

【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29年5月19日
【計算期間】	第5期 自 平成28年2月23日 至 平成29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】	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
【事務連絡者氏名】	太田 裕之
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目23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）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

※ 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。ベンチマークとは、ファンドの運用にあたって運用成果の目標基準とする指標です。

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

■ 当ファンドが該当する商品分類

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

属性区分表

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

債券 一般 国債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
		中南米	ファンド・ オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)、資産配 分変更型))	日々	中近東 (中東)			その他 (AMCリスク バジェット型 資産配分モデル 指数)
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型	その他 ()	アフリカ			
		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(投資信託証券(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。
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	なし	目論見書又は信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象 インデックス	その他 (AMCリスクバジェッ ト型資産配分モデル 指数)	「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。

④ ファンドの特色

- 1 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。
日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク（＝収益のブレ）総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。
＜株式会社トータルアセットデザインの概要＞
平成10年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、平成27年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。
- 2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指します。
マザーファンドのベンチマークについては、「マザーファンドの概要」をご参照ください。
また、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」とは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、各ベンチマークのリターンを合成した指数です。
- 3 実質的に保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

投資対象とするマザーファンドの概要

日本株式インデックス・マザーファンド

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

日本債券インデックス・マザーファンド

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

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

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

※MSCI コクサイ指数(円ベース)とは、MSCI コクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

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

※シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)とは、シティ世界国債指数(除く日本)の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

■ ベンチマーク

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

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、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

* マザーファンドのベンチマークの算出に用いた指数です。

シティ世界国債指数(除く日本)*

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

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

*マザーファンドのベンチマークの算出に用いた指数です。

（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。



※マザーファンドには、当ファンド以外にも、当該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。

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。）

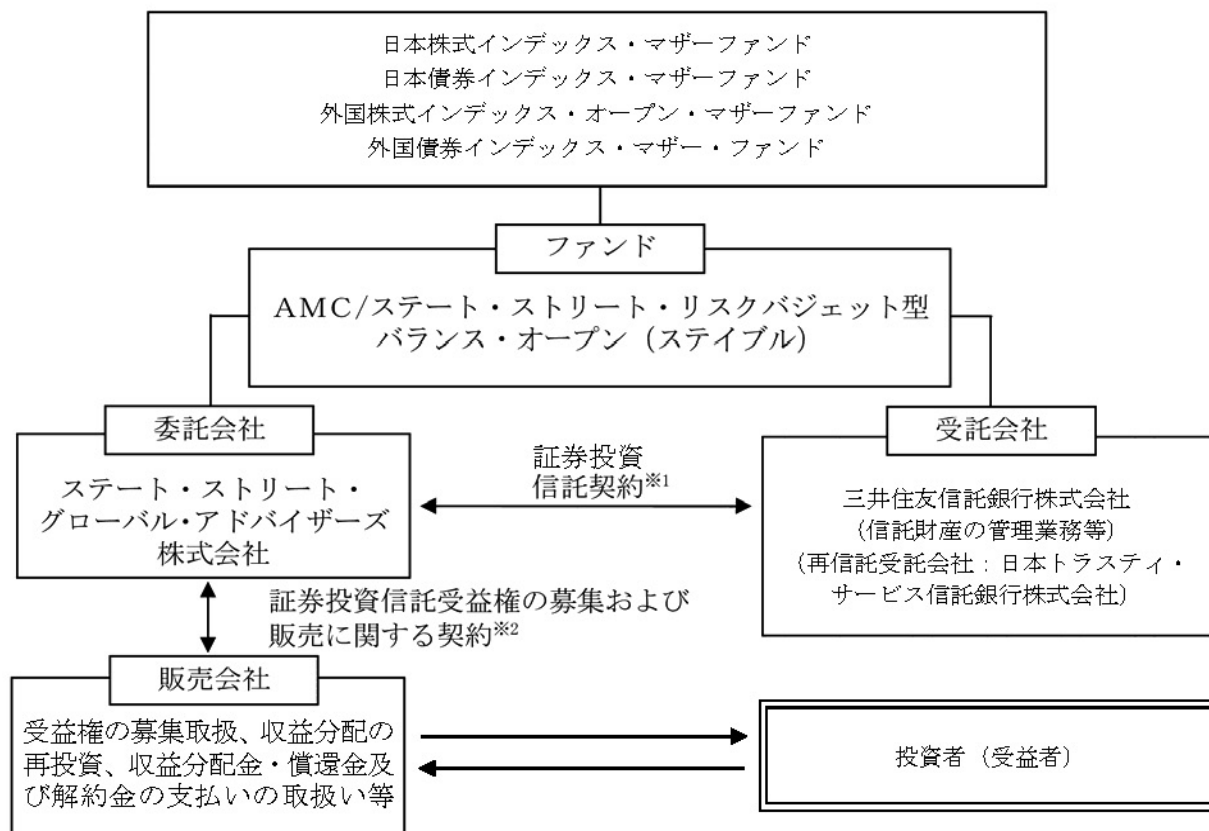
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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 証券投資信託契約

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証券投資信託契約を締結することにより成立します。証券投資信託契約は、「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（本書提出日現在）

1) 資本金の額

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

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

- ① 「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「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。

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）]

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]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCIコクサイ指数（円ベース^{※1}）]

外国債券インデックス・マザー・ファンド

[ベンチマーク：シティ世界国債指数（除く日本、円ベース^{※2}）]

※1 MSCIコクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。

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

- 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、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 投資の対象とする資産の種類

当ファンド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
- (c) 金銭債権
- (d) 約束手形

2) 特定資産以外の資産で、次に掲げる資産

- (a) 為替手形

② 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

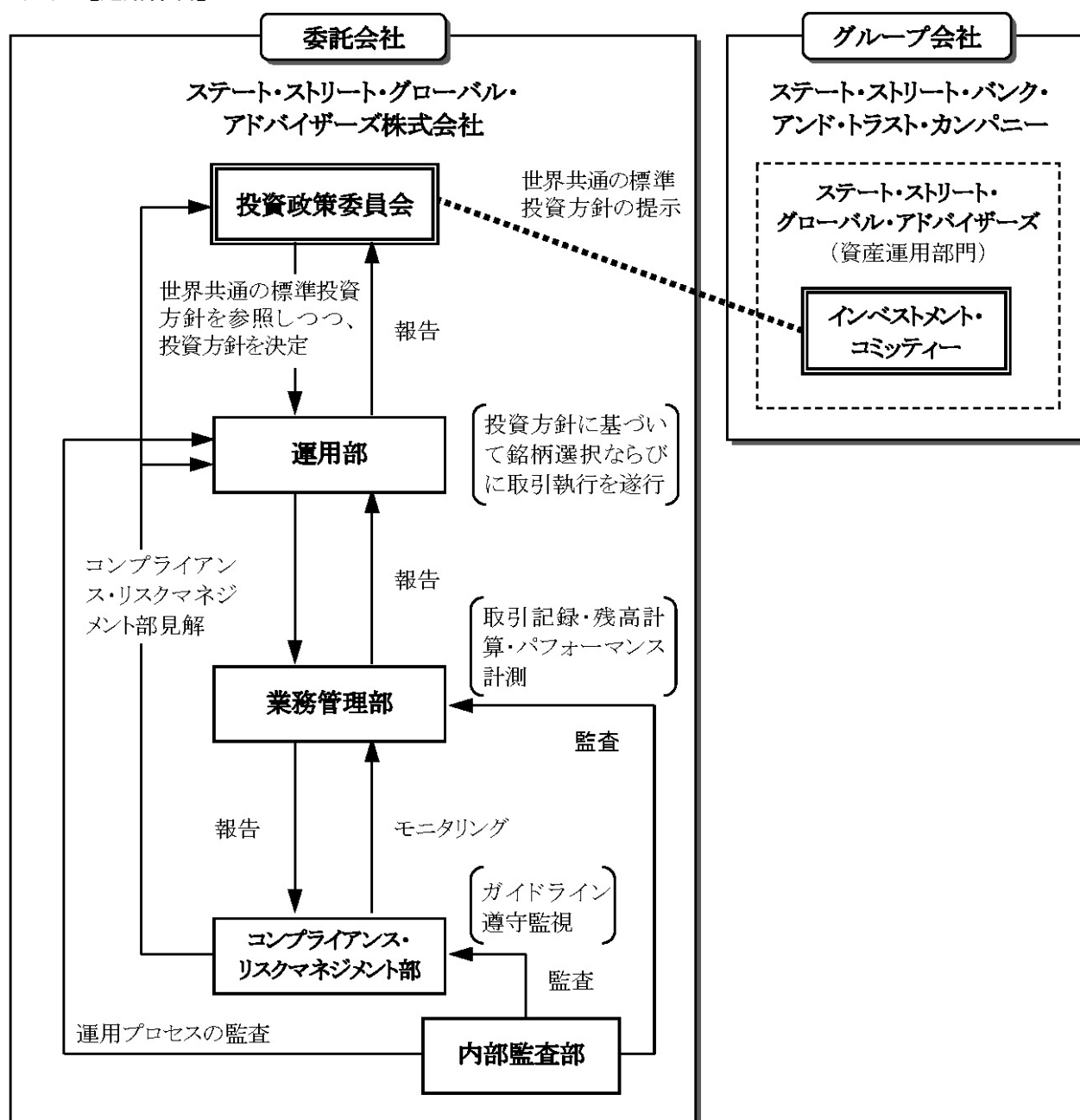
委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。（信託約款等15条）

- 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します。）
 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。
- 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②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③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（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。
- ⑥ 上記⑤において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。運用モデル／プロセスは基本的に、グループ会社、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー（所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市）の資産運用部門であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズを中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

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

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者等により構成され

ています。投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、ガイドラインに対する適合性、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

（注）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、資産運用部門であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズの業務について、平成29年6月1日付にてステート・ストリート・グループの新会社ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニーに譲渡する予定です。なお、新会社への譲渡後も、運用の体制やプロセス、投資方針等に変更はありません。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

- 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。

※当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

＜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。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

② 信託約款上のその他の投資制限

1) 投資する株式等の範囲（信託約款第18条）

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

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。

11) デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第22条の2）

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

③ 法令に基づく投資制限

1) 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を

除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考）「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「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

(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②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③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。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑪ デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第18条の2）
委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（参考）「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「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
 - （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せん。）

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

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

- 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②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③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ます。）の行使により取得可能なものに限り、実質的投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 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 金利先渡取引は、約款第17条の範囲で行います。
- ⑨ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑩ デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）
- 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（参考）「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「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取引および為替先渡取引を行うことができます。

（3）投資対象

- 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
 - (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) コマーシャル・ペーパー

- 7) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 9) 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号定めるものをいいます。）
- 10) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（クローズド・エンド型の会社型外国投資信託証券を除きます。以下同じ。）（金融商品取引法第2条第1項第11号定めるものをいいます。）
- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 13) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 14) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 15) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

- 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②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、上記③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。
- ⑧ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨ デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第19条の2）

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

（参考）「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「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（1）投資対象

日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とします。

（2）投資態度

- 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
 - (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 上記②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、上記③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 金利先渡取引及び為替先渡取引は、約款17条の範囲で行います。
- ⑧ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨ デリバティブ取引等にかかる投資制限（信託約款第17条の2）
委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本および世界主要国の株式や公社債等に分散投資を行います。主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合があります。その運用成果（損益）はすべて投資者の皆さまに帰属します。

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。

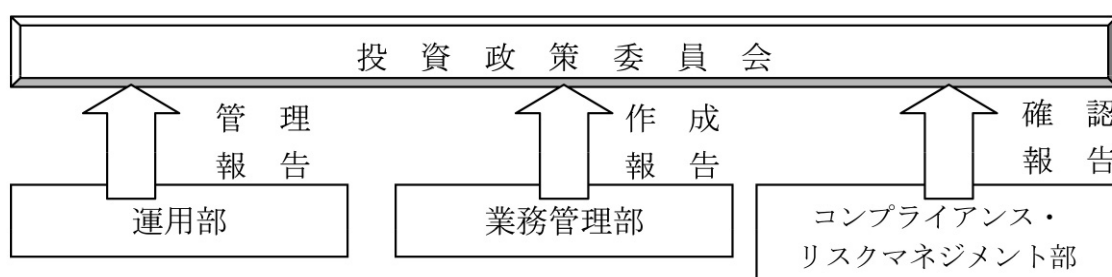
⑩ ファミリーファンド方式のリスク

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。

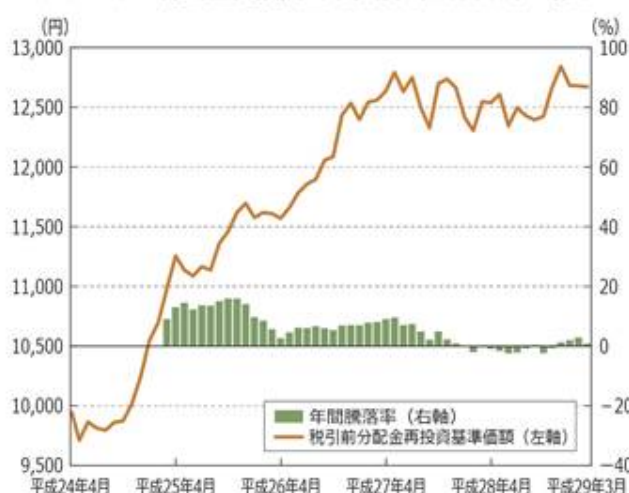
コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

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。

上記リスクに対する管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

＜ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移＞



＜ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較＞



※当ファンドの騰落率は、月末における税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)を用いて計算しています。
 ※代表的な資産クラスを表す指数の年間騰落率は、5年間(平成24年4月～平成29年3月)の各月末における直近1年前を対比して計算しております。なお、当ファンドは平成25年3月以降の年間騰落率を用いています。
 ※平均値・最大値・最小値は、同期間の各月末における年間騰落率の該当値を表示しています。
 ※代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。
 ※代表的な資産クラスを表す指数については、最終ページにてご確認ください。

■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

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

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

日本国債:NOMURA-BPI国債

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

- ① 申込手数料は、購入申込受付日の翌営業日の基準価額に2.16%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします（申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です）。申込手数料には消費税等相当額がかかります。
- ② 「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合の手数料は、無手数料とします。

※詳細については販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

（２）【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料は、ありません。

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

（３）【信託報酬等】

当ファンドから支払われる信託報酬は、以下の合計額とします。

- ① 日々のファンドの純資産総額に年率0.81%（税抜0.75%）の信託報酬率を乗じて得た額

＜信託報酬率の配分（税抜）＞

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

- ② マザーファンドで有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料のうち信託財産に属するとみなした額の100分の50以内の額

ファンドの信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（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払います。

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

（４）【その他の手数料等】

- 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。

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

※上記（１）～（４）の当該手数料等の合計額については、投資者の皆さまがファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

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

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

＜収益分配金に対する課税＞

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。

＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

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、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります。）との損益通算が可能です。また、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

※少額投資非課税制度（NISA）、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

◆法人の投資者に対する課税

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

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

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

＜注1＞個別元本について

- ① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。
- ② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行うつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。
- ③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

- ① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- ② 投資者が収益分配金を受取る際、イ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

※上記は、平成29年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成29年3月31日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,828,977,170	85.36
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		485,287,037	14.64
純資産総額		3,314,264,207	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(平成29年3月31日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	日本	113,585,231,664	97.77
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,594,547,620	2.23
純資産総額		116,179,779,284	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(平成29年3月31日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	日本	103,688,718,100	80.51
特殊債券	日本	10,724,134,175	8.33
地方債証券	日本	7,979,320,864	6.20
社債券	日本	5,980,956,860	4.64
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		414,238,859	0.32
純資産総額		128,787,368,858	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(平成29年3月31日現在)

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率(%)
株式	アメリカ	91,481,488,627	59.55
	イギリス	10,177,879,103	6.63
	フランス	5,650,901,960	3.68
	カナダ	5,631,167,145	3.67
	ドイツ	5,347,765,845	3.48
	スイス	5,028,361,386	3.27
	オーストラリア	4,068,689,065	2.65
	オランダ	1,987,255,700	1.29
	香港	1,957,081,001	1.27
	スペイン	1,928,535,294	1.26
	スウェーデン	1,659,557,672	1.08
	イタリア	1,231,362,911	0.80
	デンマーク	940,603,758	0.61
	シンガポール	716,505,249	0.47

	ベルギー	665,246,151	0.43
	フィンランド	548,200,764	0.36
	イスラエル	377,852,134	0.25
	ノルウェー	372,735,571	0.24
	アイルランド	252,647,899	0.16
	オーストリア	123,057,192	0.08
	ニュージーランド	92,580,903	0.06
	ポルトガル	90,128,989	0.06
	小計	140,329,604,319	91.35
投資証券	アメリカ	2,807,651,171	1.83
	オーストラリア	351,258,662	0.23
	フランス	174,036,463	0.11
	イギリス	141,712,488	0.09
	香港	67,751,321	0.04
	シンガポール	58,742,799	0.04
	カナダ	32,455,076	0.02
	小計	3,633,607,980	2.36
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		9,655,175,138	6.29
純資産総額		153,618,387,437	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（平成29年3月31日現在）

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	73,852,493,617	44.11
	フランス	16,074,701,245	9.60
	イタリア	15,355,130,735	9.17
	イギリス	12,175,166,985	7.27
	ドイツ	11,830,768,333	7.07
	スペイン	9,010,312,603	5.38
	ベルギー	4,224,549,681	2.52
	オランダ	3,812,134,756	2.28
	カナダ	3,548,608,996	2.12
	オーストラリア	3,535,443,739	2.11
	オーストリア	2,410,813,535	1.44
	メキシコ	1,483,977,989	0.89
	アイルランド	1,272,562,479	0.76
	ポーランド	1,083,245,428	0.65
	フィンランド	1,001,960,897	0.60
	デンマーク	976,957,618	0.58
	南アフリカ	912,345,002	0.54
	スウェーデン	743,243,925	0.44
	マレーシア	695,510,118	0.42
	シンガポール	661,092,247	0.40
	ノルウェー	457,743,468	0.27
	スイス	303,447,950	0.18
	小計	165,422,211,346	98.80
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		2,004,633,254	1.20

