,000
日本電産	58,300	7,372.00	429,787,600
東光高岳	2,600	1,337.00	3,476,200
ダブル・スコープ	1,600	4,025.00	6,440,000
宮越ホールディングス	1,800	351.00	631,800
ダイヘン	29,000	454.00	13,166,000
田淵電機	5,300	437.00	2,316,100
ヤーマン	600	1,932.00	1,159,200
JVCケンウッド	35,200	294.00	10,348,800
ミマキエンジニアリング	3,300	429.00	1,415,700
第一精工	2,000	1,285.00	2,570,000
日新電機	11,200	917.00	10,270,400
大崎電気工業	9,000	717.00	6,453,000
オムロン	55,600	3,070.00	170,692,000
日東工業	7,700	1,799.00	13,852,300
I D E C	6,300	1,023.00	6,444,900
不二電機工業	600	1,397.00	838,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	93,000	448.00	41,664,000
サクサホールディングス	13,000	191.00	2,483,000
メルコホールディングス	2,800	2,237.00	6,263,600
テクノメディカ	1,000	2,235.00	2,235,000
日本電気	666,000	273.00	181,818,000
富士通	467,000	414.20	193,431,400
沖電気工業	209,000	152.00	31,768,000
岩崎通信機	25,000	72.00	1,800,000
電気興業	13,000	551.00	7,163,000
サンケン電気	27,000	303.00	8,181,000
ナカヨ	4,000	323.00	1,292,000
アイホン	2,800	1,933.00	5,412,400
ルネサスエレクトロニクス	25,000	659.00	16,475,000
セイコーエプソン	72,100	1,799.00	129,707,900
ワコム	37,900	484.00	18,343,600
アルバック	8,900	3,280.00	29,192,000
アクセル	2,400	860.00	2,064,000
E I Z O	4,900	2,990.00	14,651,000
ジャパントディスプレイ	90,200	211.00	19,032,200

日本信号	13,300	799.00	10,626,700	
京三製作所	12,000	321.00	3,852,000	
能美防災	5,400	1,353.00	7,306,200	
ホーチキ	3,400	1,134.00	3,855,600	
エレコム	3,800	1,618.00	6,148,400	
日本無線	12,000	267.00	3,204,000	
パナソニック	553,500	845.10	467,762,850	
シャープ	409,000	173.00	70,757,000	
アンリツ	29,000	638.00	18,502,000	
富士通ゼネラル	15,000	1,488.00	22,320,000	
日立国際電気	11,000	1,266.00	13,926,000	
ソニー	341,800	2,488.00	850,398,400	
T D K	29,200	5,740.00	167,608,000	
帝国通信工業	11,000	163.00	1,793,000	
ミツミ電機	18,800	487.00	9,155,600	
タムラ製作所	20,000	271.00	5,420,000	
アルプス電気	41,100	1,804.00	74,144,400	
池上通信機	16,000	128.00	2,048,000	
パイオニア	78,000	244.00	19,032,000	
日本電波工業	4,700	675.00	3,172,500	
鈴木	1,400	463.00	648,200	
日本トリム	1,300	4,335.00	5,635,500	
ローランド ディー . ジー .	2,100	2,334.00	4,901,400	
日本コロムビア	1,700	509.00	865,300	
フォスター電機	6,000	2,138.00	12,828,000	
クラリオン	25,000	351.00	8,775,000	
S M K	14,000	529.00	7,406,000	
ヨコオ	4,100	541.00	2,218,100	
東光	9,000	358.00	3,222,000	
ティアック	30,000	42.00	1,260,000	
ホシデン	14,500	661.00	9,584,500	
ヒロセ電機	7,800	12,610.00	98,358,000	
日本航空電子工業	14,000	1,151.00	16,114,000	
T O A	5,600	1,012.00	5,667,200	
日立マクセル	8,000	1,627.00	13,016,000	
古野電気	6,200	698.00	4,327,600	
ユニデンホールディングス	16,000	113.00	1,808,000	
アルパイン	11,500	1,270.00	14,605,000	
スミダコーポレーション	4,300	708.00	3,044,400	
アイコム	2,600	2,196.00	5,709,600	
リオン	1,800	1,560.00	2,808,000	
船井電機	4,800	963.00	4,622,400	
横河電機	48,400	1,124.00	54,401,600	
新電元工業	18,000	361.00	6,498,000	
アズビル	15,800	2,777.00	43,876,600	
東亜ディーケーケー	1,900	510.00	969,000	
日本光電工業	20,200	2,826.00	57,085,200	
チノー	2,100	1,005.00	2,110,500	
共和電業	6,800	363.00	2,468,400	
日本電子材料	2,200	384.00	844,800	
堀場製作所	8,900	3,655.00	32,529,500	
アドバンテスト	32,900	1,025.00	33,722,500	
小野測器	2,500	707.00	1,767,500	
エスベック	5,200	1,343.00	6,983,600	
パナソニック デバイス S U N X	4,100	544.00	2,230,400	
キーエンス	11,000	58,580.00	644,380,000	
日置電機	2,500	2,239.00	5,597,500	
シスメックス	37,600	6,660.00	250,416,000	
日本マイクロニクス	6,200	959.00	5,945,800	
メガチップス	5,000	1,063.00	5,315,000	
O B A R A G R O U P	3,100	4,150.00	12,865,000	

イマジカ・ロボット ホールディングス	2,900	389.00	1,128,100
澤藤電機	3,000	179.00	537,000
デンソー	119,700	4,200.00	502,740,000
コーセル	7,100	998.00	7,085,800
新日本無線	4,000	373.00	1,492,000
オプテックス	3,500	2,770.00	9,695,000
千代田インテグレ	2,700	2,538.00	6,852,600
レーザーテック	4,900	1,419.00	6,953,100
スタンレー電気	34,700	2,534.00	87,929,800
岩崎電気	18,000	174.00	3,132,000
ウシオ電機	29,300	1,578.00	46,235,400
岡谷電機産業	2,800	370.00	1,036,000
ヘリオス テクノ ホールディング	4,600	382.00	1,757,200
日本セラミック	2,700	1,820.00	4,914,000
遠藤照明	2,400	1,027.00	2,464,800
日本デジタル研究所	4,000	1,569.00	6,276,000
古河電池	4,000	624.00	2,496,000
双信電機	2,600	259.00	673,400
山一電機	4,700	572.00	2,688,400
図研	3,900	1,163.00	4,535,700
日本電子	19,000	524.00	9,956,000
カシオ計算機	48,500	2,102.00	101,947,000
ファナック	49,600	17,040.00	845,184,000
日本シイエムケイ	10,700	390.00	4,173,000
エンプラス	2,400	3,815.00	9,156,000
大真空	10,000	203.00	2,030,000
ローム	23,900	4,685.00	111,971,500
浜松ホトニクス	37,800	2,805.00	106,029,000
三井ハイテック	7,500	528.00	3,960,000
新光電気工業	18,200	648.00	11,793,600
京セラ	79,500	4,927.00	391,696,500
協栄産業	6,000	125.00	750,000
太陽誘電	23,500	1,111.00	26,108,500
村田製作所	50,800	13,435.00	682,498,000
ユーシン	6,700	659.00	4,415,300
双葉電子工業	8,200	1,504.00	12,332,800
日東電工	39,200	5,982.00	234,494,400
北陸電気工業	22,000	124.00	2,728,000
東海理化電機製作所	14,100	2,357.00	33,233,700
ニチコン	15,100	733.00	11,068,300
日本ケミコン	39,000	142.00	5,538,000
K O A	6,600	864.00	5,702,400
三井造船	187,000	147.00	27,489,000
日立造船	37,700	514.00	19,377,800
三菱重工業	863,000	409.90	353,743,700
川崎重工業	377,000	303.00	114,231,000
I H I	372,000	190.00	70,680,000
名村造船所	14,800	675.00	9,990,000
サノヤスホールディングス	7,300	204.00	1,489,200
日本車輛製造	20,000	243.00	4,860,000
ニチユ三菱フォークリフト	5,400	431.00	2,327,400
近畿車輛	8,000	298.00	2,384,000
F P G	13,900	957.00	13,302,300
島根銀行	1,100	1,156.00	1,271,600
じもとホールディングス	33,400	145.00	4,843,000
全国保証	12,400	3,310.00	41,044,000
足利ホールディングス	35,000	316.00	11,060,000
東京TYフィナンシャルグループ	6,900	2,597.00	17,919,300
九州フィナンシャルグループ	72,700	659.00	47,909,300
かんぽ生命保険	14,700	2,377.00	34,941,900
ゆうちょ銀行	92,000	1,191.00	109,572,000

日産自動車	680,100	979.20	665,953,920
トヨタ自動車	602,700	5,980.00	3,604,146,000
日野自動車	69,100	1,182.00	81,676,200
三菱自動車工業	192,300	809.00	155,570,700
エフテック	2,500	1,059.00	2,647,500
レシップホールディングス	1,900	762.00	1,447,800
GMB	700	826.00	578,200
ファルテック	700	1,324.00	926,800
武蔵精密工業	5,100	2,105.00	10,735,500
日産車体	23,600	1,133.00	26,738,800
新明和工業	21,000	767.00	16,107,000
極東開発工業	9,900	1,032.00	10,216,800
日信工業	10,800	1,442.00	15,573,600
トピー工業	39,000	214.00	8,346,000
ティラド	20,000	168.00	3,360,000
曙ブレーキ工業	22,800	240.00	5,472,000
タチエス	7,600	1,495.00	11,362,000
NOK	23,400	1,850.00	43,290,000
フタバ産業	15,400	463.00	7,130,200
KYB	54,000	294.00	15,876,000
シロキ工業	11,000	331.00	3,641,000
市光工業	11,000	184.00	2,024,000
大同メタル工業	6,700	779.00	5,219,300
プレス工業	26,400	391.00	10,322,400
ミクニ	5,200	340.00	1,768,000
カルソニックカンセイ	37,000	814.00	30,118,000
太平洋工業	10,900	1,001.00	10,910,900
ケーヒン	11,100	1,585.00	17,593,500
河西工業	5,900	1,235.00	7,286,500
アイシン精機	48,700	4,480.00	218,176,000
富士機工	5,300	410.00	2,173,000
マツダ	153,400	1,614.50	247,664,300
ダイハツ工業	57,800	1,586.00	91,670,800
今仙電機製作所	4,400	1,016.00	4,470,400
本田技研工業	436,000	2,925.00	1,275,300,000
スズキ	101,300	2,809.50	284,602,350
富士重工業	153,100	3,693.00	565,398,300
安永	1,900	502.00	953,800
ヤマハ発動機	68,400	1,783.00	121,957,200
ショーワ	12,500	926.00	11,575,000
小糸製作所	29,000	4,930.00	142,970,000
TBK	6,600	369.00	2,435,400
エクセディ	6,500	2,272.00	14,768,000
ミツバ	8,200	1,497.00	12,275,400
豊田合成	17,600	2,235.00	39,336,000
愛三工業	8,400	887.00	7,450,800
盟和産業	500	867.00	433,500
ヨロズ	4,500	2,172.00	9,774,000
エフ・シー・シー	7,800	1,860.00	14,508,000
新家工業	12,000	132.00	1,584,000
シマノ	19,500	18,470.00	360,165,000
タカタ	8,600	507.00	4,360,200
テイ・エス テック	11,200	2,553.00	28,593,600
ジャムコ	2,000	2,489.00	4,978,000
小野建	4,100	961.00	3,940,100
はるやま商事	2,200	754.00	1,658,800
佐鳥電機	3,600	689.00	2,480,400
カッパ・クリエイト	6,600	1,126.00	7,431,600
エコトレーディング	1,000	605.00	605,000
伯東	3,600	931.00	3,351,600
コンドーテック	3,800	765.00	2,907,000

中山福	3,400	747.00	2,539,800
ライトオン	3,700	1,458.00	5,394,600
ナガイレーベン	6,900	1,993.00	13,751,700
ジーンズメイト	2,600	167.00	434,200
三菱食品	5,200	2,968.00	15,433,600
良品計画	5,500	23,850.00	131,175,000
三城ホールディングス	6,800	445.00	3,026,000
松田産業	3,700	1,220.00	4,514,000
第一興商	8,500	4,650.00	39,525,000
メディカルホールディングス	47,800	1,739.00	83,124,200
アドヴァン	5,100	1,048.00	5,344,800
S P K	1,100	1,905.00	2,095,500
萩原電気	1,200	1,847.00	2,216,400
アルビス	1,200	1,903.00	2,283,600
アズワン	3,700	3,925.00	14,522,500
スズデン	1,800	1,047.00	1,884,600
尾家産業	1,800	846.00	1,522,800
シモジマ	3,400	1,081.00	3,675,400
ドウシシャ	5,600	2,142.00	11,995,200
小津産業	1,100	2,158.00	2,373,800
コナカ	6,000	533.00	3,198,000
高速	3,100	856.00	2,653,600
ハウス オブ ローゼ	600	1,460.00	876,000
G - 7ホールディングス	1,200	1,121.00	1,345,200
たけびし	1,900	962.00	1,827,800
イオン北海道	3,600	518.00	1,864,800
コジマ	8,500	228.00	1,938,000
ヒマラヤ	1,600	1,006.00	1,609,600
コーナン商事	6,700	1,547.00	10,364,900
黒田電気	9,100	1,623.00	14,769,300
ネットワンシステムズ	20,600	588.00	12,112,800
エコス	1,800	1,180.00	2,124,000
ワタミ	6,100	1,076.00	6,563,600
マルシェ	1,600	836.00	1,337,600
ドンキホーテホールディングス	30,900	3,705.00	114,484,500
丸文	4,500	705.00	3,172,500
西松屋チェーン	9,300	972.00	9,039,600
ゼンショーホールディングス	24,500	1,393.00	34,128,500
ハピネット	3,100	931.00	2,886,100
幸楽苑ホールディングス	2,900	1,563.00	4,532,700
ハークスレイ	1,400	1,051.00	1,471,400
橋本総業	1,000	1,515.00	1,515,000
サイゼリヤ	7,800	2,299.00	17,932,200
エクセル	2,400	1,294.00	3,105,600
V Tホールディングス	16,700	569.00	9,502,300
マルカキカイ	1,600	1,386.00	2,217,600
アルゴグラフィックス	2,200	1,686.00	3,709,200
魚力	1,500	1,210.00	1,815,000
ガリバーインターナショナル	12,800	1,116.00	14,284,800
日本エム・ディ・エム	3,800	566.00	2,150,800
ポブラ	1,700	503.00	855,100
ユナイテッドアローズ	6,800	5,080.00	34,544,000
進和	2,700	1,408.00	3,801,600
エスケイジャパン	900	451.00	405,900
ダイトエレクトロン	2,600	718.00	1,866,800
ハイデイ日高	3,600	3,495.00	12,582,000
シークス	3,000	2,833.00	8,499,000
京都きもの友禅	3,100	842.00	2,610,200
コロワイド	15,800	1,730.00	27,334,000
ピーシーデポコーポレーション	4,300	1,028.00	4,420,400
田中商事	1,600	620.00	992,000

オーハシテクニカ	2,800	1,258.00	3,522,400
壱番屋	2,200	5,920.00	13,024,000
白銅	1,700	1,012.00	1,720,400
トップカルチャー	1,700	457.00	776,900
P L A N T	1,400	1,163.00	1,628,200
スギホールディングス	8,600	5,430.00	46,698,000
島津製作所	62,000	1,787.00	110,794,000
J M S	10,000	290.00	2,900,000
クボテック	1,100	446.00	490,600
モリテックス	1,400	289.00	404,600
長野計器	2,900	598.00	1,734,200
ビー・テクノロジー	1,000	3,675.00	3,675,000
スター精密	9,100	1,273.00	11,584,300
東京計器	16,000	154.00	2,464,000
愛知時計電機	7,000	299.00	2,093,000
オーバル	4,300	215.00	924,500
東京精密	9,300	2,141.00	19,911,300
マニー	4,400	1,662.00	7,312,800
ニコン	90,400	1,692.00	152,956,800
トプコン	16,200	1,185.00	19,197,000
オリンパス	72,200	4,100.00	296,020,000
理研計器	4,100	1,044.00	4,280,400
S C R E E Nホールディングス	50,000	812.00	40,600,000
キヤノン電子	4,400	1,643.00	7,229,200
タムロン	3,800	1,718.00	6,528,400
H O Y A	112,700	4,150.00	467,705,000
ノーリツ鋼機	5,000	418.00	2,090,000
エー・アンド・デイ	5,400	378.00	2,041,200
キヤノン	260,800	3,311.00	863,508,800
リコー	156,800	1,134.00	177,811,200
シチズンホールディングス	59,500	626.00	37,247,000
リズム時計工業	23,000	142.00	3,266,000
大研医器	3,800	900.00	3,420,000
メニコン	2,600	3,060.00	7,956,000
スノーピーク	400	3,455.00	1,382,000
パラマウントベッドホールディングス	5,100	3,745.00	19,099,500
トランザクション	600	591.00	354,600
S H O - B I	1,600	395.00	632,000
ニホンフラッシュ	1,500	980.00	1,470,000
前田工織	5,500	982.00	5,401,000
永大産業	7,000	391.00	2,737,000
アートネイチャー	3,900	960.00	3,744,000
ダンロップスポーツ	3,300	934.00	3,082,200
バンダイナムコホールディングス	50,100	2,345.00	117,484,500
アイフィスジャパン	900	410.00	369,000
共立印刷	7,700	282.00	2,171,400
S H O E I	2,500	1,820.00	4,550,000
フランスベッドホールディングス	6,600	964.00	6,362,400
マーベラス	7,900	821.00	6,485,900
パイロットコーポレーション	8,400	3,965.00	33,306,000
萩原工業	1,200	1,976.00	2,371,200
エイベックス・グループ・ホールディングス	8,700	1,302.00	11,327,400
トッパン・フォームズ	8,600	1,325.00	11,395,000
フジシールインターナショナル	5,900	3,650.00	21,535,000
タカラトミー	15,800	843.00	13,319,400
廣済堂	5,200	308.00	1,601,600
A s - m e エステール	1,700	593.00	1,008,100
アーク	16,600	83.00	1,377,800
レック	1,600	1,258.00	2,012,800
タカノ	2,300	599.00	1,377,700
プロネクサス	4,400	1,112.00	4,892,800

ホクシン	6,100	108.00	658,800
ウッドワン	9,000	242.00	2,178,000
大建工業	19,000	239.00	4,541,000
きもと	8,300	167.00	1,386,100
凸版印刷	137,000	972.00	133,164,000
大日本印刷	143,000	990.00	141,570,000
図書印刷	9,000	461.00	4,149,000
共同印刷	17,000	338.00	5,746,000
日本写真印刷	8,100	1,736.00	14,061,600
光村印刷	5,000	205.00	1,025,000
藤森工業	4,300	2,443.00	10,504,900
宝印刷	2,500	1,259.00	3,147,500
前澤化成工業	3,500	975.00	3,412,500
アシックス	45,100	2,032.00	91,643,200
ツツミ	2,600	2,449.00	6,367,400
J S P	3,300	2,239.00	7,388,700
ニチハ	6,700	1,529.00	10,244,300
エフピコ	4,500	4,400.00	19,800,000
小松ウオール工業	1,600	1,667.00	2,667,200
ヤマハ	35,600	3,180.00	113,208,000
河合楽器製作所	2,000	1,897.00	3,794,000
クリナップ	4,800	723.00	3,470,400
ビジョン	27,400	2,637.00	72,253,800
天馬	3,900	1,907.00	7,437,300
兼松日産農林	7,000	130.00	910,000
キングジム	4,300	736.00	3,164,800
リンテック	11,500	2,125.00	24,437,500
T A S A K I	1,000	1,308.00	1,308,000
信越ポリマー	9,800	581.00	5,693,800
東リ	14,000	291.00	4,074,000
イトーキ	10,100	697.00	7,039,700
任天堂	29,800	16,495.00	491,551,000
三菱鉛筆	3,600	4,360.00	15,696,000
松風	2,500	1,310.00	3,275,000
タカラスタンダード	20,000	968.00	19,360,000
コクヨ	25,100	1,107.00	27,785,700
ナカバヤシ	10,000	260.00	2,600,000
ニフコ	9,700	5,060.00	49,082,000
立川ブラインド工業	2,200	685.00	1,507,000
グロープライド	2,500	1,423.00	3,557,500
岡村製作所	16,800	993.00	16,682,400
日本バルカー工業	20,000	276.00	5,520,000
M U T O Hホールディングス	5,000	233.00	1,165,000
伊藤忠商事	375,200	1,378.50	517,213,200
丸紅	470,500	584.40	274,960,200
スクロール	7,300	404.00	2,949,200
高島	11,000	165.00	1,815,000
ヨンドシーホールディングス	3,800	2,437.00	9,260,600
三陽商会	28,000	257.00	7,196,000
長瀬産業	28,700	1,170.00	33,579,000
ナイガイ	21,000	41.00	861,000
蝶理	3,000	1,428.00	4,284,000
豊田通商	53,200	2,330.00	123,956,000
オンワードホールディングス	34,000	705.00	23,970,000
三共生興	7,400	389.00	2,878,600
兼松	101,000	151.00	15,251,000
美津濃	26,000	503.00	13,078,000
ツカモトコーポレーション	9,000	105.00	945,000
ファミリーマート	14,700	5,560.00	81,732,000
ルック	10,000	143.00	1,430,000
三井物産	432,400	1,313.00	567,741,200

日本紙パルプ商事	26,000	316.00	8,216,000
東京エレクトロン	43,500	7,053.00	306,805,500
日立ハイテクノロジーズ	16,500	3,030.00	49,995,000
カメイ	6,500	983.00	6,389,500
東都水産	9,000	173.00	1,557,000
OUGホールディングス	6,000	215.00	1,290,000
スターゼン	1,800	3,145.00	5,661,000
セイコーホールディングス	31,000	398.00	12,338,000
山善	18,300	907.00	16,598,100
椿本興業	6,000	286.00	1,716,000
住友商事	301,000	1,136.50	342,086,500
日本ユニシス	13,100	1,395.00	18,274,500
内田洋行	12,000	390.00	4,680,000
三菱商事	358,800	1,872.00	671,673,600
第一実業	11,000	456.00	5,016,000
キャノンマーケティングジャパン	13,600	1,946.00	26,465,600
西華産業	15,000	217.00	3,255,000
佐藤商事	4,500	622.00	2,799,000
菱洋エレクトロ	5,400	1,095.00	5,913,000
東京産業	4,500	393.00	1,768,500
ユアサ商事	4,600	2,442.00	11,233,200
神鋼商事	10,000	198.00	1,980,000
小林産業	3,900	193.00	752,700
阪和興業	48,000	435.00	20,880,000
カナデン	4,400	811.00	3,568,400
菱電商事	8,000	624.00	4,992,000
ニプロ	36,000	1,075.00	38,700,000
フルサト工業	2,600	1,563.00	4,063,800
岩谷産業	57,000	609.00	34,713,000
すてきナイスグループ	22,000	132.00	2,904,000
昭光通商	21,000	75.00	1,575,000
ニチモウ	9,000	175.00	1,575,000
極東貿易	6,000	223.00	1,338,000
イワキ	8,000	185.00	1,480,000
兼松エレクトロニクス	3,100	1,834.00	5,685,400
三愛石油	12,000	869.00	10,428,000
稲畑産業	11,400	1,194.00	13,611,600
G S Iクレオス	15,000	119.00	1,785,000
明和産業	4,500	374.00	1,683,000
キムラタン	234,000	7.00	1,638,000
ゴールドウイン	2,100	4,570.00	9,597,000
ユニ・チャーム	102,700	2,415.00	248,020,500
デサント	11,500	1,713.00	19,699,500
キング	2,900	383.00	1,110,700
ワキタ	10,100	825.00	8,332,500
ヤマトインターナショナル	3,300	380.00	1,254,000
東邦ホールディングス	15,300	2,327.00	35,603,100
サンゲツ	17,200	1,950.00	33,540,000
ミツウロコグループホールディングス	7,500	557.00	4,177,500
シナネンホールディングス	11,000	440.00	4,840,000
伊藤忠エネクス	11,600	817.00	9,477,200
サンリオ	14,700	2,100.00	30,870,000
サンワテクノス	3,200	676.00	2,163,200
リョーサン	7,600	2,821.00	21,439,600
新光商事	5,500	1,030.00	5,665,000
トーヨー	2,300	2,212.00	5,087,600
三信電気	6,500	837.00	5,440,500
東陽テクニカ	6,900	1,086.00	7,493,400
モスフードサービス	6,200	3,105.00	19,251,000
加賀電子	4,300	1,291.00	5,551,300
三益半導体工業	3,600	1,026.00	3,693,600

ソーダニッカ	4,700	450.00	2,115,000
立花エレクトック	3,400	1,091.00	3,709,400
木曽路	5,800	2,229.00	12,928,200
サトレストランシステムズ	6,100	780.00	4,758,000
千趣会	9,300	705.00	6,556,500
タカキュー	3,300	180.00	594,000
ケーヨー	8,400	503.00	4,225,200
アデランス	8,200	565.00	4,633,000
上新電機	11,000	853.00	9,383,000
日本瓦斯	5,400	2,080.00	11,232,000
ベスト電器	18,500	120.00	2,220,000
ロイヤルホールディングス	7,900	2,017.00	15,934,300
東天紅	5,000	130.00	650,000
いなげや	5,200	1,230.00	6,396,000
島忠	12,300	2,469.00	30,368,700
チヨダ	5,600	2,816.00	15,769,600
ライフコーポレーション	3,000	2,336.00	7,008,000
リンガーハット	4,300	2,411.00	10,367,300
さが美	5,000	92.00	460,000
Mr Max	5,300	285.00	1,510,500
テナアライド	5,200	363.00	1,887,600
AOKIホールディングス	10,800	1,238.00	13,370,400
オークワ	7,000	1,005.00	7,035,000
コメリ	7,300	2,173.00	15,862,900
青山商事	9,100	4,175.00	37,992,500
しまむら	5,500	12,060.00	66,330,000
はせがわ	2,100	406.00	852,600
高島屋	69,000	920.00	63,480,000
松屋	9,500	850.00	8,075,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	24,400	1,850.00	45,140,000
近鉄百貨店	19,000	306.00	5,814,000
丸栄	8,000	86.00	688,000
ニッセンホールディングス	7,300	146.00	1,065,800
バルコ	4,500	866.00	3,897,000
丸井グループ	58,600	1,500.00	87,900,000
クレディセゾン	36,200	1,854.00	67,114,800
アクシアル リテイリング	3,700	3,370.00	12,469,000
井筒屋	30,000	50.00	1,500,000
イオン	196,700	1,425.50	280,395,850
ユニーグループ・ホールディングス	45,700	749.00	34,229,300
イズミ	9,500	4,325.00	41,087,500
東武ストア	7,000	297.00	2,079,000
フォーバル	2,200	606.00	1,333,200
平和堂	9,600	2,095.00	20,112,000
フジ	5,300	2,056.00	10,896,800
ヤオコー	5,400	4,125.00	22,275,000
ゼビオホールディングス	6,400	1,754.00	11,225,600
ケーズホールディングス	10,100	3,480.00	35,148,000
PALTAC	7,600	1,739.00	13,216,400
三谷産業	5,700	310.00	1,767,000
Olympicグループ	3,100	567.00	1,757,700
日産東京販売ホールディングス	7,700	283.00	2,179,100
新生銀行	413,000	141.00	58,233,000
あおぞら銀行	302,000	357.00	107,814,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,837,100	477.30	1,831,447,830
りそなホールディングス	559,300	389.60	217,903,280
三井住友トラスト・ホールディングス	998,000	324.50	323,851,000
三井住友フィナンシャルグループ	382,900	3,026.00	1,158,655,400
第四銀行	60,000	368.00	22,080,000
北越銀行	51,000	182.00	9,282,000
西日本シティ銀行	155,000	200.00	31,000,000

