

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年5月20日

【計算期間】 第1期 自 平成24年3月9日 至 平成25年2月20日

【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）

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 山本 幸次

【本店の所在の場所】 東京都港区赤坂九丁目7番1号

【事務連絡者氏名】 太田 裕之

【連絡場所】 東京都港区赤坂九丁目7番1号

【電話番号】 03－4530－7093

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的および基本的性格】

- ① 当ファンドは、株式会社エー・エム・シー（AMC）が算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券への投資を通じて、中長期的に「AMC リスクバジェット型資産配分モデル指数※」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

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

- ② 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。
- ③ 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<br>(収益の源泉)                               | 補足分類               |
|----------------|---------------------------|-------------------------------------------------|--------------------|
| 単位型<br><br>追加型 | 国 内<br><br>海 外<br><br>内 外 | 株 式<br><br>債 券<br>不動産投信<br>その他資産<br>( )<br>資産複合 | インデックス型<br><br>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<br>(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<br>一般<br>大型株<br>中小型株 | 年1回  | グローバル  |      |       |          |        |
|                         | 年2回  | 日本     |      |       |          | ブル・ベア型 |
|                         | 年4回  | 北米     |      |       | 日経 225   |        |

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

#### ■ 当ファンドが該当する属性区分

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

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

## ファンドの目的

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

## ファンドの特色

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

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

#### ＜株式会社エー・エム・シーの概要＞

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

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

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

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

### 3 実質的に保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません

投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## ファンドの運用の仕組み

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



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

## 主な投資制限

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



## 投資対象とするマザーファンドの概要

### ■ ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド

|         |                                                                        |
|---------|------------------------------------------------------------------------|
| 運用の基本方針 | 中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)に連動した投資成果を目指して運用を行います。                      |
| 主要投資対象  | 日本の取引所に上場されている株式                                                       |
| 投資態度    | ・ TOPIX(東証株価指数配当込み)をベンチマークとします。<br>・ 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。<br>・ 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。<br>・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。<br>・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |

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

### ■ ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

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

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

### ■ 収益分配方針

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

- ① 分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の範囲内とします。
  - ② 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象金額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。
  - ③ 留保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

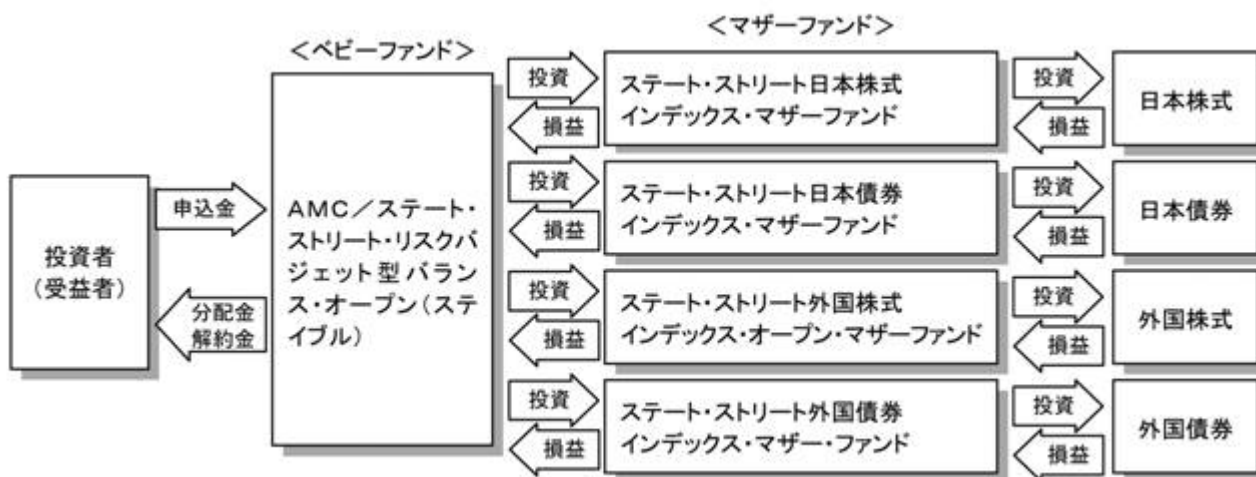
- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基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

## (2) 【ファンドの沿革】

平成24年3月9日 投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

- ① 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。



## ② 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。）

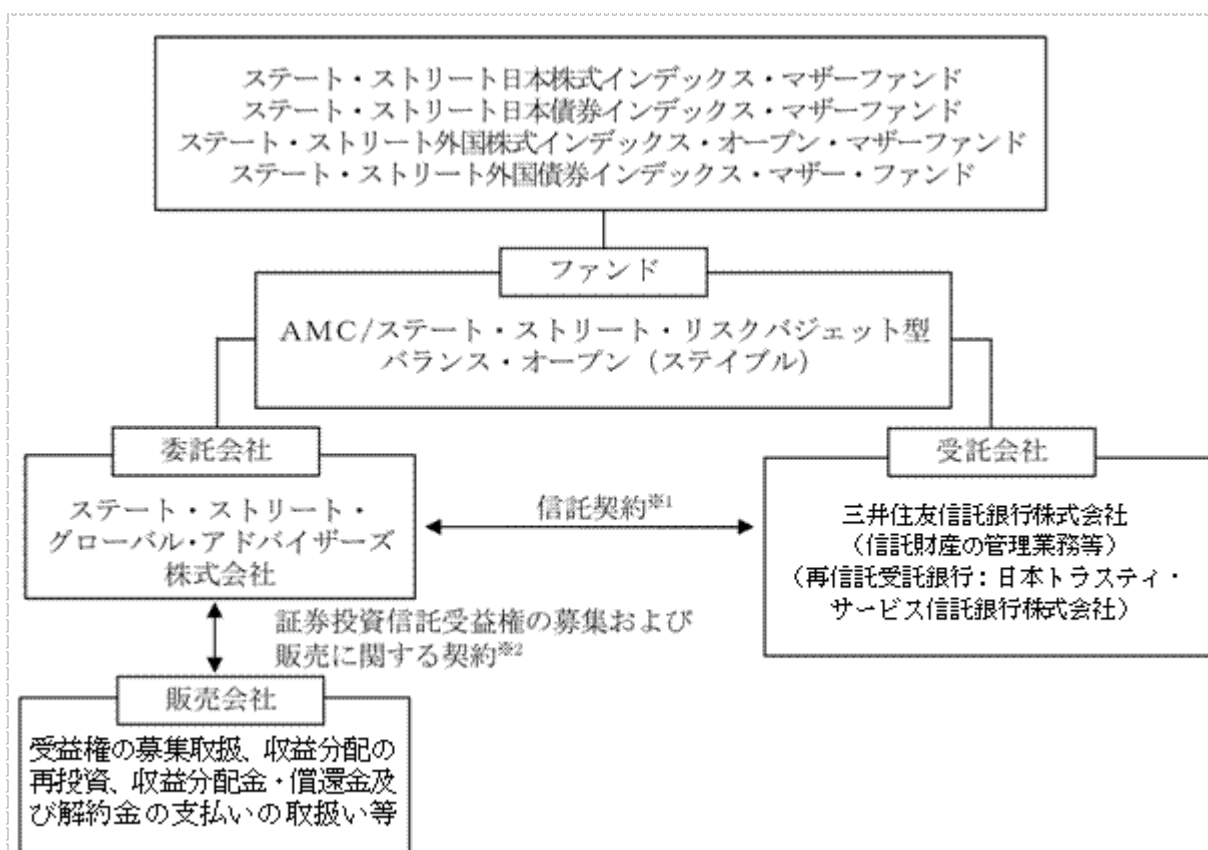
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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。