純資産総額	167,426,844,600	100.00
-------	-----------------	--------

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

(平成28年3月31日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデックス・ マザー・ファンド	—	669,542,743	2.1693	1,452,465,973	2.1719	1,454,179,883	43.88
2	日本	親投資信託 受益証券	日本債券インデックス・ マザーファンド	—	792,793,522	1.2519	992,498,211	1.2576	997,017,133	30.08
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・ オープン・マザーファン ド	—	94,430,219	2.2301	210,588,832	2.2524	212,694,625	6.42
4	日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデックス・ マザーファンド	—	68,777,040	2.4322	167,279,517	2.4003	165,085,529	4.98
投資比率：合計									85.36	

(注1) 投資有価証券は4銘柄です。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	—	85.36
合 計		85.36

(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。

<参考情報>

親投資信託受益証券（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29年3月31日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	626,700	6,444.00	4,038,454,800	6,042.00	3,786,521,400	3.26
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	3,854,900	759.00	2,925,869,100	699.70	2,697,273,530	2.32
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	408,400	4,850.00	1,980,740,000	4,752.00	1,940,716,800	1.67
4	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通信業	229,000	8,439.00	1,932,531,000	7,862.00	1,800,398,000	1.55
5	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	407,300	4,346.83	1,770,463,859	4,045.00	1,647,528,500	1.42
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	463,800	3,536.00	1,639,996,800	3,351.00	1,554,193,800	1.34
7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	503,200	2,982.50	1,500,794,000	2,922.00	1,470,350,400	1.27
8	日本	株式	みずほフィナンシ ャルグループ	銀行業	6,906,500	212.40	1,466,940,600	204.00	1,408,926,000	1.21
9	日本	株式	ソニー	電気機器	363,900	3,560.00	1,295,484,000	3,766.00	1,370,447,400	1.18

10	日本	株式	ファナック	電気機器	52,300	22,305.00	1,166,551,500	22,820.00	1,193,486,000	1.03
11	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	320,100	3,782.00	1,210,618,200	3,618.00	1,158,121,800	1.00
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	202,400	5,272.00	1,067,052,800	5,229.00	1,058,349,600	0.91
13	日本	株式	キーエンス	電気機器	23,400	44,500.00	1,041,300,000	44,580.00	1,043,172,000	0.90
14	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	380,100	2,675.50	1,016,957,550	2,592.50	985,409,250	0.85
15	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	206,100	4,950.00	1,020,195,000	4,696.00	967,845,600	0.83
16	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	99,700	10,025.00	999,492,500	9,694.00	966,491,800	0.83
17	日本	株式	キャノン	電気機器	277,500	3,314.00	919,635,000	3,471.00	963,202,500	0.83
18	日本	株式	信越化学工業	化学	96,800	9,690.00	937,992,000	9,644.00	933,539,200	0.80
19	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	212,900	4,403.00	937,398,700	4,362.00	928,669,800	0.80
20	日本	株式	三菱商事	卸売業	381,700	2,531.50	966,273,550	2,405.50	918,179,350	0.79
21	日本	株式	三菱電機	電気機器	549,800	1,662.00	913,767,600	1,597.00	878,030,600	0.76
22	日本	株式	村田製作所	電気機器	54,100	16,250.00	879,125,000	15,835.00	856,673,500	0.74
23	日本	株式	花王	化学	137,100	5,972.00	818,761,200	6,104.00	836,858,400	0.72
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	182,200	4,522.00	823,908,400	4,503.00	820,446,600	0.71
25	日本	株式	任天堂	その他製品	31,700	24,240.00	768,408,000	25,835.00	818,969,500	0.70
26	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	551,500	1,531.50	844,622,250	1,466.00	808,499,000	0.70
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	70,400	10,860.00	764,544,000	11,185.00	787,424,000	0.68
28	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	42,900	18,300.00	785,070,000	18,140.00	778,206,000	0.67
29	日本	株式	三菱地所	不動産業	378,000	2,196.00	830,088,000	2,030.00	767,340,000	0.66
30	日本	株式	日立製作所	電気機器	1,238,000	621.30	769,169,400	602.50	745,895,000	0.64
									投資比率：合計	31.77

（注１）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	12.69
	輸送用機器	8.90
	銀行業	7.96
	情報・通信業	7.60
	化学	6.70
	機械	5.08
	医薬品	4.65
	小売業	4.55
	食料品	4.44
	卸売業	4.39
	陸運業	4.03
	サービス業	3.68
	建設業	2.89
	保険業	2.58
	不動産業	2.33
	その他製品	1.79
	電気・ガス業	1.78
	精密機器	1.55
	鉄鋼	1.24
	その他金融業	1.20
	証券、商品先物取引業	1.17
	ガラス・土石製品	0.99
	ゴム製品	0.96
	非鉄金属	0.96
	金属製品	0.71

繊維製品	0.71
空運業	0.56
石油・石炭製品	0.56
鉱業	0.33
パルプ・紙	0.25
海運業	0.24
倉庫・運輸関連業	0.19
水産・農林業	0.11
合 計	97.77

（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 ／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX（先物） (2017年6月限)	大阪取引所	買建	170	2,603,683,160	2,571,250,000	2.21

（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（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29年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第130回利付国債（5年）	0.100	2021/12/20	2,100,000,000	101.22	2,125,809,000	101.13	2,123,898,000	1.65
2	日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	0.100	2026/09/20	1,730,000,000	100.52	1,738,996,000	100.51	1,738,961,400	1.35
3	日本	国債証券	第298回利付国債（10年）	1.300	2018/12/20	1,600,000,000	102.88	1,646,112,000	102.63	1,642,080,000	1.28
4	日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	0.100	2026/12/20	1,450,000,000	100.43	1,456,351,000	100.43	1,456,293,000	1.13
5	日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	0.100	2021/09/20	1,350,000,000	101.18	1,366,038,000	101.07	1,364,539,500	1.06
6	日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	0.400	2025/09/20	1,300,000,000	103.32	1,343,238,000	103.29	1,342,861,000	1.04
7	日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	1.400	2018/12/20	1,200,000,000	103.06	1,236,744,000	102.80	1,233,624,000	0.96
8	日本	国債証券	第304回利付国債（10年）	1.300	2019/09/20	1,100,000,000	103.93	1,143,230,000	103.68	1,140,557,000	0.89
9	日本	国債証券	第295回利付国債（10年）	1.500	2018/06/20	1,100,000,000	102.34	1,125,828,000	102.12	1,123,375,000	0.87
10	日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1.300	2021/03/20	1,000,000,000	105.94	1,059,470,000	105.77	1,057,740,000	0.82
11	日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	1.300	2019/12/20	1,000,000,000	104.27	1,042,750,000	104.04	1,040,480,000	0.81

12	日本	国債証券	第302回利付国債（10年）	1.400	2019/06/20	1,000,000,000	103.80	1,038,030,000	103.55	1,035,530,000	0.80
13	日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	0.400	2025/06/20	1,000,000,000	103.31	1,033,130,000	103.28	1,032,840,000	0.80
14	日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	0.400	2025/03/20	1,000,000,000	103.29	1,032,960,000	103.26	1,032,650,000	0.80
15	日本	国債証券	第337回利付国債（10年）	0.300	2024/12/20	1,000,000,000	102.49	1,024,950,000	102.47	1,024,710,000	0.80
16	日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	0.800	2023/09/20	900,000,000	105.85	952,668,000	105.68	951,138,000	0.74
17	日本	国債証券	第314回利付国債（10年）	1.100	2021/03/20	900,000,000	105.13	946,215,000	104.97	944,802,000	0.73
18	日本	国債証券	第307回利付国債（10年）	1.300	2020/03/20	900,000,000	104.59	941,337,000	104.38	939,483,000	0.73
19	日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	1.000	2020/09/20	900,000,000	104.21	937,962,000	104.02	936,189,000	0.73
20	日本	国債証券	第158回利付国債（20年）	0.500	2036/09/20	950,000,000	97.73	928,435,000	97.91	930,192,500	0.72
21	日本	国債証券	第293回利付国債（10年）	1.800	2018/06/20	900,000,000	102.73	924,570,000	102.49	922,410,000	0.72
22	日本	国債証券	第57回利付国債（20年）	1.900	2022/06/20	800,000,000	110.77	886,184,000	110.53	884,272,000	0.69
23	日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	1.200	2020/12/20	800,000,000	105.22	841,760,000	105.02	840,160,000	0.65
24	日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1.400	2020/03/20	800,000,000	104.89	839,184,000	104.68	837,472,000	0.65
25	日本	国債証券	第157回利付国債（20年）	0.200	2036/06/20	900,000,000	92.60	833,400,000	92.79	835,110,000	0.65
26	日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	1.100	2020/06/20	800,000,000	104.26	834,112,000	104.08	832,664,000	0.65
27	日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	0.500	2024/09/20	800,000,000	104.00	832,024,000	103.96	831,712,000	0.65
28	日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	0.100	2026/03/20	800,000,000	100.63	805,040,000	100.67	805,360,000	0.63
29	日本	国債証券	第159回利付国債（20年）	0.600	2036/12/20	800,000,000	99.29	794,376,000	99.56	796,488,000	0.62
30	日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	1.200	2021/06/20	750,000,000	105.86	794,002,500	105.67	792,570,000	0.62
										投資比率：合計	25.24

（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	—	80.51
特殊債券	—	8.33
地方債証券	—	6.20
社債券	—	4.64
合 計		99.68

（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。

<参考情報>

親投資信託受益証券（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29年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	210,067	12,504.69	2,626,824,268	16,147.50	3,392,058,289	2.21
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	290,632	6,853.68	1,991,900,789	7,372.00	2,142,540,528	1.39
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	15,808	85,547.11	1,352,328,853	98,316.58	1,554,188,569	1.01
4	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	162,451	9,637.12	1,565,559,943	9,390.30	1,525,464,112	0.99
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	107,925	12,619.13	1,361,919,734	13,985.60	1,509,396,462	0.98
6	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	92,152	13,580.19	1,251,441,950	15,976.97	1,472,310,467	0.96
7	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	141,790	8,854.03	1,255,413,594	9,988.27	1,416,237,611	0.92
8	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	188,597	5,818.17	1,097,290,048	6,309.56	1,189,965,143	0.77
9	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	348,502	3,483.49	1,214,006,542	3,351.11	1,167,870,384	0.76
10	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	12,181	86,480.53	1,053,419,452	93,285.98	1,136,316,583	0.74
11	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	241,013	4,429.26	1,067,509,529	4,685.05	1,129,159,016	0.74
12	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	11,612	88,567.27	1,028,443,181	95,303.16	1,106,660,307	0.72
13	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	397,987	2,276.33	905,951,777	2,677.97	1,065,799,355	0.69
14	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	122,180	7,654.38	935,212,270	8,663.01	1,058,446,683	0.69
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	100,539	9,299.42	934,955,302	10,119.53	1,017,408,230	0.66
16	アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	238,088	3,581.10	852,618,079	3,853.72	917,526,034	0.60
17	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	47,834	17,690.11	846,189,161	18,776.11	898,136,847	0.58
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	73,695	12,266.85	904,005,849	12,091.83	891,108,016	0.58
19	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	159,384	5,717.20	911,230,587	5,504.04	877,256,134	0.57
20	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	190,212	3,934.50	748,389,741	4,208.24	800,459,059	0.52
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	48,539	14,542.06	705,857,428	16,486.32	800,229,510	0.52
22	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,515	25,372.64	698,128,409	28,902.85	795,262,000	0.52
23	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	161,807	4,616.61	747,001,189	4,779.29	773,323,224	0.50
24	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	60,651	10,164.41	616,481,873	12,735.80	772,439,539	0.50

25	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	108,460	6,977.09	756,735,843	7,118.45	772,067,683	0.50
26	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	112,251	6,228.78	699,187,771	6,788.61	762,029,035	0.50
27	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア	59,586	11,181.97	666,289,299	12,697.66	756,603,019	0.49
28	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	196,682	3,346.62	658,221,429	3,785.29	744,498,525	0.48
29	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	74,195	8,879.83	658,839,617	9,986.03	740,913,636	0.48
30	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	184,728	3,961.42	731,786,837	4,010.79	740,905,676	0.48
投資比率：合計									22.05	

（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29年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	銀行	9.03
	ソフトウェア・サービス	8.68
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.15
	資本財	7.04
	エネルギー	6.60
	食品・飲料・タバコ	5.55
	素材	4.64
	各種金融	4.03
	保険	3.94
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.76
	小売	3.69
	ヘルスケア機器・サービス	3.67
	公益事業	3.06
	電気通信サービス	2.72
	メディア	2.56
	半導体・半導体製造装置	2.37
	家庭用品・パーソナル用品	2.06
	運輸	1.84
	食品・生活必需品小売り	1.78
	消費者サービス	1.68
	耐久消費財・アパレル	1.61
	自動車・自動車部品	1.41
	商業・専門サービス	0.93
	不動産	0.55
	小 計	91.35
投資証券	—	2.36
合 計		93.71

（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29年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

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 ／ 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	484	57,317,427.16	57,223,320.00	6,419,884,270	4.18
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	304	10,161,900.00	10,369,440.00	1,242,155,217	0.81
	FTSE100INDEX	インターコンチネンタル取引所	買建	イギリス・ポンド	76	5,543,080.00	5,548,000.00	777,163,840	0.51
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	28	5,112,582.00	5,113,360.00	429,777,908	0.28
	FSMI INDEX	ユーレックス・チューリッヒ取引所	買建	スイス・フラン	40	3,403,182.30	3,426,400.00	383,996,648	0.25
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	29	4,180,350.00	4,263,000.00	365,935,920	0.24

(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29年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・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29年3月31日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/05/31	14,500,000	11,302.69	1,638,890,592	11,289.56	1,636,987,288	0.98
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	12,000,000	12,028.45	1,443,414,102	11,997.71	1,439,725,294	0.86
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/12/31	12,000,000	11,257.14	1,350,857,352	11,243.12	1,349,174,502	0.81
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2023/03/31	12,000,000	10,810.17	1,297,221,556	10,810.51	1,297,261,945	0.77
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/02/28	11,000,000	11,324.23	1,245,665,764	11,304.04	1,243,444,402	0.74
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2019/11/30	11,000,000	11,088.85	1,219,774,556	11,087.06	1,219,577,101	0.73
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	10,000,000	11,402.65	1,140,265,503	11,395.58	1,139,558,706	0.68
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	10,000,000	11,268.13	1,126,813,922	11,255.34	1,125,534,956	0.67

有価証券報告書（内国投資信託）											
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/12/31	10,000,000	11,215.38	1,121,538,457	11,246.59	1,124,659,874	0.67
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2020/02/29	10,000,000	11,135.97	1,113,597,940	11,129.13	1,112,913,581	0.66
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/15	9,500,000	11,085.38	1,053,111,262	11,076.96	1,052,311,908	0.63
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	8,800,000	11,917.15	1,048,709,936	11,887.76	1,046,123,283	0.62
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2020/12/31	9,000,000	11,493.30	1,034,397,409	11,469.63	1,032,266,921	0.62
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	14,315.66	1,030,728,123	14,230.62	1,024,605,241	0.61
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2020/01/31	9,000,000	11,188.37	1,006,953,491	11,176.92	1,005,923,587	0.60
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2019/04/30	8,900,000	11,209.35	997,632,297	11,205.87	997,322,765	0.60
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	8,900,000	11,097.76	987,701,014	11,100.63	987,956,919	0.59
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2023/05/15	9,000,000	10,968.55	987,169,907	10,951.65	985,648,610	0.59
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2018/04/30	8,800,000	11,172.10	983,145,203	11,159.87	982,069,076	0.59
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	8,800,000	11,147.08	980,943,586	11,137.10	980,064,914	0.59
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2023/11/15	8,400,000	11,597.19	974,164,169	11,594.61	973,947,418	0.58
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/02/15	8,500,000	11,254.11	956,599,814	11,250.52	956,294,658	0.57
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/09/30	8,500,000	11,266.34	957,639,255	11,248.39	956,113,471	0.57
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	8,000,000	11,836.49	946,919,500	11,810.24	944,819,304	0.56
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/11/30	8,400,000	11,261.07	945,929,985	11,247.04	944,751,990	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2021/01/31	8,500,000	11,056.88	939,835,263	11,047.23	939,015,154	0.56
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2018/11/30	8,200,000	11,233.92	921,181,544	11,221.58	920,169,590	0.55
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2019/12/31	8,200,000	11,117.35	911,623,180	11,110.73	911,080,405	0.54
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2019/09/30	8,200,000	11,104.22	910,546,829	11,103.33	910,473,233	0.54
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/09/30	8,000,000	11,345.43	907,635,050	11,321.09	905,687,432	0.54
投資比率：合計									19.18		

（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29年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券	—	98.80
合 計		98.80

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

(注2) 平成29年3月31日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

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。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

平成29年3月31日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの 純資産額（円）	
第1期	（平成25年 2月20日）	分配付：	213,198,476	分配付：	1.0667
		分配落：	213,198,476	分配落：	1.0667
第2期	（平成26年 2月20日）	分配付：	1,623,142,054	分配付：	1.1583
		分配落：	1,616,135,543	分配落：	1.1533
第3期	（平成27年 2月20日）	分配付：	1,749,455,838	分配付：	1.2424
		分配落：	1,726,925,712	分配落：	1.2264
第4期	（平成28年 2月22日）	分配付：	2,799,520,026	分配付：	1.1999
		分配落：	2,783,188,603	分配落：	1.1929
第5期	（平成29年 2月20日）	分配付：	3,353,263,422	分配付：	1.2368
		分配落：	3,315,305,934	分配落：	1.2228
平成28年 3月末日		2,893,526,582		1.2258	
4月末日		2,911,044,009		1.2250	
5月末日		3,368,255,457		1.2318	
6月末日		3,302,586,732		1.2060	
7月末日		3,351,318,287		1.2208	
8月末日		3,327,026,662		1.2143	
9月末日		3,269,199,126		1.2110	
10月末日		3,283,088,791		1.2139	
11月末日		3,354,806,209		1.2378	
12月末日		3,392,526,569		1.2546	
平成29年 1月末日		3,355,628,026		1.2391	
2月末日		3,329,589,638		1.2248	
3月末日		3,314,264,207		1.2240	

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 至平成25年 2月20日	0.0000円
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	0.0050円
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	0.0160円

第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	0.0070円
第5期	自平成28年 2月23日 至平成29年 2月20日	0.0140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 至平成25年 2月20日	6.7%
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	8.6%
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	7.7%
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	△2.2%
第5期	自平成28年 2月23日 至平成29年 2月20日	3.7%

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

（４）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自平成28年 2月23日 至平成29年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203

（注１）日本国外における設定、解約はありません。

（注２）第１期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

(参考情報) 運用実績

(平成29年3月31日現在)