千葉銀行	184,000	538.00	98,992,000
横浜銀行	321,000	504.20	161,848,200
常陽銀行	173,000	385.00	66,605,000
群馬銀行	106,000	487.00	51,622,000
武蔵野銀行	7,600	2,894.00	21,994,400
千葉興業銀行	13,200	447.00	5,900,400
筑波銀行	19,600	279.00	5,468,400
七十七銀行	75,000	402.00	30,150,000
青森銀行	35,000	295.00	10,325,000
秋田銀行	31,000	268.00	8,308,000
山形銀行	27,000	377.00	10,179,000
岩手銀行	3,300	3,705.00	12,226,500
東邦銀行	42,000	323.00	13,566,000
東北銀行	25,000	140.00	3,500,000
みちのく銀行	23,000	166.00	3,818,000
ふくおかフィナンシャルグループ	207,000	352.00	72,864,000
静岡銀行	140,000	822.00	115,080,000
十六銀行	60,000	361.00	21,660,000
スルガ銀行	45,400	1,820.00	82,628,000
八十二銀行	86,000	504.00	43,344,000
山梨中央銀行	29,000	392.00	11,368,000
大垣共立銀行	64,000	343.00	21,952,000
福井銀行	40,000	186.00	7,440,000
北國銀行	53,000	277.00	14,681,000
清水銀行	1,600	2,108.00	3,372,800
富山銀行	1,000	2,703.00	2,703,000
滋賀銀行	45,000	448.00	20,160,000
南都銀行	46,000	301.00	13,846,000
百五銀行	43,000	393.00	16,899,000
京都銀行	91,000	727.00	66,157,000
紀陽銀行	18,700	1,184.00	22,140,800
三重銀行	23,000	191.00	4,393,000
ほくほくフィナンシャルグループ	325,000	167.00	54,275,000
広島銀行	141,000	410.00	57,810,000
山陰合同銀行	28,900	652.00	18,842,800
中国銀行	33,800	1,176.00	39,748,800
鳥取銀行	16,000	159.00	2,544,000
伊予銀行	51,100	772.00	39,449,200
百十四銀行	52,000	316.00	16,432,000
四国銀行	37,000	207.00	7,659,000
阿波銀行	39,000	502.00	19,578,000
大分銀行	27,000	339.00	9,153,000
宮崎銀行	32,000	260.00	8,320,000
佐賀銀行	30,000	200.00	6,000,000
十八銀行	29,000	230.00	6,670,000
沖縄銀行	3,800	3,455.00	13,129,000
琉球銀行	9,800	1,133.00	11,103,400
セブン銀行	179,000	483.00	86,457,000
みずほフィナンシャルグループ	6,736,200	166.30	1,120,230,060
高知銀行	18,000	109.00	1,962,000
山口フィナンシャルグループ	45,000	1,050.00	47,250,000
アクリーティブ	3,500	368.00	1,288,000
芙蓉総合リース	5,500	4,605.00	25,327,500
興銀リース	8,900	1,885.00	16,776,500
東京センチュリーリース	11,200	3,740.00	41,888,000
SBIホールディングス	57,300	1,016.00	58,216,800
日本証券金融	20,900	479.00	10,011,100
アイフル	79,800	294.00	23,461,200
日本アジア投資	4,000	302.00	1,208,000
ポケットカード	4,300	440.00	1,892,000
長野銀行	15,000	176.00	2,640,000

名古屋銀行	40,000	356.00	14,240,000
北洋銀行	71,800	276.00	19,816,800
愛知銀行	1,600	4,375.00	7,000,000
第三銀行	29,000	140.00	4,060,000
中京銀行	21,000	192.00	4,032,000
東日本銀行	23,000	271.00	6,233,000
大光銀行	16,000	190.00	3,040,000
愛媛銀行	28,000	208.00	5,824,000
トマト銀行	20,000	146.00	2,920,000
みなと銀行	45,000	152.00	6,840,000
京葉銀行	39,000	420.00	16,380,000
関西アーバン銀行	7,000	1,045.00	7,315,000
栃木銀行	26,000	418.00	10,868,000
北日本銀行	1,500	2,609.00	3,913,500
東和銀行	66,000	81.00	5,346,000
福島銀行	63,000	71.00	4,473,000
大東銀行	30,000	177.00	5,310,000
リコーリース	3,700	3,170.00	11,729,000
イオンフィナンシャルサービス	31,300	2,500.00	78,250,000
アコム	95,900	468.00	44,881,200
ジャックス	26,000	375.00	9,750,000
オリエントコーポレーション	206,300	191.00	39,403,300
日立キャピタル	11,200	2,371.00	26,555,200
アプラスフィナンシャル	24,200	87.00	2,105,400
オリックス	338,600	1,429.50	484,028,700
三菱UFJリース	121,100	481.00	58,249,100
ジャフコ	8,000	3,175.00	25,400,000
トモニホールディングス	36,400	331.00	12,048,400
大和証券グループ本社	447,000	671.80	300,294,600
野村ホールディングス	920,000	494.10	454,572,000
岡三証券グループ	41,000	532.00	21,812,000
丸三証券	14,100	1,199.00	16,905,900
東洋証券	19,000	289.00	5,491,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	54,700	523.00	28,608,100
光世証券	14,000	138.00	1,932,000
水戸証券	14,500	323.00	4,683,500
いちよし証券	11,000	1,078.00	11,858,000
松井証券	24,200	963.00	23,304,600
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	106,200	3,075.00	326,565,000
だいこう証券ビジネス	2,500	770.00	1,925,000
日本取引所グループ	140,400	1,729.00	242,751,600
マネックスグループ	55,900	283.00	15,819,700
カブドットコム証券	42,100	330.00	13,893,000
極東証券	6,300	1,327.00	8,360,100
岩井コスモホールディングス	4,800	1,055.00	5,064,000
藍澤證券	6,600	564.00	3,722,400
フィデアホールディングス	28,800	172.00	4,953,600
池田泉州ホールディングス	50,500	387.00	19,543,500
アニコムホールディングス	3,000	2,493.00	7,479,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	142,900	2,972.00	424,698,800
マネースクウェアHD	1,700	995.00	1,691,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	45,800	1,552.00	71,081,600
マネーパートナーズグループ	4,400	308.00	1,355,200
小林洋行	1,300	238.00	309,400
第一生命保険	306,400	1,306.00	400,158,400
東京海上ホールディングス	193,700	3,791.00	734,316,700
イー・ギャランティ	1,500	2,161.00	3,241,500
アサックス	1,000	1,320.00	1,320,000
NECキャピタルソリューション	2,100	1,547.00	3,248,700
T & Dホールディングス	174,200	1,116.50	194,494,300

三井不動産	254,000	2,652.00	673,608,000
三菱地所	356,000	2,144.50	763,442,000
平和不動産	9,000	1,184.00	10,656,000
東京建物	52,100	1,327.00	69,136,700
ダイビル	12,200	931.00	11,358,200
京阪神ビルディング	8,500	571.00	4,853,500
住友不動産	115,000	3,085.00	354,775,000
太平洋興発	21,000	74.00	1,554,000
大京	88,000	182.00	16,016,000
テーオーシー	18,100	901.00	16,308,100
東京楽天地	8,000	473.00	3,784,000
レオパレス21	56,200	668.00	37,541,600
スターツコーポレーション	5,400	2,307.00	12,457,800
フジ住宅	6,700	678.00	4,542,600
空港施設	6,300	499.00	3,143,700
明和地所	3,400	644.00	2,189,600
住友不動産販売	3,400	2,135.00	7,259,000
ゴールドクレスト	3,700	1,616.00	5,979,200
リロ・ホールディング	1,900	12,850.00	24,415,000
日本エスリード	1,800	1,037.00	1,866,600
日神不動産	7,300	359.00	2,620,700
タカラレーベン	21,000	595.00	12,495,000
サンヨーハウジング名古屋	2,800	1,015.00	2,842,000
イオンモール	30,800	1,589.00	48,941,200
ファースト住建	1,900	1,285.00	2,441,500
ランド	4,900	13.00	63,700
東祥	1,200	3,945.00	4,734,000
トーセイ	7,500	650.00	4,875,000
穴吹興産	5,000	246.00	1,230,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	29,600	1,096.00	32,441,600
サンフロンティア不動産	6,000	1,005.00	6,030,000
エフ・ジェー・ネクスト	4,500	497.00	2,236,500
ランドビジネス	2,600	286.00	743,600
グランディハウス	5,300	364.00	1,929,200
東武鉄道	259,000	600.00	155,400,000
相鉄ホールディングス	83,000	701.00	58,183,000
東京急行電鉄	282,000	954.00	269,028,000
京浜急行電鉄	133,000	1,015.00	134,995,000
小田急電鉄	155,000	1,369.00	212,195,000
京王電鉄	135,000	1,077.00	145,395,000
京成電鉄	73,000	1,653.00	120,669,000
富士急行	13,000	1,233.00	16,029,000
新京成電鉄	7,000	419.00	2,933,000
東日本旅客鉄道	88,600	9,953.00	881,835,800
西日本旅客鉄道	46,600	6,814.00	317,532,400
東海旅客鉄道	43,400	20,755.00	900,767,000
西武ホールディングス	38,600	2,355.00	90,903,000
鴻池運輸	6,700	1,274.00	8,535,800
西日本鉄道	63,000	838.00	52,794,000
ハマキョウレックス	3,900	1,828.00	7,129,200
サカイ引越センター	1,800	2,673.00	4,811,400
近鉄グループホールディングス	487,000	490.00	238,630,000
阪急阪神ホールディングス	325,000	722.00	234,650,000
南海電気鉄道	109,000	672.00	73,248,000
京阪電気鉄道	108,000	789.00	85,212,000
神戸電鉄	13,000	355.00	4,615,000
名古屋鉄道	176,000	554.00	97,504,000
山陽電気鉄道	18,000	455.00	8,190,000
トランコム	1,400	6,340.00	8,876,000
日本通運	187,000	516.00	96,492,000
ヤマトホールディングス	89,500	2,366.50	211,801,750

山九	64,000	528.00	33,792,000
日新	21,000	275.00	5,775,000
丸運	2,800	244.00	683,200
丸全昭和運輸	16,000	399.00	6,384,000
センコー	22,000	711.00	15,642,000
トナミホールディングス	11,000	258.00	2,838,000
ニッコンホールディングス	15,800	1,959.00	30,952,200
日本石油輸送	6,000	240.00	1,440,000
福山通運	29,000	534.00	15,486,000
セイノーホールディングス	34,300	1,198.00	41,091,400
神奈川中央交通	6,000	685.00	4,110,000
日立物流	10,000	1,731.00	17,310,000
丸和運輸機関	1,000	2,169.00	2,169,000
C & F ロジホールディングス	4,200	848.00	3,561,600
日本郵船	435,000	213.00	92,655,000
商船三井	236,000	209.00	49,324,000
川崎汽船	212,000	189.00	40,068,000
N S ユナイテッド海運	24,000	152.00	3,648,000
明治海運	5,100	341.00	1,739,100
飯野海運	24,800	430.00	10,664,000
共栄タンカー	6,000	138.00	828,000
日本航空	92,900	4,192.00	389,436,800
A N A ホールディングス	899,000	325.90	292,984,100
パスコ	5,000	411.00	2,055,000
三菱倉庫	34,000	1,493.00	50,762,000
三井倉庫ホールディングス	28,000	273.00	7,644,000
住友倉庫	35,000	550.00	19,250,000
澁澤倉庫	13,000	276.00	3,588,000
ヤマタネ	23,000	160.00	3,680,000
東陽倉庫	10,000	231.00	2,310,000
乾汽船	3,400	768.00	2,611,200
日本トランスシティ	12,000	353.00	4,236,000
ケイヒン	10,000	145.00	1,450,000
中央倉庫	3,000	912.00	2,736,000
安田倉庫	4,100	697.00	2,857,700
東洋埠頭	14,000	144.00	2,016,000
宇徳	4,700	313.00	1,471,100
上組	58,000	1,050.00	60,900,000
サンリツ	1,200	485.00	582,000
キムラユニティー	1,300	1,086.00	1,411,800
キューソー流通システム	1,500	2,074.00	3,111,000
郵船ロジスティクス	4,400	1,204.00	5,297,600
近鉄エクスプレス	8,600	1,494.00	12,848,400
東海運	2,700	271.00	731,700
エーアイティー	2,300	1,014.00	2,332,200
内外トランスライン	1,200	897.00	1,076,400
東京放送ホールディングス	28,600	1,762.00	50,393,200
日本テレビホールディングス	43,600	1,976.00	86,153,600
朝日放送	4,600	684.00	3,146,400
テレビ朝日ホールディングス	13,000	2,024.00	26,312,000
スカパー J S A T ホールディングス	36,100	683.00	24,656,300
テレビ東京ホールディングス	4,300	1,847.00	7,942,100
日本 B S 放送	800	1,033.00	826,400
U - N E X T	1,100	936.00	1,029,600
コネクシオ	3,800	1,077.00	4,092,600
日本通信	24,800	171.00	4,240,800
クロップス	200	521.00	104,200
日本電信電話	369,600	4,812.00	1,778,515,200
K D D I	485,800	3,013.00	1,463,715,400
光通信	5,700	7,780.00	44,346,000
N T T ドコモ	368,800	2,642.00	974,369,600

エムティーアイ	6,000	735.00	4,410,000
GMOインターネット	17,700	1,218.00	21,558,600
カドカワ	15,000	1,812.00	27,180,000
学研ホールディングス	16,000	237.00	3,792,000
ゼンリン	6,300	1,852.00	11,667,600
昭文社	2,600	626.00	1,627,600
インプレスホールディングス	3,200	125.00	400,000
東京電力	410,900	560.00	230,104,000
中部電力	148,200	1,428.50	211,703,700
関西電力	197,700	1,236.00	244,357,200
中国電力	66,900	1,518.00	101,554,200
北陸電力	47,400	1,640.00	77,736,000
東北電力	121,000	1,458.00	176,418,000
四国電力	43,600	1,625.00	70,850,000
九州電力	106,900	1,086.00	116,093,400
北海道電力	45,300	967.00	43,805,100
沖縄電力	5,100	2,781.00	14,183,100
電源開発	41,300	3,450.00	142,485,000
イーレックス	900	1,664.00	1,497,600
東京瓦斯	541,000	540.90	292,626,900
大阪瓦斯	501,000	441.60	221,241,600
東邦瓦斯	122,000	795.00	96,990,000
北海道瓦斯	11,000	274.00	3,014,000
広島ガス	8,700	405.00	3,523,500
西部瓦斯	54,000	254.00	13,716,000
静岡ガス	13,600	724.00	9,846,400
メタウォーター	3,400	2,384.00	8,105,600
アイネット	2,600	1,090.00	2,834,000
松竹	31,000	1,020.00	31,620,000
東宝	34,100	2,816.00	96,025,600
エイチ・アイ・エス	8,200	3,260.00	26,732,000
東映	18,000	879.00	15,822,000
AOI Pro.	2,500	1,004.00	2,510,000
ラックランド	800	1,412.00	1,129,600
エヌ・ティ・ティ・データ	29,500	5,620.00	165,790,000
共立メンテナンス	3,800	8,500.00	32,300,000
イチネンホールディングス	5,700	905.00	5,158,500
建設技術研究所	3,200	914.00	2,924,800
スペース	2,900	1,239.00	3,593,100
アインホールディングス	5,700	4,945.00	28,186,500
燦ホールディングス	1,100	1,372.00	1,509,200
ピー・シー・エー	800	1,451.00	1,160,800
スバル興業	4,000	381.00	1,524,000
東京テアトル	21,000	117.00	2,457,000
ビジネスブレイン太田昭和	700	921.00	644,700
ナガワ	900	2,730.00	2,457,000
よみうりランド	11,000	419.00	4,609,000
東京都競馬	34,000	212.00	7,208,000
常磐興産	20,000	149.00	2,980,000
カナモト	7,000	2,479.00	17,353,000
東京ドーム	40,000	521.00	20,840,000
D T S	5,300	2,089.00	11,071,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	20,200	2,920.00	58,984,000
シーイーシー	3,400	1,093.00	3,716,200
カプコン	12,200	2,404.00	29,328,800
西尾レントオール	4,000	2,598.00	10,392,000
アイ・エス・ピー	400	737.00	294,800
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	38.00	1,102,000
日本空港ビルデング	15,200	4,010.00	60,952,000
トランス・コスモス	5,800	2,419.00	14,030,200
乃村工藝社	11,100	1,433.00	15,906,300

ジャステック	3,400	914.00	3,107,600
S C S K	11,400	4,380.00	49,932,000
藤田観光	18,000	552.00	9,936,000
K N T - C Tホールディングス	24,000	170.00	4,080,000
日本管財	4,300	1,756.00	7,550,800
トーカイ	2,200	3,070.00	6,754,000
白洋舎	6,000	257.00	1,542,000
セコム	52,600	8,120.00	427,112,000
日本システムウエア	1,900	872.00	1,656,800
セントラル警備保障	2,400	2,114.00	5,073,600
アイネス	7,000	1,089.00	7,623,000
丹青社	10,000	670.00	6,700,000
メイテック	6,300	3,980.00	25,074,000
T K C	4,400	3,145.00	13,838,000
アサツー ディ・ケイ	8,800	2,859.00	25,159,200
富士ソフト	7,100	2,335.00	16,578,500
応用地質	5,200	1,224.00	6,364,800
船井総研ホールディングス	7,000	1,399.00	9,793,000
N S D	10,100	1,658.00	16,745,800
進学会	2,300	622.00	1,430,600
丸紅建材リース	4,000	183.00	732,000
オオバ	3,000	374.00	1,122,000
コナミホールディングス	21,600	2,844.00	61,430,400
学究社	800	1,279.00	1,023,200
ベネッセホールディングス	16,900	3,535.00	59,741,500
イオンディライト	4,900	3,635.00	17,811,500
ナック	3,000	834.00	2,502,000
福井コンピュータホールディングス	1,400	1,008.00	1,411,200
ニチイ学館	8,700	789.00	6,864,300
ダイセキ	9,400	1,757.00	16,515,800
ステップ	2,000	991.00	1,982,000
日鉄住金物産	31,000	336.00	10,416,000
元氣寿司	1,300	2,143.00	2,785,900
トラスコ中山	5,400	3,910.00	21,114,000
ヤマダ電機	145,200	518.00	75,213,600
オートバックスセブン	18,300	1,945.00	35,593,500
アークランドサカモト	7,400	1,035.00	7,659,000
ニトリホールディングス	20,700	8,420.00	174,294,000
グルメ杵屋	3,000	996.00	2,988,000
愛眼	4,200	209.00	877,800
ケーユーホールディングス	2,600	695.00	1,807,000
吉野家ホールディングス	17,600	1,429.00	25,150,400
加藤産業	7,400	2,722.00	20,142,800
イノテック	5,200	440.00	2,288,000
イエローハット	4,500	1,900.00	8,550,000
松屋フーズ	2,300	2,812.00	6,467,600
J B C Cホールディングス	4,300	636.00	2,734,800
J Kホールディングス	4,600	456.00	2,097,600
サガミチェーン	6,300	1,216.00	7,660,800
日伝	2,100	2,817.00	5,915,700
関西スーパーマーケット	4,100	773.00	3,169,300
ミロク情報サービス	3,700	917.00	3,392,900
北沢産業	4,000	162.00	648,000
杉本商事	3,000	1,260.00	3,780,000
因幡電機産業	6,700	3,445.00	23,081,500
王将フードサービス	3,500	3,910.00	13,685,000
プレナス	5,300	1,953.00	10,350,900
ミニストップ	3,500	2,039.00	7,136,500
アークス	8,900	2,299.00	20,461,100
パローホールディングス	10,300	2,417.00	24,895,100
バイテックホールディングス	1,400	950.00	1,330,000

ミスミグループ本社	53,600	1,545.00	82,812,000
藤久	500	1,713.00	856,500
アルテック	4,300	142.00	610,600
ベルク	2,300	3,815.00	8,774,500
大庄	2,500	1,432.00	3,580,000
タキヒヨー	8,000	460.00	3,680,000
ファーストリテイリング	9,600	31,760.00	304,896,000
ソフトバンクグループ	271,000	5,095.00	1,380,745,000
蔵王産業	600	1,251.00	750,600
スズケン	21,700	3,715.00	80,615,500
サンドラッグ	10,100	7,560.00	76,356,000
サックスパー ホールディングス	3,900	1,498.00	5,842,200
ジェコス	3,700	895.00	3,311,500
ヤマザワ	1,200	1,664.00	1,996,800
やまや	900	1,870.00	1,683,000
ルネサスイーストン	2,500	410.00	1,025,000
ペルーナ	11,800	504.00	5,947,200
合 計	80,498,300		93,167,451,910

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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		83,756	555,149,420
コール・ローン		218,478,289	12,096,597
国債証券		138,100,440,400	111,482,950,600
地方債証券		10,652,666,670	8,712,383,705
特殊債券		15,585,164,349	11,929,987,179
社債券		9,430,313,970	8,080,609,220
未収入金		351,000,000	977,700,000
未収利息		641,607,808	526,178,865
前払費用		8,703,929	4,240,941
流動資産合計		174,988,459,171	142,281,296,527
資産合計		174,988,459,171	142,281,296,527
負債の部			
流動負債			
未払解約金		54,776,000	1,220,714,241
流動負債合計		54,776,000	1,220,714,241

負債合計		54,776,000	1,220,714,241
純資産の部			
元本等			
元本	1	145,599,818,302	112,637,231,314
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		29,333,864,869	28,423,350,972
元本等合計		174,933,683,171	141,060,582,286
純資産合計		174,933,683,171	141,060,582,286
負債純資産合計		174,988,459,171	142,281,296,527

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

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
-------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（平成27年 2月20日現在）	（平成28年 2月22日現在）
1 期首元本額	160,599,147,379円	145,599,818,302円
期中追加設定元本額	21,448,965,807円	20,917,964,505円
期中一部解約元本額	36,448,294,884円	53,880,551,493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）	659,871,549円	1,165,481,769円
ステート・ストリート日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,213,235,438円	3,475,655,804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＞	243,262,193円	118,068,530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＞	13,548,455,587円	6,850,158,087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＞	1,813,101円	1,738,192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＞	92,688,633円	66,210,122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＞	67,434,987円	48,238,130円
ステート・ストリート・バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	25,593,675,326円	20,871,418,406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>	156,689,258円	83,382,907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>	17,689,205,182円	11,523,951,706円
ステート・ストリート・バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	3,992,915,098円	3,388,876,404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>	34,277,722円	26,358,049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>	1,793,222,235円	861,692,718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>	6,414,165,897円	2,813,677,488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>	3,087,490,477円	1,282,599,221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>	13,041,114,995円	10,926,324,967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>	1,426,566,192円	967,179,722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>	4,356,938,342円	3,602,900,305円
日本債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	289,514,750円	236,460,798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>	93,675,824円	85,553,492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>	53,814,735円	47,310,904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>	772,629,122円	1,334,458,108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>	117,436,277円	61,812,496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>	6,230,674,441円	5,390,636,692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>	104,024,317円	52,428,279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>	59,037,267円	56,478,381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>	453,659円	443,409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>	1,796,284,662円	1,661,098,501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>	10,111,445,386円	6,919,654,462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>	2,243,097,626円	2,139,155,035円
4資産インデックスバランスVA20 <適格機関投資家限定>	4,667,031,784円	4,101,545,966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>	17,485,646,311円	15,133,234,444円
4資産インデックスバランスVA50 <適格機関投資家限定>	21,039,605円	18,902,051円
Tadリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド(ステイブル)年金<適 格機関投資家限定>	442,582,912円	1,265,180,071円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド (年金)<適格機関投資家限定>	506,615,308円	492,449,114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>	83,005,928円	円
フレックス資産配分戦略ファンド<適 格機関投資家限定>	円	192,174,876円
Tadリスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド(ステイブル)<適格機 関投資家限定>	円	351,635,700円
ステート・ストリート・グローバルバ ランス40VA<適格機関投資家限定 >	359,271,528円	262,609,337円
ステート・ストリート・グローバルバ ランス40VA2<適格機関投資家限 定>	3,937,626,841円	3,148,233,745円
ステート・ストリート・グローバルバ ランス40VA3<適格機関投資家限 定>	246,104,759円	191,933,757円
ステート・ストリート・グローバルバ ランス50VA<適格機関投資家限定 >	132,749,559円	88,700,940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>	433,033,489円	1,331,228,229円
計	145,599,818,302円	112,637,231,314円
2 受益権の総数	145,599,818,302口	112,637,231,314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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（平成27年 2月20日現在）	（平成28年 2月22日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	1,641,506,400	3,542,878,200
地方債証券	63,734,735	116,381,829
特殊債券	103,924,490	155,596,813
社債券	29,016,390	14,831,330
合計	1,838,182,015	3,829,688,172