## ③ 委託会社の概況（平成25年3月29日現在）

### 1) 資本金

3億1千万円

### 2) 沿革

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

### 3) 大株主の状況

（平成25年3月29日現在）

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

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

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

- ① 「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。

- ② 各マザーファンド受益証券のベンチマークは下記の通りで、各マザーファンド受益証券においては、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

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

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

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

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

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

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

- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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。

- ⑦ 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】

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

- ② 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
- ③ 上記①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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記④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。



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。
- ③ 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小さかった場合も同様です。

#### （５）【投資制限】

##### ① 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。

##### ② 信託約款上のその他の投資制限（信託約款第18条）

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

の一部を決済するための指図をするものとします。

- (d) 上記（b）においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売り付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) 委託会社は、上記（a）の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### 3) 先物取引等の運用指図（信託約款第20条）

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

### 4) スワップ取引の運用指図（信託約款第21条）

- (a) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。
- (d) 上記（c）においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、



担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

5) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（信託約款第22条）

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

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たときは、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たときは、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。

### ③ 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①および②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③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

- ① TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。）および金利先渡し取引を行うことができます。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

- ① この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - (a) 有価証券
    - (b) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限りません。）
    - (c) 金銭債権
    - (d) 約束手形
  - 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
    - (a) 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
  - 1) 株券または新株引受権証券
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
- ④ 上記①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②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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行いません。
- ③ 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。

- ④ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤ 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。
- ⑥ 信用取引の指図は、約款第15条の範囲で行います。
- ⑦ 有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲で行います。
- ⑧ スワップ取引は、約款第17条の範囲で行います。
- ⑨ 金利先渡し取引は、約款第18条の範囲で行います。

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

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

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### （1）投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

### （2）投資態度

- ① NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。
- ② 債券組入比率は原則として高位を維持します。
- ③ 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。
- ④ 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。）ならびに金利先渡し取引を行うことができます。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

- ① この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - （a）有価証券
    - （b）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
    - （c）金銭債権
    - （d）約束手形
  - 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
    - （a）為替手形
- ② 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。
  - 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。
  - 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。
- ③ 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
  - ④ 上記①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。
  - ⑤ 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。
  - ⑥ 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。
  - ⑦ 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

- ① 公社債の投資割合には制限を設けません。
- ② 株式への投資は、転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り。）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 外貨建資産への投資は行いません。
- ⑥ 有価証券先物取引等は、約款第15条の範囲で行います。
- ⑦ スワップ取引は、約款第16条の範囲で行います。
- ⑧ 金利先渡し取引は、約款第17条の範囲で行います。

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

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

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### （１）投資対象

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

##### （２）投資態度

- ① 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。
- ② 株式の組入率は、原則として高位を維持します。
- ③ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ④ 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。
- ⑤ 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し取引および為替先渡し取引を行うことができます。

##### （３）投資対象

- ① 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。
    - (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
- ② 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。
  - 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。
- ③ 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
- ④ 上記①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。

- ⑤ 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

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ⑤ 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- ⑥ スワップ取引は、約款第18条の範囲で行います。
- ⑦ 金利先物取引及び為替先渡取引は、約款第19条の範囲で行います。

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

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

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### （１）投資対象

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

##### （２）投資態度

- ① 公社債への投資は原則として高位を維持します。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。

- ⑥ 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

- ① 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します。）
    - （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
- ② 委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
- １）株券または新株引受権証書
  - ２）国債証券
  - ３）地方債証券
  - ４）特別の法律により法人の発行する債券
  - ５）社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。)
  - ６）特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - ７）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  - ８）協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  - ９）特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  - 10）コマーシャル・ペーパー
  - 11）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 12）外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号までの証券または証書の性質を有するもの
  - 13）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 14）投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  - 15）外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 16）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。)
  - 17）預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 18）外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 19）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。

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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

- ① 公社債の投資割合には制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ④ 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。
- ⑤ 有価証券先物取引等は、約款15条の範囲で行います。
- ⑥ スワップ取引は、約款16条の範囲で行います。
- ⑦ 金利先渡し取引及び為替先渡し取引は、約款17条の範囲で行います。



## ベンチマークについて

### TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスを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いれる義務は一切ありません。MSCI関係者は、当ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI関係者は、当ファンドの発行者(SSgA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSgA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人または法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

### シティグループ世界国債指数(除く日本)

「CITIGROUP」は、シティグループまたはシティグループ関連会社の登録商標およびサービスマークであり、世界中において使用・登録されています。シティグループ世界国債指数(除く日本)は、シティグループ・インデックスLLCによって所有・保持されています。シティグループ世界国債指数(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))は、シティグループ・インクおよびその関連会社(以下、総称して「シティグループ」といいます。))のサービスマークであり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下、「SSgA」といいます。))が利用許諾に基づき特定の目的において使用します。当ファンドは、シティグループによって支持、保証、販売または販売促進されるものではありません。シティグループは、当ファンドの所有者、所有者となる可能性のある者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または当ファンドへの投資適合性について、明示的にも黙示的にも、何ら表明または保証するものではありません。シティグループのSSgAに対する唯一の関係は、シティグループが有する特定の情報、データおよび登録商標についての利用許諾を与えるものです。シティグループは、WGBIに関する決定、作成および計算について、SSgAまたは当ファンドを考慮することなく行ないます。シティグループは、WGBIに関する決定、作成または計算において、SSgAまたは当ファンドの所有者の要望等を考慮せずに行ないます。シティグループは当ファンドの価格・数量の決定、発行・販売に関する時期、または当ファンドを現金に換算する式の決定もしくは計算に関わらず、これらに責任を負いません。シティグループは、当ファンドの管理、マーケティングまたは取引に関する義務または責任を何ら負うものではありません。シティグループは、WGBIまたはそれに含まれるいかなるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。シティグループは、WGBIまたはそれ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、明示的にも黙示的にも何ら保証しません。シティグループは、WGBIまたはそれに含まれる一切のデータに関して、商品性の保証や特定の目的の使用における適合性に対する一切の保証を免除されることを明示し、かつそれらに関して明示もしくは暗示の保証も行いません。以上のことに関わらず、いかなる直接的、特別な、罰則的、間接的あるいは結果的な損害(逸失利益を含む。)について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、シティグループが責任を負うことはありません。

## 3【投資リスク】

### (1) ファンドのリスク特性

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

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。

#### ① 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。

#### ② 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。

#### ③ 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。

#### ④ 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。

#### ⑤ 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。

#### ⑥ 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。

#### ⑦ 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。

#### ⑧ 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。

#### ⑨ パッシブ運用のリスク

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

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

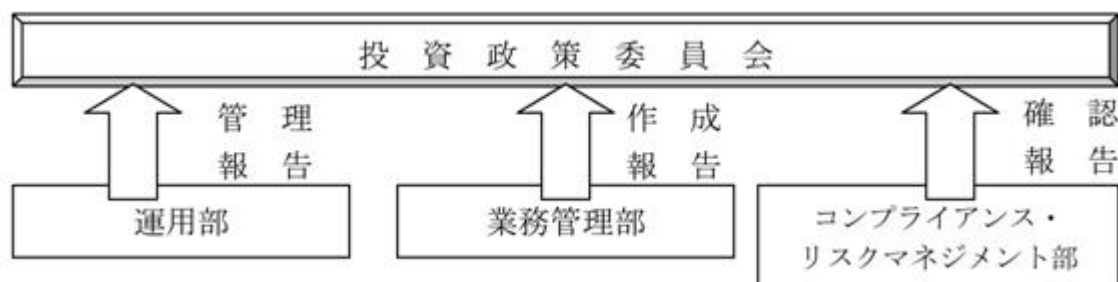
#### ⑩ ファミリーファンド方式のリスク

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

### （２）その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

### （３）リスク管理体制



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

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

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （１）【申込手数料】

- ① お申込み手数料は、販売会社がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額に乗じて得た額とします。お申込み手数料には消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）がかかります。
- ② なお、現在申込可能な販売会社では、無手数料です。
- ③ 分配金を再投資する場合の手数料は、無手数料とします。
- ④ 償還乗換えでこのファンドをお申込みになる場合（以下「償還乗換え※」といいます。）には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額と元本のいずれか大きい額とします。）で取得する口数については上記手数料を無料とします。