基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	12,240円
純資産総額	3,314百万円

分配の推移

決算期	分配金
第1期 (平成25年2月20日)	0円
第2期 (平成26年2月20日)	50円
第3期 (平成27年2月20日)	160円
第4期 (平成28年2月22日)	70円
第5期 (平成29年2月20日)	140円
設定来累計	420円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
日本債券 インデックス・マザーファンド	25.24%	第130回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2021/12/20	1.65%
		第344回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.100%	2026/09/20	1.35%
		第298回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.300%	2018/12/20	1.28%
日本株式 インデックス・マザーファンド	31.77%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.26%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.32%
		日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	—	—	1.67%
外国株式 インデックス・オープン・ マザーファンド	22.05%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	—	—	2.21%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	—	—	1.39%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	1.01%
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	19.18%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2021/05/31	0.98%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	3.625%	2021/02/15	0.86%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.375%	2018/12/31	0.81%

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

年間収益率の推移 (暦年ベース)



※ベンチマークは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、組入れマザーファンドの各ベンチマークのリターンを合成したAMCリスクバジェット型資産配分モデル指数です。

※平成24年のファンドとベンチマークの収益率は設定時から12月末まで、平成29年は3月末までで算出しております。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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、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）。

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）。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

1) 基準価額の算出方法

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

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。ただし、上場している場合は、原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 ①日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値） ②証券会社、銀行等の提示する価額 ③価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。

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

2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「AMC安定型」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03-4530-7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

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

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）の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

（d）上記（b）の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。

（e）書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

（f）上記（b）から（e）までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

（g）上記の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあって、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

3）反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

4）運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

（a）交付運用報告書は、知っている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。

（b）運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（www.ssga.com/jp）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

5）公告

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

6）関係法人との契約の更改に関する手続き等

委託会社と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」（別の名称で同様の権利義務を規定する契約を含みます。）は、契約期間満了3ヶ月前までに、別段の意思表示のない限り、原則として1年毎に自動的に更新されるものとします。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

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が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

① 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）手続等1）により信託の一部解約が行われ

た場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記１）に準じて受益者に支払います。当該売付けにより増加した受益権は、第９条第３項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます（信託約款第42条第２項）。

- ３）償還金は、信託終了日後１ヶ月以内の委託会社の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます（信託約款第42条第３項）。
- ４）一部解約金は、上記２ 換金（解約）手続等１）の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として５営業日目から当該受益者に支払います（信託約款第42条第４項）。
- ５）上記１）２）３）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとします。（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）。

② 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- （2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成28年2月23日から平成29年2月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任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4期 (平成28年 2月22日現在)	第5期 (平成29年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	446,357,532	279,144
コール・ローン	9,721,414	526,011,363
親投資信託受益証券	2,354,470,265	2,840,567,592
流動資産合計	2,810,549,211	3,366,858,099
資産合計	2,810,549,211	3,366,858,099
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	16,331,423	37,957,488
未払受託者報酬	725,617	894,278
未払委託者報酬	10,158,509	12,519,823
未払利息	—	1,525
その他未払費用	145,059	179,051
流動負債合計	27,360,608	51,552,165
負債合計	27,360,608	51,552,165
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,333,060,456	※1 2,711,249,203
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	450,128,147	604,056,731
（分配準備積立金）	146,021,951	143,186,317
元本等合計	2,783,188,603	3,315,305,934
純資産合計	2,783,188,603	3,315,305,934
負債純資産合計	2,810,549,211	3,366,858,099

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	第5期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
営業収益		
受取利息	33,097	—
有価証券売買等損益	△42,274,904	136,097,327
営業収益合計	△42,241,807	136,097,327
営業費用		
支払利息	—	405,069
受託者報酬	1,283,627	1,730,457
委託者報酬	17,970,548	24,226,232
その他費用	256,597	392,642
営業費用合計	19,510,772	26,754,400
営業利益又は営業損失（△）	△61,752,579	109,342,927
経常利益又は経常損失（△）	△61,752,579	109,342,927
当期純利益又は当期純損失（△）	△61,752,579	109,342,927
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△28,914	1,889,746
期首剰余金又は期首欠損金（△）	318,792,775	450,128,147
剰余金増加額又は欠損金減少額	210,994,082	102,157,756
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	210,994,082	102,157,756
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,603,622	17,724,865
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,603,622	17,724,865
分配金	※ 1 16,331,423	※ 1 37,957,488
期末剰余金又は期末欠損金（△）	450,128,147	604,056,731

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成28年2月20日が休日のため、当計算期間は平成28年2月23日から平成29年2月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期 (平成28年 2月22日現在)	第5期 (平成29年 2月20日現在)
1 期首元本額	1,408,132,937円	2,333,060,456円
期中追加設定元本額	932,006,609円	468,679,521円
期中一部解約元本額	7,079,090円	90,490,774円
2 受益権の総数	2,333,060,456口	2,711,249,203口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期 自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	第5期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,936,376円）、収益調整金（304,106,196円）及び分配準備積立金（144,416,998円）より分配対象収益は466,459,570円（1万口当たり1,999円）であり、うち16,331,423円（1万口当たり70円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（39,946,388円）、収益調整金（460,870,414円）及び分配準備積立金（141,197,417円）より分配対象収益は642,014,219円（1万口当たり2,367円）であり、うち37,957,488円（1万口当たり140円）を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期 （平成28年 2月22日現在）	第5期 （平成29年 2月20日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第4期 (平成28年 2月22日現在)	第5期 (平成29年 2月20日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△53,121,023	73,252,783
合計	△53,121,023	73,252,783

(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4期 自 平成27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	第5期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 (平成28年 2月22日現在)	第5期 (平成29年 2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1929円 (11,929円)	1.2228円 (12,228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 受益証券	外国株式インデックス・オープン・マザーファンド	97,946,394	218,430,253	
	外国債券インデックス・マザー・ファンド	664,054,017	1,440,465,973	
	日本株式インデックス・マザーファンド	71,216,462	173,212,678	
	日本債券インデックス・マザーファンド	805,542,526	1,008,458,688	
合計		1,638,759,399	2,840,567,592	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

<参考>

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

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		1,692,250,530	792,513
コール・ローン		36,856,257	1,493,386,989
株式		93,167,451,910	119,939,478,880
派生商品評価勘定		9,000,376	2,331,576
未収入金		4,474,400	1,880,928
未収配当金		154,837,548	208,753,058
未収利息		1	—
前払金		157,245,000	3,850,000
差入委託証拠金		136,290,000	60,480,000
流動資産合計		95,358,406,022	121,710,953,944
資産合計		95,358,406,022	121,710,953,944
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		161,084,520	4,491,008
未払金		1,416,296	36,250,391
未払解約金		5,748,000	237,163,000
未払利息		—	4,331
その他未払費用		—	986
流動負債合計		168,248,816	277,909,716

負債合計		168,248,816	277,909,716
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,624,700,839	49,927,537,771
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		47,565,456,367	71,505,506,457
元本等合計		95,190,157,206	121,433,044,228
純資産合計		95,190,157,206	121,433,044,228
負債純資産合計		95,358,406,022	121,710,953,944

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

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（平成28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1 期首元本額	60,470,886,080円	47,624,700,839円
期中追加設定元本額	7,869,377,988円	13,653,552,130円
期中一部解約元本額	20,715,563,229円	11,350,715,198円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	61,059,364円	71,216,462円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	937,009,211円	1,050,162,140円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	28,579,358円	9,516,980円

バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	1,789,754,811円	667,343,923円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	565,745円	518,243円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	25,497,391円	12,070,006円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	22,517,384円	15,919,515円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	11,636,116,633円	10,019,098,143円
日本株式インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	733,518,232円	707,568,894円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	49,046,960円	24,029,636円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,416,238,945円	1,820,682,165円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,256,363,868円	1,058,652,878円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	102,941,007円	87,907,344円
日本株式インデックス・ファンドM＜適格機関投資家限定＞	866,852,830円	360,444,137円
日本株式インデックス・ファンドS＜適格機関投資家限定＞	9,925,735,568円	16,163,823,137円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	122,551,245円	104,177,249円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,057,553,586円	1,105,640,786円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	313,473,073円	320,148,017円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	3,494,104,159円	2,885,386,421円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	359,065,869円	283,821,859円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	1,136,069,732円	1,038,228,867円
日本株式インデックス・ファンドFOF＜適格機関投資家限定＞	5,230,105,025円	5,052,827,822円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	24,102,902円	22,407,065円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	25,517,267円	24,592,434円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	11,657,497円	10,995,781円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	916,512,893円	779,609,454円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	7,244,638円	4,668,648円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	16,615,843円	14,924,955円

バランスファンドVA50D＜適格機関投資家限定＞	259,894円	— 円
バランスファンドVA10A＜適格機関投資家限定＞	49,862,802円	45,554,289円
日本株式インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	1,545,606,479円	1,661,541,071円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	557,823,373円	463,483,809円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,563,860,098円	2,141,680,323円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	228,382,598円	285,652,384円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適格機関投資家限定＞	49,292,823円	554,042,282円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	63,241,736円	63,398,033円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	— 円	425,348,768円
グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	— 円	47,295,454円
グローバルバランス40VA2＜適格機関投資家限定＞	— 円	377,009,513円
グローバルバランス40VA3＜適格機関投資家限定＞	— 円	34,995,868円
グローバルバランス50VA＜適格機関投資家限定＞	— 円	12,817,787円
ワールドバランスVA0809＜適格機関投資家限定＞	— 円	74,388,218円
ワールドバランスVA0902＜適格機関投資家限定＞	— 円	23,947,011円
計	47,624,700,839円	49,927,537,771円
2 受益権の総数	47,624,700,839口	49,927,537,771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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	△15,921,436,541	14,433,158,975
合計	△15,921,436,541	14,433,158,975

(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28年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX 先物	2,137,925,000	—	1,985,940,000	△151,985,000
	合 計	2,137,925,000	—	1,985,940,000	△151,985,000

(単位：円)

区 分	種 類	(平成29年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX 先物	1,301,585,000	—	1,299,480,000	△2,105,000
	合 計	1,301,585,000	—	1,299,480,000	△2,105,000

(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27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9988円 （19,988円）	2.4322円 （24,322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）	
いすゞ自動車	153,900	1,540.50	237,082,950	
極洋	2,300	2,851.00	6,557,300	
日本水産	78,000	562.00	43,836,000	
マルハニチロ	11,500	3,285.00	37,777,500	
ハウスイ	6,000	126.00	756,000	
カネコ種苗	2,000	1,435.00	2,870,000	
サカタのタネ	8,800	3,185.00	28,028,000	
ホクト	6,000	2,136.00	12,816,000	
ホクリヨウ	700	770.00	539,000	
ショーボンドホールディングス	6,200	5,000.00	31,000,000	
ミライト・ホールディングス	18,600	1,053.00	19,585,800	
タマホーム	4,400	555.00	2,442,000	
サンヨーホームズ	600	664.00	398,400	
ファーストコーポレーション	1,000	927.00	927,000	
インベスターズクラウド	600	4,525.00	2,715,000	
住石ホールディングス	17,800	99.00	1,762,200	
日鉄鉱業	1,600	6,030.00	9,648,000	
三井松島産業	3,600	1,510.00	5,436,000	
国際石油開発帝石	313,600	1,118.50	350,761,600	
日本海洋掘削	1,900	2,413.00	4,584,700	
石油資源開発	9,600	2,705.00	25,968,000	
K&Oエナジーグループ	3,900	1,766.00	6,887,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	1,591.00	2,545,600	
安藤・間	41,000	850.00	34,850,000	
東急建設	19,700	835.00	16,449,500	
コムシスホールディングス	23,500	2,025.00	47,587,500	

ミサワホーム	7,000	1,054.00	7,378,000	
ビーアールホールディングス	5,000	302.00	1,510,000	
高松コンストラクショングループ	4,400	2,648.00	11,651,200	
東建コーポレーション	2,500	8,020.00	20,050,000	
ソネック	700	650.00	455,000	
ヤマウラ	2,900	608.00	1,763,200	
大成建設	303,000	806.00	244,218,000	
大林組	178,500	1,065.00	190,102,500	
清水建設	182,000	1,042.00	189,644,000	
飛島建設	51,000	175.00	8,925,000	
長谷工コーポレーション	69,400	1,288.00	89,387,200	
松井建設	7,100	1,062.00	7,540,200	
銭高組	8,000	428.00	3,424,000	
鹿島建設	262,000	741.00	194,142,000	
不動テトラ	44,500	203.00	9,033,500	
大末建設	2,500	1,015.00	2,537,500	
鉄建建設	37,000	337.00	12,469,000	
西松建設	69,000	585.00	40,365,000	
三井住友建設	232,200	123.00	28,560,600	
大豊建設	22,000	526.00	11,572,000	
前田建設工業	37,000	1,002.00	37,074,000	
佐田建設	4,600	423.00	1,945,800	
ナカノフドー建設	4,700	558.00	2,622,600	
奥村組	49,000	706.00	34,594,000	
東鉄工業	7,100	3,145.00	22,329,500	
イチケン	5,000	487.00	2,435,000	
浅沼組	19,000	359.00	6,821,000	
戸田建設	69,000	668.00	46,092,000	
熊谷組	89,000	319.00	28,391,000	
青木あすなろ建設	4,000	820.00	3,280,000	
北野建設	12,000	320.00	3,840,000	
植木組	8,000	263.00	2,104,000	
三井ホーム	7,000	576.00	4,032,000	
矢作建設工業	8,700	1,051.00	9,143,700	
ピーエス三菱	7,100	404.00	2,868,400	
日本ハウスホールディングス	13,100	517.00	6,772,700	
大東建託	21,900	15,775.00	345,472,500	
新日本建設	7,500	929.00	6,967,500	
N I P P O	14,000	2,176.00	30,464,000	
東亜道路工業	12,000	345.00	4,140,000	
前田道路	19,000	2,012.00	38,228,000	
日本道路	19,000	481.00	9,139,000	
東亜建設工業	4,900	1,954.00	9,574,600	
若築建設	37,000	152.00	5,624,000	
東洋建設	17,200	424.00	7,292,800	
五洋建設	66,600	516.00	34,365,600	
大林道路	6,100	686.00	4,184,600	
世紀東急工業	8,800	516.00	4,540,800	
福田組	10,000	1,044.00	10,440,000	

日本ドライケミカル	800	2,310.00	1,848,000	
住友林業	40,900	1,607.00	65,726,300	
日本基礎技術	6,900	363.00	2,504,700	
日成ビルド工業	17,000	551.00	9,367,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	28,000	80.00	2,240,000	
巴コーポレーション	7,800	358.00	2,792,400	
パナホーム	23,000	1,057.00	24,311,000	
大和ハウス工業	175,900	3,109.00	546,873,100	
ライト工業	11,600	1,156.00	13,409,600	
積水ハウス	187,300	1,798.00	336,765,400	
日特建設	6,200	442.00	2,740,400	
北陸電気工事	3,200	885.00	2,832,000	
ユアテック	10,000	804.00	8,040,000	
西部電気工業	1,000	2,295.00	2,295,000	
四電工	5,000	425.00	2,125,000	
中電工	7,600	2,367.00	17,989,200	
関電工	24,000	925.00	22,200,000	
きんでん	39,900	1,485.00	59,251,500	
東京エネシス	6,000	951.00	5,706,000	
トーエネック	8,000	559.00	4,472,000	
住友電設	4,100	1,278.00	5,239,800	
日本電設工業	9,900	1,991.00	19,710,900	
協和エクシオ	23,300	1,592.00	37,093,600	
新日本空調	4,500	1,375.00	6,187,500	
日本工営	3,600	2,734.00	9,842,400	
NDS	900	2,920.00	2,628,000	
九電工	11,600	2,948.00	34,196,800	
三機工業	13,100	1,002.00	13,126,200	
日揮	55,500	2,053.00	113,941,500	
中外炉工業	19,000	240.00	4,560,000	
ヤマト	4,600	541.00	2,488,600	
太平電業	8,000	1,052.00	8,416,000	
高砂熱学工業	16,700	1,649.00	27,538,300	
三晃金属工業	600	3,215.00	1,929,000	
NECネットエスアイ	5,800	2,124.00	12,319,200	
朝日工業社	1,400	3,035.00	4,249,000	
明星工業	10,200	613.00	6,252,600	
大気社	7,400	2,891.00	21,393,400	
ダイダン	8,000	961.00	7,688,000	
日比谷総合設備	6,700	1,721.00	11,530,700	
東芝プラントシステム	9,800	1,611.00	15,787,800	
日本製粉	18,000	1,695.00	30,510,000	
日清製粉グループ本社	65,200	1,685.00	109,862,000	
日東富士製粉	500	3,995.00	1,997,500	
昭和産業	25,000	609.00	15,225,000	
鳥越製粉	4,600	809.00	3,721,400	
中部飼料	5,900	1,154.00	6,808,600	
フィード・ワン	36,100	180.00	6,498,000	
東洋精糖	9,000	119.00	1,071,000	

日本甜菜製糖	2,900	2,461.00	7,136,900	
三井製糖	4,200	2,658.00	11,163,600	
塩水港精糖	6,800	256.00	1,740,800	
日新製糖	2,400	1,836.00	4,406,400	
ネクスト	13,900	738.00	10,258,200	
ジェイエイシーリクルートメント	3,600	1,547.00	5,569,200	
日本M&Aセンター	16,000	3,435.00	54,960,000	
アコーディア・ゴルフ	2,800	1,206.00	3,376,800	
中広	500	695.00	347,500	
タケエイ	4,600	1,025.00	4,715,000	
トラスト・テック	2,000	1,720.00	3,440,000	
コシダカホールディングス	1,900	2,482.00	4,715,800	
パソナグループ	5,200	812.00	4,222,400	
CDS	1,000	1,005.00	1,005,000	
リンクアンドモチベーション	13,100	436.00	5,711,600	
GCA	5,300	955.00	5,061,500	
エス・エム・エス	7,000	2,566.00	17,962,000	
テンプホールディングス	42,800	1,937.00	82,903,600	
リニカル	3,200	1,443.00	4,617,600	
クックパッド	12,300	975.00	11,992,500	
エスクリ	2,000	761.00	1,522,000	
アイ・ケイ・ケイ	2,800	718.00	2,010,400	
森永製菓	11,700	4,710.00	55,107,000	
中村屋	1,500	5,130.00	7,695,000	
江崎グリコ	15,000	5,300.00	79,500,000	
名糖産業	2,900	1,389.00	4,028,100	
不二家	36,000	223.00	8,028,000	
山崎製パン	43,600	2,224.00	96,966,400	
第一屋製パン	10,000	126.00	1,260,000	
モロゾフ	9,000	508.00	4,572,000	
亀田製菓	3,400	4,965.00	16,881,000	
寿スピリッツ	4,200	2,594.00	10,894,800	
カルビー	24,300	3,750.00	91,125,000	
森永乳業	54,000	740.00	39,960,000	
六甲バター	2,600	2,451.00	6,372,600	
ヤクルト本社	31,900	6,270.00	200,013,000	
明治ホールディングス	35,300	8,670.00	306,051,000	
雪印メグミルク	12,800	2,947.00	37,721,600	
プリマハム	38,000	449.00	17,062,000	
日本ハム	40,000	3,065.00	122,600,000	
林兼産業	1,900	877.00	1,666,300	
丸大食品	28,000	497.00	13,916,000	
S Foods	3,200	3,240.00	10,368,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	34,200	1,094.00	37,414,800	
学情	2,000	1,204.00	2,408,000	
スタジオアリス	2,300	2,249.00	5,172,700	
シミックホールディングス	3,000	1,487.00	4,461,000	
システナ	4,200	1,630.00	6,846,000	
NJS	1,300	1,398.00	1,817,400	