（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26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22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27年 2月20日現在）	（平成28年 2月22日現在）
1口当たり純資産額	1.2015円	1.2523円
（1万口当たり純資産額）	（12,015円）	（12,523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	249,624,000	
	第101回利付国債（20年）	300,000,000	381,576,000	
	第102回利付国債（20年）	200,000,000	255,196,000	
	第103回利付国債（20年）	200,000,000	252,768,000	
	第104回利付国債（20年）	150,000,000	185,824,500	
	第105回利付国債（20年）	200,000,000	248,268,000	
	第106回利付国債（20年）	200,000,000	250,736,000	
	第106回利付国債（5年）	400,000,000	402,484,000	
	第107回利付国債（20年）	200,000,000	248,738,000	
	第107回利付国債（5年）	500,000,000	503,695,000	
	第108回利付国債（20年）	200,000,000	243,560,000	
	第108回利付国債（5年）	800,000,000	804,448,000	
	第109回利付国債（20年）	100,000,000	121,956,000	
	第109回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,006,740,000	
	第110回利付国債（20年）	200,000,000	249,178,000	
	第110回利付国債（5年）	500,000,000	505,445,000	
第111回利付国債（20年）	300,000,000	378,324,000		

第111回利付国債(5年)	1,100,000,000	1,114,267,000	
第112回利付国債(20年)	300,000,000	374,670,000	
第112回利付国債(5年)	600,000,000	608,736,000	
第113回利付国債(20年)	200,000,000	250,202,000	
第113回利付国債(5年)	500,000,000	506,115,000	
第114回利付国債(20年)	500,000,000	626,485,000	
第114回利付国債(5年)	100,000,000	101,343,000	
第115回利付国債(20年)	400,000,000	506,556,000	
第115回利付国債(5年)	900,000,000	909,765,000	
第116回利付国債(20年)	500,000,000	634,205,000	
第116回利付国債(5年)	200,000,000	202,382,000	
第117回利付国債(5年)	600,000,000	607,776,000	
第118回利付国債(20年)	400,000,000	497,104,000	
第118回利付国債(5年)	500,000,000	506,930,000	
第119回利付国債(5年)	800,000,000	808,416,000	
第120回利付国債(5年)	700,000,000	710,318,000	
第121回利付国債(5年)	800,000,000	808,920,000	
第122回利付国債(20年)	400,000,000	486,132,000	
第122回利付国債(5年)	550,000,000	556,457,000	
第123回利付国債(20年)	500,000,000	629,925,000	
第123回利付国債(5年)	700,000,000	708,603,000	
第124回利付国債(5年)	600,000,000	607,704,000	
第125回利付国債(5年)	500,000,000	506,565,000	
第126回利付国債(20年)	400,000,000	498,732,000	
第127回利付国債(20年)	400,000,000	492,960,000	
第128回利付国債(20年)	400,000,000	493,364,000	
第12回利付国債(30年)	300,000,000	379,977,000	
第130回利付国債(20年)	200,000,000	243,718,000	
第132回利付国債(20年)	200,000,000	240,832,000	
第133回利付国債(20年)	300,000,000	365,751,000	
第135回利付国債(20年)	300,000,000	361,053,000	
第136回利付国債(20年)	200,000,000	237,484,000	
第137回利付国債(20年)	150,000,000	180,421,500	
第139回利付国債(20年)	300,000,000	356,235,000	
第13回利付国債(30年)	300,000,000	374,853,000	
第140回利付国債(20年)	200,000,000	240,402,000	
第141回利付国債(20年)	200,000,000	240,404,000	
第142回利付国債(20年)	500,000,000	608,870,000	
第143回利付国債(20年)	400,000,000	473,652,000	
第144回利付国債(20年)	200,000,000	233,466,000	
第145回利付国債(20年)	720,000,000	863,892,000	
第146回利付国債(20年)	670,000,000	803,095,500	
第147回利付国債(20年)	360,000,000	425,138,400	
第148回利付国債(20年)	500,000,000	580,920,000	
第149回利付国債(20年)	600,000,000	696,012,000	
第14回ポーランド共和国	100,000,000	100,771,000	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	395,097,000	
第150回利付国債(20年)	600,000,000	684,198,000	
第151回利付国債(20年)	500,000,000	551,660,000	
第152回利付国債(20年)	350,000,000	385,266,000	
第153回利付国債(20年)	350,000,000	390,719,000	
第154回利付国債(20年)	540,000,000	591,559,200	
第15回利付国債(30年)	200,000,000	266,898,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	266,834,000	
第17回利付国債(30年)	200,000,000	263,324,000	
第18回利付国債(30年)	100,000,000	129,862,000	
第19回利付国債(30年)	200,000,000	259,756,000	
第1回利付国債(30年)	300,000,000	403,581,000	
第1回利付国債(40年)	160,000,000	218,363,200	
第20回利付国債(30年)	300,000,000	400,527,000	
第21回利付国債(30年)	200,000,000	259,534,000	

第22回利付国債(30年)	100,000,000	133,430,000	
第23回利付国債(30年)	100,000,000	133,442,000	
第24回利付国債(30年)	320,000,000	427,024,000	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	388,986,000	
第26回利付国債(30年)	150,000,000	197,356,500	
第27回利付国債(30年)	220,000,000	294,210,400	
第285回利付国債(10年)	900,000,000	918,162,000	
第286回利付国債(10年)	1,500,000,000	1,539,435,000	
第287回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,027,610,000	
第288回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,029,670,000	
第289回利付国債(10年)	800,000,000	824,824,000	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	402,060,000	
第290回利付国債(10年)	500,000,000	516,805,000	
第291回利付国債(10年)	100,000,000	103,154,000	
第292回利付国債(10年)	400,000,000	415,936,000	
第293回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,047,180,000	
第294回利付国債(10年)	400,000,000	417,940,000	
第295回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,144,209,000	
第296回利付国債(10年)	100,000,000	104,458,000	
第297回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,254,960,000	
第298回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,668,752,000	
第299回利付国債(10年)	400,000,000	418,700,000	
第29回利付国債(30年)	400,000,000	528,924,000	
第2回利付国債(30年)	700,000,000	907,095,000	
第2回利付国債(40年)	550,000,000	722,986,000	
第300回利付国債(10年)	700,000,000	737,044,000	
第301回利付国債(10年)	600,000,000	634,380,000	
第302回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,053,960,000	
第303回利付国債(10年)	600,000,000	634,740,000	
第304回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,159,741,000	
第305回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,058,130,000	
第306回利付国債(10年)	800,000,000	852,464,000	
第307回利付国債(10年)	900,000,000	955,332,000	
第308回利付国債(10年)	700,000,000	745,402,000	
第309回利付国債(10年)	800,000,000	844,744,000	
第30回利付国債(30年)	350,000,000	456,228,500	
第310回利付国債(10年)	900,000,000	948,933,000	
第311回利付国債(10年)	600,000,000	627,090,000	
第312回利付国債(10年)	800,000,000	853,664,000	
第313回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,075,660,000	
第314回利付国債(10年)	900,000,000	958,887,000	
第315回利付国債(10年)	750,000,000	805,350,000	
第316回利付国債(10年)	800,000,000	854,744,000	
第317回利付国債(10年)	600,000,000	643,026,000	
第318回利付国債(10年)	250,000,000	266,522,500	
第319回利付国債(10年)	700,000,000	752,465,000	
第31回利付国債(30年)	400,000,000	513,596,000	
第320回利付国債(10年)	700,000,000	748,349,000	
第321回利付国債(10年)	300,000,000	321,609,000	
第322回利付国債(10年)	700,000,000	746,130,000	
第323回利付国債(10年)	200,000,000	213,734,000	
第324回利付国債(10年)	400,000,000	424,912,000	
第325回利付国債(10年)	600,000,000	638,664,000	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	317,895,000	
第327回利付国債(10年)	700,000,000	746,585,000	
第328回利付国債(10年)	600,000,000	632,586,000	
第329回利付国債(10年)	500,000,000	535,145,000	
第32回利付国債(30年)	600,000,000	784,788,000	
第330回利付国債(10年)	900,000,000	964,719,000	
第331回利付国債(10年)	500,000,000	528,305,000	
第332回利付国債(10年)	900,000,000	951,894,000	

第333回利付国債(10年)	700,000,000	740,747,000	
第334回利付国債(10年)	900,000,000	952,839,000	
第335回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,155,550,000	
第336回利付国債(10年)	200,000,000	210,116,000	
第337回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,032,830,000	
第338回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,041,450,000	
第339回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,197,322,500	
第33回利付国債(30年)	350,000,000	435,347,500	
第340回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,768,459,000	
第341回利付国債(10年)	500,000,000	514,980,000	
第34回利付国債(30年)	500,000,000	644,805,000	
第35回利付国債(30年)	500,000,000	622,735,000	
第36回利付国債(20年)	300,000,000	315,093,000	
第36回利付国債(30年)	500,000,000	622,690,000	
第37回利付国債(20年)	400,000,000	420,752,000	
第37回利付国債(30年)	500,000,000	611,800,000	
第38回利付国債(20年)	100,000,000	106,059,000	
第38回利付国債(30年)	550,000,000	659,884,500	
第39回利付国債(20年)	100,000,000	105,852,000	
第39回利付国債(30年)	330,000,000	403,685,700	
第3回利付国債(30年)	300,000,000	385,317,000	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	329,577,500	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	106,512,000	
第40回利付国債(30年)	380,000,000	455,544,000	
第41回利付国債(20年)	100,000,000	105,325,000	
第41回利付国債(30年)	150,000,000	176,110,500	
第42回利付国債(30年)	300,000,000	352,194,000	
第43回利付国債(30年)	300,000,000	351,777,000	
第44回利付国債(30年)	200,000,000	234,496,000	
第45回利付国債(20年)	650,000,000	719,121,000	
第45回利付国債(30年)	320,000,000	359,004,800	
第46回利付国債(30年)	400,000,000	448,572,000	
第47回利付国債(20年)	600,000,000	665,988,000	
第47回利付国債(30年)	200,000,000	229,284,000	
第48回利付国債(20年)	300,000,000	339,105,000	
第48回利付国債(30年)	500,000,000	547,515,000	
第49回利付国債(20年)	100,000,000	111,697,000	
第4回利付国債(40年)	250,000,000	330,457,500	
第50回利付国債(20年)	50,000,000	55,336,500	
第51回利付国債(20年)	350,000,000	390,985,000	
第52回利付国債(20年)	100,000,000	112,770,000	
第55回利付国債(20年)	500,000,000	566,700,000	
第57回利付国債(20年)	800,000,000	905,464,000	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	127,677,000	
第5回利付国債(40年)	130,000,000	164,457,800	
第60回利付国債(20年)	700,000,000	775,551,000	
第61回利付国債(20年)	350,000,000	379,011,500	
第63回利付国債(20年)	500,000,000	572,140,000	
第65回利付国債(20年)	400,000,000	463,960,000	
第68回利付国債(20年)	500,000,000	593,990,000	
第69回利付国債(20年)	300,000,000	353,952,000	
第6回利付国債(30年)	100,000,000	130,967,000	
第6回利付国債(40年)	150,000,000	185,254,500	
第70回利付国債(20年)	600,000,000	725,508,000	
第72回利付国債(20年)	600,000,000	712,866,000	
第74回利付国債(20年)	300,000,000	357,768,000	
第76回利付国債(20年)	200,000,000	235,624,000	
第77回利付国債(20年)	300,000,000	356,169,000	
第78回利付国債(20年)	250,000,000	295,360,000	
第7回利付国債(30年)	300,000,000	389,259,000	
第7回利付国債(40年)	200,000,000	234,716,000	

	第80回利付国債（20年）	100,000,000	120,014,000	
	第81回利付国債（20年）	200,000,000	238,850,000	
	第83回利付国債（20年）	300,000,000	361,860,000	
	第85回利付国債（20年）	300,000,000	363,231,000	
	第88回利付国債（20年）	400,000,000	493,904,000	
	第89回利付国債（20年）	400,000,000	489,784,000	
	第8回利付国債（30年）	300,000,000	365,616,000	
	第8回利付国債（40年）	200,000,000	215,218,000	
	第90回利付国債（20年）	300,000,000	368,397,000	
	第91回利付国債（20年）	300,000,000	371,556,000	
	第92回利付国債（20年）	340,000,000	415,000,600	
	第93回利付国債（20年）	300,000,000	363,777,000	
	第94回利付国債（20年）	300,000,000	367,071,000	
	第95回利付国債（20年）	150,000,000	187,455,000	
	第96回利付国債（20年）	200,000,000	245,312,000	
	第97回利付国債（20年）	150,000,000	186,240,000	
	第98回利付国債（20年）	100,000,000	122,945,000	
	第99回利付国債（20年）	100,000,000	123,290,000	
	第9回利付国債（30年）	100,000,000	115,304,000	
国債証券	小計	99,790,000,000	111,482,950,600	
地方債証券	第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,515,000	
	第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,737,000	
	第10回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	123,375,000	
	第10回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	119,805,000	
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,536,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,268,000	
	第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,335,000	
	第120回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	105,261,000	
	第124回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,521,000	
	第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,254,000	
	第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,565,000	
	第12回東京都公募公債（20年）	100,000,000	123,818,000	
	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,729,000	
	第132回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,389,000	
	第135回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	103,640,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,233,000	
	第138回神奈川県公募公債	7,260,000	7,269,946	
	第139回神奈川県公募公債	300,000	300,384	
	第13回東京都公募公債（20年）	100,000,000	122,240,000	
	第141回神奈川県公募公債	5,000,000	5,032,000	
	第143回神奈川県公募公債	10,000,000	10,145,100	
	第144回神奈川県公募公債	40,000,000	40,600,400	
	第145回神奈川県公募公債	40,000,000	40,762,400	
	第147回神奈川県公募公債	50,000,000	51,293,000	
	第149回神奈川県公募公債	9,000,000	9,258,750	
	第14回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	124,526,000	
	第188回神奈川県公募公債	100,000,000	106,303,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	100,000,000	118,798,000	
	第287回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,000,100	
	第288回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,015,600	
	第296回大阪府公募公債（10年）	30,000,000	30,426,900	
	第2回兵庫県公募公債（30年）	100,000,000	125,573,000	
	第301回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,210,400	
	第305回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	41,146,800	
	第309回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,301,400	
	第30回2号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	103,880,000	
第312回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,332,800		
第316回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,448,200		
第320回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,505,300		
第323回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	42,018,800		

第324回大阪府公募公債（10年）	8,000,000	8,402,960	
第325回大阪府公募公債（10年）	6,000,000	6,313,620	
第326回大阪府公募公債（10年）	56,000,000	59,009,440	
第346回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,800,000	
第368回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,573,000	
第374回大阪府公募公債（10年）	134,000,000	142,854,720	
第387回大阪府公募公債（10年）	44,040,000	45,604,300	
第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	131,055,000	
第3回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	112,352,000	
第45回共同発行市場公募地方債	7,800,000	7,909,278	
第468回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	104,976,000	
第480回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	105,262,000	
第49回共同発行市場公募地方債	15,500,000	15,821,780	
第4回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	129,455,000	
第56回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,148,800	
第57回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,150,350	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	126,463,000	
第60回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,309,100	
第61回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,335,900	
第62回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,783,400	
第631回東京都公募公債	700,000	700,791	
第634回東京都公募公債	20,000,000	20,120,000	
第637回東京都公募公債	10,000,000	10,104,200	
第63回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,435,800	
第649回東京都公募公債	2,300,000	2,362,031	
第652回東京都公募公債	1,400,000	1,442,952	
第658回東京都公募公債	10,000,000	10,456,800	
第662回東京都公募公債	10,000,000	10,434,200	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	117,384,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	105,785,000	
第7回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,467,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,807,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,568,000	
第82回川崎市公募公債	130,000,000	137,074,600	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,770,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,655,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,006,000	
第90回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,114,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,522,000	
平成17年度第2回鹿児島県公募公債（10年）	12,000,000	12,019,560	
平成18年度第1回横浜市公募公債	10,000,000	10,012,600	
平成18年度第1回広島市公募公債	30,000,000	30,456,000	
平成18年度第1回堺市公募公債	40,400,000	41,026,604	
平成18年度第1回埼玉県公募公債	5,500,000	5,517,050	
平成18年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,143,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	7,500,000	7,566,525	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	2,000,000	2,009,720	
平成18年度第4回愛知県公募公債（10年）	23,100,000	23,367,960	
平成18年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,190,600	
平成18年度第5回兵庫県公募公債	30,000,000	30,191,100	
平成18年度第6回福岡市公募公債	30,000,000	30,453,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	2,000,000	2,035,520	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	103,308,000	
平成19年度第14回北海道公募公債	10,000,000	10,338,000	
平成19年度第1回愛知県公募公債（10年）	21,700,000	22,174,362	
平成19年度第1回岡山県公募公債（10年）	42,200,000	43,473,174	
平成19年度第1回広島県公募公債	13,800,000	14,104,428	
平成19年度第1回埼玉県公募公債	13,150,000	13,421,679	
平成19年度第1回静岡県公募公債	18,300,000	18,705,528	
平成19年度第1回千葉県公募公債	2,000,000	2,043,940	
平成19年度第1回大分県公募公債	15,670,000	16,159,687	

平成19年度第2回熊本県公募公債（10年）	30,000,000	30,937,500		
平成19年度第4回大阪市公募公債	10,000,000	10,249,500		
平成19年度第5回福岡市公募公債	13,700,000	14,122,371		
平成19年度第9回大阪市公募公債	30,000,000	30,895,800		
平成19年度第9回北海道公募公債	21,000,000	21,626,010		
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	104,857,000		
平成20年度第1回浜松市公募公債	11,000,000	11,519,970		
平成20年度第2回札幌市公募公債	22,550,000	23,560,916		
平成20年度第2回大阪市公募公債	20,000,000	20,911,600		
平成20年度第3回大阪市公募公債	30,000,000	31,327,500		
平成20年度第7回千葉県公募公債	1,000,000	1,044,400		
平成20年度第7回兵庫県公募公債	10,000,000	10,429,100		
平成20年度第8回大阪市公募公債	40,000,000	41,881,600		
平成21年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,107,000		
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	105,462,000		
平成21年度第1回埼玉県公募公債	20,000,000	20,972,800		
平成21年度第1回千葉県公募公債	40,000,000	41,946,000		
平成21年度第2回熊本県公募公債（10年）	10,000,000	10,505,100		
平成21年度第2回広島県公募公債	16,160,000	16,971,555		
平成21年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,585,600		
平成21年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	105,531,000		
平成21年度第2回千葉県公募公債	40,000,000	42,046,800		
平成21年度第3回埼玉県公募公債	20,000,000	21,100,400		
平成21年度第6回北海道公募公債	60,000,000	63,337,800		
平成21年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	105,753,000		
平成22年度第1回静岡市公募公債	12,000,000	12,578,400		
平成22年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	122,463,000		
平成23年度第2回北九州市公募公債	111,000,000	117,809,850		
平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	105,862,000		
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	105,340,000		
平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	105,466,000		
平成24年度第14回愛知県公募公債（15年）	100,000,000	112,461,000		
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	106,454,000		
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	105,236,000		
平成24年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	105,358,000		
平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	105,389,000		
平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	31,560,600		
平成24年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,409,000		
平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	31,458,300		
平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	104,634,000		
平成24年度第9回北海道公募公債	107,400,000	112,695,894		
平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,058,000		
平成25年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,303,000		
平成25年度第7回北海道公募公債	100,000,000	105,536,000		
平成26年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	111,753,000		
地方債証券 小計	8,052,430,000	8,712,383,705		
特殊債券	F89回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	114,819,000	
	い第730号商工債	100,000,000	100,043,000	
	い第757号農林債	100,000,000	100,726,000	
	い第758号農林債	100,000,000	100,876,000	
	い第763号商工債	100,000,000	100,753,000	
	い第763号農林債	100,000,000	100,724,000	
	い第772号農林債	100,000,000	100,699,000	
	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	105,314,000	
	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	105,544,000	
	第10回日本政策金融公庫社債	100,000,000	123,460,000	
	第10回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,299,600	
	第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,968,000	
	第11回関西国際空港	100,000,000	102,996,000	

第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,818,000	
第11回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,527,000	
第12回政府保証東日本高速道路債券	22,000,000	22,643,940	
第13回沖縄振興開発金融公庫債券	10,000,000	10,553,400	
第13回公営企業債券(20年)	10,000,000	11,852,800	
第13回政府保証西日本高速道路債券	4,000,000	4,116,320	
第13回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,010,040	
第14回政府保証中日本高速道路債券	5,000,000	5,123,800	
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	11,068,640	
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	124,326,000	
第15回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,419,900	
第15回日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	50,585,000	
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	201,712	
第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,018,060	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,541,000	37,233,107	
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	232,532,000	
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	120,285,000	
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	105,256,000	
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	105,429,000	
第179号商工債(3年)	100,000,000	100,193,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	36,501,000	38,344,665	
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	104,689,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,854,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	104,699,000	
第18回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,048,000	
第18回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,027,860	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	36,432,000	38,090,020	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	136,134,000	
第191回政府保証中小企業債券	16,000,000	16,422,080	
第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	106,378,000	
第19回都市再生債券	50,000,000	52,097,500	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	59,373,000	62,241,309	
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	1,060,330	
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	105,277,000	
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	105,476,000	
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	202,490	
第20回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	118,839,000	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,899,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,000,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,113,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	118,712,000	
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	3,043,260	
第24回公営企業債券	70,000,000	71,115,100	
第24回政府保証中日本高速道路債券	20,000,000	20,766,600	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,338,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,436,000	89,496,535	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	20,000,000	21,020,600	

第273回信金中金債(5年)	100,000,000	100,360,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,435,000	
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,750,000	
第284回信金中金債(5年)	100,000,000	100,901,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,417,000	50,432,534	
第28回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,802,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,472,000	26,979,687	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,253,000	52,354,987	
第2回政府保証原子力損害賠償支援機構債	100,000,000	100,249,000	
第2回政府保証西日本高速道路債券	13,000,000	13,157,560	
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	108,746,000	
第2回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,977,000	
第2回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	41,404,000	43,649,338	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,508,000	64,353,141	
第300回信金中金債(5年)	100,000,000	100,675,000	
第303回信金中金債(5年)	100,000,000	100,782,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,482,000	
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	10,183,600	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,253,000	53,431,131	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,381,000	54,457,830	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,566,000	52,265,272	
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	3,059,310	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	107,109,000	
第342回東京交通債券	30,000,000	34,337,100	
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	51,053,000	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,596,000	33,718,935	
第34回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,026,000	
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	7,175,560	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,153,000	63,578,235	
第36回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,700,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,616,000	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,027,070	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,754,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,626,000	28,416,598	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,705,000	65,796,041	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,663,000	68,719,956	
第39回日本政策投資銀行社債	10,000,000	10,274,000	
第3回政府保証東日本高速道路債券	17,000,000	17,082,280	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,356,000	
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	1,028,750	
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	67,780,020	
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	1,030,150	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,792,000	77,313,111	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,672,000	157,139,980	
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	9,270,630	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,063,000	74,572,846	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,829,000	
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	69,876,120	
第48回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,260,000	
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	13,375,960	

第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,275,000	
第4回公営企業債券(30年)	100,000,000	137,268,000	
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	113,821,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,836,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,257,000	
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	11,320,320	
第55回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,076,000	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,452,000	84,384,380	
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	2,077,560	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,541,000	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	120,068,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,418,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,481,000	
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	8,342,560	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,817,000	84,447,982	
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	104,169,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,085,000	86,832,133	
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	80,425,730	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,510,000	90,258,370	
第6回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	21,767,000	23,540,139	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,996,000	32,299,071	
第6回中小企業債券	10,000,000	10,159,500	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,725,000	88,264,569	
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	64,491,780	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,131,000	86,724,753	
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	104,054,000	
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	104,483,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,886,000	90,661,196	
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	69,270,300	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,334,000	92,228,646	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,877,000	
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	105,091,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,363,000	
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	130,867,000	
第861回政府保証公営企業債券	18,000,000	18,017,640	
第862回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,013,700	
第863回政府保証公営企業債券	12,000,000	12,060,360	
第865回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,072,180	
第866回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,028,800	
第867回政府保証公営企業債券	4,000,000	4,041,760	
第868回政府保証公営企業債券	5,000,000	5,059,700	
第872回政府保証公営企業債券	64,000,000	65,139,840	
第873回政府保証公営企業債券	90,000,000	91,608,300	
第874回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,175,320	
第875回政府保証公営企業債券	74,000,000	75,551,780	
第879回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,372,120	
第880回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,440,850	
第881回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,869,000	
第882回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,031,840	
第885回政府保証公営企業債券	40,000,000	41,535,600	

	第886回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,126,930	
	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	128,172,000	
	第8回公営企業債券(30年)	10,000,000	12,894,100	
	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	33,041,250	
	第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,229,000	32,491,036	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,675,000	
	第96回都市再生債券	100,000,000	104,374,000	
	第98回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,126,000	
	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,162,000	
	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	109,613,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,024,000	48,656,986	
	第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,047,000	33,463,698	
特殊債券	小計	11,039,210,000	11,929,987,179	
社債券	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	111,432,000	
	第112回三菱地所	100,000,000	102,076,000	
	第11回パナソニック	100,000,000	102,033,000	
	第11回三井住友銀行	100,000,000	103,727,000	
	第11回電源開発	100,000,000	114,377,000	
	第12回パナソニック	100,000,000	100,837,000	
	第12回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	102,907,000	
	第138回オリックス	100,000,000	102,352,000	
	第13回東京地下鉄	100,000,000	115,648,000	
	第14回トヨタ自動車	100,000,000	105,798,000	
	第14回武田薬品工業	100,000,000	101,385,000	
	第16回ジェイ エフ イー ホールディングス	100,000,000	100,933,000	
	第17回東日本旅客鉄道	100,000,000	110,962,000	
	第18回コーベラティブ・セントラル・ライファイズン・ポエレン	100,000,000	101,108,000	
	第18回みずほ銀行	100,000,000	115,791,000	
	第20回大阪瓦斯	100,000,000	107,688,000	
	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	100,119,000	
	第23回三菱UFJリース	100,000,000	101,044,000	
	第245回四国電力	100,000,000	109,650,000	
	第257回北海道電力	100,000,000	100,628,000	
	第25回ホンダファイナンス	100,000,000	101,199,000	
	第25回三井住友銀行	100,000,000	117,210,000	
	第25回日本郵船	100,000,000	119,175,000	
	第261回北海道電力	12,000,000	12,554,160	
	第26回東海旅客鉄道	100,000,000	105,331,000	
	第27回エヌ・ティ・ティ・データ	100,000,000	105,584,000	
	第27回三井住友銀行	100,000,000	107,379,000	
	第281回北陸電力	100,000,000	104,162,000	
	第28回東京瓦斯	100,000,000	121,407,000	
	第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ	100,000,000	101,204,000	
	第2回あおぞら銀行	100,000,000	100,299,000	
	第32回東日本旅客鉄道	100,000,000	116,870,000	
	第33回大成建設	100,000,000	101,375,000	
	第354回中国電力	100,000,000	104,173,000	
第378回東北電力	100,000,000	100,632,000		
第37回三菱化学	100,000,000	104,825,000		
第382回東北電力	10,000,000	10,356,500		
第394回九州電力	100,000,000	102,727,000		
第39回野村ホールディングス	100,000,000	101,537,000		