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

### （２）【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料は、ありません。

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

### （３）【信託報酬等】

- ① 当ファンドから支払われる信託報酬は、以下の合計額とします。
  - ・以下の支払先が行う当ファンドに関する業務の対価として、当ファンドの信託財産の計算期間を通じて毎日、以下の支払先に対してそれぞれ以下の額

| 支 払 先 | 報 酬 額                          |
|-------|--------------------------------|
| 委託会社  | 信託財産の純資産総額の年率0.63%（税抜0.60%）相当額 |

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

・マザーファンドで有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品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

- ② 上記①の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（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。
- ③ 上記①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。
- ④ 上記①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】

- ① 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用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）。
- ② 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。
- ③ 上記①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。
- ④ ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。  
信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

#### （５）【課税上の取扱い】

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

#### ■個人、法人別の課税について■

##### ◆個人の投資家に対する課税

##### <収益分配金に対する課税>

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

##### <換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

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

**[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]**

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

**◆法人の投資家に対する課税**

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

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

なお、益金不算入制度は適用されません。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

(平成25年3月29日現在)

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

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

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

(平成25年3月29日現在)

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

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

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

(平成25年3月29日現在)

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

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

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

(平成25年3月29日現在)

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

（平成25年3月29日現在）

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

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

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

## （２）【投資資産】

## ①【投資有価証券の主要銘柄】

（平成25年3月29日現在）

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

（注１）投資有価証券は3銘柄です。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 業種 | 投資比率（%） |
|-----------|----|---------|
| 親投資信託受益証券 | —  | 95.23   |
| 合 計       |    | 95.23   |

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。



## ②【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

## ③【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。

## &lt;参考情報&gt;

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

## ①投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成25年3月29日現在）

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

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

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

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

## ②投資不動産物件

該当する事項はありません。

## ③その他投資資産の主要なもの

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

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

## ＜参考情報＞

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

## ①投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成25年3月29日現在）

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

（平成25年3月29日現在）

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

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類    | 業種 | 投資比率(%) |
|-------|----|---------|
| 国債証券  | —  | 79.18   |
| 特殊債券  | —  | 8.80    |
| 地方債証券 | —  | 6.39    |
| 社債券   | —  | 5.48    |
| 合 計   |    | 99.85   |

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

## ②投資不動産物件

該当する事項はありません。

## ③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。

## &lt;参考情報&gt;

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

## ①投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成25年3月29日現在）

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

（平成25年3月29日現在）

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

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

（注３）平成25年3月29日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

## 種類別及び業種別投資比率

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

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

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

(注2) 平成25年3月29日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

## ②投資不動産物件

該当する事項はありません。

## ③その他投資資産の主要なもの

| 資産の<br>種類        | 資産の名称         | 取引所等                   | 買建<br>／<br>売建 | 通貨             | 数量  | 簿価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率<br>(%) |
|------------------|---------------|------------------------|---------------|----------------|-----|----------------|----------------|---------------|-----------------|
| 株価指<br>数先物<br>取引 | S&P 500       | シカゴ商業取引所               | 買建            | アメリカ・<br>ドル    | 84  | 32,626,225.00  | 32,816,700.00  | 3,086,410,635 | 1.88            |
|                  | EURO STOXX 50 | ユーレックス・ドイ<br>ツ金融先物取引所  | 買建            | ユーロ            | 204 | 5,346,804.89   | 5,210,160.00   | 629,022,616   | 0.38            |
|                  | FTSE100INDEX  | ロンドン国際金融先<br>物オプション取引所 | 買建            | イギリス・<br>ポンド   | 63  | 4,033,754.39   | 4,001,130.00   | 572,801,770   | 0.35            |
|                  | SPI 200       | シドニー先物取引所              | 買建            | オーストラ<br>リア・ドル | 25  | 3,152,274.99   | 3,104,375.00   | 304,011,443   | 0.19            |
|                  | S&P 60        | モントリオール取引<br>所         | 買建            | カナダ・ド<br>ル     | 20  | 2,935,243.99   | 2,915,600.00   | 269,926,248   | 0.16            |
|                  | FSMI INDEX    | ユーレックス・<br>チューリッヒ取引所   | 買建            | スイス・フ<br>ラン    | 35  | 2,688,432.00   | 2,692,200.00   | 267,066,240   | 0.16            |

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（平成25年3月29日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

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



## (3) 【運用実績】

## ① 【純資産の推移】

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

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

## ② 【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<br>至平成25年 2月20日 | 0.0000円   |

## ③ 【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<br>至平成25年 2月20日 | 6.7% |

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

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

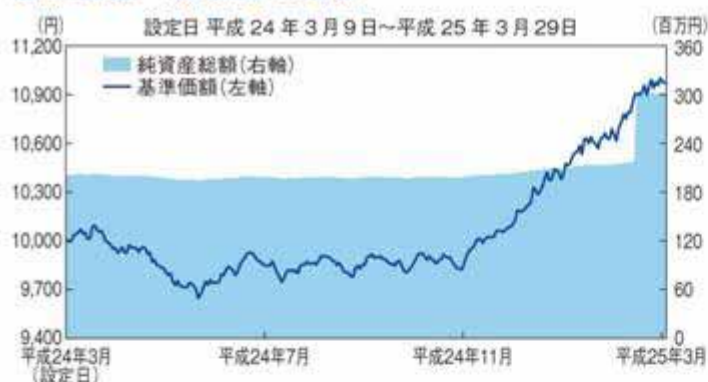
(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

## &lt;参考情報&gt;

## 基準価額・純資産の推移

(平成 25 年 3 月 29 日現在)



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## &lt;基準価額・純資産総額&gt;

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 10,977円 |
| 純資産総額 | 301百万円  |

## 分配の推移

該当する事項はありません。

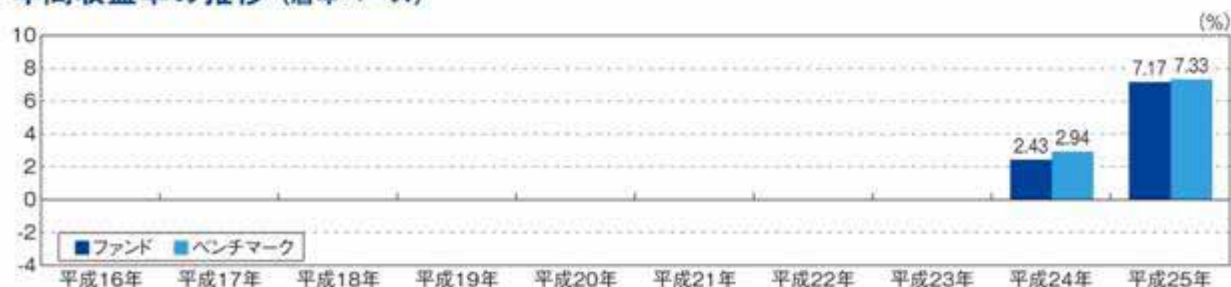
## 主要な資産の状況

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

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

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

## 年間収益率の推移（暦年ベース）



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

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

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### （１）【資産の評価】

##### 1) 基準価額の算出方法

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

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

##### 2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

##### 3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03-4530-7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

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

#### （２）【保管】

該当事項はありません。

### （３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は無期限ですが、下記（５）１）の理由により信託は終了します。

### （４）【計算期間】

- １）当ファンドの計算期間は、毎年２月21日から翌年２月20日までとすることを原則とします（信託約款第36条第１項）。
- ２）上記１）の規定にかかわらず、上記１）の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のときは、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします（信託約款第36条２項）。