デジタルアーツ	2,300	3,310.00	7,613,000	
新日鉄住金ソリューションズ	8,900	2,285.00	20,336,500	
総合警備保障	20,200	4,330.00	87,466,000	
キューブシステム	2,600	684.00	1,778,400	
いちご	50,600	366.00	18,519,600	
日本駐車場開発	66,600	153.00	10,189,800	
コア	2,100	1,385.00	2,908,500	
カカクコム	39,500	1,613.00	63,713,500	
アイロムグループ	1,600	1,332.00	2,131,200	
セントケア・ホールディング	700	1,681.00	1,176,700	
サイネックス	400	1,185.00	474,000	
ルネサンス	2,900	1,704.00	4,941,600	
ディップ	7,400	2,321.00	17,175,400	
SBSホールディングス	5,300	833.00	4,414,900	
オプトホールディング	3,000	931.00	2,793,000	
新日本科学	5,900	562.00	3,315,800	
ツクイ	14,000	683.00	9,562,000	
キャリアデザインセンター	1,500	1,163.00	1,744,500	
エムスリー	48,000	2,845.00	136,560,000	
ツカダ・グローバルホールディング	3,900	623.00	2,429,700	
アウトソーシング	3,300	3,735.00	12,325,500	
ウェルネット	4,400	1,293.00	5,689,200	
ワールドホールディングス	1,400	1,930.00	2,702,000	
ディー・エヌ・エー	25,100	2,463.00	61,821,300	
博報堂DYホールディングス	76,900	1,337.00	102,815,300	
ぐるなび	8,300	2,217.00	18,401,100	
エスアールジータカミヤ	6,500	585.00	3,802,500	
ジャパンベストレスキューシステム	5,000	253.00	1,265,000	
ファンコミュニケーションズ	13,600	775.00	10,540,000	
ライク	1,400	2,450.00	3,430,000	
ビジネス・ブレークスルー	1,800	448.00	806,400	
WDBホールディングス	2,100	1,368.00	2,872,800	
ティア	2,700	696.00	1,879,200	
バリューコマース	4,700	384.00	1,804,800	
インフォマート	23,400	593.00	13,876,200	
サッポロホールディングス	19,500	2,851.00	55,594,500	
アサヒグループホールディングス	111,700	4,110.00	459,087,000	
麒麟ホールディングス	256,400	1,908.50	489,339,400	
宝ホールディングス	43,500	1,109.00	48,241,500	
オエノンホールディングス	15,000	265.00	3,975,000	
養命酒製造	2,000	1,870.00	3,740,000	
コカ・コーラウエスト	20,100	3,165.00	63,616,500	
コカ・コーライーストジャパン	23,100	2,357.00	54,446,700	
サントリー食品インターナショナル	40,800	4,650.00	189,720,000	
ダイドーグループホールディングス	2,800	5,640.00	15,792,000	
伊藤園	17,600	3,705.00	65,208,000	
キーコーヒー	5,200	2,197.00	11,424,400	
ユニカフェ	1,600	976.00	1,561,600	
ジャパンフーズ	800	1,382.00	1,105,600	

日清オイリオグループ	33,000	580.00	19,140,000	
不二製油グループ本社	16,000	2,419.00	38,704,000	
かどや製油	600	4,685.00	2,811,000	
Jーオイルミルズ	2,500	4,100.00	10,250,000	
ローソン	18,100	8,010.00	144,981,000	
サンエー	3,700	5,170.00	19,129,000	
カワチ薬品	4,000	2,997.00	11,988,000	
エービーシー・マート	9,600	6,710.00	64,416,000	
ハードオフコーポレーション	2,500	1,171.00	2,927,500	
高千穂交易	1,900	1,054.00	2,002,600	
アスクル	6,400	3,315.00	21,216,000	
ゲオホールディングス	9,200	1,365.00	12,558,000	
アダストリア	8,000	2,956.00	23,648,000	
ジーフット	3,100	819.00	2,538,900	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	800	730.00	584,000	
伊藤忠食品	1,400	4,515.00	6,321,000	
くらコーポレーション	3,500	4,640.00	16,240,000	
キャンドウ	2,800	1,814.00	5,079,200	
エレマテック	2,400	1,962.00	4,708,800	
パルグループホールディングス	2,700	2,779.00	7,503,300	
JALUX	1,500	2,218.00	3,327,000	
エディオン	20,700	1,030.00	21,321,000	
あらた	2,300	2,839.00	6,529,700	
サーラコーポレーション	6,600	625.00	4,125,000	
ワッツ	2,100	1,297.00	2,723,700	
トーマンデバイス	800	2,160.00	1,728,000	
ハローズ	1,500	2,359.00	3,538,500	
J Pホールディングス	14,800	258.00	3,818,400	
あみやき亭	1,100	4,070.00	4,477,000	
東京エレクトロン デバイス	1,800	1,599.00	2,878,200	
ひらまつ	7,800	660.00	5,148,000	
フィールズ	4,000	1,250.00	5,000,000	
双日	309,400	292.00	90,344,800	
ゲンキー	1,000	6,440.00	6,440,000	
アルフレッサ ホールディングス	62,000	1,999.00	123,938,000	
大黒天物産	1,300	5,030.00	6,539,000	
ハニーズホールディングス	4,900	1,113.00	5,453,700	
ファーマライズホールディングス	800	515.00	412,000	
キッコーマン	42,000	3,395.00	142,590,000	
味の素	122,600	2,319.50	284,370,700	
キューピー	30,300	2,942.00	89,142,600	
ハウス食品グループ本社	22,200	2,392.00	53,102,400	
カゴメ	21,300	2,878.00	61,301,400	
焼津水産化学工業	2,500	1,229.00	3,072,500	
アリアケジャパン	4,900	6,240.00	30,576,000	
ピエトロ	500	1,655.00	827,500	
エバラ食品工業	1,600	2,099.00	3,358,400	
ニチレイ	29,200	2,565.00	74,898,000	
横浜冷凍	13,200	1,055.00	13,926,000	

東洋水産	29,200	3,980.00	116,216,000	
イトアアンド	800	2,287.00	1,829,600	
大冷	400	1,805.00	722,000	
日清食品ホールディングス	23,200	6,140.00	142,448,000	
永谷園ホールディングス	6,000	1,425.00	8,550,000	
一正蒲鉾	2,100	1,182.00	2,482,200	
フジッコ	5,700	2,450.00	13,965,000	
ロック・フィールド	6,600	1,690.00	11,154,000	
日本たばこ産業	330,000	3,774.00	1,245,420,000	
ケンコーマヨネーズ	2,200	2,710.00	5,962,000	
わらべや日洋ホールディングス	3,400	2,553.00	8,680,200	
なとり	3,200	1,865.00	5,968,000	
北の達人コーポレーション	800	648.00	518,400	
ユーグレナ	19,600	1,240.00	24,304,000	
片倉工業	7,400	1,511.00	11,181,400	
グンゼ	42,000	422.00	17,724,000	
ヒューリック	109,300	1,088.00	118,918,400	
神栄	9,000	179.00	1,611,000	
山下医科器械	400	1,797.00	718,800	
ラサ商事	2,200	696.00	1,531,200	
アルペン	4,600	1,964.00	9,034,400	
ラクーン	2,400	508.00	1,219,200	
クオール	5,700	1,534.00	8,743,800	
アルコニックス	3,200	1,779.00	5,692,800	
神戸物産	2,900	3,755.00	10,889,500	
ジェイアイエヌ	3,500	5,970.00	20,895,000	
ビックカメラ	30,000	1,074.00	32,220,000	
DCMホールディングス	31,400	993.00	31,180,200	
MonotaRO	18,500	3,235.00	59,847,500	
東京一番フーズ	700	586.00	410,200	
ダイヤモンドダイニング	700	1,677.00	1,173,900	
あい ホールディングス	7,500	2,249.00	16,867,500	
ディービーエックス	1,600	1,264.00	2,022,400	
きちり	1,200	660.00	792,000	
アークランドサービスホールディングス	1,800	3,205.00	5,769,000	
J. フロント リテイリング	66,300	1,720.00	114,036,000	
ドトール・日レスホールディングス	9,300	2,239.00	20,822,700	
マツモトキョシホールディングス	9,900	5,280.00	52,272,000	
ブロンコビリー	2,900	2,804.00	8,131,600	
スタートトゥデイ	47,800	2,487.00	118,878,600	
トレジャー・ファクトリー	1,200	840.00	1,008,000	
物語コーポレーション	1,500	4,460.00	6,690,000	
ココカラファイン	5,600	4,680.00	26,208,000	
三越伊勢丹ホールディングス	104,300	1,383.00	144,246,900	
東洋紡	220,000	197.00	43,340,000	
ユニチカ	154,000	90.00	13,860,000	
富士紡ホールディングス	2,700	3,365.00	9,085,500	
日清紡ホールディングス	29,400	1,156.00	33,986,400	
倉敷紡績	58,000	237.00	13,746,000	

ダイワボウホールディングス	45,000	295.00	13,275,000	
シキボウ	31,000	153.00	4,743,000	
日東紡績	46,000	506.00	23,276,000	
トヨタ紡織	18,500	2,452.00	45,362,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	9,900	1,685.00	16,681,500	
Hame e	600	954.00	572,400	
ウエルシアホールディングス	5,200	6,290.00	32,708,000	
クリエイトSDホールディングス	7,900	2,572.00	20,318,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,700	1,014.00	9,835,800	
八洲電機	4,500	644.00	2,898,000	
UKCホールディングス	3,600	2,238.00	8,056,800	
丸善CHIホールディングス	6,800	364.00	2,475,200	
OCHIホールディングス	1,400	1,358.00	1,901,200	
TOKAIホールディングス	23,400	838.00	19,609,200	
ミサワ	500	462.00	231,000	
ティーライフ	500	1,460.00	730,000	
大阪工機	800	731.00	584,800	
エー・ピーカンパニー	800	822.00	657,600	
三洋貿易	3,000	1,817.00	5,451,000	
チムニー	1,300	2,859.00	3,716,700	
シュッピン	2,400	1,470.00	3,528,000	
ビューティガレージ	400	1,165.00	466,000	
ウイン・パートナーズ	3,600	988.00	3,556,800	
ネクステージ	400	2,832.00	1,132,800	
ジョイフル本田	8,500	3,465.00	29,452,500	
鳥貴族	1,400	2,427.00	3,397,800	
麒麟堂ホールディングス	1,500	853.00	1,279,500	
ホットランド	1,400	1,032.00	1,444,800	
すかいらく	22,900	1,604.00	36,731,600	
綿半ホールディングス	1,900	1,621.00	3,079,900	
日本毛織	16,100	905.00	14,570,500	
ダイトウボウ	12,000	75.00	900,000	
トーア紡コーポレーション	2,700	543.00	1,466,100	
ダイドーリミテッド	5,500	453.00	2,491,500	
ヨシックス	500	1,321.00	660,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18,000	1,010.00	18,180,000	
三栄建築設計	2,100	1,566.00	3,288,600	
野村不動産ホールディングス	34,800	1,925.00	66,990,000	
三重交通グループホールディングス	10,000	390.00	3,900,000	
サムティ	4,100	1,195.00	4,899,500	
ディア・ライフ	2,600	402.00	1,045,200	
エー・ディー・ワークス	52,800	43.00	2,270,400	
日本商業開発	2,500	1,942.00	4,855,000	
プレサンスコーポレーション	7,600	1,407.00	10,693,200	
ユニゾホールディングス	3,900	3,095.00	12,070,500	
THEグローバル社	1,700	454.00	771,800	
日本管理センター	3,500	1,387.00	4,854,500	
サンセイランディック	1,400	758.00	1,061,200	

エストラスト	600	774.00	464,400	
フージャースホールディングス	7,300	613.00	4,474,900	
オープンハウス	7,800	2,716.00	21,184,800	
東急不動産ホールディングス	126,700	655.00	82,988,500	
飯田グループホールディングス	43,700	1,819.00	79,490,300	
ムゲンエステート	1,600	723.00	1,156,800	
帝国繊維	6,200	1,699.00	10,533,800	
ブックオフコーポレーション	2,600	857.00	2,228,200	
日本コークス工業	42,200	104.00	4,388,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,100	790.00	869,000	
ミタチ産業	1,200	646.00	775,200	
BEENOS	600	1,470.00	882,000	
あさひ	4,200	1,311.00	5,506,200	
日本調剤	1,900	3,730.00	7,087,000	
コスモス薬品	2,600	21,210.00	55,146,000	
シップヘルスケアホールディングス	10,200	2,978.00	30,375,600	
トーエル	2,900	929.00	2,694,100	
一六堂	1,200	406.00	487,200	
ソフトクリエイトホールディングス	2,700	1,335.00	3,604,500	
オンリー	500	820.00	410,000	
セブン&アイ・ホールディングス	219,500	4,401.00	966,019,500	
薬王堂	2,600	2,428.00	6,312,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	14,300	1,031.00	14,743,300	
明治電機工業	1,500	1,227.00	1,840,500	
ツルハホールディングス	10,500	10,480.00	110,040,000	
デリカフーズ	1,100	1,061.00	1,167,100	
スターティア	1,000	552.00	552,000	
サンマルクホールディングス	3,400	3,490.00	11,866,000	
フェリシモ	1,500	1,034.00	1,551,000	
トリドールホールディングス	6,500	2,366.00	15,379,000	
帝人	45,500	2,159.00	98,234,500	
東レ	404,000	972.50	392,890,000	
クラレ	93,600	1,717.00	160,711,200	
旭化成	347,000	1,095.00	379,965,000	
サカイオーベックス	1,300	1,960.00	2,548,000	
稲葉製作所	2,700	1,331.00	3,593,700	
宮地エンジニアリンググループ	15,000	241.00	3,615,000	
トーカロ	3,700	2,722.00	10,071,400	
アルファC o	2,000	1,359.00	2,718,000	
SUMCO	58,000	1,777.00	103,066,000	
川田テクノロジーズ	1,100	7,830.00	8,613,000	
R S T e c h n o l o g i e s	200	5,950.00	1,190,000	
ファーストブラザーズ	500	1,708.00	854,000	
ハウスドゥ	600	1,428.00	856,800	
シーアールイー	600	1,683.00	1,009,800	
ケイアイスター不動産	1,100	1,601.00	1,761,100	
住江織物	14,000	291.00	4,074,000	
日本フエルト	3,100	524.00	1,624,400	
イチカワ	3,000	301.00	903,000	

エコナックホールディングス	18,000	56.00	1,008,000	
日東製網	700	1,931.00	1,351,700	
芦森工業	13,000	170.00	2,210,000	
アツギ	41,000	127.00	5,207,000	
コメダホールディングス	7,400	1,925.00	14,245,000	
サツドラホールディングス	800	2,008.00	1,606,400	
ダイユー・リックホールディングス	1,200	793.00	951,600	
パロックジャパンリミテッド	3,000	1,405.00	4,215,000	
クスリのアオキホールディングス	4,800	4,775.00	22,920,000	
ダイニック	11,000	193.00	2,123,000	
共和レザー	3,700	926.00	3,426,200	
セーレン	14,100	1,579.00	22,263,900	
ソトー	2,200	1,166.00	2,565,200	
東海染工	8,000	147.00	1,176,000	
小松精練	8,200	735.00	6,027,000	
ワコールホールディングス	33,000	1,420.00	46,860,000	
ホギメディカル	3,500	6,770.00	23,695,000	
レナウン	14,200	114.00	1,618,800	
クラウドシア	1,300	549.00	713,700	
T S Iホールディングス	23,200	826.00	19,163,200	
T I S	17,500	2,696.00	47,180,000	
ネオス	1,300	457.00	594,100	
電算システム	1,900	1,705.00	3,239,500	
グリー	32,400	674.00	21,837,600	
コーエーテクモホールディングス	12,400	2,180.00	27,032,000	
三菱総合研究所	2,200	3,185.00	7,007,000	
ボルテージ	900	1,005.00	904,500	
電算	600	2,433.00	1,459,800	
A G S	1,000	1,916.00	1,916,000	
ファインデックス	3,400	963.00	3,274,200	
ヒト・コミュニケーションズ	1,200	1,675.00	2,010,000	
ブレインパッド	700	1,189.00	832,300	
K L a b	8,700	808.00	7,029,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	3,300	1,097.00	3,620,100	
イーブックイニシアティブジャパン	1,200	945.00	1,134,000	
ネクソン	57,600	1,925.00	110,880,000	
アイスタイル	8,600	979.00	8,419,400	
エムアップ	1,400	901.00	1,261,400	
エイチーム	2,900	2,136.00	6,194,400	
テクノスジャパン	2,400	1,240.00	2,976,000	
e n i s h	1,500	586.00	879,000	
コロプラ	15,000	1,025.00	15,375,000	
モバイルクリエイト	3,000	407.00	1,221,000	
オルトプラス	1,100	837.00	920,700	
ブロードリーフ	12,200	633.00	7,722,600	
ハーツユナイテッドグループ	3,000	1,504.00	4,512,000	
メディアドゥ	1,200	1,716.00	2,059,200	
ブイキューブ	3,400	622.00	2,114,800	
サイバーリンクス	500	1,045.00	522,500	