第3回G L P投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,584,000	
第3回西日本旅客鉄道	70,000,000	71,983,800	
第3回東日本旅客鉄道	3,000,000	2,999,460	
第3回富士フィルムホールディングス	100,000,000	104,799,000	
第400回九州電力	100,000,000	106,408,000	
第42回ソフトバンク	100,000,000	100,823,000	
第445回東北電力	100,000,000	104,593,000	
第450回関西電力	100,000,000	100,952,000	
第46回伊藤忠商事	100,000,000	102,280,000	
第473回関西電力	100,000,000	104,708,000	
第47回東海旅客鉄道	100,000,000	123,864,000	
第486回中部電力	100,000,000	104,108,000	
第492回関西電力	100,000,000	101,333,000	
第4回ヒューリック	100,000,000	100,812,000	
第4回プレミア投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,650,000	
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	100,223,000	
第4回東京地下鉄	10,000,000	12,118,300	
第506回中部電力	100,000,000	102,630,000	
第520回東京電力	100,000,000	100,458,000	
第525回東京電力	100,000,000	101,442,000	
第52回日本電信電話	100,000,000	101,827,000	
第531回東京電力	100,000,000	102,192,000	
第536回東京電力	100,000,000	102,382,000	
第545回東京電力	100,000,000	103,414,000	
第54回日立キャピタル	100,000,000	101,496,000	
第55回日産自動車	100,000,000	100,719,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	113,905,000	
第60回トヨタファイナンス	100,000,000	100,526,000	
第63回日本電信電話	100,000,000	104,105,000	
第65回三菱地所	100,000,000	117,440,000	
第69回東日本旅客鉄道	100,000,000	104,928,000	
第6回ノルデア・バンク・アクツィエボラーグ・ブブリクト円貨社	100,000,000	100,178,000	
第6回みずほ銀行	100,000,000	101,428,000	
第6回りそな銀行	100,000,000	107,376,000	
第7回みずほコーポレート銀行	100,000,000	107,551,000	
第7回三井住友信託銀行	100,000,000	100,720,000	
第84回住友不動産	100,000,000	100,585,000	
第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,492,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	101,095,000	
第9回モルガン・スタンレー円貨債券	100,000,000	100,774,000	
第9回沖縄電力	100,000,000	101,739,000	
第9回三菱UFJ信託銀行	100,000,000	107,474,000	
社債券 小計	7,705,000,000	8,080,609,220	
合計	126,586,640,000	140,205,930,704	

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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		716,877,284	3,682,348,691
金銭信託			2,636,234,789
コール・ローン		4,453,072,933	57,415,699
株式		161,915,065,293	117,258,392,917
投資証券		3,926,195,100	3,210,321,908
派生商品評価勘定		253,645,558	154,175,708
未収入金		43,461,111	96,098,389
未収配当金		271,223,034	240,434,552
未収利息		1,220	1
差入委託証拠金		1,303,160,640	1,511,987,097
流動資産合計		172,882,702,173	128,847,409,751
資産合計		172,882,702,173	128,847,409,751
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,744,337	56,853,548
未払解約金		323,355,800	1,418,716,000
流動負債合計		327,100,137	1,475,569,548
負債合計		327,100,137	1,475,569,548
純資産の部			
元本等			
元本	1	80,290,033,338	69,950,993,970
剰余金			
剰余金又は欠損金()		92,265,568,698	57,420,846,233
元本等合計		172,555,602,036	127,371,840,203
純資産合計		172,555,602,036	127,371,840,203
負債純資産合計		172,882,702,173	128,847,409,751

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
-------------------	--

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1 期首元本額	98,382,507,045円	80,290,033,338円
期中追加設定元本額	21,380,624,115円	22,408,813,834円
期中一部解約元本額	39,473,097,822円	32,747,853,202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	8,064,168,654円	7,404,464,299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	6,924,147,313円	7,007,507,550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	36,668,594円	37,966,903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)	38,444,715円	348,830,019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)	3,682,692,491円	3,076,645,691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)	456,704,882円	264,414,758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>	27,287,269円	15,425,761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>	3,274,170,208円	2,025,097,086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>	354,653円	366,021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>	34,827,896円	28,538,491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>	19,740,254円	16,187,131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>	14,869,453,492円	13,143,616,943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>	37,466,994円	22,523,943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>	2,486,556,867円	1,782,091,006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>	1,343,675,610円	1,236,269,890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>	157,662,975円	133,045,853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>	266,321,849円	136,147,847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>	2,540,345,430円	1,171,209,274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>	786,225,250円	348,193,513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>	3,231,298,517円	2,930,127,488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>	538,201,982円	405,577,482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>	1,789,923,358円	1,613,319,080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>	56,043,997円	55,507,311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>	64,043,185円	58,846,125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>	46,544,688円	26,045,962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>	461,986,014円	428,549,962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>	4,540,789円	2,668,011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>	6,916,911円	7,079,130円

ステート・ストリート・バランスファン ドV A 5 0 D < 適格機関投資家限定 >	113,743円	120,390円
ステート・ストリート・バランスファン ドV A 1 0 A < 適格機関投資家限定 >	56,743,231円	56,333,060円
ステート・ストリート外国株式インデッ クス・ファンドV A 3 < 適格機関投資家 限定 >	12,002,478,528円	9,085,167,180円
4資産インデックスバランスV A 2 0 < 適格機関投資家限定 >	453,837,467円	409,583,792円
4資産インデックスバランスV A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	57,427,685円	52,316,340円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦 略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機 関投資家限定 >	26,333,704円	272,448,392円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦 略ファンド（ステイブル） < 適格機関投 資家限定 >	円	75,618,215円
ワールドエクイティ・ファンドV L < 適 格機関投資家限定 >	16,446,684,143円	16,273,144,071円
計	80,290,033,338円	69,950,993,970円
2 受益権の総数	80,290,033,338口	69,950,993,970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27年 2月20日現在）	（平成28年 2月22日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

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

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	（平成27年 2月20日現在）	（平成28年 2月22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	4,652,464,235	12,436,831,976
投資証券	191,133,092	170,301,366
合計	4,843,597,327	12,607,133,342

（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27年 2月20日現在）			
		契 約 額 等		時 価	
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	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	

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 2月22日現在）		
		契 約 額 等		時 価
		うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建			
	MINI S&P 500	4,257,318,443	4,342,631,634	85,313,191
	S&P 60	239,628,250	246,723,432	7,095,182
	SPI 200	241,469,486	248,367,750	6,898,264
	FTSE100INDEX	555,929,742	572,379,492	16,449,750
	FSMI INDEX	297,365,203	300,819,923	3,454,720
	EURO STOXX 50	849,015,477	864,729,545	15,714,068
	合 計	6,440,726,601	6,575,651,776	134,925,175

(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27年 2月20日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
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

(単位：円)

区 分	種 類	(平成28年 2月22日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益

市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,782,531,674		1,755,844,800	26,686,874
	カナダ・ドル	60,625,073		60,137,700	487,373
	オーストラリア・ドル	99,137,433		98,740,080	397,353
	イギリス・ポンド	253,246,565		247,841,250	5,405,315
	ユーロ	286,388,688		280,430,320	5,958,368
	売建				
	アメリカ・ドル	832,617,570		832,082,160	535,410
	カナダ・ドル	24,256,040		24,230,560	25,480
	オーストラリア・ドル	63,033,849		63,235,080	201,231
	イギリス・ポンド	233,823,220		233,415,570	407,650
	香港・ドル	21,069,972		21,083,040	13,068
	スウェーデン・クローナ	20,536,320		20,490,240	46,080
	デンマーク・クローネ	46,652,760		46,569,600	83,160
	イスラエル・シェケル	21,764,385		21,774,200	9,815
	ユーロ	226,608,042		226,149,440	458,602
	合 計	3,972,291,591		3,932,024,040	37,603,015

(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26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1492円 (21,492円)	1.8209円 (18,209円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表
株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	19,645	35.35	694,450.75	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,461	23.98	59,014.78	
	APACHE CORP	15,239	37.33	568,871.87	
	BAKER HUGHES	16,849	42.14	710,016.86	
	CABOT OIL GAS CORP	15,721	19.91	313,005.11	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	7,608	66.33	504,638.64	
	CHENIERE ENERGY INC	9,611	29.37	282,275.07	
	CHEVRON CORPORATION	73,695	86.50	6,374,617.50	
	CIMAREX ENERGY CO	3,800	85.58	325,204.00	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP INC	13,847	17.08	236,506.76	
	CONCHO RESOURCES INC	5,000	92.29	461,450.00	
	CONOCOPHILLIPS	48,106	32.87	1,581,244.22	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,400	17.46	76,824.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,800	107.29	193,122.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	15,640	18.65	291,686.00	
	EOG RESOURCES INC	21,406	69.71	1,492,212.26	
	EQT CORPORATION	6,000	58.89	353,340.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	163,151	82.50	13,459,957.50	
	FMC TECHNOLOGIES INC	9,800	25.17	246,666.00	
	HALLIBURTON CO	33,214	31.37	1,041,923.18	
	HELMERICH & PAYNE	4,700	51.58	242,426.00	
	HESS CORP	10,400	42.31	440,024.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,043	30.76	216,642.68	
	KINDER MORGAN INC	75,972	17.37	1,319,633.64	
	MARATHON OIL CORP	26,957	6.73	181,420.61	
	MARATHON PETROLEUM CORP	20,575	31.59	649,964.25	
	MURPHY OIL CORP	7,400	15.76	116,624.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	15,731	29.30	460,918.30	
	NOBLE ENERGY INC	16,000	29.85	477,600.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	29,802	70.26	2,093,888.52	
	OCEANEERING INTL INC	4,147	28.11	116,572.17	
	ONEOK INC NEW	9,100	20.66	188,006.00	
	PHILLIPS 66	20,783	80.09	1,664,510.47	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,024	122.99	740,891.76	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8,100	7.13	57,753.00	
	RANGE RESOURCES CORP	7,400	23.74	175,676.00	
	SCHLUMBERGER LTD	49,315	72.87	3,593,584.05	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	17,000	7.09	120,530.00	
	SPECTRA ENERGY CORP	25,966	28.63	743,406.58	
	TESORO CORP	4,882	72.16	352,285.12	
	VALERO ENERGY CORP	18,703	57.05	1,067,006.15	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	33,860	6.20	209,932.00		
WILLIAMS COS	29,241	15.51	453,527.91		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	7,947	131.53	1,045,268.91		
AIRGAS INC	2,700	141.23	381,321.00		
ALBEMARLE CORP	3,700	54.48	201,576.00		
ALCOA INC	51,988	7.87	409,145.56		
ASHLAND INC	2,755	92.70	255,388.50		

AVERY DENNISON CORP	3,757	64.59	242,664.63	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,700	24.76	116,372.00	
BALL CORP	5,200	66.06	343,512.00	
CELANESE CORP DEL COM SER A	5,572	59.00	328,748.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,000	33.00	330,000.00	
CROWN HOLDINGS INC	5,900	45.56	268,804.00	
DOW CHEMICAL CO	43,873	47.08	2,065,540.84	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	34,195	59.97	2,050,674.15	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,655	62.40	352,872.00	
ECOLAB INC	10,326	107.77	1,112,833.02	
FMC CORP	5,800	35.95	208,510.00	
FREEPORT MCMORAN INC	40,966	6.92	283,484.72	
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	3,289	105.40	346,660.60	
INT'L PAPER CO	15,890	34.01	540,418.90	
LYONDELLBASELL INDU CL A	14,845	78.14	1,159,988.30	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,300	135.98	312,754.00	
MONSANTO CO	17,133	88.52	1,516,613.16	
MOSAIC CO/THE	13,401	24.40	326,984.40	
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	20,347	24.84	505,419.48	
NUCOR CORP	12,271	39.39	483,354.69	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,100	45.15	185,115.00	
PPG INDUSTRIES	10,447	95.63	999,046.61	
PRAXAIR	11,073	103.31	1,143,951.63	
SEALED AIR CORP	7,503	43.29	324,804.87	
SHERWIN-WILLIAMS CO	3,063	255.51	782,627.13	
VULCAN MATERIALS CO	5,356	94.88	508,177.28	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,208	42.80	94,502.40	
WESTROCK COMPANY	10,625	31.56	335,325.00	
WR GRACE & CO	2,616	68.55	179,326.80	
3M CO	24,082	156.45	3,767,628.90	
ACUITY BRANDS INC	1,800	191.06	343,908.00	
AERCAP HOLDINGS NV	3,348	31.70	106,131.60	
AGCO CORP	2,461	46.40	114,190.40	
AMETEK INC	9,800	46.13	452,074.00	
B/E AEROSPACE INC	4,154	40.94	170,064.76	
BOEING CO	24,870	115.16	2,864,029.20	
CATERPILLAR	22,671	65.42	1,483,136.82	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	4,357	33.20	144,652.40	
CUMMINS ENGINE CO	6,512	96.59	628,994.08	
DANAHER CORP	24,069	86.65	2,085,578.85	
DEERE & CO	12,095	77.00	931,315.00	
DOVER CORP	6,214	60.62	376,692.68	
EATON CORP PLC	17,961	56.01	1,005,995.61	
EMERSON ELECTRIC CO	25,449	48.06	1,223,078.94	
FASTENAL CO	11,300	44.65	504,545.00	
FLOWSERVE CORP	5,200	41.39	215,228.00	
FLUOR CORP	5,311	45.38	241,013.18	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,700	49.58	332,186.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	10,460	135.26	1,414,819.60	
GENERAL ELECTRIC CO	369,802	29.02	10,731,654.04	
GRAINGER (WW)	2,167	217.27	470,824.09	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,617	107.27	3,069,745.59	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,718	95.86	1,219,147.48	
INGERSOLL-RAND PLC	10,031	52.02	521,812.62	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,400	37.99	205,146.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,400	56.60	532,040.00	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,300	117.56	387,948.00	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	10,798	213.62	2,306,668.76	
MASCO CORP	12,790	27.62	353,259.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,740	190.68	1,285,183.20	
PACCAR INC	14,306	50.90	728,175.40	
PARKER HANNIFIN CORP	5,228	99.89	522,224.92	
PENTAIR PLC	6,834	48.01	328,100.34	
QUANTA SERVICES INC	7,500	18.68	140,100.00	
RAYTHEON COMPANY	11,726	123.57	1,448,981.82	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,322	101.60	540,715.20	
ROCKWELL COLLINS	5,309	86.07	456,945.63	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,000	170.34	681,360.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	34.60	242,200.00	
SNAP-ON	2,204	145.22	320,064.88	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,760	92.00	529,920.00	
TEXTRON	11,152	33.28	371,138.56	
TRANSDIGM GROUP INC	2,100	207.41	435,561.00	
UNITED RENTALS INC	3,696	48.40	178,886.40	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	32,931	88.23	2,905,502.13	
WABCO HOLDINGS INC	2,300	91.35	210,105.00	
WABTEC CORPORATION	3,625	67.25	243,781.25	
XYLEM INC	6,754	37.03	250,100.62	
ADT CORP/THE	6,625	40.00	265,000.00	
CINTAS CORP	3,699	83.38	308,422.62	
DUN & BRADSTREET CORP	1,600	92.59	148,144.00	
EQUIFAX INC	4,803	100.99	485,054.97	
IHS INC	2,700	102.60	277,020.00	
MANPOWER GROUP	3,254	76.99	250,525.46	
NIELSEN HOLDINGS PLC	13,350	48.09	642,001.50	
REPUBLIC SERVICES INC	9,302	45.68	424,915.36	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	5,340	38.37	204,895.80	
STERICYCLE INC	3,237	109.66	354,969.42	
TYCO INTERNATIONAL PLC	16,276	33.57	546,385.32	
VERISK ANALYTICS INC	6,600	67.95	448,470.00	
WASTE CONNECTIONS INC	4,624	62.12	287,242.88	
WASTE MANAGEMENT (NEW)	17,320	55.50	961,260.00	
AMERCO	300	343.19	102,957.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP	5,902	39.76	234,663.52	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,900	70.48	415,832.00	
CSX CORP	37,805	24.51	926,600.55	
DELTA AIR LINES INC	7,900	46.72	369,088.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,084	46.69	330,751.96	
FEDEX CORP	10,440	129.76	1,354,694.40	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	16,400	8.30	136,120.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,457	76.76	265,359.32	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	253,000	0.46	117,645.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,149	82.71	343,163.79	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,569	75.00	867,675.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,610	39.31	259,839.10	
UNION PACIFIC CORP	33,366	79.90	2,665,943.40	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	4,027	53.82	216,733.14	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	27,197	97.37	2,648,171.89	
AUTOLIV INC	3,500	108.72	380,520.00	
BORGWARNER INC	9,100	32.30	293,930.00	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	10,812	65.16	704,509.92	
FORD MOTOR COMPANY	144,325	12.10	1,746,332.50	
GENERAL MOTORS CO	55,099	28.78	1,585,749.22	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	11,400	29.61	337,554.00	
HARLEY-DAVIDSON	7,258	42.00	304,836.00	
JOHNSON CONTROLS	25,106	34.88	875,697.28	
LEAR CORP	2,850	103.32	294,462.00	
TESLA MOTORS INC	4,000	166.58	666,320.00	
COACH INC	10,583	35.82	379,083.06	
DR HORTON INC	13,066	25.01	326,780.66	
GARMIN LTD	5,000	39.97	199,850.00	
HANESBRANDS INC	16,224	26.53	430,422.72	
HARMAN INTERNATIONAL	2,900	73.20	212,280.00	
HASBRO INC	4,500	72.08	324,360.00	
JARDEN CORPORATION	7,969	52.17	415,742.73	
LEGGETT & PLATT INC	5,091	43.70	222,476.70	
LENNAR CORP-CL A	7,512	39.97	300,254.64	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,500	60.76	273,420.00	
MATTEL	13,461	31.79	427,925.19	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	7,600	52.73	400,748.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	165.68	414,200.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	10,175	37.46	381,155.50	
NIKE B	53,004	59.31	3,143,667.24	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,789	85.85	239,435.65	
PULTE GROUP INC	12,363	16.54	204,484.02	
PVH CORP	3,300	74.99	247,467.00	
RALPH LAUREN CORP	2,374	88.28	209,576.72	
TOLL BROTHERS INC	7,000	25.08	175,560.00	
UNDER ARMOUR INC CLASS A	6,924	80.64	558,351.36	
VF CORP	13,198	58.55	772,742.90	
WHIRLPOOL CORP	3,274	142.91	467,887.34	
ARAMARK	9,300	30.15	280,395.00	

BLOCK (H&R)	9,284	33.96	315,284.64	
CARNIVAL CORP	15,966	46.39	740,662.74	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,201	511.58	614,407.58	
DARDEN RESTAURANTS	4,719	61.19	288,755.61	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC.	20,152	19.88	400,621.76	
LAS VEGAS SANDS CORP	16,000	45.86	733,760.00	
MARRIOTT INT'L A	7,894	65.71	518,714.74	
MCDONALD'S CORP	35,928	116.53	4,186,689.84	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT LTD- ADR	3,132	15.60	48,859.20	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	17,900	18.06	323,274.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	6,893	42.49	292,883.57	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,300	70.85	517,205.00	
STARBUCKS CORP	58,052	57.67	3,347,858.84	
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	6,813	66.33	451,906.29	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,800	69.17	332,016.00	
WYNN RESORTS LTD	3,600	77.18	277,848.00	
YUM! BRANDS INC	16,758	70.52	1,181,774.16	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	7,800	32.44	253,032.00	
CBS CORP-CL B	16,777	45.09	756,474.93	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,452	173.57	599,163.64	
COMCAST CORP-CL A	97,206	57.76	5,614,618.56	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	6,145	25.35	155,775.75	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	10,835	24.94	270,224.90	
DISH NETWORK CORP-A	8,572	44.21	378,968.12	
DISNEY (WALT) CO NEW	61,486	95.01	5,841,784.86	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	15,439	21.14	326,380.46	
LIBERTY GLOBAL PLC A	10,199	37.10	378,382.90	
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	23,080	36.19	835,265.20	
LIBERTY MEDIA CORP	3,973	33.85	134,486.05	
LIBERTY MEDIA CORP-C	7,862	33.19	260,939.78	
NEWS CORP - CLASS A	15,956	10.92	174,239.52	
OMNICOM GROUP	9,788	76.52	748,977.76	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,900	55.13	159,877.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	78,764	3.62	285,125.68	
TEGNA INC	9,100	23.91	217,581.00	
TIME WARNER CABLE INC-A	11,051	188.84	2,086,870.84	
TIME WARNER INC	31,194	64.67	2,017,315.98	
TWENTY FIRST CENTURY FOX	16,814	26.69	448,765.66	
TWENTY FIRST CENTURY FOX INC	45,507	26.62	1,211,396.34	
VIACOM INC-CLASS B	14,017	35.28	494,519.76	
ADVANCE AUTO PARTS	2,950	143.63	423,708.50	
AMAZON COM INC	15,608	534.90	8,348,719.20	
AUTONATION INC	3,027	47.94	145,114.38	
AUTOZONE INC	1,181	759.91	897,453.71	
BED BATH & BEYOND INC	6,887	46.49	320,176.63	

BEST BUY COMPANY INC	11,786	29.95	352,990.70	
CARMAX INC	8,250	45.36	374,220.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,200	38.50	161,700.00	
DOLLAR GENERAL CORP	11,409	72.00	821,448.00	
DOLLAR TREE INC	9,103	79.44	723,142.32	
EXPEDIA INC	4,327	108.67	470,215.09	
FOOT LOCKER, INC.	5,595	67.50	377,662.50	
GAMESTOP CORP NEW	4,500	28.19	126,855.00	
GAP	9,054	26.24	237,576.96	
GENUINE PARTS CO	6,100	92.07	561,627.00	
HOME DEPOT	49,639	121.69	6,040,569.91	
KOHL'S CORP	8,221	44.38	364,847.98	
L BRANDS INC	9,560	83.94	802,466.40	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	16,987	24.45	415,332.15	
LKQ CORP	11,565	26.31	304,275.15	
LOWE'S COMPANIES	35,806	68.52	2,453,427.12	
MACY'S INC	12,062	40.23	485,254.26	
NETFLIX INC	15,807	89.23	1,410,458.61	
NORDSTROM INC	5,800	49.17	285,186.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,828	257.84	987,011.52	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,943	1,283.74	2,494,306.82	
ROSS STORES INC	15,812	54.69	864,758.28	
SIGNET JEWELERS LTD	2,964	103.82	307,722.48	
STAPLES	25,339	9.48	240,213.72	
TARGET CORP	22,805	72.32	1,649,257.60	
TIFFANY & CO	5,225	64.51	337,064.75	
TJX COMPANIES INC	26,111	71.59	1,869,286.49	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,144	84.62	435,285.28	
TRIPADVISOR INC	5,071	63.42	321,602.82	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	2,316	150.07	347,562.12	
COSTCO WHOLESALE CORP	17,087	148.70	2,540,836.90	
CVS HEALTH CORPORATION	43,323	97.59	4,227,891.57	
KROGER CO	35,992	37.82	1,361,217.44	
RITE AID CORP	41,700	7.93	330,681.00	
SYSCO CORP	21,903	44.99	985,415.97	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,029	77.57	2,639,629.53	
WAL-MART STORES	62,716	64.66	4,055,216.56	
WHOLE FOODS MARKET INC	13,034	31.39	409,137.26	
ALTRIA GROUP INC	76,732	60.56	4,646,889.92	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	23,084	32.65	753,692.60	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,662	102.01	475,570.62	
BUNGE LIMITED	5,375	48.81	262,353.75	
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,110	60.94	433,283.40	
COCA COLA ENTERPRISES	8,900	48.93	435,477.00	
COCA-COLA CO	161,807	43.77	7,082,292.39	
CONAGRA FOODS	16,727	41.84	699,857.68	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,716	139.51	936,949.16	

DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	7,662	90.54	693,717.48	
GENERAL MILLS	23,261	58.72	1,365,885.92	
HORMEL FOODS CORP	11,600	42.75	495,900.00	
JM SMUCKER CO	4,288	127.75	547,792.00	
KELLOGG CO	10,287	75.52	776,874.24	
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	4,268	91.52	390,607.36	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,449	92.02	409,396.98	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	7,585	74.79	567,282.15	
MOLSON COORS BREWING CO-B	6,200	85.55	530,410.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	62,061	39.81	2,470,648.41	
MONSTER BEVERAGE CORP	5,480	127.58	699,138.40	
PEPSICO INC	57,036	99.58	5,679,644.88	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	60,651	91.94	5,576,252.94	
REYNOLDS AMERICAN INC	33,449	49.51	1,656,059.99	
THE HERSHEY COMPANY	6,100	91.03	555,283.00	
THE KRAFT HEINZ CO/THE	23,655	73.52	1,739,115.60	
TYSON FOODS INC-CL A	11,426	62.97	719,495.22	
WHITEWAVE FOODS CO	7,400	38.31	283,494.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,300	89.41	473,873.00	
CLOROX CO	4,983	128.63	640,963.29	
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,262	67.46	2,243,854.52	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,214	75.12	166,315.68	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,613	91.63	789,209.19	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,157	130.43	1,846,497.51	
PROCTER & GAMBLE CO	106,579	81.79	8,717,096.41	
ABBOTT LABORATORIES	58,229	38.53	2,243,563.37	
AETNA INC	13,573	103.45	1,404,126.85	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,542	86.84	654,947.28	
ANTHEM INC	10,155	127.23	1,292,020.65	
BARD (C.R.) INC	2,992	189.11	565,817.12	
BAXTER INTERNATIONAL	21,937	37.65	825,928.05	
BECTON DICKINSON	8,190	144.90	1,186,731.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,148	17.16	894,859.68	
CARDINAL HEALTH INC	12,771	80.83	1,032,279.93	
CENTENE CORP	4,800	55.43	266,064.00	
CERNER CORP	11,888	51.46	611,756.48	
CIGNA CORP	10,024	133.94	1,342,614.56	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	7,000	63.80	446,600.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	5,600	56.37	315,672.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,800	86.21	758,648.00	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	7,700	21.03	161,931.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	26,372	68.01	1,793,559.72	
HCA HOLDINGS INC	12,633	67.62	854,243.46	
HENRY SCHEIN INC	3,400	166.24	565,216.00	
HOLOGIC INC	9,616	34.49	331,655.84	
HUMANA	5,749	165.34	950,539.66	
IMS HEALTH HOLDINGS INC	6,300	25.73	162,099.00	

INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	1,446	546.34	790,007.64	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,844	108.72	417,919.68	
MCKESSON CORP	8,958	154.27	1,381,950.66	
MEDNAX INC	3,700	65.88	243,756.00	
MEDTRONIC PLC	55,305	75.38	4,168,890.90	
PATTERSON COS INC	3,500	44.47	155,645.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,746	66.31	381,017.26	
RESMED INC	5,633	58.90	331,783.70	
ST JUDE MEDICAL INC	11,424	53.41	610,155.84	
STRYKER CORP	13,167	97.72	1,286,679.24	
THE COOPER COS INC	1,831	140.84	257,878.04	
UNITED HEALTH GROUP INC	37,291	117.68	4,388,404.88	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,720	106.99	398,002.80	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,960	77.78	308,008.80	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,031	94.79	666,468.49	
ABBVIE INC	63,923	54.29	3,470,379.67	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,220	37.44	494,956.80	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,763	145.89	1,278,434.07	
ALKERMES PLC	5,900	33.57	198,063.00	
ALLERGAN PLC	15,425	275.75	4,253,443.75	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,200	63.52	203,264.00	
AMGEN INC	29,514	150.12	4,430,641.68	
BAXALTA INC	21,837	39.41	860,596.17	
BIOGEN INC	8,701	261.40	2,274,441.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,721	77.70	522,221.70	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	65,263	63.80	4,163,779.40	
CELGENE CORP	30,713	102.61	3,151,460.93	
ENDO INTERNATIONAL PLC	8,542	50.26	429,320.92	
GILEAD SCIENCES INC	56,410	87.44	4,932,490.40	
ILLUMINA INC	5,900	151.31	892,729.00	
INCYTE CORP	6,708	72.70	487,671.60	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,700	37.00	173,900.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,601	123.07	320,105.07	
JOHNSON & JOHNSON	108,425	104.16	11,293,548.00	
LILLY (ELI) & CO	38,973	72.61	2,829,829.53	
MALLINCKRODT PLC	4,713	64.74	305,119.62	
MEDIVATION INC	6,774	32.76	221,916.24	
MERCK & CO	109,360	50.12	5,481,123.20	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,107	322.14	356,608.98	
MYLAN NV	16,500	45.34	748,110.00	
PERRIGO CO PLC	5,879	129.34	760,389.86	
PFIZER	241,788	29.49	7,130,328.12	
QUINTILES TRANSNATIONAL	2,713	63.43	172,085.59	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,977	394.98	1,175,855.46	
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	220	139.07	30,595.40	
THERMO ELECTRON CORP	15,571	130.16	2,026,721.36	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,706	127.32	217,207.92	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,510	88.08	837,640.80	
WATERS CORPORATION	3,327	121.37	403,797.99	
ZOETIS INC	18,295	41.83	765,279.85	
BANK OF AMERICA CORP	407,487	12.13	4,942,817.31	
BB&T CORPORATION	30,800	32.38	997,304.00	
CIT GROUP INC	7,400	28.23	208,902.00	
CITIGROUP INC	116,551	38.99	4,544,323.49	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,100	19.24	405,964.00	
COMERICA	7,022	34.32	240,995.04	
FIFTH THIRD BANCORP	32,920	15.28	503,017.60	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,606	59.86	335,575.16	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,715	8.67	274,969.05	
JPMORGAN CHASE & CO	144,190	57.82	8,337,065.80	
KEYCORP	33,391	10.70	357,283.70	
M & T BANK CORP	5,791	107.05	619,926.55	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	17,669	15.46	273,162.74	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	12,000	14.67	176,040.00	
PNC BANK CORP	19,787	82.82	1,638,759.34	
REGIONS FINANCIAL CORP	52,945	7.65	405,029.25	
SIGNATURE BANK	2,000	131.34	262,680.00	
SUNTRUST BANKS	19,664	34.15	671,525.60	
US BANCORP	68,335	39.46	2,696,499.10	
WELLS FARGO COMPANY	190,097	48.09	9,141,764.73	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,300	129.54	297,942.00	
ALLY FINANCIAL INC.	15,175	16.90	256,457.50	
AMERICAN EXPRESS	32,615	54.71	1,784,366.65	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,696	82.69	553,692.24	
BANK NEW YORK MELLO CORP	42,557	34.93	1,486,516.01	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	46,434	131.05	6,085,175.70	
BLACKROCK INC	4,790	314.29	1,505,449.10	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,699	65.73	1,360,545.27	
CME GROUP INC	12,489	93.32	1,165,473.48	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,532	46.15	762,951.80	
E*TRADE FINANCIAL CORP	12,200	22.49	274,378.00	
EATON VANCE CORP	4,400	29.11	128,084.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	16,005	34.08	545,450.40	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,984	146.91	2,201,299.44	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	4,545	248.07	1,127,478.15	
INVESCO LTD	17,180	26.30	451,834.00	
LEGG MASON INC	4,518	27.42	123,883.56	
LEUCADIA NATIONAL CORP	13,700	14.76	202,212.00	
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	10,478	87.95	921,540.10	
MOODY'S CORPORATION	6,849	85.66	586,685.34	
MORGAN STANLEY	56,488	24.00	1,355,712.00	
MSCI INC	3,670	71.55	262,588.50	
NASDAQ INC	4,340	62.93	273,116.20	
NAVIENT CORP	15,156	9.92	150,347.52	
NORTHERN TRUST CORP	8905	59.38	528,778.90	

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,115	43.87	224,395.05	
SCHWAB (CHARLES) CORP	46,016	24.44	1,124,631.04	
SEI INVESTMENTS CO COM	6,200	37.24	230,888.00	
STATE STREET CORP	15,631	56.19	878,305.89	
SYNCHRONY FINANCIAL	33,715	26.77	902,550.55	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,693	68.86	667,459.98	
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	10,900	27.89	304,001.00	
VOYA FINANCIAL INC	8,054	28.93	233,002.22	
AFLAC	16,555	59.32	982,042.60	
ALLEGHANY CORP	648	466.04	301,993.92	
ALLSTATE CORP	15,028	64.00	961,792.00	
AMERICAN INT'L GROUP	48,317	51.53	2,489,775.01	
AON PLC	10,634	93.58	995,129.72	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,650	68.63	319,129.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,900	39.43	272,067.00	
ASSURANT INC	2,700	70.33	189,891.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,586	53.97	193,536.42	
CHUBB LTD	17,984	115.67	2,080,209.28	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,937	62.57	371,478.09	
EVEREST RE GROUP LTD	1,800	186.55	335,790.00	
FNF GROUP	10,102	32.93	332,658.86	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	16,709	41.78	698,102.02	
LINCOLN NATIONAL CORP	10,015	35.96	360,139.40	
LOEWS CORP	11,505	36.92	424,764.60	
MARKEL CORP	535	861.43	460,865.05	
MARSH & MCLENNAN COS	20,275	57.31	1,161,960.25	
METLIFE INC	36,771	39.11	1,438,113.81	
PARTNERRE LTD	1,900	140.15	266,285.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,186	36.81	411,756.66	
PROGRESSIVE CORP	22,589	31.91	720,814.99	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,435	65.36	1,139,551.60	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,628	115.20	187,545.60	
TORCHMARK CORP	4,950	51.88	256,806.00	
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	11,834	108.09	1,279,137.06	
UNUM GROUP	9,932	27.52	273,328.64	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,028	110.33	554,739.24	
WR BERKLEY CORP	4,210	52.00	218,920.00	
XL GROUP PLC	11,600	34.28	397,648.00	
CBRE GROUP INC	12,684	25.06	317,861.04	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	22,000	5.81	127,820.00	
JONES LANG LASALLE INC	1,900	100.54	191,026.00	
REALOGY HOLDINGS CORP	6,391	31.06	198,504.46	
ACCENTURE PLC-CL A	24,397	98.95	2,414,083.15	
ACTIVISION BLIZZARD INC	20,500	30.19	618,895.00	
ADOBE SYSTEMS	19,428	80.87	1,571,142.36	
AKAMA I TECHNOLOGIES	6,772	53.13	359,796.36	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,500	204.36	510,900.00	

ALPHABET INC-CL A	11,412	722.11	8,240,719.32	
ALPHABET INC-CL C	12,181	700.91	8,537,784.71	
ANSYS INC	3,600	87.59	315,324.00	
AUTODESK INC	8,637	49.91	431,072.67	
AUTOMATIC DATA PROCESS	17,963	85.56	1,536,914.28	
CA INC	13,125	30.01	393,881.25	
CDK GLOBAL INC	5,800	43.01	249,458.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	2,628	81.61	214,471.08	
CITRIX SYSTEMS INC	5,870	69.28	406,673.60	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,655	55.90	1,322,314.50	
EBAY INC	41,922	23.81	998,162.82	
ELECTRONIC ARTS	12,524	59.57	746,054.68	
FACEBOOK INC-A	88,952	104.57	9,301,710.64	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	11,530	59.71	688,456.30	
FISERV INC	8,853	96.65	855,642.45	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,081	127.97	394,275.57	
FORTINET INC	5,600	26.09	146,104.00	
GARTNER INC	3,300	82.78	273,174.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,100	59.16	301,716.00	
IBM CORP	36,061	133.08	4,798,997.88	
INTUIT CORP	9,726	97.19	945,269.94	
LINKEDIN CORP - A	4,468	114.12	509,888.16	
MASTERCARD INC-CLASS A	38,714	86.79	3,359,988.06	
MICROSOFT CORP	297,432	51.82	15,412,926.24	
MOBILEYE NV	3,042	28.89	87,883.38	
NETSUITE INC	1,723	56.25	96,918.75	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	10,800	18.70	201,960.00	
ORACLE CORP	125,159	36.78	4,603,348.02	
PAYCHEX INC	13,051	51.25	668,863.75	
PAYPAL HOLDINGS INC	42,822	35.76	1,531,314.72	
RED HAT INC	7,300	65.90	481,070.00	
SABRE CORP	6,900	27.55	190,095.00	
SALESFORCE COM INC COM	24,570	62.14	1,526,779.80	
SERVICENOW INC	5,984	54.74	327,564.16	
SPLUNK INC	5,300	34.84	184,652.00	
SYMANTEC CORP	27,600	19.93	550,068.00	
SYNOPSYS INC	6,515	44.48	289,787.20	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,100	42.39	89,019.00	
TERADATA CORP	5,400	25.08	135,432.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6,616	42.79	283,098.64	
TWITTER INC	20,747	18.31	379,877.57	
VANTIV INC CL A	5,787	50.33	291,259.71	
VERISIGN INC	3,799	80.67	306,465.33	
VISA INC-CLASS A SHARES	76,195	71.53	5,450,228.35	
VMWARE INC	3,000	49.22	147,660.00	
WESTERN UNION CO	19,216	18.19	349,539.04	
WORKDAY INC CLASS A	4,172	57.12	238,304.64	

XEROX CORP	34,568	9.36	323,556.48	
YAHOO! INC	34,808	30.04	1,045,632.32	
ZILLOW GROUP INC-C	4,200	20.31	85,302.00	
AMPHENOL CORP-CL A	12,400	52.10	646,040.00	
APPLE INC	218,567	96.04	20,991,174.68	
ARROW ELECTRONICS INC	4,000	56.96	227,840.00	
AVNET	4,912	41.28	202,767.36	
CDW CORP/DE	5,600	38.20	213,920.00	
CISCO SYSTEMS	198,682	26.55	5,275,007.10	
CORNING	45,828	18.55	850,109.40	
EMC CORP	75,624	25.03	1,892,868.72	
FLEXTRONICS INTL LTD	24,045	10.59	254,636.55	
FLIR SYSTEMS INC	5,300	30.83	163,399.00	
FS NETWORKS INC	3,000	92.67	278,010.00	
HARRIS CORP	4,400	75.18	330,792.00	
HEWLETT-PACKARD CO	69,403	10.32	716,238.96	
HP ENTERPRISE CO	69,976	13.67	956,571.92	
JUNIPER NETWORKS INC	13,708	24.57	336,805.56	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,343	66.00	418,638.00	
NETAPP INC	11,848	24.64	291,934.72	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,940	127.16	373,850.40	
QUALCOMM	58,718	49.42	2,901,843.56	
SANDISK CORP	8,200	68.85	564,570.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	11,378	31.34	356,586.52	
TE CONNECTIVITY LTD	14,962	57.61	861,960.82	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	9,343	23.54	219,934.22	
WESTERN DIGITAL CORP	8,835	44.12	389,800.20	
AT & T INC	241,013	36.57	8,813,845.41	
CENTURYLINK INC	21,161	29.73	629,116.53	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	43,629	4.44	193,712.76	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	12,200	48.17	587,674.00	
SBA COMMUNICATIONS COR	5,100	89.64	457,164.00	
SPRINT CORP W/I	37,012	2.93	108,445.16	
T MOBILE US INC	11,608	34.95	405,699.60	
VERIZON COMMUNICATIONS	159,384	50.86	8,106,270.24	
AES CORPORATION	25,262	9.41	237,715.42	
AGL RESOURCES INC	4,700	64.75	304,325.00	
ALLIANT ENERGY CORP	4,295	67.12	288,280.40	
AMEREN CORPORATION	9,677	45.60	441,271.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,085	61.91	1,181,552.35	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,100	65.77	466,967.00	
ATMOS ENERGY CORP	3,858	70.10	270,445.80	
CALPINE CORP	12,527	12.21	152,954.67	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,456	18.44	285,008.64	
CMS ENERGY CORP	11,000	39.40	433,400.00	
CONSOLIDATED EDISON	11,359	70.87	805,012.33	
DOMINION RESOURCES INC/VA	23,203	69.46	1,611,680.38	
DTE ENERGY	7,166	84.72	607,103.52	

DUKE ENERGY CORP	26,865	74.55	2,002,785.75	
EDISON INTERNATIONAL	12,616	62.89	793,420.24	
ENTERGY CORP	7,220	72.98	526,915.60	
EVERSOURCE ENERGY	12,871	54.67	703,657.57	
EXELON CORP	35,309	31.24	1,103,053.16	
FIRSTENERGY CORP	17,116	32.97	564,314.52	
NEXTERA ENERGY INC	18,290	114.75	2,098,777.50	
NRG ENERGY INC COM NEW	14,800	10.01	148,148.00	
OGE ENERGY CORP	8,712	26.45	230,432.40	
PEPCO HOLDINGS INC	9,895	26.42	261,425.90	
PG&E CORP	19,634	55.89	1,097,344.26	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,197	68.25	286,445.25	
PPL CORPORATION	26,066	36.26	945,153.16	
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	19,602	42.97	842,297.94	
SCANA CORP	5,168	65.38	337,883.84	
SEMPRA ENERGY	9,141	97.25	888,962.25	
SOUTHERN CO	35,439	48.57	1,721,272.23	
TECO ENERGY INC	8,851	27.45	242,959.95	
WEC ENERGY GROUP INC	12,786	56.53	722,792.58	
XCEL ENERGY INC	19,644	39.33	772,598.52	
ANALOG DEVICES	12,729	52.10	663,180.90	
APPLIED MATERIALS	46,441	18.38	853,585.58	
BROADCOM LIMITED	15,146	128.67	1,948,835.82	
INTEL CORP	184,728	28.71	5,303,540.88	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,248	65.69	410,431.12	
LAM RESEARCH CORP	6,400	69.77	446,528.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	9,133	43.17	394,271.61	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	9.16	165,796.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,300	32.99	372,787.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,710	42.37	326,672.70	
MICRON TECHNOLOGY	44,030	11.16	491,374.80	
NVIDIA CORP	21,800	30.44	663,592.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	5,159	66.47	342,918.73	
QORVO INC	6,325	41.85	264,701.25	
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	7,751	63.03	488,545.53	
TEXAS INSTRUMENTS	39,586	52.76	2,088,557.36	
XILINX INC	10,410	48.43	504,156.30	
アメリカ・ドル 小計	12,600,367		669,552,318.93 (75,558,979,191)	

カナダ・ドル	ALTAGAS LTD	5,713	33.19	189,614.47	
	ARC RESOURCES LTD	14,678	17.99	264,057.22	
	CAMECO CORP	16,622	16.56	275,260.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,390	28.09	1,190,735.10	
	CENOVUS ENERGY INC	33,348	14.53	484,546.44	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	19,712	15.65	308,492.80	
	ENBRIDGE INC	33,271	43.14	1,435,310.94	
	ENCANA CORP	32,545	4.32	140,594.40	
	HUSKY ENERGY INC	15,927	13.26	211,192.02	
	IMPERIAL OIL LTD	11,285	42.46	479,161.10	
	INTER PIPELINE LTD	13,189	23.43	309,018.27	
	KEYERA CORP	7,042	37.36	263,089.12	
	PEMBINA PIPELINE CORP	15,007	33.14	497,331.98	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,864	29.42	201,938.88	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	6,361	19.90	126,583.90	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	5,600	15.89	88,984.00	
	SUNCOR ENERGY INC	61,230	32.86	2,012,017.80	
	TOURMALINE OIL CORP	7,700	26.79	206,283.00	
	TRANSCANADA CORP	27,512	49.98	1,375,049.76	
	VERESEN INC	11,900	7.49	89,131.00	
	VERMILION ENERGY TRUST	4,600	35.35	162,610.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	8,455	47.62	402,627.10	
	AGRIUM INC	5,148	112.95	581,466.60	
	BARRICK GOLD CORP	45,976	17.26	793,545.76	
	CCL INDUSTRIES INC	1,100	198.92	218,812.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	30,800	4.02	123,816.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,228	4.58	120,124.24	
	FRANCO NEV CORP	5,962	78.75	469,507.50	
	GOLDCORP INC	31,883	21.25	677,513.75	
	KINROSS GOLD CORP	44,963	4.07	182,999.41	
	METHANEX CORP	3,781	40.00	151,240.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	33,530	22.06	739,671.80	
	SILVER WHEATON CORCOM NPV	16,300	21.43	349,309.00	
	TECK RESOURCES LTD	24,708	8.15	201,370.20	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	33,539	2.95	98,940.05	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,100	40.90	126,790.00	
	YAMANA GOLD INC	42,813	3.71	158,836.23	
	BOMBARDIER INC.	69,741	1.14	79,504.74	
	CAE Inc.	12,550	14.67	184,108.50	
	FINNING INTERNATIONAL INC	8,102	17.70	143,405.40	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	6,613	40.98	271,000.74	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	3,916	40.78	159,694.48		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,025	78.48	2,434,842.00		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,613	173.39	973,238.07		
LINAMAR CORP	1,800	55.44	99,792.00		
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,538	47.11	731,995.18		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,615	33.65	289,894.75		
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,233	44.98	370,320.34		

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,356	23.55	408,733.80	
THOMSON CORP	13,262	49.50	656,469.00	
CANADIAN TIRE CORP.	2,931	129.83	380,531.73	
DOLLARAMA INC	4,495	77.69	349,216.55	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	17,100	59.69	1,020,699.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	6466	25.55	165,206.30	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	3,700	19.99	73,963.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,672	66.40	575,820.80	
METRO INC	9,900	41.46	410,454.00	
WESTON (GEORGE)	1,936	107.45	208,023.20	
SAPUTO INC	9,607	38.33	368,236.31	
VALENT PHARMACEUTICALS INTE	12,591	117.00	1,473,147.00	
BANK MONTREAL	24,994	74.39	1,859,303.66	
BANK OF NOVA SCOTIA	46,922	56.01	2,628,101.22	
CANADIAN IMPERIAL BANK	15,414	90.50	1,394,967.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,946	38.42	535,805.32	
ROYAL BANK OF CANADA	58,042	71.28	4,137,233.76	
TRONTO-DOMINION BANK	72,435	52.42	3,797,042.70	
CI FINANCIAL CORP	9,853	29.01	285,835.53	
ELEMENT FINANCIAL CORP	14,700	14.02	206,094.00	
IGM FINANCIAL INC	4,733	34.43	162,957.19	
ONEX CORPORATION	3,609	80.87	291,859.83	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	857	774.00	663,318.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	11,246	34.96	393,160.16	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,993	37.66	150,376.38	
INTACT FINANCIAL CORP	5,300	85.53	453,309.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	76,420	17.55	1,341,171.00	
POWER CORP OF CANADA	14,888	28.85	429,518.80	
POWER FINANCIAL CORP	10,858	31.46	341,592.68	
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,591	40.45	954,255.95	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	34,630	41.84	1,448,919.20	
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,141	19.68	101,174.88	
CGI GROUP INC	8,884	57.44	510,296.96	
CONSTELLATION SOFTWARE	755	515.00	388,825.00	
OPEN TEXT CORP	4,542	67.99	308,810.58	
BLACKBERRY LTD	22,600	9.80	221,480.00	
BCE INC	5,415	59.06	319,809.90	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	13,904	49.36	686,301.44	
TELUS CORP	7,932	39.39	312,441.48	
ATCO LTD -CLASS I	3,514	38.61	135,675.54	
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,700	35.04	199,728.00	
FORTIS INC	10,800	38.27	413,316.00	
カナダ・ドル 小計	1,566,162		52,608,550.21 (4,307,062,006)	

オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	6,559	35.37	231,991.83	
	OIL SEARCH LTD	53,914	7.13	384,406.82	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	76,018	4.11	312,433.98	
	SANTOS	65,542	3.39	222,187.38	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	30,190	28.10	848,339.00	
	ALUMINA LTD	118,405	1.22	144,454.10	
	AMCOR	46,966	13.90	652,827.40	
	BHP BILLITON LTD	125,027	16.61	2,076,698.47	
	BORAL LIMITED	26,628	5.78	153,909.84	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	69,110	1.99	137,528.90	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	19,225	6.74	129,576.50	
	INCITEC PIVOT LTD	64,405	3.06	197,079.30	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	17,696	17.14	303,309.44	
	NEWCREST MINING	29,806	15.90	473,915.40	
	ORICA	16,138	14.00	225,932.00	
	RIO TINTO LTD	17,237	42.62	734,640.94	
	SOUTH32 LTD	236,569	1.19	282,699.95	
	CIMIC GROUP LTD	4,540	29.28	132,931.20	
	BRAMBLES LTD	60,528	11.06	669,439.68	
	SEEK LTD	11,699	13.44	157,234.56	
	ASCIANO LTD	23,943	8.87	212,374.41	
	AURIZON HOLDINGS LTD	83,667	3.91	327,137.97	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	20,756	3.96	82,193.76	
	SYDNEY AIRPORT	42,048	6.51	273,732.48	
	TRANSURBAN GROUP	81,904	10.96	897,667.84	
	ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	22,072	9.90	218,512.80	
	CROWN RESORTS LTD	13,026	12.10	157,614.60	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,483	40.36	100,213.88	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,278	4.19	152,004.82	
	TATTS GROUP LTD	53,769	4.02	216,151.38	
	REA GROUP LTD	2,606	51.00	132,906.00	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	24,179	4.64	112,190.56	
	WESFARMERS LIMITED	43,833	43.43	1,903,667.19	
	WOOLWORTHS LIMITED	49,213	22.95	1,129,438.35	
	COCA-COLA AMATIL	21,581	8.75	188,833.75	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	32,281	9.42	304,087.02	
	COCHLEAR LIMITED	2,155	104.53	225,262.15	
	HEALTHSCOPE LTD.	51,528	2.29	117,999.12	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,710	59.88	341,914.80	
	SONIC HEALTHCARE LIMITED	15,003	18.94	284,156.82	
CSL LIMITED	18,094	101.80	1,841,969.20		
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	114,024	23.40	2,668,161.60		
BANK OF QUEENSLAND LTD	15,461	11.20	173,163.20		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,189	8.78	177,259.42		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	66,780	73.43	4,903,655.40		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	102,417	25.62	2,623,923.54		
WESTPAC BANKING	129,832	29.78	3,866,396.96		

	AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	7,593	41.75	317,007.75	
	CHALLENGER LTD	21,308	7.70	164,071.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	12,448	63.90	795,427.20	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT LIMITED	10,394	6.35	66,001.90	
	AMP LTD	113,241	5.45	617,163.45	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	99,210	5.40	535,734.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD.	102,132	2.48	253,287.36	
	QBE INSURANCE GROUP	52,313	10.19	533,069.47	
	SUNCORP GROUP LTD	52,023	11.48	597,224.04	
	LENLEASE GROUP	23,929	13.20	315,862.80	
	COMPUTERSHARE LIMITED	20,356	9.17	186,664.52	
	TELSTRA CORP	171,684	5.28	906,491.52	
	TPG TELECOM LTD	11,648	10.10	117,644.80	
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	15,859	7.53	119,418.27	
	AGL ENERGY LIMITED	26,961	18.65	502,822.65	
	APA GROUP	42,047	8.80	370,013.60	
	AUSNET SERVICES	77,077	1.47	113,688.57	
	DUET GROUP	87,718	2.35	206,137.30	
	オーストラリア・ドル 小計	3,138,975		38,821,856.51 (3,135,641,350)	
イギリス・ポンド	BP PLC	716,144	3.43	2,458,164.28	
	PETROFAC	12,271	7.25	89,026.10	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	154,120	15.63	2,408,895.60	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	152,728	15.60	2,383,320.44	
	ANGLO AMERICAN PLC	59,668	4.36	260,540.32	
	ANTOFAGASTA PLC	18,608	4.80	89,411.44	
	BHP BILLITON PLC	81,729	7.32	598,583.19	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,356	28.35	151,842.60	
	FRESNILLO PLC	9,924	9.53	94,625.34	
	GLENCORE PLC	471,254	1.18	557,964.73	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,201	24.76	203,056.76	
	MONDI PLC	15,496	13.21	204,702.16	
	RANDGOLD RESOURCES	3,874	63.55	246,192.70	
	REXAM PLC	27,379	6.05	165,779.84	
	RIO TINTO PLC REG	48,256	18.91	912,762.24	
	ASHTREAD GROUP PLC	18,827	8.46	159,370.55	
	BAE SYSTEMS PLC	124,141	5.05	627,532.75	
	BUNZL PLC	13,432	19.04	255,745.28	
	COBHAM PLC	51,512	2.49	128,573.95	
	IMI PLC	10,505	8.37	87,926.85	
	MEGGITT PLC	30,402	3.77	114,858.75	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	72,114	6.42	462,971.88	
	SMITHS GROUP PLC	17,162	9.73	166,986.26	
	TRAVIS PERKINS PLC	9,925	17.86	177,260.50	
	WEIR GROUP PLC/THE	9,243	9.08	83,926.44	
WOLSELEY PLC	10,388	36.03	374,279.64		
AGGREKO PLC	11,123	8.48	94,378.76		