### （５）【その他】

#### １）信託の終了

##### i. 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）株式会社エー・エム・シーがベンチマークである「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」の算出および提供をしないこととなった場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させるものとします。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- （ハ）委託会社は、上記（イ）の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- （ニ）上記（ハ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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半数以上であって、当該受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行います。
- （ヘ）上記（ハ）から上記（ホ）までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたとき及び上記（ロ）の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記（ハ）から上記（ホ）までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

##### ii. 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。

##### iii. 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。

iv. 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。

v. 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い（信託約款第50条）

- (イ) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、第51条の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- (ロ) 委託者が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

2) 信託約款の変更等（信託約款第51条）

- (a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- (b) 委託会社は、上記(a)の事項（上記(a)の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 上記(b)から(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (g) 上記の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

3) 反対者の買取請求権



上記１）ｉに規定する信託契約の解約または上記２）に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受託者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記１）ｉ（ハ）または上記２）（b）に規定する書面に付記します。（信託約款第52条）。

#### 4）公告

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

#### 5）募集・売出し契約の変更

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

### 4【受益者の権利等】

#### ① 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）。

#### ② 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します。）に支払います。（信託約款第42条第1項）。

2）上記1）の規定にかかわらず、委託会社の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と受益権の取得申込者との間に結ばれた別に定める自動けいぞく投資約款にしたがった契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。ただし、上記2 換金（解約）手續等1）により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記1）に準じて受益者に支払います。当該売付けにより増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。（信託約款第42条第2項）。

3）償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）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）手續等1）の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原



則として5営業日目から当該受益者に支払います。（信託約款第42条第4項）。

- 5) 上記1) 2) 3) に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとします。（信託約款第42条第5項）。
- 6) 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。（信託約款第42条第6項）。
- 7) 上記6) に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。（信託約款第47条第7項）。
- 8) 受益者が、収益分配金については上記1) に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金について上記3) に規定する支払開始日から10年間、その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します（信託約款第43条）。

③ 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。

- ④ 反対した受益者の買取請求権
- ⑤ 帳簿閲覧謄写請求権

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

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

## 1 【財務諸表】

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

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

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

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

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                   |                                                                                       |
|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>親投資信託受益証券</p> <p>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。</p> |
|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|

## (貸借対照表に関する注記)

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

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

## (金融商品に関する注記)

## I 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、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。</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。 |
|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## II 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

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

## （１口当たり情報に関する注記）

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



## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

該当する事項はありません。

## ② 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<br>益証券 | ステート・ストリート日本株式イン<br>デックス・マザーファンド          | 37,868,472  | 53,405,906  |    |
|               | ステート・ストリート日本債券イン<br>デックス・マザーファンド          | 120,851,648 | 138,423,477 |    |
|               | ステート・ストリート外国株式イン<br>デックス・オープン・マザーファン<br>ド | 8,446,607   | 10,949,336  |    |
| 合計            |                                           | 167,166,727 | 202,778,719 |    |

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

[次へ](#)

## ＜参考＞

当ファンドは「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」及び「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

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

## (2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

|                      |                                                                                 |
|----------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>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<br>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。   |

## (貸借対照表に関する注記)

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

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

(金融商品に関する注記)

## I 金融商品の状況に関する事項

|  |  |
|--|--|
|  |  |
|--|--|

|                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。                                                                                                                                                                                                                               |
| 2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。</p>                         |
| 3 金融商品に係るリスク管理体制        | 運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。 |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | (平成25年 2月20日現在)                                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 | 貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                                                                   |
| 金融商品の時価の算定方法        | <p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>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<br/>売買目的有価証券<br/>「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<br/>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p> |

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

## （有価証券関係に関する注記）

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

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

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項  
株式関連

（単位：円）

| 区 分  | 種 類                       | （平成25年 2月20日現在） |       |               |             |
|------|---------------------------|-----------------|-------|---------------|-------------|
|      |                           | 契 約 額 等         |       | 時 価           | 評 価 損 益     |
|      |                           |                 | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建<br>TOPIX先物 | 3,175,931,000   | —     | 3,462,100,000 | 286,169,000 |
| 合 計  |                           | 3,175,931,000   | —     | 3,462,100,000 | 286,169,000 |

## （注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

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

## （1口当たり情報に関する注記）

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

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## ② 株式以外の有価証券

該当する事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)



「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

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

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

(金融商品に関する注記)

## I 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。 |

## Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券関係に関する注記)

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

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

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

## (1口当たり情報に関する注記)

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

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

該当する事項はありません。

② 株式以外の有価証券

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

[次へ](#)



「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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

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

(2) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                      |                                                                                                                                                     |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法    | 株式、投資証券、新株予約権証券<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。        |
| 2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。 |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | (平成25年 2月20日現在)                                                                                                                                                                                            |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1 期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | <p>140,608,680,472円</p> <p>26,878,620,365円</p> <p>38,426,911,779円</p>                                                                                                                                      |
| <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン</p> <p>ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン</p> <p>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</p> <p>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）</p> <p>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）</p> <p>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）</p> <p>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＞</p> <p>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＞</p> <p>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＞</p> <p>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＞</p> | <p>12,633,758,885円</p> <p>6,528,890,170円</p> <p>27,166,854円</p> <p>8,446,607円</p> <p>6,036,320,227円</p> <p>880,770,553円</p> <p>87,643,477円</p> <p>6,672,746,747円</p> <p>12,965,709円</p> <p>83,657,989円</p> |

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

## （金融商品に関する注記）

## I 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。                                                                                                     |

## II 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                  | (平成25年 2月20日現在)                                                                                                                                                                          |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 | 貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                         |
| 金融商品の時価の算定方法        | <p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>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<br/>売買目的有価証券<br/>「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> |

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

## (有価証券関係に関する注記)

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

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

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項  
株式関連

(単位：円)

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

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

## 通貨関連

(単位：円)

| 区分 | 種 類 | (平成25年 2月20日現在) |     |      |
|----|-----|-----------------|-----|------|
|    |     | 契 約 額 等         | 時 価 | 評価損益 |

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

## (注) 1. 時価の算定方法

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

- ① 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。
- ② 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

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

## (1口当たり情報に関する注記)

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

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 |    | 備考 |
|----|----|----|-----|----|----|
|    |    |    | 単価  | 金額 |    |