ディー・エル・イー	1,500	623.00	934,500	
フィックスターズ	700	3,650.00	2,555,000	
VOYAGE GROUP	2,200	1,651.00	3,632,200	
オプティム	300	5,260.00	1,578,000	
セレス	900	1,682.00	1,513,800	
特種東海製紙	3,200	4,205.00	13,456,000	
ベリサーブ	500	2,967.00	1,483,500	
ティーガイア	5,200	1,866.00	9,703,200	
日本アジアグループ	6,400	413.00	2,643,200	
豆蔵ホールディングス	3,800	885.00	3,363,000	
テクマトリックス	1,600	2,573.00	4,116,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	111,900	256.00	28,646,400	
GMOペイメントゲートウェイ	4,400	6,480.00	28,512,000	
ザッパラス	3,100	457.00	1,416,700	
システムリサーチ	500	2,169.00	1,084,500	
インターネットイニシアティブ	7,800	2,026.00	15,802,800	
さくらインターネット	3,700	1,138.00	4,210,600	
GMOクラウド	1,200	1,827.00	2,192,400	
SRAホールディングス	2,700	2,795.00	7,546,500	
M i n o r i ソリューションズ	700	1,212.00	848,400	
システムインテグレータ	400	692.00	276,800	
朝日ネット	5,100	525.00	2,677,500	
アドソル日進	1,100	1,301.00	1,431,100	
フリービット	2,700	973.00	2,627,100	
コムチュア	900	3,520.00	3,168,000	
サイバーコム	600	1,028.00	616,800	
王子ホールディングス	217,000	520.00	112,840,000	
日本製紙	25,200	1,981.00	49,921,200	
三菱製紙	7,800	760.00	5,928,000	
北越紀州製紙	31,600	751.00	23,731,600	
中越パルプ工業	22,000	242.00	5,324,000	
巴川製紙所	9,000	251.00	2,259,000	
大王製紙	22,600	1,295.00	29,267,000	
阿波製紙	1,000	606.00	606,000	
メディカル・データ・ビジョン	900	2,679.00	2,411,100	
g u m i	5,400	1,254.00	6,771,600	
ショーケース・ティービー	600	1,418.00	850,800	
P C I ホールディングス	600	2,876.00	1,725,600	
パイプドHD	400	1,109.00	443,600	
アイビーシー	400	1,007.00	402,800	
オープンドア	500	3,210.00	1,605,000	
L I N E	8,600	3,540.00	30,444,000	
レンゴー	54,100	651.00	35,219,100	
トーモク	19,000	335.00	6,365,000	
ザ・バック	3,900	3,075.00	11,992,500	
AOI TYO Holdings	4,000	842.00	3,368,000	
昭和電工	37,000	1,982.00	73,334,000	
住友化学	410,000	638.00	261,580,000	
住友精化	2,400	4,725.00	11,340,000	

日産化学工業	30,500	3,915.00	119,407,500	
ラサ工業	18,000	147.00	2,646,000	
クレハ	4,300	4,860.00	20,898,000	
多木化学	3,000	944.00	2,832,000	
テイカ	9,000	725.00	6,525,000	
石原産業	9,900	1,120.00	11,088,000	
片倉コープアグリ	7,000	239.00	1,673,000	
日東エフシー	3,300	957.00	3,158,100	
日本曹達	34,000	670.00	22,780,000	
東ソー	161,000	1,004.00	161,644,000	
トクヤマ	86,000	573.00	49,278,000	
セントラル硝子	57,000	547.00	31,179,000	
東亜合成	35,100	1,272.00	44,647,200	
大阪ソーダ	24,000	495.00	11,880,000	
関東電化工業	12,000	1,159.00	13,908,000	
デンカ	116,000	610.00	70,760,000	
イビデン	37,500	1,919.00	71,962,500	
信越化学工業	99,800	9,865.00	984,527,000	
日本カーバイド工業	18,000	162.00	2,916,000	
堺化学工業	21,000	411.00	8,631,000	
エア・ウォーター	45,900	2,162.00	99,235,800	
大陽日酸	43,300	1,426.00	61,745,800	
日本化学工業	20,000	241.00	4,820,000	
日本パーカライジング	28,700	1,408.00	40,409,600	
高圧ガス工業	8,000	765.00	6,120,000	
チタン工業	7,000	190.00	1,330,000	
四国化成工業	8,000	1,185.00	9,480,000	
戸田工業	10,000	285.00	2,850,000	
ステラ ケミファ	2,600	3,430.00	8,918,000	
保土谷化学工業	1,800	3,650.00	6,570,000	
日本触媒	8,800	7,470.00	65,736,000	
大日精化工業	23,000	724.00	16,652,000	
カネカ	75,000	900.00	67,500,000	
協和発酵キリン	66,500	1,639.00	108,993,500	
三菱瓦斯化学	51,800	2,325.00	120,435,000	
三井化学	253,000	553.00	139,909,000	
J S R	55,900	2,019.00	112,862,100	
東京応化工業	10,400	3,785.00	39,364,000	
大阪有機化学工業	4,100	972.00	3,985,200	
三菱ケミカルホールディングス	375,000	859.30	322,237,500	
KHネオケム	6,900	1,340.00	9,246,000	
ダイセル	75,000	1,401.00	105,075,000	
住友ベークライト	49,000	665.00	32,585,000	
積水化学工業	126,300	1,875.00	236,812,500	
日本ゼオン	47,000	1,298.00	61,006,000	
アイカ工業	18,000	2,898.00	52,164,000	
宇部興産	280,000	285.00	79,800,000	
積水樹脂	8,700	1,882.00	16,373,400	
タキロン	12,000	544.00	6,528,000	

旭有機材	17,000	242.00	4,114,000	
日立化成	30,900	3,225.00	99,652,500	
ニチバン	5,000	930.00	4,650,000	
リケンテクノス	12,800	547.00	7,001,600	
大倉工業	13,000	564.00	7,332,000	
積水化成品工業	7,000	830.00	5,810,000	
群栄化学工業	1,300	3,785.00	4,920,500	
タイガースポリマー	3,000	802.00	2,406,000	
ミライアル	2,200	940.00	2,068,000	
ダイキアクシス	600	1,342.00	805,200	
ダイキョーニシカワ	10,000	1,454.00	14,540,000	
日本化薬	36,000	1,581.00	56,916,000	
カーリットホールディングス	5,000	594.00	2,970,000	
E P Sホールディングス	7,300	1,525.00	11,132,500	
ソルクシーズ	1,800	548.00	986,400	
レッグス	800	805.00	644,000	
プレステージ・インターナショナル	7,900	890.00	7,031,000	
フェイス	1,600	1,349.00	2,158,400	
ハイマックス	600	1,491.00	894,600	
アミューズ	3,200	2,023.00	6,473,600	
野村総合研究所	39,100	3,895.00	152,294,500	
ドリームインキュベータ	1,700	2,121.00	3,605,700	
サイバネットシステム	4,600	823.00	3,785,800	
クイック	2,800	1,164.00	3,259,200	
T A C	2,500	229.00	572,500	
C Eホールディングス	800	1,135.00	908,000	
ケネディクス	74,300	441.00	32,766,300	
電通	61,900	5,970.00	369,543,000	
インテージホールディングス	2,600	2,172.00	5,647,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,300	957.00	2,201,100	
東邦システムサイエンス	2,000	647.00	1,294,000	
びあ	1,600	2,922.00	4,675,200	
イオンファンタジー	1,600	3,120.00	4,992,000	
ソースネクスト	2,800	651.00	1,822,800	
シーティーエス	1,300	1,555.00	2,021,500	
ネクシィーズグループ	1,900	1,589.00	3,019,100	
メディカルシステムネットワーク	5,200	454.00	2,360,800	
日本精化	4,500	947.00	4,261,500	
扶桑化学工業	3,800	3,140.00	11,932,000	
A D E K A	24,100	1,562.00	37,644,200	
日油	45,000	1,264.00	56,880,000	
ミヨシ油脂	22,000	142.00	3,124,000	
新日本理化	8,200	153.00	1,254,600	
ハリマ化成グループ	4,100	787.00	3,226,700	
花王	141,400	5,727.00	809,797,800	
第一工業製薬	13,000	454.00	5,902,000	
日華化学	1,800	1,288.00	2,318,400	
ニイタカ	800	1,505.00	1,204,000	
三洋化成工業	3,600	4,710.00	16,956,000	

武田薬品工業	208,700	5,242.00	1,094,005,400	
アステラス製薬	568,600	1,513.00	860,291,800	
大日本住友製薬	39,300	1,967.00	77,303,100	
塩野義製薬	75,300	5,490.00	413,397,000	
田辺三菱製薬	64,800	2,295.00	148,716,000	
わかもと製薬	7,000	255.00	1,785,000	
あすか製薬	6,100	1,720.00	10,492,000	
日本新薬	12,700	6,110.00	77,597,000	
バイオフェルミン製薬	900	3,085.00	2,776,500	
中外製薬	55,400	3,840.00	212,736,000	
科研製薬	10,400	5,890.00	61,256,000	
エーザイ	68,500	6,114.00	418,809,000	
理研ビタミン	1,500	4,340.00	6,510,000	
ロート製薬	27,500	2,194.00	60,335,000	
小野薬品工業	126,400	2,523.00	318,907,200	
久光製薬	15,700	6,130.00	96,241,000	
有機合成薬品工業	3,000	273.00	819,000	
持田製薬	3,800	8,430.00	32,034,000	
参天製薬	102,500	1,623.00	166,357,500	
扶桑薬品工業	2,000	2,869.00	5,738,000	
日本ケミファ	700	5,540.00	3,878,000	
ツムラ	18,600	3,390.00	63,054,000	
日医工	12,900	1,724.00	22,239,600	
テルモ	81,400	3,895.00	317,053,000	
みらかホールディングス	14,200	5,070.00	71,994,000	
キッセイ薬品工業	9,800	2,864.00	28,067,200	
生化学工業	10,600	1,727.00	18,306,200	
栄研化学	4,700	3,040.00	14,288,000	
日水製薬	2,200	1,367.00	3,007,400	
鳥居薬品	4,000	2,909.00	11,636,000	
J C Rファーマ	4,300	2,856.00	12,280,800	
東和薬品	2,500	5,260.00	13,150,000	
富士製薬工業	1,900	3,085.00	5,861,500	
沢井製薬	9,400	6,130.00	57,622,000	
ゼリア新薬工業	11,700	1,706.00	19,960,200	
第一三共	163,800	2,563.50	419,901,300	
キョーリン製薬ホールディングス	13,800	2,359.00	32,554,200	
大幸薬品	3,000	1,797.00	5,391,000	
ダイト	3,300	2,275.00	7,507,500	
大塚ホールディングス	119,700	5,155.00	617,053,500	
大正製薬ホールディングス	11,900	9,230.00	109,837,000	
ペプチドリーム	10,400	5,330.00	55,432,000	
大日本塗料	34,000	233.00	7,922,000	
日本ペイントホールディングス	42,900	3,595.00	154,225,500	
関西ペイント	58,400	2,200.00	128,480,000	
神東塗料	2,000	222.00	444,000	
中国塗料	15,800	854.00	13,493,200	
日本特殊塗料	4,200	1,753.00	7,362,600	
藤倉化成	7,400	682.00	5,046,800	

太陽ホールディングス	4,300	4,775.00	20,532,500	
D I C	22,000	3,950.00	86,900,000	
サカタインクス	11,500	1,614.00	18,561,000	
東洋インキ S Cホールディングス	56,000	555.00	31,080,000	
T & K T O K A	4,400	1,082.00	4,760,800	
アルプス技研	2,200	3,055.00	6,721,000	
サニックス	7,100	188.00	1,334,800	
ダイオーズ	1,100	1,074.00	1,181,400	
日本空調サービス	4,800	666.00	3,196,800	
オリエンタルランド	60,000	6,317.00	379,020,000	
フォーカスシステムズ	2,100	588.00	1,234,800	
ダスキン	14,500	2,441.00	35,394,500	
パーク 2 4	26,500	3,095.00	82,017,500	
明光ネットワークジャパン	6,900	1,209.00	8,342,100	
ファルコホールディングス	2,400	1,495.00	3,588,000	
クレスコ	1,200	2,493.00	2,991,600	
フジ・メディア・ホールディングス	54,600	1,537.00	83,920,200	
秀英予備校	1,000	481.00	481,000	
田谷	800	671.00	536,800	
ラウンドワン	17,400	880.00	15,312,000	
リゾートトラスト	21,400	2,201.00	47,101,400	
オービック	18,100	5,350.00	96,835,000	
ジャストシステム	8,500	1,215.00	10,327,500	
T D C ソフトウェアエンジニアリング	2,200	1,246.00	2,741,200	
ヤフー	375,700	527.00	197,993,900	
ビー・エム・エル	6,700	2,477.00	16,595,900	
ワタベウェディング	1,600	573.00	916,800	
トレンドマイクロ	27,800	4,840.00	134,552,000	
りらいあコミュニケーションズ	9,100	1,090.00	9,919,000	
インフォメーション・ディベロプメント	1,900	1,169.00	2,221,100	
リソー教育	9,400	626.00	5,884,400	
日本オラクル	8,400	6,600.00	55,440,000	
早稲田アカデミー	900	1,198.00	1,078,200	
アルファシステムズ	1,500	1,975.00	2,962,500	
フューチャー	6,100	899.00	5,483,900	
C A C H o l d i n g s	4,000	1,085.00	4,340,000	
ソフトバンク・テクノロジー	1,300	4,125.00	5,362,500	
トーセ	1,200	829.00	994,800	
ユー・エス・エス	67,100	1,933.00	129,704,300	
オービックビジネスコンサルタント	2,600	5,560.00	14,456,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	11,800	3,150.00	37,170,000	
アイティフォー	6,000	655.00	3,930,000	
東京個別指導学院	1,600	1,034.00	1,654,400	
東計電算	1,000	2,215.00	2,215,000	
サイバーエージェント	29,200	3,010.00	87,892,000	
楽天	283,500	1,028.00	291,438,000	
エックスネット	500	2,062.00	1,031,000	
クリーク・アンド・リバー社	2,200	1,085.00	2,387,000	
テー・オー・ダブリュー	4,800	685.00	3,288,000	

大塚商会	14,200	5,890.00	83,638,000	
総合メディカル	2,500	3,995.00	9,987,500	
サイボウズ	7,100	443.00	3,145,300	
ソフトブレーン	7,300	456.00	3,328,800	
セントラルスポーツ	1,900	3,580.00	6,802,000	
パラカ	1,600	1,990.00	3,184,000	
電通国際情報サービス	3,500	2,219.00	7,766,500	
デジタルガレージ	8,400	2,062.00	17,320,800	
EMシステムズ	1,800	1,627.00	2,928,600	
ウェザーニューズ	1,700	3,565.00	6,060,500	
C I J	4,700	532.00	2,500,400	
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,546.00	1,082,200	
日本エンタープライズ	4,000	281.00	1,124,000	
WOWOW	2,400	3,670.00	8,808,000	
スカラ	3,600	857.00	3,085,200	
フルキャストホールディングス	5,100	1,074.00	5,477,400	
富士フイルムホールディングス	110,400	4,360.00	481,344,000	
コニカミノルタ	124,300	1,105.00	137,351,500	
資生堂	105,600	2,873.00	303,388,800	
ライオン	69,000	1,874.00	129,306,000	
高砂香料工業	3,600	3,605.00	12,978,000	
マンダム	5,300	5,200.00	27,560,000	
ミルボン	3,100	5,290.00	16,399,000	
ファンケル	12,000	1,614.00	19,368,000	
コーセー	9,000	9,190.00	82,710,000	
コタ	2,000	1,328.00	2,656,000	
シーズ・ホールディングス	7,400	3,115.00	23,051,000	
シーボン	600	2,555.00	1,533,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	5,700	10,920.00	62,244,000	
ノエビアホールディングス	3,500	4,280.00	14,980,000	
アジュバンコスメジャパン	800	974.00	779,200	
エステー	3,800	1,732.00	6,581,600	
アグロ カネショウ	2,400	1,310.00	3,144,000	
コニシ	9,200	1,360.00	12,512,000	
長谷川香料	7,100	1,957.00	13,894,700	
星光PMC	2,900	1,132.00	3,282,800	
小林製薬	15,400	5,210.00	80,234,000	
荒川化学工業	5,100	2,042.00	10,414,200	
メック	4,100	1,238.00	5,075,800	
日本高純度化学	1,400	2,480.00	3,472,000	
タカラバイオ	12,100	1,544.00	18,682,400	
J C U	1,700	7,500.00	12,750,000	
新田ゼラチン	3,100	755.00	2,340,500	
O A Tアグリオ	400	1,468.00	587,200	
デクセリアルズ	14,800	1,288.00	19,062,400	
アース製薬	4,100	5,110.00	20,951,000	
イハラケミカル工業	7,900	1,055.00	8,334,500	
北興化学工業	6,000	485.00	2,910,000	
大成ラミック	1,700	3,145.00	5,346,500	

クミアイ化学工業	12,200	673.00	8,210,600	
日本農薬	13,600	700.00	9,520,000	
昭和シェル石油	50,200	1,084.00	54,416,800	
富士興産	2,400	495.00	1,188,000	
ニチレキ	7,300	915.00	6,679,500	
東燃ゼネラル石油	91,000	1,317.00	119,847,000	
ユシロ化学工業	3,200	1,452.00	4,646,400	
ビービー・カストロール	2,000	1,651.00	3,302,000	
富士石油	13,200	394.00	5,200,800	
MORESCO	1,400	1,752.00	2,452,800	
出光興産	26,600	3,555.00	94,563,000	
JXホールディングス	617,500	527.00	325,422,500	
コスモエネルギーホールディングス	16,700	1,933.00	32,281,100	
横浜ゴム	33,500	2,196.00	73,566,000	
東洋ゴム工業	29,600	1,707.00	50,527,200	
ブリヂストン	187,800	4,549.00	854,302,200	
住友ゴム工業	52,000	1,811.00	94,172,000	
藤倉ゴム工業	4,000	709.00	2,836,000	
オカモト	17,000	1,029.00	17,493,000	
アキレス	4,900	1,826.00	8,947,400	
フコク	1,700	939.00	1,596,300	
ニッタ	5,100	2,990.00	15,249,000	
クリエートメディック	1,900	950.00	1,805,000	
住友理工	10,400	1,159.00	12,053,600	
三ツ星ベルト	14,000	1,005.00	14,070,000	
バンドー化学	10,200	1,062.00	10,832,400	
旭硝子	274,000	918.00	251,532,000	
日本板硝子	25,700	855.00	21,973,500	
石塚硝子	8,000	241.00	1,928,000	
有沢製作所	8,000	789.00	6,312,000	
日本山村硝子	22,000	204.00	4,488,000	
日本電気硝子	115,000	705.00	81,075,000	
オハラ	2,200	1,131.00	2,488,200	
住友大阪セメント	103,000	461.00	47,483,000	
太平洋セメント	335,000	409.00	137,015,000	
リソルホールディングス	5,000	350.00	1,750,000	
日本ヒューム	5,000	710.00	3,550,000	
日本コンクリート工業	12,500	343.00	4,287,500	
三谷セキサン	2,700	2,553.00	6,893,100	
アジアパイルホールディングス	6,400	579.00	3,705,600	
東海カーボン	51,000	468.00	23,868,000	
日本カーボン	29,000	299.00	8,671,000	
東洋炭素	3,300	1,953.00	6,444,900	
ノリタケカンパニーリミテド	3,300	2,925.00	9,652,500	
TOTO	40,900	4,220.00	172,598,000	
日本碍子	70,200	2,455.00	172,341,000	
日本特殊陶業	47,900	2,584.00	123,773,600	
ダントーホールディングス	6,000	191.00	1,146,000	
MARUWA	2,000	3,715.00	7,430,000	