BABCOCK INTL GROUP PLC	9,592	9.22	88,486.29	
CAPITA PLC	26,907	11.11	298,936.77	
EXPERIAN PLC	37,278	11.62	433,170.36	
G4S PLC	57,203	1.99	114,005.57	
INTERTEK GROUP PLC	6,776	28.91	195,894.16	
EASYJET PLC	5,750	15.53	89,297.50	
ROYAL MAIL PLC	29,110	4.41	128,462.43	
GKN PLC	71,935	2.79	200,842.52	
BARRATT DEVELOPMENTS	41,916	5.84	244,999.02	
BURBERRY GROUP PLC	17,517	12.70	222,465.90	
PERSIMMON PLC	12,323	20.62	254,100.26	
TAYLOR WIMPEY PLC	127,603	1.83	234,406.71	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	4,859	33.63	163,408.17	
CARNIVAL PLC	7,291	33.13	241,550.83	
COMPASS GROUP PLC	63,905	12.29	785,392.45	
INTERCONTINENTAL HOTELS	9,458	24.46	231,342.68	
MERLIN ENTERTAINMENTS	23,482	4.35	102,334.55	
TUI AG	19,387	10.60	205,502.20	
WHITBREAD PLC	6,964	38.83	270,412.12	
WILLIAM HILL PLC	34,412	3.84	132,210.90	
BRITISH SKY BROADCASTING	42,034	10.18	427,906.12	
ITV PLC	153,433	2.52	386,958.02	
PEARSON	33,288	7.94	264,306.72	
RELX PLC	42,992	12.16	522,782.72	
WPP PLC	50,266	14.68	737,904.88	
DIXONS CARPHONE PLC	41,170	4.48	184,606.28	
KINGFISHER PLC	94,185	3.42	322,206.88	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	66,796	4.32	288,825.90	
NEXT PLC	5,830	70.05	408,391.50	
SPORTS DIRECT INTERNATIO	12,643	4.00	50,572.00	
MORRISON SUPERMARKETS	91,346	1.84	168,898.75	
SAINSBURY (J) PLC	58,994	2.61	154,033.33	
TESCO	315,388	1.83	578,106.20	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,973	32.55	454,821.15	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	72,927	38.30	2,793,104.10	
COCA COLA HBC AG CDI	8,311	14.13	117,434.43	
DIAGEO	98,255	18.28	1,796,592.67	
IMPERIAL BRANDS PLC	37,406	37.32	1,396,178.95	
SABMILLER PLC	37,940	41.75	1,584,184.70	
TATE & LYLE	17,684	5.58	98,765.14	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,871	65.56	1,630,542.76	
UNILEVER PLC	50,097	30.34	1,519,942.98	
SMITH&NEOHEW PLC	36,360	11.53	419,230.80	
ASTRAZENECA PLC	49,396	40.73	2,011,899.08	
GLAXOSMITHKLINE PLC	190,370	13.83	2,633,768.95	
SHIRE PLC	23,034	38.19	879,668.46	
BARCLAYS PLC	654,066	1.61	1,057,624.72	
HSBC HOLDINGS PLC	766,490	4.49	3,448,055.26	

	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,226,964	0.61	1,376,263.75	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	131,707	2.46	323,999.22	
	STANDARD CHARTERED PLC	126,610	4.14	524,925.06	
	3I GROUP PLC	41,014	4.20	172,586.91	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	39,948	2.38	95,315.92	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,112	12.38	125,186.56	
	ICAP PLC	23,582	4.13	97,582.31	
	INVESTEC PLC	21,401	4.68	100,156.68	
	LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	12,500	23.14	289,250.00	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	5,779	32.20	186,083.80	
	SCHRODERS PLC	5,217	24.60	128,338.20	
	ADMIRAL GROUP PLC	8,283	17.43	144,372.69	
	AVIVA PLC	156,931	4.36	685,631.53	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	51919	3.74	194,540.49	
	LEGAL & GENERAL GROUP	229787	2.22	510,127.14	
	OLD MUTUAL PLC	200,170	1.71	343,091.38	
	PRUDENTIAL PLC	100217	12.29	1,232,168.01	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,647	4.09	166,286.87	
	ST JAMES'S PLACE PLC	22,509	8.92	200,780.28	
	STANDARD LIFE PLC	79,732	3.36	268,537.37	
	AUTO TRADER GROUP PLC	28,623	3.86	110,570.64	
	SAGE GROUP PLC/THE	42,648	5.80	247,358.40	
	WORLDPAY GROUP PLC	40,536	2.94	119,500.12	
	BT GROUP PLC	330,761	4.57	1,514,389.23	
	INMARSAT PLC	17618	9.99	176,003.82	
	VODAFONE GROUP PLC	1,038,007	2.12	2,210,435.90	
	CENTRICA PLC	195,006	2.11	412,437.69	
	NATIONAL GRID PLC	146,082	9.64	1,408,960.89	
	SEVERN TRENT PLC	9,476	21.44	203,165.44	
	SSE PLC	40,615	13.94	566,173.10	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,957	9.32	241,919.24	
	ARM HOLDINGS PLC	54295	9.37	508,744.15	
	イギリス・ポンド 小計	11,371,648		59,418,096.98 (9,585,327,405)	
スイス・フラン	TRANSOCEAN LTD	15,709	8.27	129,913.43	
	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	299	466.50	139,483.50	
	GIVAUDAN-REG	356	1,870.00	665,720.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	9,608	37.99	365,007.92	
	SIKA AG-BR	82	3,849.00	315,618.00	
	SYNGETA AG	3,620	402.20	1,455,964.00	
	ABB LTD	85,636	17.73	1,518,326.28	
	GEBERIT AG-REG	1,453	359.50	522,353.50	
	SCHINDLER HLDG AG	946	164	155,144.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,670	165.20	275,884.00	
	SULZER	524	92.80	48,627.20	
	ADECCO SA-REG	6,902	58.35	402,731.70	
	SGS S.A.	217	1,978.00	429,226.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,150	131.60	282,940.00	

	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	20,311	65.00	1,320,215.00	
	THE SWATCH GROUP	1,897	67.00	127,099.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,178	341.60	402,404.80	
	DUFREY AG-REG	1,066	103.80	110,650.80	
	ARYZTA AG	3,798	44.81	170,188.38	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	86	1,087.00	93,482.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	41	5,730.00	234,930.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	68,470.00	273,880.00	
	NESTLE SA-REG	124,916	70.85	8,850,298.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,002	118.80	237,837.60	
	ACTELION CHFO.50 (REGD)	3,950	137.40	542,730.00	
	GALENCIA AG-REG	151	1,420.00	214,420.00	
	LOMZA AG-REG	2,105	147.30	310,066.50	
	NOVARTIS AG-REG SHS	89,105	73.20	6,522,486.00	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	27,515	255.70	7,035,585.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	69,636	13.10	912,231.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,511	40.39	343,759.29	
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1,347	57.15	76,981.05	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	667	356.25	237,618.75	
	UBS GROUP AG	142,712	14.79	2,110,710.48	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,942	121.70	236,341.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,279	237.80	304,146.20	
	SWISS RE LTD	13,696	91.65	1,255,238.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,850	212.80	1,244,880.00	
	SWISS PRIME SITE REG	2,716	82.85	225,020.60	
	SWISSCOM	994	482.70	479,803.80	
スイス・フラン	小計	656,647		40,579,945.28 (4,619,620,970)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	105,123	95.60	10,049,758.80	
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	65,540	11.14	730,115.60	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	56,000	12.08	676,480.00	
	MTR CORP	55,148	36.00	1,985,328.00	
	LI & FUNG LTD	254,400	4.49	1,142,256.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	53,500	28.10	1,503,350.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	34,000	26.80	911,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	99,000	25.75	2,549,250.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	46,800	8.76	409,968.00	
	SANDS CHINA LTD	94,944	26.75	2,539,752.00	
	SHANGRI-LA ASIA	64,000	7.35	470,400.00	
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	5.50	522,500.00	
	WYNN MACAU LTD	75,361	8.63	650,365.43	
	WH GROUP LIMITED	167,500	4.43	742,025.00	
	BANK EAST ASIA	49,040	23.40	1,147,536.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	140,989	19.58	2,760,564.62	
	HANG SENG BANK	31,000	126.30	3,915,300.00	
	FIRST PACIFIC CO	111,000	5.48	608,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,546	171.20	7,626,275.20	
	AIA GROUP LTD	470,484	39.35	18,513,545.40	

	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	110,133	41.30	4,548,492.90	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	13.60	1,319,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	45,411	41.45	1,882,285.95	
	HYSAN DEVELOPMENT	24,964	30.35	757,657.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	28,500	18.82	536,370.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	226,192	6.23	1,409,176.16	
	SINO LAND	117,200	10.62	1,244,664.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	67,108	84.95	5,700,824.60	
	SWIRE PACIFIC A	25,000	75.00	1,875,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,877	19.70	824,976.90	
	WHARF HOLDINGS	58,125	39.60	2,301,750.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	35,000	30.15	1,055,250.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	118,000	10.50	1,239,000.00	
	PCCW LIMITED	188,000	4.74	891,120.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	24,000	77.00	1,848,000.00	
	CLP HOLDINGS	74,317	66.95	4,975,523.15	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	92,161	6.50	599,046.50	
	HONGKONG CHINA GAS	281,467	13.92	3,918,020.64	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	56,000	73.90	4,138,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,000	63.35	633,500.00	
	香港・ドル 小計	3,833,830		101,152,508.25 (1,468,734,420)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	61,900	5.34	330,546.00	
	NOBLE GROUP LTD	213,833	0.36	78,049.04	
	SEMBCORP INDUSTRIES	48,560	2.70	131,112.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	37,200	1.70	63,240.00	
	SINGAPORE TECH ENGR.	67,000	2.80	187,600.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	86,000	0.96	82,560.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	82,000	2.95	241,900.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	23,800	11.48	273,224.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	224,000	0.72	161,280.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	67,000	3.76	251,920.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,280	39.34	168,375.20	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	332,960	0.36	121,530.40	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	73,000	3.16	230,680.00	
	DBS GROUP HOLDING	67,968	13.68	929,802.24	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	121,863	7.98	972,466.74	
	UNITED OVERSEAS BANK	49,852	17.24	859,448.48	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	7.30	255,500.00	
	CAPITALAND LIMITED	100,585	2.87	288,678.95	
	CITY DEVELOPMENTS	19,000	7.14	135,660.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES	132,000	1.71	226,380.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,405	5.79	123,934.95	
SINGAPORE TELECOM	308,674	3.73	1,151,354.02		
STARHUB LTD	24,000	3.46	83,040.00		

シンガポール・ドル 小計		2,201,880		7,348,282.02 (589,846,597)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	25,514	6.57	167,626.98	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	6.34	219,966.30	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,783	8.03	150,827.49	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	69,089	3.29	227,648.25	
	CONTACT ENERGY LIMITED	16,243	4.50	73,093.50	
	MERIDIAN ENERGY LTD	56,024	2.28	128,014.84	
	MIGHTY RIVER POWER LTD.	31,153	2.70	84,268.86	
ニュージーランド・ドル 小計		251,501		1,051,446.22 (78,742,807)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	8,099	132.90	1,076,357.10	
	BOLIDEN AB	10,491	124.80	1,309,276.80	
	ALFA LAVAL AB	12,272	134.10	1,645,675.20	
	ASSA ABLOY AB-B	38,739	164.10	6,357,069.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	27,336	193.30	5,284,048.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,442	182.90	2,824,341.80	
	SANDVIK AB	42,326	78.40	3,318,358.40	
	SKANSKA AB-B	15,125	172.10	2,603,012.50	
	SKF AB-B SHARES	14,989	145.10	2,174,903.90	
	VOLVO AB-B SHS	62,587	85.60	5,357,447.20	
	SECURITAS B	13,372	122.50	1,638,070.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,549	193.80	1,850,596.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,029	53.60	966,354.40	
	HENNES & MAURITZ B	36,919	283.90	10,481,304.10	
	ICA GRUPPEN AB	3,600	255.50	919,800.00	
	SWEDISH MATCH	7,739	273.80	2,118,938.20	
	SCA SV CELLULOSA AB-B SHS	23,647	255.20	6,034,714.40	
	GETINGE AB-B SHS	7,850	185.10	1,453,035.00	
	NORDEA BANK AB	118,040	83.10	9,809,124.00	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	61,913	82.80	5,126,396.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	57,875	109.40	6,331,525.00	
	SWEDBANK AB	34,961	165.30	5,779,053.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,013	133.80	804,539.40	
	INVESTOR AB SER B NPV	18,537	282.10	5,229,287.70	
	KINNEVIK INV AB	9,233	211.50	1,952,779.50	
	"ERICSSON (LM) TEL, SEK1 SER B"	118,167	77.55	9,163,850.85	
	HEXAGON AB B SHS	9815	288.00	2,826,720.00	
MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 US D1.5	2554	392.00	1,001,168.00		
TELE2 AB-B SHS	15,324	70.50	1,080,342.00		
TELIASONERA	105,058	39.32	4,130,880.56		
スウェーデン・クローナ 小計		925,601		110,648,970.61 (1,476,057,268)	

ノルウェー・ クローネ	STATOIL ASA	45,418	118.70	5,391,116.60	
	NORSK HYDRO	58,691	32.70	1,919,195.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,166	331.60	2,376,245.60	
	SCHIBSTED	2,760	231.40	638,664.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,292	223.40	735,432.80	
	ORKLA ASA	34,222	70.35	2,407,517.70	
	DNB ASA	37,378	98.70	3,689,208.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8500	134.00	1,139,000.00	
	TELENOR ASA	30,504	124.10	3,785,546.40	
ノルウェー・クローネ 小計		227,931		22,081,927.40 (290,598,164)	
デンマーク・ クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,842	404.30	1,553,320.60	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	9,396	294.00	2,762,424.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,062	441.40	3,999,966.80	
	ISS A/C	4,279	240.20	1,027,815.80	
	"DSV, DE SAMMENSLUT VOGN"	6,921	271.90	1,881,819.90	
	A P MOLLER MAERSK A/S	289	8,220.00	2,375,580.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	168	8,040.00	1,350,720.00	
	PANDORA A/S	4,456	838.00	3,734,128.00	
	CARLSBERG B	4,224	605.50	2,557,632.00	
	COLOPLAST B	4,386	515.00	2,258,790.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	958	570.50	546,539.00	
	GENMAB A/S	1,999	763.50	1,526,236.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	76,643	340.00	26,058,620.00	
	DANSKE BANK A/S	27,302	186.20	5,083,632.40	
	TRYG A/S	4,970	123.30	612,801.00	
TDC A/S	35,300	30.16	1,064,648.00		
デンマーク・クローネ 小計		194,195		58,394,674.00 (981,030,523)	
イスラエル・ シェケル	DELEK GROUP LTD	283	644.10	182,280.30	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,712	15.45	320,000.40	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	35,593	221.70	7,890,968.10	
	BANK HAPOALIM BM	45,583	18.48	842,373.84	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,630	12.87	767,438.10	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,788	42.73	247,321.24	
	AZRIELI GROUP	1,403	139.10	195,157.30	
	NICE SYSTEMS LTD	2,072	236.00	488,992.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	72,807	8.59	625,557.74	
イスラエル・シェケル 小計		243,871		11,560,089.02 (333,392,967)	

ユ-ロ	ENI SPA	98,958	11.92	1,179,579.36	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	14,786	10.35	153,035.10	
	NESTE OYJ	4,680	27.80	130,104.00	
	OMV AG	6,306	23.48	148,064.88	
	REPSOL SA	43,889	8.84	388,373.76	
	SAIPEM EUR1	250,792	0.33	82,936.91	
	TECHNIP SA	4,054	39.21	158,977.69	
	TENARIS SA	20,564	9.37	192,684.68	
	TOTAL SA	85,828	39.74	3,410,804.72	
	VOPAK	3,294	41.31	136,075.14	
	AIR LIQUIDE	13,399	95.14	1,274,780.86	
	AKZO NOBEL	10,046	53.20	534,447.20	
	ARCELORMITTAL	43,850	3.21	141,021.60	
	ARKEMA	2,812	53.30	149,879.60	
	BASF SE	35,867	60.04	2,153,454.68	
	CRH	32,660	22.98	750,690.10	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,827	27.70	106,027.03	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,216	36.19	116,387.04	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,683	66.04	375,305.32	
	IMERYS SA	1,606	54.36	87,302.16	
	K&S AG	7,454	18.66	139,091.64	
	KONINKLIJKE DSM N.V	7,289	43.44	316,670.60	
	LAFARGEHOLCIM LTD	7,507	34.49	258,953.96	
	LANXESS AG	3,918	37.62	147,414.75	
	LINDE	7,208	127.05	915,776.40	
	OCI NV	3,727	15.31	57,060.37	
	SOLVAY	2,782	80.01	222,587.82	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	21,462	7.67	164,613.54	
	SYMRISE AG	4,674	57.75	269,923.50	
	THYSSENKRUPP AG	15,587	14.84	231,311.08	
	UMICORE	3,961	38.59	152,874.79	
	UPM-KYMMENE	21,157	15.63	330,683.91	
	VOESTALPINE AG	5,300	26.49	140,423.50	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,054	21.13	170,221.29	
	AIRBUS GROUP SE	23,002	55.25	1,270,860.50	
	ALSTOM	6,471	20.83	134,790.93	
	ANDRITZ AG	3,120	42.97	134,082.00	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,013	31.67	127,091.71	
	BOUYGUES SA	8,005	34.59	276,932.97	
	BRENTAG AG	5,838	43.64	254,799.56	
	CIE DE SAINT-GOBAIN	18,420	35.34	650,962.80	
CNH INDUSTRIAL NV	37,836	5.69	215,286.84		
FERROVIAL SA	17,881	18.36	328,384.56		
FINMECCANICA SPA	16,864	9.30	156,919.52		
GEA GROUP AG NPV	6,932	40.14	278,285.20		
KONE OYJ	13,213	40.34	533,012.42		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	38,270	22.39	856,865.30		
LEGRAND PROMESSES EUR4	10,259	44.64	458,013.05		

MAN SE	1,316	94.24	124,019.84	
METSO OYJ	5,434	19.98	108,571.32	
OSRAM LICHT AG	3,817	41.63	158,920.79	
PRYSMIAN SPA EURO.10	7,536	17.79	134,065.44	
REXEL SA	11,359	9.95	113,078.84	
SAFRAN SA	11,972	53.95	645,889.40	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,701	52.36	1,136,264.36	
SIEMENS AG	30,986	84.55	2,619,866.30	
THALES SA	4,135	66.13	273,447.55	
VINCI SA	18,667	62.89	1,173,967.63	
WARTSILA OYJ	5,554	38.25	212,440.50	
ZARDOYA OTIS	7,271	9.25	67,256.75	
ZODIAC AEROSPACE	8,082	19.89	160,750.98	
BIC	1,100	124.95	137,445.00	
BUREAU VERITAS	10,721	17.86	191,530.66	
EDENRED	7,967	15.42	122,851.14	
RANDSTAD HOLDING NV	5,309	46.69	247,903.75	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	18,560	13.22	245,456.00	
ADP	1,341	106.50	142,816.50	
AENA SA	2,679	103.35	276,874.65	
ATLANTIA SPA	15,789	22.86	360,936.54	
BOLLORE	25,923	3.57	92,648.80	
DEUTSCHE POST AG-REG	37,550	21.07	791,366.25	
FRAPORT AG NPV	1,722	52.23	89,940.06	
GROUPE EUROTUNNEL SE-REGR	20,314	9.32	189,468.67	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	34,329	7.01	240,749.27	
LUFTHANSA	9,110	13.60	123,941.55	
TNT EXPRESS NV - W/I	21,588	7.87	169,897.56	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	12,853	73.83	948,936.99	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	2,336	62.66	146,373.76	
CONTINENTAL	4,264	187.65	800,139.60	
DAIMLER AG	37,613	63.37	2,383,535.81	
FERRARI NV	3,644	34.36	125,207.84	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,441	5.69	207,349.29	
MICHELIN B	7,204	85.29	614,429.16	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,789	33.34	159,665.26	
PEUGEOT SA	17,661	13.47	237,893.67	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	6,513	40.48	263,646.24	
RENAULT SA	7,822	79.53	622,083.66	
VALEO SA	3,167	124.10	393,024.70	
VOLKSWAGEN STAMM	1,284	119.45	153,373.80	
VOLKSWAGEN VORZUG	7,489	102.05	764,252.45	
ADIDAS AG	8,105	99.34	805,150.70	
CHRISTIAN DIOR	2,160	164.25	354,780.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,005	320.45	322,052.25	
HUGO BOSS AG -ORD	2,514	69.19	173,943.66	

KERING	3,071	159.35	489,363.85	
LUXOTTICA GROUP SPA	6,820	53.05	361,801.00	
LVMH	10,898	154.50	1,683,741.00	
ACCOR SA	7,625	35.62	271,640.62	
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,299	130.15	429,364.85	
SODEXO	3,773	89.49	337,645.77	
ALTICE NV-A	10,352	12.36	128,002.48	
ALTICE NV-B	3,939	12.49	49,198.11	
AXEL SPRINGER SE	1,652	45.94	75,901.14	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,348	26.78	169,999.44	
JC DECAUX SA	2,913	35.33	102,916.29	
LAGARDERE	5,230	26.63	139,301.05	
NUMERICABLE-SFR	3,802	32.41	123,222.82	
PROSIEBEN SAT 1 MEDIA SE	8,369	45.52	380,998.72	
PUBLICIS GROUPE	7,640	57.25	437,390.00	
RELX NV	39,931	14.87	593,973.62	
RTL GROUP	1,727	75.75	130,820.25	
SES	13,349	23.04	307,627.70	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,970	47.61	93,791.70	
VIVENDI SA	45,063	18.02	812,035.26	
WOLTERS KLUWER CVA	12,133	31.03	376,486.99	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	42,450	28.25	1,199,424.75	
ZALANDO SE	3,171	29.09	92,260.24	
CARREFOUR	22,235	23.52	522,967.20	
CASINO ORD	2,554	41.00	104,714.00	
COLRUYT NV	2,574	49.22	126,692.28	
DELHAIZE GROUP	4,118	91.41	376,426.38	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	23,349	4.91	114,783.68	
JERONIMO MARTINS	10,993	12.93	142,194.45	
KONINKLIJKE AHOLD NV	33,529	19.84	665,215.36	
METRO STAMM	6,776	23.80	161,268.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	31,450	104.80	3,295,960.00	
DANONE	22,966	60.35	1,385,998.10	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	4,005	66.12	264,810.60	
HEINEKEN NV	8,911	73.79	657,542.69	
KERRY GROUP A	6,081	72.23	439,230.63	
PERNOD RICARD	8,232	96.80	796,857.60	
REMY COINTREAU	1,030	62.69	64,570.70	
BEIERSDORF	3,988	79.40	316,647.20	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	6,888	97.97	674,817.36	
HENKEL KGAA	3,961	83.42	330,426.62	
L'OREAL	9,818	154.65	1,518,353.70	
UNILEVER NV CVA	63,648	38.92	2,477,180.16	
ESSILOR INTERNATIONAL	7,967	109.35	871,191.45	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	8,452	76.73	648,521.96	
FRESENIUS SE & CO KGaA	14,795	56.75	839,616.25	
BAYER AG	32,338	98.03	3,170,094.14	

GRIFOLS SA	11,668	19.12	223,150.50	
MERCK KGAA	4,944	76.05	375,991.20	
ORION OYJ	3,906	30.40	118,742.40	
QIAGEN N.V.	8,569	19.31	165,467.39	
SANOFI	45,949	70.35	3,232,512.15	
UCB SA	5,025	76.85	386,171.25	
BANCA INTESA SPA	493,599	2.32	1,149,098.47	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	248,004	5.53	1,373,694.15	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	1,819,893	0.03	60,056.46	
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192			
BANCO POPOLARE SC	15,655	7.45	116,629.75	
BANCO POPULAR ESPANOL	72,560	2.04	148,022.40	
BANCO SANTANDER SA	563,442	3.49	1,971,483.55	
BANK OF IRELAND	1,109,756	0.24	274,109.73	
BANKIA SA	200,556	0.74	148,812.55	
BANKINTER, S.A.	26,337	5.86	154,387.49	
BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV	202,864	1.40	285,429.64	
BNP PARIBAS	41,306	40.51	1,673,306.06	
CAIXABANK	90,998	2.46	223,946.07	
COMMERZBANK AG	44,524	7.27	323,867.57	
CREDIT AGRICOLE SA	41,830	9.20	384,877.83	
ERSTE GROUP BANK AG	10,571	25.02	264,539.27	
ING GROUP N.V.	150,809	10.32	1,556,348.88	
INTESA SANPAOLO RSP	42,401	2.16	91,840.56	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	10,031	46.13	462,730.03	
NATIXIS	40,646	4.54	184,532.84	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,358	11.26	60,357.87	
SOCIETE GENERALE-A	28,133	30.43	856,087.19	
UNICREDIT SPA	184,126	3.19	588,466.69	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	37,272	3.29	122,699.42	
DEUTSCHE BANK AG-REG	53,443	15.20	812,333.60	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,570	74.32	562,602.40	
EURAZEO NPV	1,752	51.85	90,841.20	
EXOR SPA	3,827	27.72	106,084.44	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,025	68.20	206,305.00	
MEDIOBANCA	23,487	5.97	140,334.82	
WENDEL	1,178	85.95	101,249.10	
AEGON NV	72,039	4.30	309,911.77	
AGEAS	7,620	33.91	258,432.30	
ALLIANZ	17,854	134.05	2,393,328.70	
ASSICURAZIONI GENERALI	45,796	11.71	536,271.16	
AXA	76,844	20.40	1,567,617.60	
CNP ASSURANCES	8,159	12.44	101,538.75	
HANNOVER RUECK SE	2,358	92.15	217,289.70	
MAPFRE SA	44,197	1.73	76,725.99	
MUENCHENER RUECK AG-REG	6,488	175.20	1,136,697.60	
NN GROUP NV	9,402	27.82	261,610.65	