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

|                                      |         |       |              |  |
|--------------------------------------|---------|-------|--------------|--|
| GLENCORE INTERNATIONAL PLC           | 265,103 | 3.92  | 1,039,336.31 |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC                  | 14,144  | 23.33 | 329,979.52   |  |
| KAZAKHMYS ORD GBPO.20 (WI)           | 14,060  | 7.24  | 101,794.40   |  |
| RANDGOLD RESOURCES                   | 6,028   | 55.50 | 334,554.00   |  |
| REXAM PLC                            | 57,879  | 4.76  | 275,909.19   |  |
| RIO TINTO PLC REG                    | 93,603  | 37.13 | 3,475,947.40 |  |
| VEDANTA RESOURCES ORD US<br>D0.10    | 7,544   | 12.85 | 96,940.40    |  |
| XSTRATA PLC                          | 146,594 | 11.77 | 1,726,144.35 |  |
| BAE SYSTEMS PLC                      | 225,931 | 3.30  | 745,572.30   |  |
| BALFOUR BEATTY PLC                   | 46,565  | 2.73  | 127,494.97   |  |
| BUNZL PLC                            | 22,784  | 12.21 | 278,192.64   |  |
| COBHAM PLC                           | 80,888  | 2.25  | 182,725.99   |  |
| IMI PLC                              | 23,284  | 11.74 | 273,354.16   |  |
| INVENSYS PLC                         | 55,620  | 3.57  | 198,952.74   |  |
| MEGGITT PLC                          | 53,690  | 4.54  | 243,913.67   |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC               | 82,305  | 2.42  | 199,754.23   |  |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC             | 130,446 | 10.43 | 1,360,551.78 |  |
| SMITHS GROUP PLC                     | 28,620  | 12.49 | 357,463.80   |  |
| WEIR GROUP PLC/THE                   | 15,554  | 21.75 | 338,299.50   |  |
| WOLSELEY PLC                         | 19,001  | 30.99 | 588,840.99   |  |
| AGGREKO PLC                          | 18,511  | 17.15 | 317,463.65   |  |
| BABCOCK INTL GROUP PLC               | 24,760  | 10.51 | 260,227.60   |  |
| CAPITA PLC                           | 45,171  | 8.43  | 381,017.38   |  |
| EXPERIAN PLC                         | 70,187  | 10.91 | 765,740.17   |  |
| G4S PLC                              | 97,065  | 2.90  | 282,070.89   |  |
| INTERTEK GROUP PLC                   | 11,102  | 33.19 | 368,475.38   |  |
| SERCO GROUP PLC                      | 36,141  | 5.74  | 207,630.04   |  |
| GKN PLC                              | 112,078 | 2.61  | 293,532.28   |  |
| BURBERRY GROUP PLC                   | 30,559  | 13.80 | 421,714.20   |  |
| CARNIVAL PLC                         | 12,581  | 24.85 | 312,637.85   |  |
| COMPASS GROUP PLC                    | 129,569 | 7.98  | 1,033,960.62 |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS<br>GROUP INC | 18,796  | 19.53 | 367,085.88   |  |
| TUI TRAVEL PLC                       | 31,655  | 3.29  | 104,366.53   |  |
| WHITBREAD PLC                        | 13,046  | 26.81 | 349,763.26   |  |
| BRITISH SKY BROADCASTING             | 75,051  | 8.27  | 620,671.77   |  |
| ITV PLC                              | 270,397 | 1.23  | 332,588.31   |  |
| PEARSON                              | 56,706  | 12.05 | 683,307.30   |  |
| REED ELSEVIER PLC                    | 84,648  | 7.14  | 604,386.72   |  |
| WPP PLC                              | 87,868  | 10.60 | 931,400.80   |  |
| KINGFISHER PLC                       | 164,096 | 2.75  | 451,920.38   |  |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC            | 111,254 | 3.86  | 429,551.69   |  |
| NEXT PLC                             | 11,418  | 42.00 | 479,556.00   |  |
| MORRISON SUPERMARKETS                | 159,044 | 2.60  | 414,786.75   |  |
| SAINSBURY (J) PLC                    | 84,482  | 3.32  | 280,733.68   |  |
| TESCO                                | 561,016 | 3.69  | 2,070,710.05 |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC         | 24,654  | 18.52 | 456,592.08   |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO             | 135,749 | 33.90 | 4,601,891.10 |  |
| DIAGEO                               | 175,012 | 19.44 | 3,403,108.34 |  |
| IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC           | 69,159  | 24.08 | 1,665,348.72 |  |

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

|            |                                   |           |           |                                  |  |
|------------|-----------------------------------|-----------|-----------|----------------------------------|--|
|            | ADECCO SA-REG                     | 9,661     | 53.90     | 520,727.90                       |  |
|            | SGS S.A.                          | 380       | 2,329.00  | 885,020.00                       |  |
|            | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG        | 3,943     | 110.80    | 436,884.40                       |  |
|            | CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A      | 36,416    | 76.45     | 2,784,003.20                     |  |
|            | THE SWATCH GROUP                  | 3,167     | 94.00     | 297,698.00                       |  |
|            | THE SWATCH GROUP AG-B             | 2,144     | 528.50    | 1,133,104.00                     |  |
|            | ARYZTA AG                         | 6,191     | 53.95     | 334,004.45                       |  |
|            | BARRY CALLEBAUT AG REG            | 138       | 907.50    | 125,235.00                       |  |
|            | LINDT SPRUENGLI<br>PTG CERT CHF10 | 65        | 3,378.00  | 219,570.00                       |  |
|            | LINDT & SPRUENGLI AG-REG          | 7         | 39,060.00 | 273,420.00                       |  |
|            | NESTLE SA-REG                     | 225,383   | 64.10     | 14,447,050.30                    |  |
|            | SONOVA HOLDING AG-REG             | 3,621     | 113.10    | 409,535.10                       |  |
|            | ACTELION CHF0.50 (REGD)           | 7,387     | 48.14     | 355,610.18                       |  |
|            | LOMZA AG-REG                      | 3,793     | 59.85     | 227,011.05                       |  |
|            | NOVARTIS AG-REG SHS               | 160,736   | 64.30     | 10,335,324.80                    |  |
|            | ROCHE HOLDING AG GENUSS           | 49,093    | 210.80    | 10,348,804.40                    |  |
|            | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG      | 245       | 512.00    | 125,440.00                       |  |
|            | CREDIT SUISSE GROUP AG            | 87,455    | 27.09     | 2,369,155.95                     |  |
|            | JULIUS BAER GROUP LTD             | 14,983    | 37.27     | 558,416.41                       |  |
|            | PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)        | 2,164     | 66.95     | 144,879.80                       |  |
|            | PARTNERS GROUP HOLDING AG         | 1,184     | 212.10    | 251,126.40                       |  |
|            | UBS AG-REG                        | 254,222   | 15.28     | 3,884,512.16                     |  |
|            | BALOISE HOLDING AG REG            | 3,246     | 83.30     | 270,391.80                       |  |
|            | SWISS LIFE HOLDING AG             | 2,193     | 147.40    | 323,248.20                       |  |
|            | SWISS RE LTD                      | 24,533    | 73.35     | 1,799,495.55                     |  |
|            | ZURICH INSURANCE GROUP AG         | 10,281    | 258.80    | 2,660,722.80                     |  |
|            | SWISS PRIME SITE REG              | 3,816     | 74.20     | 283,147.20                       |  |
|            | SWISSCOM                          | 1,614     | 420.30    | 678,364.20                       |  |
| スイス・フラン 小計 |                                   | 1,129,486 |           | 67,459,635.07<br>(6,861,994,079) |  |
| 香港・ドル      | HOPEWELL HOLDINGS                 | 38,000    | 34.00     | 1,292,000.00                     |  |
|            | HUTCHISON WHAMPOA                 | 148,200   | 85.75     | 12,708,150.00                    |  |
|            | NWS HOLDINGS LTD HKD1             | 100,500   | 14.62     | 1,469,310.00                     |  |
|            | CATHAY PACIFIC AIRWAYS            | 79,000    | 14.60     | 1,153,400.00                     |  |
|            | MTR CORP                          | 106,000   | 32.20     | 3,413,200.00                     |  |
|            | ORIENT OVERSEAS INTL LTD          | 17,500    | 51.85     | 907,375.00                       |  |
|            | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG          | 53,500    | 27.15     | 1,452,525.00                     |  |
|            | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L      | 144,000   | 33.15     | 4,773,600.00                     |  |
|            | MGM CHINA HOLDINGS LTD            | 76,800    | 16.98     | 1,304,064.00                     |  |
|            | SANDS CHINA LTD                   | 167,321   | 36.25     | 6,065,386.25                     |  |
|            | SHANGRI-LA ASIA                   | 112,000   | 18.02     | 2,018,240.00                     |  |
|            | SJM HOLDINGS LTD                  | 133,000   | 19.32     | 2,569,560.00                     |  |
|            | WYNN MACAU LTD                    | 114,561   | 20.15     | 2,308,404.15                     |  |
|            | LI & FUNG LTD                     | 424,400   | 10.38     | 4,405,272.00                     |  |
|            | BANK EAST ASIA                    | 88,440    | 31.45     | 2,781,438.00                     |  |
|            | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD        | 256,500   | 26.45     | 6,784,425.00                     |  |
|            | HANG SENG BANK                    | 53,000    | 126.10    | 6,683,300.00                     |  |
|            | WING HANG BANK LIMITED            | 14,000    | 83.00     | 1,162,000.00                     |  |
|            | FIRST PACIFIC CO                  | 162,000   | 9.79      | 1,585,980.00                     |  |
|            | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR       | 76,900    | 144.70    | 11,127,430.00                    |  |