品川リフラクトリーズ	14,000	302.00	4,228,000	
黒崎播磨	12,000	464.00	5,568,000	
ヨータイ	3,000	386.00	1,158,000	
イソライト工業	1,000	418.00	418,000	
東京窯業	7,000	209.00	1,463,000	
ニッカトー	1,900	425.00	807,500	
フジミインコーポレーテッド	4,800	2,589.00	12,427,200	
エーアンドエーマテリアル	15,000	134.00	2,010,000	
ニチアス	29,000	1,099.00	31,871,000	
新日鐵住金	250,900	2,818.00	707,036,200	
神戸製鋼所	96,100	1,139.00	109,457,900	
中山製鋼所	4,000	781.00	3,124,000	
合同製鐵	3,300	1,885.00	6,220,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	152,000	2,142.00	325,584,000	
日新製鋼	25,300	1,573.00	39,796,900	
東京製鐵	28,600	1,043.00	29,829,800	
共英製鋼	5,900	2,146.00	12,661,400	
大和工業	11,100	3,320.00	36,852,000	
東京鐵鋼	11,000	474.00	5,214,000	
大阪製鐵	3,700	2,194.00	8,117,800	
淀川製鋼所	7,800	3,360.00	26,208,000	
東洋鋼鈑	14,400	463.00	6,667,200	
丸一銅管	18,600	3,595.00	66,867,000	
モリ工業	1,800	2,319.00	4,174,200	
大同特殊鋼	94,000	570.00	53,580,000	
日本高周波鋼業	24,000	88.00	2,112,000	
日本冶金工業	43,900	232.00	10,184,800	
山陽特殊製鋼	34,000	614.00	20,876,000	
愛知製鋼	3,300	4,870.00	16,071,000	
日立金属	56,600	1,677.00	94,918,200	
日本金属	1,500	1,306.00	1,959,000	
大太平洋金属	36,000	417.00	15,012,000	
新日本電工	33,800	337.00	11,390,600	
栗本鐵工所	2,500	2,384.00	5,960,000	
虹技	9,000	253.00	2,277,000	
日本鑄鉄管	6,000	203.00	1,218,000	
日本製鋼所	18,500	2,026.00	37,481,000	
三菱製鋼	41,000	261.00	10,701,000	
日亜鋼業	7,300	285.00	2,080,500	
日本精線	4,000	611.00	2,444,000	
大紀アルミニウム工業所	8,000	531.00	4,248,000	
日本輕金属ホールディングス	125,500	286.00	35,893,000	
三井金属鉱業	152,000	381.00	57,912,000	
東邦亜鉛	31,000	635.00	19,685,000	
三菱マテリアル	34,700	3,840.00	133,248,000	
住友金属鉱山	144,000	1,618.50	233,064,000	
DOWAホールディングス	62,000	944.00	58,528,000	
古河機械金属	88,000	238.00	20,944,000	
エス・サイエンス	26,800	38.00	1,018,400	

大阪チタニウムテクノロジーズ	5,800	1,966.00	11,402,800	
東邦チタニウム	10,000	994.00	9,940,000	
U A C J	72,000	321.00	23,112,000	
古河電気工業	18,800	4,105.00	77,174,000	
住友電気工業	209,600	1,880.00	394,048,000	
フジクラ	73,100	853.00	62,354,300	
昭和電線ホールディングス	65,000	91.00	5,915,000	
東京特殊電線	800	1,572.00	1,257,600	
タツタ電線	10,900	461.00	5,024,900	
沖電線	6,000	249.00	1,494,000	
カナレ電気	1,000	2,258.00	2,258,000	
平河ヒューテック	2,600	1,119.00	2,909,400	
リョービ	34,000	511.00	17,374,000	
アーレスティ	6,900	1,180.00	8,142,000	
アサヒホールディングス	8,500	1,980.00	16,830,000	
東洋製罐グループホールディングス	39,500	2,070.00	81,765,000	
ホッカンホールディングス	14,000	545.00	7,630,000	
コロナ	2,800	1,164.00	3,259,200	
横河ブリッジホールディングス	9,900	1,404.00	13,899,600	
O S J Bホールディングス	11,700	251.00	2,936,700	
駒井ハルテック	1,000	2,092.00	2,092,000	
高田機工	6,000	243.00	1,458,000	
三和ホールディングス	55,100	1,085.00	59,783,500	
文化シャッター	15,400	861.00	13,259,400	
三協立山	7,500	1,767.00	13,252,500	
アルインコ	3,700	1,050.00	3,885,000	
東洋シャッター	1,500	648.00	972,000	
L I X I Lグループ	77,500	2,770.00	214,675,000	
日本ファイルコン	3,800	559.00	2,124,200	
ノーリツ	11,100	2,177.00	24,164,700	
長府製作所	6,000	2,724.00	16,344,000	
リンナイ	9,500	8,730.00	82,935,000	
ユニプレス	10,400	2,336.00	24,294,400	
ダイニチ工業	3,100	732.00	2,269,200	
日東精工	7,000	428.00	2,996,000	
三洋工業	7,000	198.00	1,386,000	
岡部	11,400	996.00	11,354,400	
ジーテクト	5,800	2,151.00	12,475,800	
中国工業	800	698.00	558,400	
東プレ	10,900	2,922.00	31,849,800	
高周波熱錬	11,000	918.00	10,098,000	
東京製綱	4,000	1,819.00	7,276,000	
サンコール	3,200	554.00	1,772,800	
モリテック スチール	2,800	300.00	840,000	
バイオラックス	2,800	7,790.00	21,812,000	
日本発條	52,300	1,290.00	67,467,000	
中央発條	8,000	340.00	2,720,000	
アドバネクス	1,100	1,899.00	2,088,900	
三浦工業	22,700	1,727.00	39,202,900	

タクマ	18,000	1,022.00	18,396,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,000	3,855.00	34,695,000	
アトラ	700	725.00	507,500	
インターワークス	700	1,128.00	789,600	
KeePer技研	700	2,155.00	1,508,500	
ファーストロジック	200	2,411.00	482,200	
デザインワン・ジャパン	300	2,850.00	855,000	
イー・ガーディアン	1,800	1,779.00	3,202,200	
リブセンス	3,600	441.00	1,587,600	
ジャパンマテリアル	4,000	1,523.00	6,092,000	
ベクトル	4,800	1,248.00	5,990,400	
ウチヤマホールディングス	2,400	439.00	1,053,600	
サクセスホールディングス	400	1,381.00	552,400	
キャリアリンク	1,200	735.00	882,000	
I B J	5,000	600.00	3,000,000	
アサンテ	2,000	1,736.00	3,472,000	
N・フィールド	2,900	1,471.00	4,265,900	
バリューHR	400	2,572.00	1,028,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	700	4,120.00	2,884,000	
ライドオン・エクスプレス	900	935.00	841,500	
E R Iホールディングス	1,500	825.00	1,237,500	
アビスト	500	3,960.00	1,980,000	
ウィルグループ	1,600	709.00	1,134,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,000	1,665.00	1,665,000	
日本ビューホテル	600	1,350.00	810,000	
リクルートホールディングス	121,300	5,330.00	646,529,000	
エラン	400	1,397.00	558,800	
ツガミ	15,000	692.00	10,380,000	
オークマ	36,000	1,215.00	43,740,000	
東芝機械	32,000	491.00	15,712,000	
アマダホールディングス	74,800	1,264.00	94,547,200	
アイダエンジニアリング	15,500	1,013.00	15,701,500	
滝澤鉄工所	15,000	187.00	2,805,000	
富士機械製造	17,200	1,533.00	26,367,600	
牧野フライス製作所	28,000	1,066.00	29,848,000	
オーエスジー	25,600	2,397.00	61,363,200	
ダイジェット工業	7,000	183.00	1,281,000	
旭ダイヤモンド工業	15,400	928.00	14,291,200	
DMG森精機	32,800	1,717.00	56,317,600	
ソディック	14,000	1,085.00	15,190,000	
ディスコ	6,500	17,080.00	111,020,000	
日東工器	3,200	2,549.00	8,156,800	
パンチ工業	2,300	1,022.00	2,350,600	
土木管理総合試験所	600	704.00	422,400	
日本郵政	144,800	1,474.00	213,435,200	
ベルシステム24ホールディングス	8,500	1,000.00	8,500,000	
一蔵	400	1,304.00	521,600	
ソラスト	2,700	1,509.00	4,074,300	
豊田自動織機	48,400	5,550.00	268,620,000	

豊和工業	3,500	667.00	2,334,500	
OKK	21,000	126.00	2,646,000	
石川製作所	1,300	764.00	993,200	
東洋機械金属	4,000	573.00	2,292,000	
津田駒工業	15,000	178.00	2,670,000	
エンシュウ	14,000	95.00	1,330,000	
島精機製作所	7,400	3,835.00	28,379,000	
NCホールディングス	1,900	937.00	1,780,300	
フリー	1,200	4,660.00	5,592,000	
ヤマシンフィルタ	1,100	1,770.00	1,947,000	
日阪製作所	7,500	921.00	6,907,500	
やまびこ	10,200	1,450.00	14,790,000	
ペガサスミシン製造	5,200	846.00	4,399,200	
ナブテスコ	28,900	3,215.00	92,913,500	
三井海洋開発	5,700	2,440.00	13,908,000	
レオン自動機	5,100	1,086.00	5,538,600	
SMC	16,700	31,700.00	529,390,000	
新川	5,100	821.00	4,187,100	
ホソカワミクロン	9,000	822.00	7,398,000	
ユニオンツール	2,600	3,595.00	9,347,000	
オイレス工業	7,200	2,059.00	14,824,800	
日精エー・エス・ビー機械	2,000	2,404.00	4,808,000	
サトーホールディングス	7,000	2,499.00	17,493,000	
日本エアテック	1,900	654.00	1,242,600	
日精樹脂工業	3,600	1,125.00	4,050,000	
オカダアイヨン	1,100	1,168.00	1,284,800	
ワイエイシイ	2,300	1,347.00	3,098,100	
小松製作所	256,600	2,801.00	718,736,600	
住友重機械工業	162,000	823.00	133,326,000	
日立建機	25,100	2,663.00	66,841,300	
日工	1,600	2,104.00	3,366,400	
巴工業	2,300	1,877.00	4,317,100	
井関農機	56,000	258.00	14,448,000	
TOWA	4,600	2,080.00	9,568,000	
丸山製作所	12,000	195.00	2,340,000	
北川鉄工所	2,500	2,460.00	6,150,000	
シンニッタン	4,400	710.00	3,124,000	
ローツェ	2,000	2,535.00	5,070,000	
タカキタ	1,300	573.00	744,900	
クボタ	267,000	1,850.00	493,950,000	
荏原実業	1,400	1,370.00	1,918,000	
東洋エンジニアリング	34,000	270.00	9,180,000	
三菱化工機	18,000	224.00	4,032,000	
月島機械	10,400	1,296.00	13,478,400	
帝国電機製作所	4,100	1,047.00	4,292,700	
東京機械製作所	26,000	76.00	1,976,000	
新東工業	12,500	1,037.00	12,962,500	
澁谷工業	4,600	2,913.00	13,399,800	
アイチ コーポレーション	8,400	886.00	7,442,400	

小森コーポレーション	12,700	1,522.00	19,329,400	
鶴見製作所	4,400	1,540.00	6,776,000	
住友精密工業	9,000	368.00	3,312,000	
酒井重工業	11,000	340.00	3,740,000	
荏原製作所	24,500	3,365.00	82,442,500	
石井鐵工所	900	1,785.00	1,606,500	
西島製作所	5,400	1,145.00	6,183,000	
北越工業	5,900	975.00	5,752,500	
千代田化工建設	43,000	720.00	30,960,000	
ダイキン工業	72,500	10,720.00	777,200,000	
オルガノ	9,000	498.00	4,482,000	
トーヨーカネツ	27,000	318.00	8,586,000	
栗田工業	31,400	2,735.00	85,879,000	
椿本チエイン	32,000	987.00	31,584,000	
大同工業	11,000	283.00	3,113,000	
日機装	18,500	1,216.00	22,496,000	
木村化工機	4,100	348.00	1,426,800	
新興プランテック	12,100	931.00	11,265,100	
アネスト岩田	9,500	1,094.00	10,393,000	
ダイフク	26,500	2,706.00	71,709,000	
サムコ	800	1,136.00	908,800	
加藤製作所	2,400	3,065.00	7,356,000	
油研工業	10,000	224.00	2,240,000	
タダノ	27,700	1,460.00	40,442,000	
フジテック	15,700	1,310.00	20,567,000	
CKD	15,000	1,496.00	22,440,000	
キトー	7,200	1,251.00	9,007,200	
平和	16,600	2,937.00	48,754,200	
理想科学工業	5,300	2,122.00	11,246,600	
SANKYO	14,800	3,965.00	58,682,000	
日本金銭機械	5,300	1,504.00	7,971,200	
マースエンジニアリング	3,200	2,297.00	7,350,400	
福島工業	3,200	3,715.00	11,888,000	
オーイズミ	2,000	683.00	1,366,000	
ダイコク電機	2,100	1,867.00	3,920,700	
竹内製作所	9,900	2,326.00	23,027,400	
アマノ	16,400	2,278.00	37,359,200	
JUKI	8,400	1,283.00	10,777,200	
サンデンホールディングス	34,000	387.00	13,158,000	
蛇の目ミシン工業	4,500	796.00	3,582,000	
ブラザー工業	68,600	2,054.00	140,904,400	
マックス	8,000	1,527.00	12,216,000	
モリタホールディングス	9,400	1,540.00	14,476,000	
グローリー	17,000	3,810.00	64,770,000	
新晃工業	4,000	1,461.00	5,844,000	
大和冷機工業	9,100	1,026.00	9,336,600	
セガサミーホールディングス	52,700	1,678.00	88,430,600	
日本ピストンリング	2,200	2,361.00	5,194,200	
リケン	2,600	4,285.00	11,141,000	

T P R	6,000	3,660.00	21,960,000	
ツバキ・ナカシマ	6,100	1,944.00	11,858,400	
ホシザキ	11,600	8,710.00	101,036,000	
大豊工業	4,200	1,540.00	6,468,000	
日本精工	109,100	1,616.00	176,305,600	
N T N	123,000	546.00	67,158,000	
ジェイテクト	56,600	1,886.00	106,747,600	
不二越	54,000	614.00	33,156,000	
ミネベアミツミ	96,700	1,411.00	136,443,700	
日本トムソン	16,900	560.00	9,464,000	
T H K	37,500	2,982.00	111,825,000	
ユーシン精機	2,000	2,924.00	5,848,000	
前澤給装工業	2,000	1,529.00	3,058,000	
イーグル工業	5,800	1,609.00	9,332,200	
前澤工業	3,900	335.00	1,306,500	
日本ピラー工業	5,200	1,569.00	8,158,800	
キッツ	24,300	744.00	18,079,200	
日立製作所	1,276,000	626.70	799,669,200	
東芝	1,189,000	186.30	221,510,700	
三菱電機	566,900	1,681.00	952,958,900	
富士電機	160,000	629.00	100,640,000	
東洋電機製造	2,200	1,734.00	3,814,800	
安川電機	61,600	2,145.00	132,132,000	
シンフォニアテクノロジー	33,000	306.00	10,098,000	
明電舎	50,000	381.00	19,050,000	
オリジン電気	8,000	317.00	2,536,000	
山洋電気	14,000	884.00	12,376,000	
デンヨー	4,800	1,785.00	8,568,000	
日立工機	14,300	867.00	12,398,100	
三櫻工業	7,300	864.00	6,307,200	
マキタ	34,600	7,740.00	267,804,000	
東芝テック	34,000	601.00	20,434,000	
芝浦メカトロニクス	7,000	282.00	1,974,000	
マブチモーター	15,100	6,230.00	94,073,000	
日本電産	68,900	10,690.00	736,541,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	2,934.00	2,053,800	
東光高岳	2,700	2,197.00	5,931,900	
ダブル・スコープ	5,400	1,842.00	9,946,800	
宮越ホールディングス	1,800	499.00	898,200	
ダイヘン	29,000	721.00	20,909,000	
田淵電機	5,300	346.00	1,833,800	
ヤーマン	600	6,160.00	3,696,000	
J V Cケンウッド	38,600	304.00	11,734,400	
ミマキエンジニアリング	5,200	772.00	4,014,400	
第一精工	2,000	1,796.00	3,592,000	
日新電機	10,800	1,373.00	14,828,400	
大崎電気工業	10,000	1,091.00	10,910,000	
オムロン	56,500	4,855.00	274,307,500	
日東工業	7,900	1,585.00	12,521,500	