SAMPO INSURANCE CO A	17,293	40.40	698,637.20	
SCOR SE	6,412	31.54	202,266.60	
UNIPOLSAI SPA	38,014	1.82	69,185.48	
DEUTSCHE WOHNEN AG BR	12,841	24.33	312,421.53	
VONOVIA SE	18,655	28.26	527,283.57	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	17,619	35.58	626,972.11	
ATOS SE	3,420	65.31	223,360.20	
CAP GEMINI SA	6,560	75.78	497,116.80	
DASSAULT SYSTEMES	5,063	69.75	353,144.25	
GEMALTO	3,361	56.27	189,123.47	
SAP SE	38,409	69.58	2,672,498.22	
UNITED INTERNET	4,853	43.79	212,537.23	
INGENICO GROUP	2,360	91.52	215,987.20	
NOKIA OYJ	65,578	5.41	354,776.98	
NOKIA OYJ	150,521	5.40	812,813.40	
DEUTSCHE TELEKOM	125,850	15.23	1,917,324.75	
ELISA CORP-A SHARES	5,535	32.44	179,555.40	
ILIAD SA	1,039	224.10	232,839.90	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	122,868	3.39	416,891.12	
ORANGE S.A.	77,918	15.94	1,242,012.92	
PROXIMUS	6,592	30.53	201,253.76	
TELECOM ITALIA SPA	429,026	0.85	367,246.25	
TELECOM ITALIA-RNC	260,935	0.68	178,740.47	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	4.57	126,530.97	
TELEFONICA S.A.	175,704	9.28	1,631,235.93	
E.ON SE	77,360	8.49	656,863.76	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	92,540	2.86	264,664.40	
ELEC DE FRANCE EURO.5	11,008	10.42	114,758.40	
ENAGAS	8,825	25.40	224,199.12	
ENDESA SA	12,380	16.14	199,875.10	
ENEL GREEN POWER SPA	65,682	1.75	115,337.59	
ENEL SPA	273,977	3.62	991,796.74	
ENGIE	56,628	14.02	793,924.56	
FORTUM OYJ	16,606	11.69	194,124.14	
GAS NATURAL SDG-E	13,145	16.10	211,634.50	
IBERDROLA SA	213,976	6.01	1,286,423.71	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,278	71.68	306,647.04	
RWE AG	20,770	10.29	213,827.15	
SNAM SPA	84,612	4.90	415,275.69	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	11,127	16.97	188,880.82	
TERNA SPA	59,888	4.67	280,156.06	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,422	21.31	392,664.93	
ASML HOLDING NV	13,473	78.99	1,064,232.27	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	45,255	11.25	509,345.02	
STMICROELECTRONICS NV	24,753	5.20	128,715.60	
ユーロ 小計	10,956,945		118,316,656.69 (14,833,359,249)	

合計	48,169,553	117,258,392,917 (117,258,392,917)
----	------------	--------------------------------------

(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	14,000	252,140.00	
		AMERICAN TOWER CORP	16,492	1,440,081.44	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,400	371,008.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,415	921,145.65	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,250	702,500.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,400	172,642.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,706	273,651.04	
		CROWN CASTLE INTL CORP	12,966	1,108,074.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,400	439,668.00	
		DUKE REALTY CORP	13,600	276,352.00	
		EQUINIX INC	2,327	696,633.99	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	14,143	1,034,136.16	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,537	525,463.44	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,700	405,140.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,700	396,630.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	22,087	579,342.01	
		HCP INC	18,800	533,920.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	30,748	463,064.88	
		IRON MOUNTAIN INC	7,457	215,880.15	
		KIMCO REALTY CORP	16,600	446,540.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,400	183,168.00	
		MACERICH CO/THE	5,141	395,445.72	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	2,837	259,869.20	
		PLUM CREEK TIMBER CO	6,856	250,518.24	
		PROLOGIS INC	21,111	788,073.63	
		PUBLIC STORAGE	5,730	1,443,788.10	
		REALTY INCOME CORP	9,374	564,502.28	
		REGENCY CENTERS CORP	4,000	281,440.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	12,080	2,288,556.00	
		SL GREEN REALTY CORP	4,000	349,280.00	
		UDR INC	11,000	375,760.00	
		VENTAS INC COM	13,600	709,784.00	
VEREIT INC	34,092	263,190.24			
VORNADO REALTY TRUST	6,859	583,152.18			
WELLTOWER INC	13,691	810,507.20			
WEYERHAEUSER CO	20,991	480,064.17			
	アメリカ・ドル 小計		422,490	21,281,112.08 (2,401,573,498)	

カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5,913	113,766.12	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,000	177,660.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,100	67,431.00	
カナダ・ドル 小計		15,013	358,857.12	(29,379,632)
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	35,987	264,864.32	
	GOODMAN GROUP	67,133	437,035.83	
	GPT GROUP	73,197	361,593.18	
	MIRVAC GROUP	160,291	298,942.71	
	SCENTRE GROUP	216,177	974,958.27	
	STOCKLAND	89,705	383,040.35	
	VINCINITY CENTERS	133,465	403,064.30	
WESTFIELD CORP	80,050	770,881.50		
オーストラリア・ドル 小計		856,005	3,894,380.46	(314,549,109)
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	39,238	271,723.15	
	HAMMERSON	33,098	186,507.23	
	INTU PROPERTIES PLC	36,917	106,800.88	
	LAND SECURITIES GROUP	32,138	332,949.68	
	SEGRO PLC	29,326	127,333.49	
イギリス・ポンド 小計		170,717	1,025,314.43	(165,403,724)
香港・ドル	LINK REIT	86,487	3,744,887.10	
香港・ドル 小計		86,487	3,744,887.10	(54,375,760)
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	77,223	183,790.74	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	96,000	133,920.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	97,221	207,080.73	
	SUNTEC REAL ESTAITTE INVESTMENT TRUST	110,000	182,600.00	
シンガポール・ドル 小計		380,444	707,391.47	(56,782,313)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,379	102,597.60	
	GECINA SA	1,359	153,159.30	
	ICADE	1,152	72,702.72	
	KLEPIERRE	7,556	292,757.22	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,827	880,401.35	
ユーロ 小計		15,273	1,501,618.19	(188,257,872)
投資証券 小計			3,210,321,908	(3,210,321,908)
合計			3,210,321,908	(3,210,321,908)

(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 603銘柄	96.9%		64.7%
	投資証券 36銘柄		3.1%	
カナダ・ドル	株式 90銘柄	99.3%		3.6%
	投資証券 3銘柄		0.7%	
オーストラリア・ドル	株式 65銘柄	90.9%		2.9%
	投資証券 8銘柄		9.1%	
イギリス・ポンド	株式 107銘柄	98.3%		8.1%
	投資証券 5銘柄		1.7%	
スイス・フラン	株式 40銘柄	100.0%		3.8%
香港・ドル	株式 40銘柄	96.4%		1.3%
	投資証券 1銘柄		3.6%	
シンガポール・ドル	株式 23銘柄	91.2%		0.5%
	投資証券 4銘柄		8.8%	
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 30銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.2%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100.0%		0.8%
イスラエル・シェケル	株式 9銘柄	100.0%		0.3%
ユーロ	株式 233銘柄	98.7%		12.5%
	投資証券 5銘柄		1.3%	

(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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		531,385,414	894,688,759
金銭信託			228,226,721
コール・ローン		182,629,528	4,970,649
国債証券		218,299,112,645	157,110,348,596
派生商品評価勘定		140,307	2,390,400
未収入金			705,397,652
未収利息		2,038,791,984	1,514,348,734
前払費用		81,036,047	28,008,805
流動資産合計		221,133,095,925	160,488,380,316
資産合計		221,133,095,925	160,488,380,316

負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,469	427,200
未払解約金		130,134,012	1,699,257,258
流動負債合計		130,139,481	1,699,684,458
負債合計		130,139,481	1,699,684,458
純資産の部			
元本等			
元本	1	93,621,001,523	70,807,053,573
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		127,381,954,921	87,981,642,285
元本等合計		221,002,956,444	158,788,695,858
純資産合計		221,002,956,444	158,788,695,858
負債純資産合計		221,133,095,925	160,488,380,316

(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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1 期首元本額	119,668,724,561円	93,621,001,523円
期中追加設定元本額	21,752,849,966円	15,970,215,085円

期中一部解約元本額	47,800,573,004円	38,784,163,035円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	5,536,083,723円	5,638,579,993円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	14,105,595円	13,076,343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)	214,227,523円	61,405,248円
ステート・ストリート海外国債インデックス・ファンド 適格機関投資家限定	288,643,752円	279,991,019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(年金1) <適格機関投資家限定>	3,803,950,475円	1,492,168,040円
ステート・ストリート外国債券パッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	13,433,881,570円	8,960,328,412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>	48,820,660円	26,395,685円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30B <適格機関投資家限定>	6,907,498,028円	3,770,477,898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>	308,138円	317,363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>	47,228,497円	35,052,645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>	8,611,473円	6,470,910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>	13,085,050,806円	11,276,376,409円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドVA1 <適格機関投資家限定>	707,266,542円	382,866,199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>	34,018,550円	20,017,905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>	7,877,102,251円	5,453,974,047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>	2,211,370,553円	1,985,114,455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 >	69,961,667円	55,498,781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>	920,331,570円	454,677,212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>	3,278,850,278円	1,506,849,551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>	1,559,416,021円	676,329,234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 >	5,738,637,479円	5,046,371,273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 >	730,048,672円	523,220,146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>	1,271,117,991円	1,103,520,704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>	284,233,524円	288,454,006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>	120,490,691円	114,367,726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>	73,674,165円	65,727,530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>	398,062,916円	716,413,612円
ステート・ストリート4資産 balan ス30VA2<適格機関投資家限定>	79,842,636円	43,432,480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>	960,695,424円	881,281,263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>	11,957,808円	6,542,069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>	9,050,616円	9,187,897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>	99,863円	104,299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>	17,383,491,729円	12,829,440,380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>	195,247,770円	341,665,536円

4 資産インデックスバランスV A 2 0 <適格機関投資家限定>	1,576,831,575円	1,472,157,148円
ステート・ストリート世界分散ファ ンドV A 2 5 A <適格機関投資家限 定>	2,691,569,394円	2,477,695,241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>	922,836,213円	1,362,187,622円
4 資産インデックスバランスV A 5 0 <適格機関投資家限定>	43,320,766円	38,772,789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V A 4 <適格機関投資家限定>	58,399,546円	31,804,629円
T a d リスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）年金 <適格機関投資家限定>	143,671,028円	1,966,382円
債券マルチ・ファクター戦略ファン ド（年金）<適格機関投資家限定>	752,455,128円	760,270,336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>	128,538,917円	円
フレックス資産配分戦略ファンド< 適格機関投資家限定>	円	596,092,651円
T a d リスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）<適 格機関投資家限定>	円	410,505円
計	93,621,001,523円	70,807,053,573円
2 受益権の総数	93,621,001,523口	70,807,053,573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27年 2月20日現在）	（平成28年 2月22日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

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

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(平成27年 2月20日現在)		(平成28年 2月22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	11,339,579,671		68,571,597	
合計	11,339,579,671		68,571,597	

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

(単位：円)

区 分	種 類	(平成28年 2月22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	790,585,000	789,880,000	705,000
	オーストラリア・ドル	8,050,300	8,076,000	25,700
	イギリス・ポンド	80,830,000	80,655,000	175,000
	メキシコ・ペソ	33,841,500	33,990,000	148,500
	ポーランド・ズロチ	54,245,000	54,473,000	228,000
	ユーロ	615,749,400	614,264,000	1,485,400
	合 計	1,583,301,200	1,581,338,000	1,963,200

(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26年 2月21日 至 平成27年 2月20日	自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22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27年 2月20日現在)	(平成28年 2月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3606円 (23,606円)	2.2426円 (22,426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	687,990.00	
		US TREASURY N/B 4.25% 17/11/15	8,100,000	8,580,654.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	1,000,000	1,382,310.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 17/05/15	5,800,000	6,069,584.00	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	1,700,000	2,596,954.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 17/01/31	3,000,000	3,070,320.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 17/02/28	1,300,000	1,303,302.00	
		US TREASURY N/B 3.25% 17/03/31	6,800,000	6,994,208.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 17/04/30	8,200,000	8,220,828.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 17/05/31	7,000,000	6,994,540.00	

US TREASURY N/B 0.75% 17/06/30	9,000,000	9,005,940.00	
US TREASURY N/B 1.875% 17/08/31	7,500,000	7,628,025.00	
US TREASURY N/B 0.625% 17/08/31	6,500,000	6,489,340.00	
US TREASURY N/B 1.875% 17/09/30	9,800,000	9,973,754.00	
US TREASURY N/B 0.625% 17/09/30	6,000,000	5,987,820.00	
US TREASURY N/B 1.875% 17/10/31	6,000,000	6,110,880.00	
US TREASURY N/B 0.75% 17/12/31	5,500,000	5,498,515.00	
US TREASURY N/B 2.625% 18/01/31	6,000,000	6,212,820.00	
US TREASURY N/B 0.75% 18/03/31	6,200,000	6,198,078.00	
US TREASURY N/B 2.625% 18/04/30	5,000,000	5,198,450.00	
US TREASURY N/B 0.625% 18/04/30	8,800,000	8,767,704.00	
US TREASURY N/B 2.375% 18/05/31	2,500,000	2,588,175.00	
US TREASURY N/B 2.375% 18/06/30	3,000,000	3,112,260.00	
US TREASURY N/B 2.25% 18/07/31	2,000,000	2,069,620.00	
US TREASURY N/B 1.5% 18/08/31	7,600,000	7,730,948.00	
US TREASURY N/B 1.375% 18/09/30	8,500,000	8,620,190.00	
US TREASURY N/B 1.75% 18/10/31	2,500,000	2,560,150.00	
US TREASURY N/B 3.75% 18/11/15	4,000,000	4,312,960.00	
US TREASURY N/B 1.375% 18/11/30	5,000,000	5,068,150.00	
US TREASURY N/B 1.25% 18/11/30	5,200,000	5,253,820.00	
US TREASURY N/B 1.375% 18/12/31	6,000,000	6,080,400.00	
US TREASURY N/B 2.75% 19/02/15	7,000,000	7,374,640.00	
US TREASURY N/B 1.5% 19/03/31	5,000,000	5,084,400.00	
US TREASURY N/B 1.25% 19/04/30	8,900,000	8,980,990.00	
US TREASURY N/B 3.125% 19/05/15	7,000,000	7,480,690.00	
US TREASURY N/B 3.625% 19/08/15	3,500,000	3,810,625.00	
US TREASURY N/B 1.0% 19/09/30	8,200,000	8,185,240.00	
US TREASURY N/B 1.25% 19/10/31	7,000,000	7,047,040.00	
US TREASURY N/B 1.0% 19/11/30	4,500,000	4,486,275.00	
US TREASURY N/B 1.125% 19/12/31	8,200,000	8,207,380.00	
US TREASURY N/B 1.375% 20/01/31	13,000,000	13,129,480.00	
US TREASURY N/B 3.625% 20/02/15	8,800,000	9,650,432.00	
US TREASURY N/B 1.25% 20/02/29	5,000,000	5,022,650.00	
US TREASURY N/B 1.125% 20/03/31	4,900,000	4,896,766.00	
US TREASURY N/B 3.5% 20/05/15	7,000,000	7,667,730.00	
US TREASURY N/B 2.625% 20/08/15	6,900,000	7,324,764.00	
US TREASURY N/B 2.0% 20/09/30	2,000,000	2,070,080.00	
US TREASURY N/B 2.625% 20/11/15	7,500,000	7,973,175.00	
US TREASURY N/B 2.0% 20/11/30	6,400,000	6,622,272.00	
US TREASURY N/B 2.375% 20/12/31	9,000,000	9,472,500.00	
US TREASURY N/B 3.625% 21/02/15	9,000,000	10,016,730.00	
US TREASURY N/B 2.0% 21/02/28	1,000,000	1,035,390.00	
US TREASURY N/B 2.25% 21/03/31	5,500,000	5,761,030.00	
US TREASURY N/B 3.125% 21/05/15	5,500,000	6,000,170.00	
US TREASURY N/B 2.0% 21/05/31	5,500,000	5,691,840.00	
US TREASURY N/B 2.125% 21/08/15	7,000,000	7,289,590.00	
US TREASURY N/B 2.0% 21/11/15	7,000,000	7,238,980.00	
US TREASURY N/B 2.0% 22/02/15	13,000,000	13,451,490.00	
US TREASURY N/B 1.75% 22/05/15	9,500,000	9,669,955.00	
US TREASURY N/B 1.625% 22/08/15	6,000,000	6,055,800.00	
US TREASURY N/B 1.75% 22/09/30	4,000,000	4,064,360.00	
US TREASURY N/B 1.625% 22/11/15	4,000,000	4,035,000.00	
US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	5,000,000	5,164,250.00	
US TREASURY N/B 1.75% 23/05/15	4,000,000	4,058,120.00	
US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	2,300,000	2,455,618.00	
US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	5,700,000	6,191,169.00	
US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	3,000,000	3,257,460.00	
US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	8,500,000	9,061,170.00	
US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	12,000,000	12,536,760.00	

US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	12,000,000	12,276,120.00	
US TREASURY N/B 2.125% 25/05/15	4,700,000	4,854,207.00	
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	7,000,000	7,152,040.00	
US TREASURY N/B 5.5% 28/08/15	1,000,000	1,395,040.00	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	2,500,000	3,462,500.00	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	1,200,000	1,439,388.00	
US TREASURY N/B 4.375% 39/11/15	500,000	678,320.00	
US TREASURY N/B 3.875% 40/08/15	2,400,000	3,031,872.00	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	2,500,000	3,335,850.00	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	2,000,000	2,865,080.00	
US TREASURY N/B 4.375% 41/05/15	1,900,000	2,587,192.00	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	2,800,000	3,480,764.00	
US TREASURY N/B 3.125% 41/11/15	1,500,000	1,681,755.00	
US TREASURY N/B 3.125% 42/02/15	2,000,000	2,242,340.00	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	500,000	546,990.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	2,200,000	2,287,494.00	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	2,400,000	2,491,224.00	
US TREASURY N/B 3.125% 43/02/15	6,500,000	7,247,760.00	
US TREASURY N/B 2.875% 43/05/15	5,000,000	5,307,800.00	
US TREASURY N/B 3.625% 43/08/15	4,800,000	5,879,232.00	
US TREASURY N/B 3.625% 44/02/15	7,800,000	9,546,810.00	
US TREASURY N/B 3.375% 44/05/15	5,000,000	5,835,750.00	
US TREASURY N/B 3.125% 44/08/15	5,000,000	5,562,500.00	
US TREASURY N/B 3.0% 44/11/15	3,300,000	3,578,817.00	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	5,600,000	5,478,368.00	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	1,000,000	1,084,060.00	
US TREASURY N/B 3.875% 18/05/15	4,000,000	4,273,600.00	
US TREASURY N/B 4.375% 38/02/15	1,100,000	1,498,145.00	
US TREASURY N/B 4.625% 17/02/15	7,600,000	7,896,020.00	
US TREASURY N/B 4.75% 17/08/15	8,300,000	8,789,866.00	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	1,000,000	1,474,730.00	
US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	1,000,000	1,388,160.00	
US TREASURY N/B 8.125% 19/08/15	6,000,000	7,458,780.00	
US TREASURY N/B 8.75% 17/05/15	5,000,000	5,492,600.00	
US TREASURY N/B 8.875% 19/02/15	650,000	803,133.50	
US TREASURY N/B 6.5% 26/11/15	1,000,000	1,457,340.00	
US TREASURY N/B 3.5% 18/02/15	5,500,000	5,792,820.00	
US TREASURY N/B 4.0% 18/08/15	4,500,000	4,857,525.00	
US TREASURY N/B 5.375% 31/02/15	1,500,000	2,153,325.00	
US TREASURY N/B 6.125% 27/11/15	1,000,000	1,447,110.00	
US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	2,000,000	2,665,320.00	
US TREASURY N/B 8.0% 21/11/15	7,200,000	9,833,904.00	
アメリカ・ドル 小計	563,750,000	600,502,351.50 (67,766,690,366)	
カナダ・ドル			
CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 19/06/01	4,300,000	4,756,230.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/06/01	1,800,000	2,044,962.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	1,300,000	1,960,374.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 17/06/01	4,550,000	4,754,340.50	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 20/06/01	2,000,000	2,253,220.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 16/09/01	1,500,000	1,517,730.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 17/03/01	2,000,000	2,021,060.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 22/06/01	800,000	896,584.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	1,100,000	1,146,299.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	1,700,000	1,900,668.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	2,450,000	3,328,325.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	100,000	126,982.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 18/06/01	3,800,000	4,125,812.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	1,300,000	2,074,579.00	
CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 41/06/01	1,550,000	2,189,158.00	

	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	1,100,000	1,695,518.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 8.0% 27/06/01	1,400,000	2,376,850.00	
カナダ・ドル	小計	32,750,000	39,168,691.50 (3,206,740,773)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/07/21	1,200,000	1,239,649.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 18/01/21	2,300,000	2,458,090.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 18/10/21	1,500,000	1,557,352.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/15	2,400,000	2,652,338.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 22/07/15	1,650,000	2,003,241.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	1,900,000	2,309,007.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,800,000	2,887,645.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	3,000,000	3,213,213.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,400,000	1,627,789.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	1,400,000	1,705,085.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	1,450,000	1,543,037.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,400,000	1,711,635.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	600,000	617,036.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	1,100,000	1,223,143.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 19/03/15	2,900,000	3,198,627.50	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 21/05/15	1,400,000	1,658,209.00		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 17/02/15	3,350,000	3,483,118.95		
オーストラリア・ドル	小計	31,750,000	35,088,222.75 (2,834,075,751)	
イギリス・ポンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	1,500,000	2,215,425.00	
	UK GILT BOND 4.5% 19/03/07	4,200,000	4,718,200.20	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	3,000,000	4,345,011.00	
	UK GILT BOND 3.75% 19/09/07	3,900,000	4,342,544.70	
	UK GILT BOND 8.0% 21/06/07	1,400,000	1,921,745.00	
	UK GILT BOND 3.75% 21/09/07	2,100,000	2,429,246.40	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	2,000,000	2,746,786.00	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	1,600,000	2,183,812.80	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	1,800,000	2,740,042.80	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	2,800,000	3,686,331.60	
	UK GILT BOND 8.75% 17/08/25	1,500,000	1,692,768.00	
	UK GILT BOND 1.25% 18/07/22	800,000	815,722.40	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	2,100,000	2,262,829.80	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	1,500,000	2,067,085.50	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	1,500,000	2,073,933.00	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	2,000,000	2,684,902.00	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	1,000,000	1,379,683.00	
	UK GILT BOND 5.0% 18/03/07	2,600,000	2,851,495.40	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	1,000,000	1,508,382.00	
	UK GILT BOND 1.75% 22/09/07	2,000,000	2,090,262.00	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	2,000,000	2,233,890.00	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	900,000	1,277,613.90	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	3,200,000	3,819,945.60	
	UK GILT BOND 4.0% 22/03/07	1,700,000	2,011,118.70	
	UK GILT BOND 3.75% 20/09/07	2,600,000	2,958,066.80	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	2,000,000	2,878,914.00	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,100,000	1,450,874.70	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,100,000	1,415,485.50	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	1,750,000	2,722,569.50	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	1,500,000	2,179,524.00	
	UK GILT BOND 4.75% 20/03/07	3,200,000	3,730,118.40	
イギリス・ポンド	小計	61,350,000	77,434,329.70 (12,491,706,067)	

スイス・フラン	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 16/03/12	1,000,000	1,001,719.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/02/11	550,000	731,623.75	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 3.0% 18/01/08	1,200,000	1,292,166.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 28/04/08	920,000	1,397,898.60	
スイス・フラン 小計		3,670,000	4,423,407.35	(503,560,692)
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.75% 16/09/01	450,000	457,020.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.375% 17/04/01	1,300,000	1,321,450.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.875% 30/09/01	690,000	722,726.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.375% 33/09/01	200,000	223,298.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	500,000	512,775.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.125% 22/09/01	950,000	1,021,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.25% 20/09/01	2,100,000	2,254,350.00	
SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	1,120,000	1,251,600.00		
シンガポール・ドル 小計		7,310,000	7,764,469.70	(623,253,982)
マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.502% 27/05/31	3,500,000	3,269,563.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.262% 16/09/15	1,200,000	1,212,980.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.814% 17/02/15	9,500,000	9,604,614.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.58% 18/09/28	1,300,000	1,309,100.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.378% 19/11/29	3,500,000	3,610,250.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.418% 22/08/15	2,100,000	2,055,900.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	1,500,000	1,458,841.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.955% 25/09/15	500,000	501,176.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.498% 30/04/15	1,800,000	1,854,750.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.127% 32/04/15	3,000,000	2,904,420.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.935% 43/09/30	750,000	774,704.25		
マレーシア・リンギット 小計		28,650,000	28,556,300.25	(764,452,157)
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 4.25% 19/03/12	12,000,000	13,729,956.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.0% 16/07/12	6,500,000	6,589,024.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 22/06/01	7,400,000	8,959,883.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	3,500,000	3,820,453.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	8,200,000	11,232,196.00	
SWEDISH GOVERNMENT BOND 5.0% 20/12/01	11,700,000	14,568,840.00		
スウェーデン・クローナ 小計		49,300,000	58,900,352.00	(785,730,695)
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 19/05/22	6,200,000	6,980,890.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/05/25	3,500,000	4,020,747.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	4,200,000	4,780,314.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 25/03/13	3,000,000	3,111,840.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	7,500,000	7,967,512.50	
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/05/19	7,500,000	7,839,375.00		
ノルウェー・クローネ 小計		31,900,000	34,700,679.00	(456,660,935)
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 19/11/15	6,400,000	7,415,052.80	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 17/11/15	3,000,000	3,231,069.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 7.0% 24/11/10	3,000,000	4,746,825.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 3.0% 21/11/15	15,500,000	18,202,053.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15	5,000,000	5,487,900.00	
DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	11,500,000	19,939,723.50		
デンマーク・クローネ 小計		44,400,000	59,022,623.30	(991,580,071)

メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 17/12/14	22,000,000	23,313,928.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 18/12/13	26,000,000	28,392,182.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 20/06/11	38,000,000	41,734,108.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 21/06/10	26,000,000	27,014,416.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	31,500,000	40,149,994.50	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	14,000,000	15,437,044.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	11,000,000	13,104,806.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	10,000,000	13,646,980.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	11,000,000	13,235,750.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	14,500,000	16,231,488.50	
メキシコ・ペソ 小計		204,000,000	232,260,697.00 (1,437,693,714)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 5.0% 16/04/25	2,000,000	2,012,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 18/07/25	500,000	512,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 20/10/25	1,150,000	1,312,495.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 21/10/25	2,000,000	2,365,600.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25	2,900,000	3,174,775.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	1,900,000	1,970,623.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	2,600,000	3,299,660.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 17/10/25	8,500,000	9,039,027.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5% 19/10/25	2,800,000	3,169,488.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 22/09/23	3,000,000	3,603,030.00	
ポーランド・ズロチ 小計		27,350,000	30,459,198.50 (873,569,812)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 8.25% 17/09/15	4,500,000	4,511,047.50	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 7.25% 20/01/15	3,000,000	2,862,630.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.75% 21/03/31	22,000,000	20,134,400.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 10.5% 26/12/21	22,000,000	23,982,024.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 7.0% 31/02/28	8,500,000	6,761,240.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.25% 36/03/31	10,000,000	6,954,800.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 41/02/28	28,000,000	19,355,000.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 8.75% 48/02/28	7,200,000	6,373,728.00	
南アフリカ・ランド 小計		105,200,000	90,934,869.50 (666,552,593)	
ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.95% 19/06/18	1,300,000	1,399,931.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.65% 22/04/20	1,200,000	1,474,648.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.4% 22/11/22	800,000	981,508.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	500,000	559,992.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	600,000	667,441.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	800,000	1,138,384.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	530,000	761,251.72	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	550,000	983,175.05	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.5% 21/09/15	1,300,000	1,564,368.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.9% 20/07/15	1,500,000	1,777,111.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	1,300,000	2,020,033.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.3% 17/09/15	800,000	860,048.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.35% 19/03/15	1,600,000	1,831,840.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	800,000	1,292,144.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.65% 18/01/15	2,350,000	2,580,102.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.5% 17/06/28	400,000	421,250.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 18/06/22	1,000,000	1,039,332.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 21/09/28	1,400,000	1,742,536.60	

BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 22/09/28	1,500,000	1,916,049.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	1,500,000	1,728,580.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	2,000,000	2,369,080.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	900,000	921,535.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	1,200,000	1,663,100.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	1,100,000	1,565,564	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	1,470,000	2,341,871.70	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	720,000	1,093,540.32	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 20/09/28	2,400,000	2,842,113.60	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 17/03/28	250,000	262,129.25	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 18/03/28	2,100,000	2,295,938.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 19/03/28	1,300,000	1,476,819.50	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 22/03/28	1,500,000	1,870,020.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 17/09/28	800,000	876,126.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,200,000	1,849,669.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	2,450,000	4,015,456.90	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.875% 17/09/15	500,000	534,252.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.375% 19/07/04	900,000	1,043,699.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.125% 18/09/15	400,000	415,973.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.375% 20/04/15	1,500,000	1,726,485.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.5% 21/04/15	600,000	713,223.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	700,000	768,453.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	420,000	518,620.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.625% 42/07/04	600,000	801,181.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	1,150,000	1,528,017.65	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	2,600,000	4,282,062.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	500,000	844,814.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 18/11/25	3,400,000	3,526,769.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 19/10/25	4,200,000	4,825,392.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 20/04/25	5,500,000	6,363,450.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 22/04/25	4,000,000	4,742,528.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 22/10/25	2,000,000	2,290,682.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	2,000,000	2,232,308.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	3,000,000	3,477,885.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	1,500,000	1,503,000.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	4,000,000	5,146,400.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,100,000	2,558,854.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	800,000	958,280.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 17/10/25	5,000,000	5,392,400.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 19/04/25	3,700,000	4,239,315.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 21/10/25	4,000,000	4,753,448.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 21/04/25	5,000,000	6,010,650.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 17/04/25	1,000,000	1,049,270.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 18/04/25	5,400,000	5,918,913.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 18/10/25	4,800,000	5,395,392.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	2,800,000	4,468,984.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	3,200,000	5,035,625.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	2,500,000	4,265,990.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	4,200,000	6,407,452.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	2,000,000	2,795,120.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	2,000,000	3,012,064.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,923,452.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 19/10/25	3,800,000	5,034,213.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	2,500,000	4,157,375.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 20/10/25	3,500,000	3,940,188.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	3,500,000	4,585,199.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 17/02/25	200,000	204,404.60	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 17/07/25	1,500,000	1,530,750.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	3,000,000	3,112,281.00	

GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	500,000	540,883.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 17/10/13	2,000,000	2,033,496.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 18/04/13	1,900,000	1,931,439.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.5% 19/07/04	5,900,000	6,695,355.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 21/01/04	3,600,000	4,109,457.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	1,500,000	2,354,833.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 18/01/04	4,000,000	4,339,192.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/07/04	2,800,000	2,982,198.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	700,000	997,786.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.0% 20/07/04	5,000,000	5,751,900.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 20/09/04	600,000	672,947.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/04	400,000	477,561.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 21/09/04	2,000,000	2,287,830.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 22/01/04	2,100,000	2,381,654.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.75% 22/07/04	1,500,000	1,690,926.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 22/09/04	2,000,000	2,227,444.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	700,000	782,452.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	2,300,000	2,576,885.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	1,500,000	1,690,459.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	2,500,000	2,712,577.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	1,850,000	2,609,282.55	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,000,000	1,537,029.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.625% 28/01/04	1,300,000	2,108,957.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 20/01/04	3,400,000	3,890,779.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.75% 19/01/04	4,800,000	5,388,393.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	1,700,000	2,754,338.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 18/07/04	4,000,000	4,453,820.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	1,700,000	2,947,585.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,800,000	3,076,894.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,500,000	2,804,037.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,500,000	2,571,135.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	2,400,000	3,607,195.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	700,000	1,252,521.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,500,000	2,552,559.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	2,000,000	2,791,462.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.6% 16/04/18	600,000	604,436.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.4% 19/06/18	900,000	1,032,526.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 18/10/18	900,000	1,010,395.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	200,000	248,477.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	530,000	547,974.95	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	550,000	627,348.70	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	950,000	1,154,086.60	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/18	2,000,000	2,373,462.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	2,500,000	3,146,715.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/02/01	2,500,000	2,906,182.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 18/02/01	4,800,000	5,212,910.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 18/08/01	4,200,000	4,648,694.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 21/09/01	3,800,000	4,626,196.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	2,000,000	2,821,100.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	1,200,000	1,850,180.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,000,000	1,269,983.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	1,700,000	2,666,195.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/08/01	2,200,000	2,557,313.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 19/02/01	5,000,000	5,598,925.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	1,700,000	2,452,263.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 17/08/01	4,000,000	4,301,140.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	4,000,000	5,579,920.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	2,400,000	3,612,403.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	3,750,000	5,650,530.00	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/11/01	2,800,000	4,170,112.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 17/05/01	4,400,000	4,647,517.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 18/06/01	1,100,000	1,185,584.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 19/03/01	5,000,000	5,649,390.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 20/03/01	3,100,000	3,579,876.90	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 20/09/01	3,200,000	3,704,371.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/03/01	4,100,000	4,736,914.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 22/03/01	3,000,000	3,728,598.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/09/01	2,500,000	3,213,260.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/11/01	3,400,000	4,381,097.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	2,600,000	3,265,938.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	2,900,000	3,601,672.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	5,500,000	7,133,830.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,400,000	1,849,589.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	2,000,000	2,876,154.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	1,600,000	2,274,347.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	950,000	1,066,504.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 19/09/01	1,200,000	1,366,161.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	1,600,000	2,625,881.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	1,200,000	1,909,920.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 17/01/15	400,000	410,754.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.25% 18/01/15	1,600,000	1,652,763.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.25% 19/01/15	1,700,000	1,782,295.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.25% 22/07/15	1,100,000	1,264,665.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	1,000,000	1,125,553.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,200,000	1,382,298.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	1,200,000	1,517,343.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	820,000	1,187,784.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 18/07/15	3,800,000	4,208,545.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/15	1,600,000	1,899,817.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.5% 20/07/15	2,200,000	2,571,701.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 23/01/15	1,000,000	1,261,980.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 19/07/15	2,200,000	2,529,560.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	1,300,000	2,042,890.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.5% 23/01/15	1,000,000	1,521,471.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.75% 18/10/31	2,900,000	3,175,926.30	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.3% 19/10/31	4,000,000	4,564,120.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.85% 20/10/31	2,100,000	2,503,139.10	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 21/04/30	2,400,000	2,973,758.40	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.85% 22/01/31	2,000,000	2,562,990.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	1,800,000	2,299,048.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,000,000	2,437,878.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	1,500,000	1,876,275.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	3,400,000	3,709,094.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	2,800,000	3,520,916.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	1,100,000	1,068,252.90	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,000,000	1,350,506.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	1,200,000	1,739,128.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	500,000	519,268.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,900,000	2,381,526.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,400,000	1,934,567.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,800,000	2,494,242.00	

	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 20/04/30	3,500,000	3,994,102.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.1% 18/07/30	4,200,000	4,599,915.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.6% 19/07/30	3,000,000	3,432,387.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 17/07/30	7,400,000	7,981,025.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	3,200,000	4,620,723.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,900,000	2,795,411.10	
	ユーロ 小計	408,990,000	508,160,492.85 (63,708,080,988)	
国債証券	小計		157,110,348,596 (157,110,348,596)	
合計			157,110,348,596 (157,110,348,596)	

(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 111銘柄	100.0%	43.2%
カナダ・ドル	国債証券 17銘柄	100.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.8%
イギリス・ポンド	国債証券 31銘柄	100.0%	8.0%
スイス・フラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
シンガポール・ドル	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リングギット	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 6銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
メキシコ・ペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカ・ランド	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ユーロ	国債証券 194銘柄	100.0%	40.5%

(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28年3月31日現在)

資産総額	2,896,134,056円
負債総額	2,607,474円
純資産総額(-)	2,893,526,582円
発行済口数	2,360,503,377口
1口当たり純資産額(/)	1.2258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28年3月31日現在）

資産総額	115,141,396,570円
負債総額	461,131,545円
純資産総額（ - ）	114,680,265,025円
発行済口数	54,825,652,538口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0917円

< 参考情報 >

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

（平成28年3月31日現在）

資産総額	137,883,218,867円
負債総額	782,572,500円
純資産総額（ - ）	137,100,646,367円
発行済口数	107,779,480,505口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2720円

< 参考情報 >

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

（平成28年3月31日現在）

資産総額	139,110,520,344円
負債総額	165,239,824円
純資産総額（ - ）	138,945,280,520円
発行済口数	70,843,745,502口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9613円

< 参考情報 >

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

（平成28年3月31日現在）

資産総額	164,551,370,289円
負債総額	1,677,069,825円
純資産総額（ - ）	162,874,300,464円
発行済口数	71,484,092,948口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2785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28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28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28年3月31日現在)。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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。

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28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112本であり、その純資産総額は1,309,063百万円です(親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。)

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表ならびに第19期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27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	7,950,582		8,366,245	
有価証券	34,680		38,658	
差入保証金	-		61,568	
前払金	16,211		34,267	
前払費用	14,721		16,572	
未収入金	603,386		631,179	
未収委託者報酬	503,082		620,043	
未収収益	21,586		20,425	
繰延税金資産	76,778		89,899	
流動資産計	9,221,030	97.5	9,878,861	97.4
固定資産				
有形固定資産	114,512		153,132	
建物附属設備	103,804		-	
器具備品	8,419		302	
リース資産	2,289		6,365	
建設仮勘定	-		146,463	
無形固定資産	1,407		804	
ソフトウェア	1,407		804	
投資その他の資産	116,869		108,598	
長期差入保証金	66,322		80,034	
繰延税金資産	45,696		23,714	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	232,789	2.5	262,535	2.6
資産合計	9,453,819	100.0	10,141,396	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27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	23,420		35,845	
未払金	249,155		560,375	
未払手数料	122,594		135,048	
その他未払金	126,561		425,326	
未払費用	11,232		11,999	
未払法人税等	406,211		154,604	
未払消費税	31,826		89,514	
賞与引当金	57,068		53,368	
リース債務	4,910		-	
流動負債計	783,826	8.3	905,707	8.9
固定負債				

退職給付引当金		66,635			58,673	
長期リース債務		-			6,502	
固定負債計		66,635	0.7		65,175	0.6
負債合計		850,462	9.0		970,883	9.6
(純資産の部)			%			%
株主資本		8,603,357	91.0		9,170,513	90.4
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	8,184,237			8,751,393		
純資産合計		8,603,357	91.0		9,170,513	90.4
負債・純資産合計		9,453,819	100.0		10,141,396	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日		当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,386,697		2,546,857	
投資顧問収入	1,524,966		1,644,728	
その他営業収益	567,688		37,200	
営業収益計	4,479,352	100.0	4,228,786	100.0
営業費用				
支払手数料	583,489		590,805	
広告宣伝費	15,984		16,509	
公告費	2,082		1,190	
調査費	408,932		379,903	
調査費	280,837		257,107	
委託調査費	126,204		120,214	
図書費	1,890		2,581	
委託計算費	157,812		166,328	
営業雑経費	29,404		36,320	
通信費	5,633		5,792	
印刷費	7,614		7,774	
協会費	7,975		10,010	
諸会費	2,894		2,763	
その他	5,286		9,978	
営業費用計	1,197,707	26.7	1,191,058	28.2
一般管理費				
給料	1,314,409		1,319,517	
役員報酬	344,116		337,945	
給料・手当	692,068		689,216	
賞与	232,545		257,155	
賞与引当金繰入額	45,678		35,199	

交際費		2,778		3,610	
旅費交通費		33,064		32,522	
租税公課		23,883		17,227	
不動産賃借料		131,057		126,366	
退職給付費用		57,037		57,683	
固定資産減価償却費		22,735		16,581	
福利厚生費		79,311		80,872	
事務手数料	1	22,320		84,588	
諸経費		179,736		183,190	
一般管理費計		1,866,335	41.7	1,922,160	45.5
営業利益		1,415,309	31.6	1,115,567	26.4
営業外収益					
受取利息		0		0	
為替差益		-		-	
有価証券運用益		-		678	
事業再構築引当金戻入		222		-	
雑収入		548		3,846	
営業外収益計		771	0.0	4,525	0.1
営業外費用					
支払利息		280		201	
為替差損		1,184		2,420	
有価証券運用損		1,386		-	
雑損失		257		500	
営業外費用計		3,109	0.1	3,122	0.1
経常利益		1,412,971	31.5	1,116,969	26.4
特別損失					
固定資産減損損失	2	-		95,541	
固定資産除却損失		-		3,268	
事業再構築費用		102,702		-	
事務処理損失		953		15,453	
特別損失計		103,655	2.3	114,263	2.7
税引前当期純利益		1,309,315	29.2	1,002,706	23.7
法人税,住民税及び事業税		613,977	13.7	426,689	10.1
法人税等調整額		26,839	0.6	8,861	0.2
当期純利益		722,177	16.1	567,156	13.4

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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								純資産合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			株主資本合計			
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金					利益剰余金合計
					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	

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計		
					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
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156
当期変動額合計	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513

[重要な会計方針]

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 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 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。 建物付属設備 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、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 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 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損益処理しております。</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

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物附属設備 88,020千円</p> <p>器具備品 48,355千円</p> <p>リース資産 6,867千円</p>	<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物附属設備 -</p> <p>器具備品 11,634千円</p> <p>リース資産 578千円</p>
<p>2. 無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウエア 10,117千円</p>	<p>2. 無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウエア 10,720千円</p>
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>

（損益計算書関係）

前事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
<p>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。</p>	<p>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24,014千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額68,801千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。</p>

-	<p>2. 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。</p> <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>東京都港区</td> <td>旧本社</td> <td>建物付属設備</td> <td>95,541</td> </tr> </tbody> </table> <p>旧本社については、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。</p> <p>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、減損損失の認定時点から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せん。</p>	場所	用途	種類	減損損失 (千円)	東京都港区	旧本社	建物付属設備	95,541
場所	用途	種類	減損損失 (千円)						
東京都港区	旧本社	建物付属設備	95,541						
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>								

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27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25年4月 1日 至 平成26年3月31日	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>リース資産の内容 社用車両であります。</p> <p>リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。</p>	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。

平成27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	8,366,245	8,366,245	
(2)未収委託者報酬	620,043	620,043	
(3)未収入金	631,179	631,179	
(4)長期差入保証金	80,034	35,636	44,398
(5)未払手数料	135,048	135,048	

(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(5)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。

(4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

(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26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)

売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 当事業年度の損益 に含まれた評価差額	34,680千円 700千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 当事業年度の損益 に含まれた評価差額	38,658千円 311千円
--	---------------------------	--	---------------------------

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付債務の期首残高	391,473
勤務費用	46,659
利息費用	3,914
数理計算上の差異の発生額	7,645
退職給付の支払額	8,106
退職給付債務の期末残高	426,295

3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
年金資産の期首残高	278,789
期待運用収益	2,052
数理計算上の差異の発生額	11,804
事業主からの拠出額	50,203
退職給付の支払額	8,106
年金資産の期末残高	311,134

4．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)

	前事業年度 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
積立型制度の退職給付債務	426,295
年金資産	311,134
	115,161
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	115,161
未認識数理計算上の差異	4,158
未認識過去勤務費用	52,329

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	58,673
---------------------	--------

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付費用	42,241
(1)勤務費用	46,659
(2)利息費用	3,914
(3)期待運用収益（減算）	2,052
(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	15,002

6. 年金資産に関する事項

前事業年度（平成26年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.2%
その他	2.7%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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。

当事業年度（平成27年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.5%
その他	2.5%
合計	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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。

7. 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

	当事業年度 (平成27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

8. 確定拠出制度

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,442千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成25年4月 1日	自 平成26年4月 1日
至 平成26年3月31日	至 平成27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	14,430	賞与引当金繰入超過額	14,194
未払事業税	27,452	未払事業税	11,023
その他	34,894	その他	64,681
繰延税金資産(流動)合計	76,778	繰延税金資産(流動)合計	89,899
繰延税金負債(流動)との相殺	-	繰延税金負債(流動)との相殺	-
繰延税金資産(流動)の純額	76,778	繰延税金資産(流動)の純額	89,899
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
退職給付引当金	24,992	退職給付引当金	20,103
その他	20,704	その他	3,610
繰延税金資産(固定)合計	45,696	繰延税金資産(固定)合計	23,714
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	45,696	繰延税金資産(固定)の純額	23,714
繰延税金資産合計	122,475	繰延税金資産合計	113,613
繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)	
その他	-	その他	-
繰延税金負債(流動)合計	-	繰延税金負債(流動)合計	-
繰延税金資産(流動)との相殺	-	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	122,475 =====	繰延税金資産の純額	113,613 =====

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	35.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目	6.3%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	7.5%
その他	0.3%	その他	0.2%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	44.8%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	43.4%
	=====		=====

（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27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、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35.64%から平成27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ついては33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は9,318千円減少し、法人税等調整額は9,318千円増加しております。

（企業結合関係等）

前事業年度 自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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差入保証金および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89,966千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および本社オフィス移転に伴う新たな資産除去債務の発生により31,670千円増加しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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

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・オブ・トラス ト・オブ・カバ ー	米国 マサチューセツ 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 ジックメン 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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27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	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	162,092	未収入金	240,569
								投資顧問料の支払	107,442	未払金	7,234
								人件費等の支払	286,824		
								事務手数料の受取	24,014		
								事務手数料の支払	84,588		
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の 人件費支払 等	35,271	前払金	34,267
								事務所賃借料の支払	4,173		
								人件費等の支払	135,406		
	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	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	440	-	-
								投資顧問料の支払	5,521		
	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	あり	投資顧問サービスの提供	66,188	-	-
								投資顧問料の受取			
	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	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	407	-	-
								紹介料の受取			

(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25年4月 1日 至 平成26年3月31日	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
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、記載しておりません。	1株当たり純資産 1,479,115円06銭 1株当たり当期純利益 91,476円79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、記載しておりません。

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25年4月 1日 至 平成26年3月31日	当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
当期純利益 (千円)	722,177	567,156
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)	722,177	567,156
期中平均株式数 (株)	6,200	6,200

(重要な後発事象)

前事業年度 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>

当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

期 別 科 目	第19期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)	
	金額	構成比
(資産の部)		%
流動資産		
預金	8,647,039	
有価証券	15,289	
前払金	85,124	
前払費用	12,271	
未収入金	588,959	
未収委託者報酬	633,502	
未収収益	150,627	
繰延税金資産	134,892	

	流動資産計		10,267,707	97.6
固定資産				
有形固定資産			139,655	
建物附属設備	1	110,285		
器具備品	1	24,161		
リース資産	1	5,208		
無形固定資産			502	
ソフトウェア		502		
投資その他の資産			112,729	
長期差入保証金		79,825		
繰延税金資産		28,054		
その他投資		4,850		
	固定資産計		252,888	2.4
	資産合計		10,520,595	100.0
	(負債の部)			%
流動負債				
預り金			29,136	
未払金			428,995	
未払手数料		129,890		
その他未払金		299,104		
未払費用			1,477	
未払法人税等			264,376	
未払消費税等	2		42,627	
賞与引当金			156,193	
リース債務			1,833	
	流動負債計		924,640	8.8
固定負債				
退職給付引当金			66,539	
長期リース債務			3,772	
	固定負債計		70,311	0.7
	負債合計		994,952	9.5
	(純資産の部)			%
株主資本			9,525,643	90.5
資本金		310,000		
利益剰余金		9,215,643		
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		9,106,523		
	純資産合計		9,525,643	90.5
	負債・純資産合計		10,520,595	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第19期中間会計期間	
		自平成27年4月1日 至平成27年9月30日	
		金額	構成比
			%
営業収益			
委託者報酬		1,340,579	
投資顧問収入		855,149	
その他営業収益	1	130,280	
	営業収益計	2,326,009	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		608,775	

支払手数料	297,919		
その他営業費用	310,856		
一般管理費	1	2	1,052,311
営業費用・一般管理費計			1,661,087
営業利益			664,922
営業外収益			220
営業外費用			2,024
経常利益			663,118
特別損失			101,658
税引前中間純利益			561,459
法人税,住民税及び事業税			255,663
法人税等調整額			49,333
中間純利益			355,129
			71.4
			28.6
			0.0
			0.1
			28.5
			4.4
			24.1
			11.0
			2.1
			15.3

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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		利益剰余金					
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513
当中間期変動額									
中間純利益	-	-	-	-	-	355,129	355,129	355,129	355,129
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	355,129	355,129	355,129	355,129
当中間期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	9,106,523	9,215,643	9,525,643	9,525,643

[重要な会計方針]

	第19期中間会計期間 自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日
1. 資産の評価基準及び 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 8～10年 器具備品 5～7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 発生翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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19期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)							
1. 有形固定資産の減価償却累計額	<table border="0"> <tr> <td>建物付属設備</td> <td style="text-align: right;">10,429千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">15,070千円</td> </tr> <tr> <td>リース資産</td> <td style="text-align: right;">1,736千円</td> </tr> </table>	建物付属設備	10,429千円	器具備品	15,070千円	リース資産	1,736千円
建物付属設備	10,429千円						
器具備品	15,070千円						
リース資産	1,736千円						
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。						

(中間損益計算書関係)

第19期中間会計期間 自 平成27年4月 1日 至 平成27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123,284千円は、その他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額246,874千円は、一般管理費に含まれております。	

2. 減価償却実施額

有形固定資産	13,941千円
無形固定資産	301千円
リース資産	1,157千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第19期中間会計期間

自 平成27年4月 1日

至 平成27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)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	6,200			6,200

(リース取引)

第19期中間会計期間

自 平成27年4月 1日

至 平成27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19期中間会計期間

自 平成27年4月 1日

至 平成27年9月30日

1. 金融商品の時価等に関する事項

平成27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	8,647,039	8,647,039	
(2)未収入金	588,959	588,959	
(3)未収委託者報酬	633,502	633,502	
(4)長期差入保証金	79,825	47,339	32,485
(5)未払手数料	129,890	129,890	

(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、(5) 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。

(4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

(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19期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	15,289千円
当事業年度の損益に含まれた評価差額	1,389千円

(資産除去債務関係)

第19期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)	
当中間会計期間において、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35,341千円であります。資産除去債務の総額は当中間会計期間において、資産除去費用の見積額の更新および旧本社オフィス及びバックアップセンターの退去に伴う資産除去債務の履行により54,624千円減少しております。	

(デリバティブ取引関係)

第19期中間会計期間末 (平成27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19期中間会計期間末 (平成27年9月30日現在)	

（セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

（セグメント関連情報）

1. 商品およびサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第19期中間会計期間

自 平成27年4月 1日

至 平成27年9月30日

1株当たり純資産額 1,536,394円06銭

1株当たり中間純利益 57,279円00銭

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

注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第19期中間会計期間	
自 平成27年4月 1日	
至 平成27年9月30日	
中間純利益（千円）	355,129
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）	355,129
期中平均株式数（株）	6,200

（重要な後発事象）

第19期中間会計期間
自 平成27年4月 1日
至 平成27年9月30日

（親会社の異動）

当社の親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・インターナショナル・ホールディングス（米国デラウェア州）は、平成27年11月19日付にて、その保有する当社の全株式6,200株（持分100%）を同社が新たに設立するステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（東京都港区）に譲渡する事を決定致しました。また、当社定款の定めに基づき、当該株式の譲渡を同年11月20日付にて当社取締役会で承認しております。尚、当社全株式の譲渡は同年11月30日までに完了しており、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社が当社の親会社となりました。

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27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27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27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27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27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。
フィデリティ証券株式会社	6,707百万円 (平成27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27年6月24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27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28年3月23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

PwC あらた監査法人

指定社員

公認会計士

大畑 茂

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27年2月21日から平成28年2月22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28年2月22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27年12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

新日本有限責任監査法人

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			
指定有限責任社員	公認会計士	伊藤 雅人	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27年4月1日から平成28年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成27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27年4月1日から平成27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。