|              |                              |           |        |                                   |  |
|--------------|------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|--|
|              | AIA GROUP LTD                | 756,200   | 31.60  | 23,895,920.00                     |  |
|              | CHEUNG KONG HOLDINGS         | 97,000    | 123.30 | 11,960,100.00                     |  |
|              | HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 155,000   | 29.90  | 4,634,500.00                      |  |
|              | HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 66,585    | 54.00  | 3,595,590.00                      |  |
|              | HYSAN DEVELOPMENT            | 46,000    | 38.70  | 1,780,200.00                      |  |
|              | KERRY PROPERTIES LTD         | 52,500    | 39.75  | 2,086,875.00                      |  |
|              | NEW WORLD DEVELOPMENT        | 267,355   | 13.88  | 3,710,887.40                      |  |
|              | SINO LAND                    | 211,200   | 14.00  | 2,956,800.00                      |  |
|              | SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 109,000   | 121.90 | 13,287,100.00                     |  |
|              | SWIRE PACIFIC A              | 47,000    | 100.30 | 4,714,100.00                      |  |
|              | SWIRE PROPERTIES LTD         | 80,000    | 28.90  | 2,312,000.00                      |  |
|              | WHARF HOLDINGS               | 105,125   | 66.45  | 6,985,556.25                      |  |
|              | WHELOCK & CO LTD             | 63,000    | 41.90  | 2,639,700.00                      |  |
|              | HKT TRUST AND HKT LTD        | 177,000   | 7.10   | 1,256,700.00                      |  |
|              | PCCW LIMITED                 | 325,000   | 3.70   | 1,202,500.00                      |  |
|              | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE   | 34,000    | 50.30  | 1,710,200.00                      |  |
|              | CLP HOLDINGS                 | 123,000   | 66.70  | 8,204,100.00                      |  |
|              | HONGKONG CHINAGAS            | 361,933   | 21.75  | 7,872,042.75                      |  |
|              | POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 96,000    | 70.85  | 6,801,600.00                      |  |
|              | ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 13,400    | 103.90 | 1,392,260.00                      |  |
| 香港・ドル 小計     |                              | 5,551,920 |        | 188,963,790.80<br>(2,282,682,593) |  |
| シンガポール・ドル    | KEPPEL CORP LTD              | 99,900    | 11.65  | 1,163,835.00                      |  |
|              | NOBLE GROUP LTD              | 292,745   | 1.18   | 346,902.82                        |  |
|              | SEBACORP INDUSTRIES          | 67,560    | 5.50   | 371,580.00                        |  |
|              | SEBACORP MARINE LTD          | 56,200    | 4.73   | 265,826.00                        |  |
|              | SINGAPORE TECH ENGR.         | 105,000   | 4.18   | 438,900.00                        |  |
|              | YANGZIJIANG SHIPBUILDING     | 155,000   | 0.97   | 150,350.00                        |  |
|              | COMFORTDELGRO CORP LTD       | 127,000   | 1.91   | 243,205.00                        |  |
|              | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 36,800    | 10.95  | 402,960.00                        |  |
|              | GENTING SINGAPORE PLC        | 421,000   | 1.53   | 644,130.00                        |  |
|              | SINGAPORE PRESS HOLDINGS     | 111,000   | 4.13   | 458,430.00                        |  |
|              | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 8,000     | 51.55  | 412,400.00                        |  |
|              | OLAM INTERNATIONAL LTD       | 102,600   | 1.66   | 170,829.00                        |  |
|              | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 515,960   | 0.65   | 335,374.00                        |  |
|              | WILMAR INTERL LTD SGD0.5     | 132,000   | 3.66   | 483,120.00                        |  |
|              | DBS GROUP HOLDING            | 126,989   | 15.12  | 1,920,073.68                      |  |
|              | OVERSEA-CHINESE BANKING      | 179,240   | 9.98   | 1,788,815.20                      |  |
|              | UNITED OVERSEAS BANK         | 88,056    | 19.35  | 1,703,883.60                      |  |
|              | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 62,000    | 7.78   | 482,360.00                        |  |
|              | CAPITALAND LIMITED           | 177,000   | 3.95   | 699,150.00                        |  |
|              | CAPITAMALLS ASIA LTD         | 96,000    | 2.10   | 201,600.00                        |  |
|              | CITY DEVELOPMENTS            | 34,000    | 11.34  | 385,560.00                        |  |
|              | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES   | 141,000   | 2.68   | 377,880.00                        |  |
|              | KEPPEL LAND LIMITED          | 58,000    | 4.25   | 246,500.00                        |  |
|              | UOL GROUP LIMITED            | 34,405    | 6.35   | 218,471.75                        |  |
|              | SINGAPORE TELECOM            | 555,060   | 3.56   | 1,976,013.60                      |  |
|              | STARHUB LTD                  | 43,000    | 4.11   | 176,730.00                        |  |
| シンガポール・ドル 小計 |                              | 3,825,515 |        | 16,064,879.65<br>(1,217,075,282)  |  |

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

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

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

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

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

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

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

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## ② 株式以外の有価証券

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



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

|         |  |                                  |  |
|---------|--|----------------------------------|--|
| 投資証券 小計 |  | 3,670,223,095<br>(3,670,223,095) |  |
| 合計      |  | 3,670,223,095<br>(3,670,223,095) |  |

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

#### 外貨建有価証券の内訳

| 通貨          | 銘 柄 数     | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 有価証券の合計<br>額に対する比率 |
|-------------|-----------|--------------|----------------|--------------------|
| アメリカ・ドル     | 株式 576銘柄  | 97.3%        | —              | 58.0%              |
|             | 投資証券 29銘柄 | —            | 2.7%           |                    |
| カナダ・ドル      | 株式 95銘柄   | 99.5%        | —              | 5.1%               |
|             | 投資証券 2銘柄  | —            | 0.5%           |                    |
| オーストラリア・ドル  | 株式 60銘柄   | 93.0%        | —              | 4.3%               |
|             | 投資証券 9銘柄  | —            | 7.0%           |                    |
| イギリス・ポンド    | 株式 101銘柄  | 98.8%        | —              | 10.2%              |
|             | 投資証券 5銘柄  | —            | 1.2%           |                    |
| スイス・フラン     | 株式 39銘柄   | 100.0%       | —              | 4.2%               |
| 香港・ドル       | 株式 40銘柄   | 96.5%        | —              | 1.4%               |
|             | 投資証券 1銘柄  | —            | 3.5%           |                    |
| シンガポール・ドル   | 株式 26銘柄   | 94.4%        | —              | 0.8%               |
|             | 投資証券 3銘柄  | —            | 5.6%           |                    |
| ニュージーランド・ドル | 株式 5銘柄    | 100.0%       | —              | 0.1%               |
| スウェーデン・クローナ | 株式 32銘柄   | 100.0%       | —              | 1.5%               |
| ノルウェー・クローネ  | 株式 10銘柄   | 100.0%       | —              | 0.4%               |
| デンマーク・クローネ  | 株式 11銘柄   | 100.0%       | —              | 0.5%               |
| イスラエル・シェケル  | 株式 10銘柄   | 100.0%       | —              | 0.3%               |
| ユーロ         | 株式 232銘柄  | 98.9%        | —              | 13.2%              |
|             | 投資証券 6銘柄  | —            | 1.1%           |                    |