I D E C	7,400	1,187.00	8,783,800	
不二電機工業	600	1,375.00	825,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	102,000	501.00	51,102,000	
サクサホールディングス	13,000	231.00	3,003,000	
メルコホールディングス	3,100	3,355.00	10,400,500	
テクノメディカ	1,000	2,187.00	2,187,000	
日本電気	730,000	276.00	201,480,000	
富士通	512,000	659.80	337,817,600	
沖電気工業	23,000	1,592.00	36,616,000	
岩崎通信機	25,000	91.00	2,275,000	
電気興業	15,000	562.00	8,430,000	
サンケン電気	31,000	514.00	15,934,000	
ナカヨ	4,000	420.00	1,680,000	
アイホン	3,200	1,858.00	5,945,600	
ルネサスエレクトロニクス	28,000	1,019.00	28,532,000	
セイコーエプソン	79,100	2,560.00	202,496,000	
ワコム	42,300	409.00	17,300,700	
アルバック	9,800	5,110.00	50,078,000	
アクセル	2,400	839.00	2,013,600	
E I Z O	5,300	3,265.00	17,304,500	
ジャパンディスプレイ	99,900	282.00	28,171,800	
日本信号	14,900	1,063.00	15,838,700	
京三製作所	12,000	409.00	4,908,000	
能美防災	6,000	1,492.00	8,952,000	
ホーチキ	4,100	1,416.00	5,805,600	
エレコム	4,900	2,026.00	9,927,400	
日本無線	2,400	1,414.00	3,393,600	
パナソニック	607,100	1,247.00	757,053,700	
アンリツ	38,600	870.00	33,582,000	
富士通ゼネラル	18,000	2,160.00	38,880,000	
日立国際電気	13,800	2,385.00	32,913,000	
ソニー	375,200	3,508.00	1,316,201,600	
T D K	29,900	7,840.00	234,416,000	
帝国通信工業	11,000	188.00	2,068,000	
タムラ製作所	20,000	455.00	9,100,000	
アルプス電気	49,000	3,465.00	169,785,000	
池上通信機	16,000	154.00	2,464,000	
パイオニア	81,000	229.00	18,549,000	
日本電波工業	4,700	846.00	3,976,200	
鈴木	1,400	575.00	805,000	
日本トリム	1,300	4,040.00	5,252,000	
ローランド ディー. ジー.	2,500	3,550.00	8,875,000	
日本コロムビア	1,700	675.00	1,147,500	
フォスター電機	6,200	1,919.00	11,897,800	
クラリオン	28,000	436.00	12,208,000	
SMK	15,000	422.00	6,330,000	
ヨコオ	4,100	1,320.00	5,412,000	
ティアック	30,000	45.00	1,350,000	
ホシデン	16,200	1,005.00	16,281,000	

ヒロセ電機	8,600	14,800.00	127,280,000	
日本航空電子工業	15,000	1,539.00	23,085,000	
TOA	6,700	1,009.00	6,760,300	
日立マクセル	8,000	2,247.00	17,976,000	
古野電気	6,200	770.00	4,774,000	
ユニデンホールディングス	16,000	168.00	2,688,000	
アルパイン	12,900	1,679.00	21,659,100	
スミダコーポレーション	4,300	1,299.00	5,585,700	
アイコム	3,200	2,379.00	7,612,800	
リオン	1,800	1,574.00	2,833,200	
本多通信工業	1,500	1,304.00	1,956,000	
船井電機	5,800	950.00	5,510,000	
横河電機	57,600	1,727.00	99,475,200	
新電元工業	20,000	480.00	9,600,000	
アズビル	16,100	3,555.00	57,235,500	
東亜ディーケーケー	1,900	557.00	1,058,300	
日本光電工業	22,200	2,483.00	55,122,600	
チノー	2,100	1,219.00	2,559,900	
共和電業	6,800	449.00	3,053,200	
日本電子材料	2,200	634.00	1,394,800	
堀場製作所	10,500	6,240.00	65,520,000	
アドバンテスト	36,500	1,977.00	72,160,500	
小野測器	2,500	877.00	2,192,500	
エスベック	4,700	1,285.00	6,039,500	
パナソニック デバイスSUNX	4,100	843.00	3,456,300	
キーエンス	24,000	44,250.00	1,062,000,000	
日置電機	3,000	2,228.00	6,684,000	
シスメックス	41,300	6,390.00	263,907,000	
日本マイクロニクス	10,400	901.00	9,370,400	
メガチップス	5,000	2,744.00	13,720,000	
OBARA GROUP	3,200	4,995.00	15,984,000	
イマジカ・ロボット ホールディングス	4,300	794.00	3,414,200	
澤藤電機	3,000	250.00	750,000	
デンソー	131,000	5,085.00	666,135,000	
コーセル	7,300	1,396.00	10,190,800	
イリソ電子工業	1,700	7,140.00	12,138,000	
新日本無線	4,000	471.00	1,884,000	
オプテックスグループ	3,900	3,145.00	12,265,500	
千代田インテグレ	2,700	2,407.00	6,498,900	
アイ・オー・データ機器	1,700	1,253.00	2,130,100	
レーザーテック	6,200	2,889.00	17,911,800	
スタンレー電気	38,000	3,160.00	120,080,000	
岩崎電気	18,000	174.00	3,132,000	
ウシオ電機	32,500	1,456.00	47,320,000	
岡谷電機産業	2,800	420.00	1,176,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	4,600	610.00	2,806,000	
日本セラミック	4,600	2,429.00	11,173,400	
遠藤照明	2,400	935.00	2,244,000	
古河電池	4,000	759.00	3,036,000	

双信電機	2,600	306.00	795,600	
山一電機	4,700	1,543.00	7,252,100	
図研	3,900	1,293.00	5,042,700	
日本電子	20,000	537.00	10,740,000	
カシオ計算機	44,300	1,553.00	68,797,900	
ファナック	53,900	22,345.00	1,204,395,500	
日本シイエムケイ	10,700	656.00	7,019,200	
エンプラス	2,400	3,525.00	8,460,000	
大真空	2,000	1,496.00	2,992,000	
ローム	25,700	7,440.00	191,208,000	
浜松ホトニクス	41,400	3,380.00	139,932,000	
三井ハイテック	7,500	890.00	6,675,000	
新光電気工業	20,100	784.00	15,758,400	
京セラ	87,200	6,228.00	543,081,600	
協栄産業	6,000	172.00	1,032,000	
太陽誘電	26,000	1,530.00	39,780,000	
村田製作所	55,800	16,390.00	914,562,000	
ユーシン	6,700	803.00	5,380,100	
双葉電子工業	8,900	2,018.00	17,960,200	
日東電工	40,100	9,528.00	382,072,800	
北陸電気工業	22,000	142.00	3,124,000	
東海理化電機製作所	14,200	2,232.00	31,694,400	
ニチコン	17,000	1,063.00	18,071,000	
日本ケミコン	46,000	319.00	14,674,000	
K O A	7,900	1,331.00	10,514,900	
三井造船	195,000	178.00	34,710,000	
日立造船	42,900	645.00	27,670,500	
三菱重工業	891,000	445.10	396,584,100	
川崎重工業	413,000	355.00	146,615,000	
I H I	408,000	339.00	138,312,000	
名村造船所	15,800	793.00	12,529,400	
サノヤスホールディングス	7,300	298.00	2,175,400	
日本車輛製造	19,000	304.00	5,776,000	
ニチュ三菱フォークリフト	6,600	717.00	4,732,200	
近畿車輛	800	2,711.00	2,168,800	
F P G	19,000	1,113.00	21,147,000	
島根銀行	1,100	1,410.00	1,551,000	
じもとホールディングス	40,400	196.00	7,918,400	
全国保証	14,900	3,620.00	53,938,000	
めぶきフィナンシャルグループ	252,700	488.00	123,317,600	
東京T Yフィナンシャルグループ	7,400	4,000.00	29,600,000	
九州フィナンシャルグループ	85,900	794.00	68,204,600	
かんぽ生命保険	19,800	2,780.00	55,044,000	
ゆうちょ銀行	148,400	1,425.00	211,470,000	
富山第一銀行	14,000	551.00	7,714,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	343,200	613.90	210,690,480	
西日本フィナンシャルホールディングス	35,200	1,259.00	44,316,800	
日産自動車	627,000	1,116.50	700,045,500	
トヨタ自動車	646,700	6,432.00	4,159,574,400	

日野自動車	75,800	1,321.00	100,131,800	
三菱自動車工業	194,600	681.00	132,522,600	
エフテック	2,500	1,339.00	3,347,500	
レシップホールディングス	1,900	854.00	1,622,600	
GMB	700	1,419.00	993,300	
ファルテック	700	1,409.00	986,300	
武蔵精密工業	6,000	2,816.00	16,896,000	
日産車体	23,700	1,089.00	25,809,300	
新明和工業	22,000	1,178.00	25,916,000	
極東開発工業	10,600	1,785.00	18,921,000	
日信工業	12,100	1,985.00	24,018,500	
トピー工業	4,400	3,255.00	14,322,000	
ティラド	20,000	311.00	6,220,000	
曙ブレーキ工業	24,800	284.00	7,043,200	
タチエス	8,900	2,101.00	18,698,900	
NOK	25,900	2,555.00	66,174,500	
フタバ産業	16,000	793.00	12,688,000	
K Y B	59,000	628.00	37,052,000	
市光工業	3,000	519.00	1,557,000	
大同メタル工業	6,700	1,031.00	6,907,700	
プレス工業	28,300	562.00	15,904,600	
ミクニ	5,200	433.00	2,251,600	
カルソニックカンセイ	57,000	1,285.00	73,245,000	
太平洋工業	11,000	1,448.00	15,928,000	
ケーヒン	12,400	1,971.00	24,440,400	
河西工業	7,000	1,386.00	9,702,000	
アイシン精機	48,600	5,660.00	275,076,000	
富士機工	5,300	544.00	2,883,200	
マツダ	168,200	1,588.50	267,185,700	
今仙電機製作所	5,200	1,008.00	5,241,600	
本田技研工業	478,300	3,574.00	1,709,444,200	
スズキ	105,300	4,404.00	463,741,200	
富士重工業	165,000	4,282.00	706,530,000	
安永	1,900	1,658.00	3,150,200	
ヤマハ発動機	75,000	2,587.00	194,025,000	
ショーワ	13,700	967.00	13,247,900	
小糸製作所	31,800	5,820.00	185,076,000	
T B K	6,600	529.00	3,491,400	
エクセディ	7,300	3,190.00	23,287,000	
ミツバ	9,600	2,249.00	21,590,400	
豊田合成	17,300	2,842.00	49,166,600	
愛三工業	9,900	977.00	9,672,300	
盟和産業	500	1,218.00	609,000	
ヨロズ	5,300	1,756.00	9,306,800	
エフ・シー・シー	8,800	2,254.00	19,835,200	
新家工業	12,000	179.00	2,148,000	
シマノ	21,400	16,570.00	354,598,000	
タカタ	10,300	548.00	5,644,400	
テイ・エス テック	12,300	2,918.00	35,891,400	

ジャムコ	3,300	2,624.00	8,659,200	
小野建	4,900	1,421.00	6,962,900	
はるやまホールディングス	2,200	982.00	2,160,400	
ノジマ	6,400	1,406.00	8,998,400	
佐島電機	3,600	798.00	2,872,800	
カッパ・クリエイト	7,800	1,279.00	9,976,200	
エコートレーディング	1,000	704.00	704,000	
伯東	3,600	1,077.00	3,877,200	
コンドーテック	3,800	874.00	3,321,200	
中山福	3,400	855.00	2,907,000	
ライトオン	4,200	983.00	4,128,600	
ナガイレーベン	7,700	2,471.00	19,026,700	
ジーンズメイト	2,600	259.00	673,400	
三菱食品	5,900	3,470.00	20,473,000	
良品計画	6,900	22,430.00	154,767,000	
三城ホールディングス	6,800	476.00	3,236,800	
松田産業	3,700	1,596.00	5,905,200	
第一興商	8,500	4,735.00	40,247,500	
メディパルホールディングス	52,400	1,838.00	96,311,200	
アドヴァン	5,100	1,159.00	5,910,900	
S P K	1,100	2,528.00	2,780,800	
萩原電気	1,900	2,177.00	4,136,300	
アルビス	1,200	3,255.00	3,906,000	
アズワン	4,100	5,010.00	20,541,000	
スズデン	1,800	1,059.00	1,906,200	
尾家産業	1,800	1,164.00	2,095,200	
シモジマ	3,400	1,199.00	4,076,600	
ドウシシャ	6,100	2,130.00	12,993,000	
小津産業	1,100	2,173.00	2,390,300	
コナカ	6,000	600.00	3,600,000	
高速	3,100	1,115.00	3,456,500	
ハウス オブ ローゼ	600	1,550.00	930,000	
G-7ホールディングス	1,200	2,101.00	2,521,200	
たけびし	1,900	1,410.00	2,679,000	
イオン北海道	3,600	617.00	2,221,200	
コジマ	8,500	275.00	2,337,500	
ヒマラヤ	1,600	857.00	1,371,200	
コーナン商事	7,600	2,182.00	16,583,200	
黒田電気	7,400	2,285.00	16,909,000	
ネットワンシステムズ	23,100	883.00	20,397,300	
エコス	1,800	1,210.00	2,178,000	
ワタミ	6,100	1,144.00	6,978,400	
マルシェ	1,600	840.00	1,344,000	
リックス	1,200	1,674.00	2,008,800	
システムソフト	9,500	153.00	1,453,500	
ドンキホーテホールディングス	33,900	3,935.00	133,396,500	
丸文	4,500	735.00	3,307,500	
西松屋チェーン	9,300	1,300.00	12,090,000	
ゼンショーホールディングス	27,100	1,894.00	51,327,400	

ハピネット	4,500	1,458.00	6,561,000	
幸楽苑ホールディングス	3,600	1,677.00	6,037,200	
ハークスレイ	1,400	1,119.00	1,566,600	
橋本総業ホールディングス	1,000	1,502.00	1,502,000	
日本ライフライン	4,600	2,040.00	9,384,000	
サイゼリヤ	8,800	2,640.00	23,232,000	
エクセル	2,400	1,499.00	3,597,600	
V Tホールディングス	17,500	524.00	9,170,000	
マルカキカイ	1,600	1,892.00	3,027,200	
アルゴグラフィックス	2,200	2,463.00	5,418,600	
魚力	1,500	1,300.00	1,950,000	
I D O M	15,000	750.00	11,250,000	
日本エム・ディ・エム	3,800	765.00	2,907,000	
ポプラ	1,700	520.00	884,000	
フジ・コーポレーション	800	2,287.00	1,829,600	
ユナイテッドアローズ	7,100	3,495.00	24,814,500	
進和	3,300	1,783.00	5,883,900	
エスケイジャパン	900	307.00	276,300	
ダイトロン	2,600	967.00	2,514,200	
ハイデイ日高	5,000	2,890.00	14,450,000	
シークス	3,900	4,240.00	16,536,000	
京都きもの友禅	3,100	995.00	3,084,500	
コロワイド	17,300	1,866.00	32,281,800	
ピーシーデポコーポレーション	7,300	559.00	4,080,700	
田中商事	1,600	724.00	1,158,400	
オーハシテクニカ	2,800	1,439.00	4,029,200	
壺番屋	3,700	3,775.00	13,967,500	
白銅	1,700	1,786.00	3,036,200	
トップカルチャー	1,700	482.00	819,400	
P L A N T	1,400	1,198.00	1,677,200	
スギホールディングス	11,600	5,350.00	62,060,000	
島津製作所	68,000	1,879.00	127,772,000	
J M S	10,000	325.00	3,250,000	
クボテック	1,100	556.00	611,600	
長野計器	2,900	705.00	2,044,500	
ブイ・テクノロジー	1,100	17,340.00	19,074,000	
スター精密	9,400	1,671.00	15,707,400	
東京計器	16,000	240.00	3,840,000	
愛知時計電機	700	3,725.00	2,607,500	
オーバル	4,300	272.00	1,169,600	
東京精密	10,200	3,835.00	39,117,000	
マニー	7,000	2,719.00	19,033,000	
ニコン	92,600	1,707.00	158,068,200	
トプコン	27,000	2,023.00	54,621,000	
オリンパス	84,800	3,940.00	334,112,000	
理研計器	4,100	1,636.00	6,707,600	
S C R E E Nホールディングス	10,900	7,640.00	83,276,000	
キヤノン電子	5,200	1,786.00	9,287,200	
タムロン	4,600	2,115.00	9,729,000	

HOYA	109,300	5,060.00	553,058,000	
ノーリツ銅機	5,000	971.00	4,855,000	
エー・アンド・デイ	5,400	468.00	2,527,200	
キヤノン	286,100	3,289.00	940,982,900	
リコー	159,700	1,002.00	160,019,400	
シチズン時計	59,800	738.00	44,132,400	
リズム時計工業	23,000	187.00	4,301,000	
大研医器	3,800	800.00	3,040,000	
メニコン	3,700	3,520.00	13,024,000	
スノーピーク	900	2,841.00	2,556,900	
パラマウントベッドホールディングス	5,200	4,155.00	21,606,000	
トランザクション	600	2,090.00	1,254,000	
SHO-BI	1,600	439.00	702,400	
ニホンフラッシュ	2,200	1,283.00	2,822,600	
前田工繊	5,400	1,326.00	7,160,400	
永大産業	7,000	533.00	3,731,000	
アートネイチャー	6,000	748.00	4,488,000	
ダンロップスポーツ	3,300	1,039.00	3,428,700	
バンダイナムコホールディングス	58,600	3,110.00	182,246,000	
アイフィスジャパン	900	420.00	378,000	
共立印刷	7,700	337.00	2,594,900	
SHOEI	2,500	2,556.00	6,390,000	
フランスベッドホールディングス	6,700	940.00	6,298,000	
マーベラス	9,400	964.00	9,061,600	
パイロットコーポレーション	9,300	4,590.00	42,687,000	
萩原工業	1,600	2,616.00	4,185,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	9,800	1,610.00	15,778,000	
トッパン・フォームズ	9,400	1,070.00	10,058,000	
フジシールインターナショナル	11,800	2,271.00	26,797,800	
タカラトミー	20,600	1,198.00	24,678,800	
廣済堂	5,200	391.00	2,033,200	
As-me エステール	1,700	692.00	1,176,400	
アーク	24,800	108.00	2,678,400	
レック	1,600	4,535.00	7,256,000	
タカノ	2,300	999.00	2,297,700	
プロネクス	5,300	1,235.00	6,545,500	
ホクシン	6,100	220.00	1,342,000	
ウッドワン	9,000	294.00	2,646,000	
大建工業	3,800	2,176.00	8,268,800	
きもと	8,300	249.00	2,066,700	
凸版印刷	150,000	1,129.00	169,350,000	
大日本印刷	153,000	1,186.00	181,458,000	
図書印刷	7,000	482.00	3,374,000	
共同印刷	17,000	384.00	6,528,000	
日本写真印刷	8,900	3,325.00	29,592,500	
光村印刷	5,000	267.00	1,335,000	
藤森工業	4,200	3,020.00	12,684,000	
ヴィア・ホールディングス	4,000	1,157.00	4,628,000	
宝印刷	2,500	1,579.00	3,947,500	