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

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(平成25年3月29日現在)

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

## &lt;参考情報&gt;

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

(平成25年3月29日現在)

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

## &lt;参考情報&gt;

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

(平成25年3月29日現在)

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

## &lt;参考情報&gt;

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

(平成25年3月29日現在)

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

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

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### （1）受益証券の名義書換等

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。従って該当事項はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### （2）受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

### （3）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### （4）内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

#### ＜受益権の譲渡＞

- ① 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。
- ② 前項の申請のある場合には、上記①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①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。
- ③ 上記①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たときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### ＜受益権の譲渡の対抗要件＞

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

### （5）その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

#### ＜受益権の再分割＞

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

#### ＜償還金＞

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

###### ① 資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です(平成25年3月29日現在)。

###### ② 発行する株式の総数

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

###### ③ 発行済株式の総数

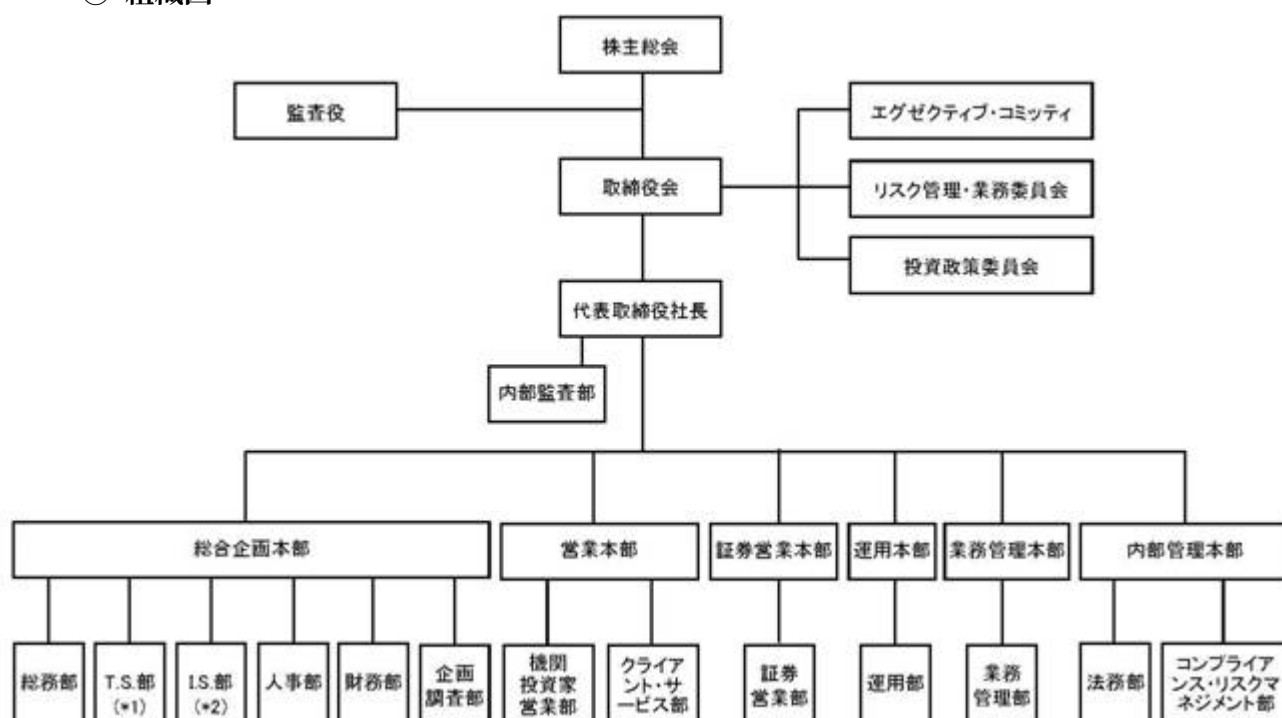
委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成25年3月29日現在)。

###### ④ 最近5年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### ① 組織図



内部管理本部の代表者は内部管理統括責任者の職を担う。

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

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

## ② 各部の業務分掌体制は以下の通りとなっています。

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

## ③ 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1種金融商品取引業及び第2種金融商品取引業を行っています。

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

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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



## 1. 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

## [重要な会計方針]

|                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法        | (1) 有価証券<br>売買目的有価証券<br>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<br>(イ)リース資産以外の有形固定資産<br>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。<br>建物附属設備 6～18年<br>器具備品 8年<br>(ロ)リース資産<br>所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産<br>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。<br><br>(2)無形固定資産<br>定額法により償却しております。<br>なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。    |
| 3.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準  | 外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。                                                                                                                                                                                                                                       |
| 4.引当金の計上基準               | (1)賞与引当金<br>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。<br><br>(2)退職給付引当金<br>退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。また、過去勤務債務及び数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。<br>過去勤務債務<br>その発生年度の従業員等の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理<br>数理計算上の差異<br>発生の翌事業年度に一括費用処理 |
| 5.その他<br>財務諸表作成のための重要な事項 | (1)消費税等の処理方法<br>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。                                                                                                                                                                                                                                           |

## [追加情報]

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

## 注 記 事 項

## （貸借対照表関係）

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

## （損益計算書関係）

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日）

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

当事業年度（自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日）

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

## （リース取引関係）

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

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |         |         |          |         |         |      |                                                                                                                                |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|---------|----------|---------|---------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるものの以外のファイナンス・リース取引<br/>(リース取引開始日が平成20年3月31日以前のもの)</p> <p>① リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>② 未経過リース料期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>③ 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <table border="0"> <tr> <td>支払リース料</td> <td>2,473千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>2,250千円</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td>60千円</td> </tr> </table> <p>④ 減価償却費相当額の算定方法</p> <p>リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>⑤ 利息相当額の算定方法</p> <p>リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p> | 支払リース料  | 2,473千円 | 減価償却費相当額 | 2,250千円 | 支払利息相当額 | 60千円 | <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>① リース資産の内容</p> <p>社用車両であります。</p> <p>② リース資産の減価償却の方法</p> <p>重要な会計方針「2.固定資産の減価償却方法」に記載の通りであります。</p> |
| 支払リース料                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 2,473千円 |         |          |         |         |      |                                                                                                                                |
| 減価償却費相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 2,250千円 |         |          |         |         |      |                                                                                                                                |
| 支払利息相当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 60千円    |         |          |         |         |      |                                                                                                                                |

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

### 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成23年3月31日 現在

(単位：千円)

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

平成24年3月31日 現在

(単位：千円)

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(4)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

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

## (デリバティブ取引関係)

| 前事業年度<br>自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月 31日 | 当事業年度<br>自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月 31日 |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 該当事項はありません。                            | 同 左                                    |

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

## 前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

## 当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

## 2. 退職給付債務及びその内訳

(単位：千円)

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

## 3. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

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

## 4. 退職給付債務等の計算基礎に関する事項

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

## (税効果会計関係)

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



| 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 | 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)                       | (単位：千円)                       |
| 繰延税金資産（流動）                    | 繰延税金資産（流動）                    |
| 賞与引当金繰入超過額 17,154             | 賞与引当金繰入超過額 11,012             |
| その他 19,822                    | 未払事業税 14,990                  |
| -----                         | その他 14,803                    |
| 繰延税金資産（流動）合計 36,977           | 繰延税金資産（流動）合計 40,805           |
| 繰延税金負債（流動）との相殺                | 繰延税金負債（流動）との相殺                |
| △12,683                       | △3,746                        |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金資産（流動）の純額 24,293          | 繰延税金資産（流動）の純額 37,059          |
| 繰延税金資産（固定）                    | 繰延税金資産（固定）                    |
| 退職給付引当金 35,207                | 退職給付引当金 25,807                |
| その他 13,831                    | その他 14,015                    |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金資産（固定）合計 49,038           | 繰延税金資産（固定）合計 39,823           |
| 繰延税金負債（固定）との相殺 △3,809         | 繰延税金負債（固定）との相殺 —              |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金資産（固定）の純額 45,229          | 繰延税金資産（固定）の純額 39,823          |
| 繰延税金資産合計 69,522               | 繰延税金資産合計 80,628               |
| 繰延税金負債（流動）                    | 繰延税金負債（流動）                    |
| 事業譲受に係る調整項目 3,809             | 事業譲受に係る調整項目 3,559             |
| 未収還付事業税 8,873                 | その他 187                       |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金負債（流動）合計 12,683           | 繰延税金負債（流動）合計 3,746            |
| 繰延税金負債（流動）との相殺                | 繰延税金負債（流動）との相殺                |
| △12,683                       | △3,746                        |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金負債（流動）の純額 —               | 繰延税金負債（流動）の純額 —               |
| 繰延税金負債（固定）                    | 繰延税金負債（固定）                    |
| 事業譲受に係る調整項目 3,809             | 事業譲受に係る調整項目 —                 |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金負債（固定）合計 3,809            | 繰延税金負債（固定）合計 —                |
| 繰延税金負債（固定）との相殺                | 繰延税金負債（固定）との相殺                |
| △3,809                        | —                             |
| -----                         | -----                         |
| 繰延税金負債（固定）の純額 —               | 繰延税金負債（固定）の純額 —               |
| 繰延税金資産の純額 69,522              | 繰延税金資産の純額 76,882              |
| =====                         | =====                         |

| 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳                                                              | 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳                                                                                               |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 法定実効税率 40.7%<br>交際費等永久に損金に<br>算入されない項目 15.8%<br>その他 0.0%<br><br>-----<br>税効果会計適用後の<br>法人税等の負担率 56.5%<br>===== | 法定実効税率 40.7%<br>交際費等永久に損金に<br>算入されない項目 21.4%<br>税率変更による<br>期末繰延税金資産の減額修正 1.6%<br>その他 0.0%<br><br>-----<br>税効果会計適用後の<br>法人税等の負担率 63.7%<br>===== |

## (企業結合関係等)

| 前事業年度<br>自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月 31日 | 当事業年度<br>自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月 31日 |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 該当事項はありません。                            | 同 左                                    |

## (資産除去債務関係)

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## (1) 資産除去債務の概要

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

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## (1) 資産除去債務の概要

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

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

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

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

① 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。

② 有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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)

I 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

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

(注) 上表の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

|                                       |                    |              |               |    |                          |                       |                      |              |      |       |
|---------------------------------------|--------------------|--------------|---------------|----|--------------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------|-------|
| ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム | 英国ロンドン             | 62百万ポンド      | 投資顧問、投資信託委託業務 | なし | なし                       | 投資顧問サービスの提供並びに受入れ     | 投資顧問料の受取<br>投資顧問料の支払 | 770<br>6,849 | 未収入金 | 63    |
| ステート・ストリート・マネジメント・S.A                 | ルクセンブルク大公国ルクセンブルク市 | 12.5万ユーロ     | サービス業         | なし | あり<br>当社代表取締役が非常勤取締役役に就任 | 投資顧問サービスの提供           | 投資顧問料の受取             | 39,445       |      |       |
| ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール       | シンガポールシンガポール市      | 136万シンガポールドル | 投資顧問業         | なし | なし                       | 投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介 | 紹介料の受取               | 183          | 未収収益 | 94    |
| タッカー・マン・グループ                          | 米国ニューヨーク州ニューヨーク市   | 1百万ドル        | 不動産投資顧問業務     | なし | なし                       | 投資顧問サービスの受入           | 投資顧問料の支払             | 1            |      |       |
| ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ,LLC           | 米国マサチューセッツ州ホーストン市  | 237百万米ドル     | 証券業           | なし | なし                       | ETF商品の紹介              | 紹介料の受取               | 15,885       | 未収収益 | 8,956 |

(注) 上表の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## Ⅱ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<br>自 平成22年4月 1日<br>至 平成23年3月 31日                                                                | 当事業年度<br>自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月 31日                                                                |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1株当たり純資産 1,170,624円94銭<br>1株当たり当期純利益 37,322円82銭<br>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。 | 1株当たり純資産 1,201,019円51銭<br>1株当たり当期純利益 30,394円51銭<br>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。 |

注） 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

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

### （重要な後発事象）

| 当事業年度<br>自 平成23年4月 1日<br>至 平成24年3月 31日 |
|----------------------------------------|
| 該当事項はありません。                            |

[次へ](#)



## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

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

## 重要な会計方針

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

## 注 記 事 項

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

| 第16期中間会計期間<br>自 平成24年4月1日<br>至 平成24年9月30日 |                   |                     |                     |                   |
|-------------------------------------------|-------------------|---------------------|---------------------|-------------------|
| 発行済株式の種類及び総数に関する事項                        |                   |                     |                     |                   |
| 株式の種類                                     | 当事業年度期首<br>株式数（株） | 当中間会計期間<br>増加株式数（株） | 当中間会計期間<br>減少株式数（株） | 当中間会計期末<br>株式数（株） |
| 普通株式                                      | 6,200             | —                   | —                   | 6,200             |

## （金融商品関係）

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

**（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項****(1) 預金**

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

**(2) 未収入金、(3)未収委託者報酬**

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

**（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16期中間会計期間末<br>(平成24年9月30日 現在) |
| 該当事項はありません。                    |

**（資産除去債務関係）**

|                                |
|--------------------------------|
| 第16期中間会計期間末<br>(平成24年9月30日 現在) |
| 資産除去債務の総額の期中における増減はありません。      |

**（デリバティブ取引関係）**

|                                  |
|----------------------------------|
| 第16期中間会計期間末<br>(平成24年9月30日 現在)   |
| 当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。 |

**（セグメント情報等）**

|                                |
|--------------------------------|
| 第16期中間会計期間末<br>(平成24年9月30日 現在) |
|--------------------------------|

## （セグメント情報）

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

## （セグメント関連情報）

## 1. 商品およびサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

## （報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

## 第16期中間会計期間

自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日

1株当たり純資産額 1,244,052円95銭

1株当たり中間純利益 43,033円33銭

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

注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

|                                             |
|---------------------------------------------|
| 第16期中間会計期間<br>自 平成24年4月 1 日<br>至 平成24年9月30日 |
| 該当事項はありません。                                 |

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- ① 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。）。
- ② 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。）。
- ③ 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④⑤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。
- ④ 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。
- ⑤ 上記③④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が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

##### ① 名 称

三井住友信託銀行株式会社

##### ② 資本金の額

342,037百万円（平成24年4月1日現在）

##### ③ 事業の内容

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

##### （参考）再信託受託会社

名 称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成24年3月末現在）

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

##### （２）販売会社

| ① 名 称        | ② 資本金の額                     | ③ 事業の内容                                                                                |
|--------------|-----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037百万円<br>（平成24年4月1日現在） | 銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。 |



## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当計算期間において提出された、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

| 書類名           | 提出年月日      |
|---------------|------------|
| 有価証券届出書の訂正届出書 | 平成24年12月7日 |
| 半期報告書         | 平成24年12月7日 |

# 独立監査人の監査報告書

平成25年4月3日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

指 定 社 員                      公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているAMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成24年3月9日から平成25年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、AMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成25年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

（※）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月28日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第15期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(※) 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 丘本 正彦 印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 湯原 尚 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第16期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

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

### 利害関係

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

以上

（※）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。