前澤化成工業	3,500	1,209.00	4,231,500	
アシックス	52,700	1,956.00	103,081,200	
ツツミ	2,000	2,116.00	4,232,000	
J S P	2,600	2,584.00	6,718,400	
ニチハ	7,600	3,155.00	23,978,000	
エフピコ	4,900	5,150.00	25,235,000	
小松ウオール工業	1,600	1,943.00	3,108,800	
ヤマハ	35,800	2,932.00	104,965,600	
河合楽器製作所	2,000	2,300.00	4,600,000	
クリナップ	5,900	834.00	4,920,600	
ビジョン	32,100	3,125.00	100,312,500	
天馬	3,700	2,145.00	7,936,500	
兼松サステック	7,000	246.00	1,722,000	
キングジム	4,300	857.00	3,685,100	
リンテック	12,600	2,475.00	31,185,000	
T A S A K I	1,000	1,512.00	1,512,000	
信越ポリマー	10,800	835.00	9,018,000	
東リ	14,000	413.00	5,782,000	
イトーキ	11,900	728.00	8,663,200	
任天堂	32,700	23,095.00	755,206,500	
三菱鉛筆	4,400	5,640.00	24,816,000	
松風	2,500	1,369.00	3,422,500	
タカラスタANDARD	11,000	1,914.00	21,054,000	
コクヨ	27,800	1,557.00	43,284,600	
ナカバヤシ	10,000	275.00	2,750,000	
ニフコ	9,800	5,710.00	55,958,000	
立川ブラインド工業	2,200	924.00	2,032,800	
グローブラインド	2,500	1,801.00	4,502,500	
岡村製作所	18,900	1,021.00	19,296,900	
日本バルカー工業	4,600	1,843.00	8,477,800	
MUTOHホールディングス	5,000	268.00	1,340,000	
伊藤忠商事	384,100	1,629.00	625,698,900	
丸紅	516,100	730.40	376,959,440	
スクロール	7,300	352.00	2,569,600	
高島	11,000	214.00	2,354,000	
ヨンドシーホールディングス	4,200	2,557.00	10,739,400	
三陽商会	29,000	172.00	4,988,000	
長瀬産業	31,800	1,649.00	52,438,200	
ナイガイ	21,000	66.00	1,386,000	
蝶理	3,600	1,998.00	7,192,800	
豊田通商	58,400	3,335.00	194,764,000	
オンワードホールディングス	36,000	858.00	30,888,000	
三共生興	7,400	414.00	3,063,600	
兼松	113,000	195.00	22,035,000	
美津濃	29,000	605.00	17,545,000	
ツカモトコーポレーション	9,000	128.00	1,152,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	23,000	7,050.00	162,150,000	
ルック	10,000	209.00	2,090,000	
三井物産	474,300	1,703.00	807,732,900	

日本紙パルプ商事	27,000	372.00	10,044,000	
東京エレクトロン	35,400	11,180.00	395,772,000	
日立ハイテクノロジーズ	18,200	4,815.00	87,633,000	
カメイ	7,300	1,355.00	9,891,500	
東都水産	900	1,964.00	1,767,600	
OUGホールディングス	6,000	263.00	1,578,000	
スターゼン	2,000	4,885.00	9,770,000	
セイコーホールディングス	36,000	464.00	16,704,000	
山善	20,400	1,064.00	21,705,600	
椿本興業	6,000	397.00	2,382,000	
住友商事	330,100	1,494.50	493,334,450	
日本ユニシス	14,700	1,520.00	22,344,000	
内田洋行	2,800	2,556.00	7,156,800	
三菱商事	393,600	2,609.50	1,027,099,200	
第一実業	12,000	783.00	9,396,000	
キヤノンマーケティングジャパン	14,900	2,280.00	33,972,000	
西華産業	17,000	364.00	6,188,000	
佐藤商事	4,500	880.00	3,960,000	
菱洋エレクトロ	5,000	1,586.00	7,930,000	
東京産業	4,500	474.00	2,133,000	
ユアサ商事	5,000	3,280.00	16,400,000	
神鋼商事	1,000	2,467.00	2,467,000	
小林産業	3,900	277.00	1,080,300	
阪和興業	53,000	779.00	41,287,000	
カナデン	5,400	1,048.00	5,659,200	
菱電商事	8,000	735.00	5,880,000	
ニプロ	36,700	1,379.00	50,609,300	
フルサト工業	3,100	1,737.00	5,384,700	
岩谷産業	59,000	665.00	39,235,000	
すてきナイスグループ	22,000	152.00	3,344,000	
昭光通商	21,000	101.00	2,121,000	
ニチモウ	9,000	189.00	1,701,000	
極東貿易	6,000	238.00	1,428,000	
イワキ	8,000	305.00	2,440,000	
兼松エレクトロニクス	3,500	2,577.00	9,019,500	
三愛石油	13,000	894.00	11,622,000	
稲畑産業	12,600	1,511.00	19,038,600	
G S Iクレオス	15,000	151.00	2,265,000	
明和産業	4,500	425.00	1,912,500	
キムラタン	234,000	7.00	1,638,000	
ゴールドウイン	2,300	5,750.00	13,225,000	
ユニ・チャーム	112,700	2,444.50	275,495,150	
デサント	12,900	1,247.00	16,086,300	
キング	2,900	415.00	1,203,500	
ワキタ	11,000	1,072.00	11,792,000	
ヤマトインターナショナル	3,300	413.00	1,362,900	
東邦ホールディングス	16,900	2,479.00	41,895,100	
サンゲツ	17,900	1,929.00	34,529,100	
ミツウロコグループホールディングス	9,100	744.00	6,770,400	

シナネンホールディングス	2,200	2,298.00	5,055,600	
伊藤忠エネクス	11,700	944.00	11,044,800	
サンリオ	16,100	2,190.00	35,259,000	
サンワテクノス	3,200	1,081.00	3,459,200	
リョーサン	7,900	3,675.00	29,032,500	
新光商事	5,700	1,350.00	7,695,000	
トーヨー	2,300	2,535.00	5,830,500	
三信電気	5,800	1,350.00	7,830,000	
東陽テクニカ	7,100	1,019.00	7,234,900	
モスフードサービス	6,800	3,330.00	22,644,000	
加賀電子	4,700	2,042.00	9,597,400	
三益半導体工業	4,400	1,760.00	7,744,000	
ソーダニッカ	4,700	520.00	2,444,000	
立花エレテック	3,500	1,322.00	4,627,000	
木曽路	6,500	2,369.00	15,398,500	
サトレストランシシステムズ	6,100	865.00	5,276,500	
千趣会	9,700	794.00	7,701,800	
タカキュー	3,300	214.00	706,200	
ケーヨー	8,400	585.00	4,914,000	
上新電機	12,000	1,089.00	13,068,000	
日本瓦斯	9,600	3,345.00	32,112,000	
ベスト電器	18,500	142.00	2,627,000	
ロイヤルホールディングス	8,800	2,012.00	17,705,600	
東天紅	5,000	169.00	845,000	
いなげや	6,200	1,567.00	9,715,400	
島忠	13,700	2,844.00	38,962,800	
チヨダ	6,100	2,747.00	16,756,700	
ライフコーポレーション	3,500	3,315.00	11,602,500	
リンガーハット	5,800	2,293.00	13,299,400	
さが美	5,000	121.00	605,000	
MrMax	5,300	418.00	2,215,400	
テンアライド	5,200	394.00	2,048,800	
AOKIホールディングス	10,600	1,421.00	15,062,600	
オークワ	8,000	1,118.00	8,944,000	
コメリ	8,300	2,740.00	22,742,000	
青山商事	11,100	4,150.00	46,065,000	
しまむら	6,100	14,520.00	88,572,000	
はせがわ	2,100	447.00	938,700	
高島屋	88,000	1,000.00	88,000,000	
松屋	11,200	1,007.00	11,278,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	27,100	1,870.00	50,677,000	
近鉄百貨店	21,000	357.00	7,497,000	
丸栄	8,000	89.00	712,000	
パルコ	5,400	1,138.00	6,145,200	
丸井グループ	55,100	1,561.00	86,011,100	
クレディセゾン	39,700	2,175.00	86,347,500	
アクシアル リテイリング	4,100	4,500.00	18,450,000	
井筒屋	3,000	396.00	1,188,000	
イオン	215,800	1,703.00	367,507,400	

イズミ	10,400	4,905.00	51,012,000	
東武ストア	700	3,020.00	2,114,000	
フォーパル	2,200	695.00	1,529,000	
平和堂	10,800	2,680.00	28,944,000	
フジ	5,800	2,401.00	13,925,800	
ヤオコー	5,900	4,560.00	26,904,000	
ゼビオホールディングス	7,100	1,795.00	12,744,500	
ケーズホールディングス	24,400	2,088.00	50,947,200	
PALTAC	8,600	3,135.00	26,961,000	
三谷産業	5,700	379.00	2,160,300	
Olympicグループ	3,100	637.00	1,974,700	
日産東京販売ホールディングス	7,700	352.00	2,710,400	
新生銀行	499,000	209.00	104,291,000	
あおぞら銀行	332,000	417.00	138,444,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,974,900	767.80	3,051,928,220	
りそなホールディングス	613,500	629.40	386,136,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	109,500	4,225.00	462,637,500	
三井住友フィナンシャルグループ	420,000	4,549.00	1,910,580,000	
第四銀行	64,000	537.00	34,368,000	
北越銀行	5,700	2,744.00	15,640,800	
千葉銀行	202,000	788.00	159,176,000	
群馬銀行	116,400	670.00	77,988,000	
武蔵野銀行	8,300	3,710.00	30,793,000	
千葉興業銀行	15,400	630.00	9,702,000	
筑波銀行	23,300	353.00	8,224,900	
七十七銀行	83,000	538.00	44,654,000	
青森銀行	39,000	394.00	15,366,000	
秋田銀行	34,000	368.00	12,512,000	
山形銀行	29,000	495.00	14,355,000	
岩手銀行	3,400	4,785.00	16,269,000	
東邦銀行	48,000	441.00	21,168,000	
東北銀行	25,000	160.00	4,000,000	
みちのく銀行	33,000	191.00	6,303,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	213,000	505.00	107,565,000	
静岡銀行	143,000	1,018.00	145,574,000	
十六銀行	68,000	413.00	28,084,000	
スルガ銀行	53,600	2,562.00	137,323,200	
八十二銀行	102,100	723.00	73,818,300	
山梨中央銀行	32,000	557.00	17,824,000	
大垣共立銀行	70,000	453.00	31,710,000	
福井銀行	45,000	284.00	12,780,000	
北國銀行	57,000	479.00	27,303,000	
清水銀行	1,900	3,780.00	7,182,000	
富山銀行	1,000	4,180.00	4,180,000	
滋賀銀行	50,000	634.00	31,700,000	
南都銀行	5,100	4,730.00	24,123,000	
百五銀行	48,000	520.00	24,960,000	
京都銀行	94,000	964.00	90,616,000	
紀陽銀行	20,500	1,923.00	39,421,500	

三重銀行	2,300	2,531.00	5,821,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	34,800	2,053.00	71,444,400	
広島銀行	155,000	550.00	85,250,000	
山陰合同銀行	31,400	1,029.00	32,310,600	
中国銀行	37,500	1,813.00	67,987,500	
鳥取銀行	1,600	1,936.00	3,097,600	
伊予銀行	56,600	842.00	47,657,200	
百十四銀行	59,000	401.00	23,659,000	
四国銀行	40,000	315.00	12,600,000	
阿波銀行	43,000	760.00	32,680,000	
大分銀行	30,000	450.00	13,500,000	
宮崎銀行	35,000	378.00	13,230,000	
佐賀銀行	31,000	313.00	9,703,000	
十八銀行	34,000	364.00	12,376,000	
沖縄銀行	4,800	4,230.00	20,304,000	
琉球銀行	11,000	1,663.00	18,293,000	
セブン銀行	196,300	331.00	64,975,300	
みずほフィナンシャルグループ	7,121,600	210.40	1,498,384,640	
高知銀行	18,000	138.00	2,484,000	
山口フィナンシャルグループ	49,000	1,321.00	64,729,000	
アクリーティブ	3,500	398.00	1,393,000	
芙蓉総合リース	6,100	5,300.00	32,330,000	
興銀リース	10,000	2,502.00	25,020,000	
東京センチュリー	10,600	3,900.00	41,340,000	
S B I ホールディングス	59,200	1,547.00	91,582,400	
日本証券金融	23,100	632.00	14,599,200	
アイフル	87,600	355.00	31,098,000	
日本アジア投資	4,000	471.00	1,884,000	
ポケットカード	3,800	607.00	2,306,600	
長野銀行	1,500	2,022.00	3,033,000	
名古屋銀行	4,500	4,365.00	19,642,500	
北洋銀行	86,300	479.00	41,337,700	
愛知銀行	1,800	7,120.00	12,816,000	
第三銀行	2,900	1,757.00	5,095,300	
中京銀行	2,100	2,305.00	4,840,500	
大光銀行	20,000	252.00	5,040,000	
愛媛銀行	6,600	1,419.00	9,365,400	
トマト銀行	2,000	1,631.00	3,262,000	
みなと銀行	4,700	2,438.00	11,458,600	
京葉銀行	43,000	548.00	23,564,000	
関西アーバン銀行	7,200	1,579.00	11,368,800	
栃木銀行	28,000	593.00	16,604,000	
北日本銀行	1,800	3,170.00	5,706,000	
東和銀行	97,000	127.00	12,319,000	
福島銀行	63,000	97.00	6,111,000	
大東銀行	30,000	172.00	5,160,000	
リコーリース	4,100	3,650.00	14,965,000	
イオンフィナンシャルサービス	33,400	2,124.00	70,941,600	
アコム	105,100	494.00	51,919,400	

ジャックス	29,000	508.00	14,732,000	
オリエントコーポレーション	112,900	215.00	24,273,500	
日立キャピタル	12,300	2,945.00	36,223,500	
アプラスフィナンシャル	24,200	119.00	2,879,800	
オリックス	371,400	1,762.00	654,406,800	
三菱UFJリース	132,900	620.00	82,398,000	
ジャフコ	8,700	3,940.00	34,278,000	
トモニホールディングス	41,500	654.00	27,141,000	
大和証券グループ本社	491,000	711.00	349,101,000	
野村ホールディングス	1,072,300	750.00	804,225,000	
岡三証券グループ	45,000	758.00	34,110,000	
丸三証券	16,500	962.00	15,873,000	
東洋証券	18,000	272.00	4,896,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	60,700	647.00	39,272,900	
光世証券	14,000	191.00	2,674,000	
水戸証券	17,400	312.00	5,428,800	
いちよし証券	11,600	900.00	10,440,000	
松井証券	29,800	933.00	27,803,400	
SOMPOホールディングス	109,600	4,281.00	469,197,600	
だいこう証券ビジネス	2,500	639.00	1,597,500	
日本取引所グループ	163,000	1,602.00	261,126,000	
マネックスグループ	57,000	294.00	16,758,000	
カブドットコム証券	39,600	391.00	15,483,600	
極東証券	7,000	1,681.00	11,767,000	
岩井コスモホールディングス	4,800	1,107.00	5,313,600	
藍澤證券	10,400	647.00	6,728,800	
フィデアホールディングス	45,400	217.00	9,851,800	
池田泉州ホールディングス	55,400	521.00	28,863,400	
アニコム ホールディングス	3,700	2,260.00	8,362,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	156,700	3,845.00	602,511,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	50,200	2,017.00	101,253,400	
マネーパートナーズグループ	4,400	531.00	2,336,400	
小林洋行	1,300	292.00	379,600	
第一生命ホールディングス	316,300	2,206.50	697,915,950	
東京海上ホールディングス	212,500	5,089.00	1,081,412,500	
イー・ギャランティ	1,500	2,613.00	3,919,500	
アサックス	1,000	1,641.00	1,641,000	
NECキャピタルソリューション	2,100	1,823.00	3,828,300	
T&Dホールディングス	191,100	1,808.00	345,508,800	
アドバンスクリエイト	1,100	2,082.00	2,290,200	
三井不動産	278,000	2,622.50	729,055,000	
三菱地所	390,000	2,258.50	880,815,000	
平和不動産	10,100	1,612.00	16,281,200	
東京建物	60,800	1,589.00	96,611,200	
ダイビル	13,400	1,067.00	14,297,800	
京阪神ビルディング	8,500	655.00	5,567,500	
住友不動産	126,000	3,246.00	408,996,000	
太平洋興発	21,000	108.00	2,268,000	
大京	99,000	232.00	22,968,000	

テーオーシー	20,700	964.00	19,954,800	
東京楽天地	8,000	528.00	4,224,000	
レオパレス21	66,700	606.00	40,420,200	
スターツコーポレーション	5,400	2,433.00	13,138,200	
フジ住宅	6,700	746.00	4,998,200	
空港施設	6,300	593.00	3,735,900	
明和地所	3,400	712.00	2,420,800	
住友不動産販売	4,000	2,847.00	11,388,000	
ゴールドクレスト	4,400	2,137.00	9,402,800	
リログループ	2,100	15,800.00	33,180,000	
日本エスリード	1,800	1,525.00	2,745,000	
日神不動産	7,300	551.00	4,022,300	
日本エスコン	7,600	401.00	3,047,600	
タカラレーベン	23,200	601.00	13,943,200	
サンヨーハウジング名古屋	2,800	1,011.00	2,830,800	
イオンモール	34,100	1,732.00	59,061,200	
ファースト住建	1,900	1,433.00	2,722,700	
ランド	4,900	22.00	107,800	
東祥	1,200	5,150.00	6,180,000	
トーセイ	7,300	776.00	5,664,800	
穴吹興産	500	2,669.00	1,334,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	32,500	1,053.00	34,222,500	
サンフロンティア不動産	5,600	1,026.00	5,745,600	
エフ・ジェー・ネクスト	4,500	807.00	3,631,500	
インテリックス	1,300	825.00	1,072,500	
ランドビジネス	2,600	289.00	751,400	
グランディハウス	5,300	418.00	2,215,400	
東武鉄道	284,000	573.00	162,732,000	
相鉄ホールディングス	85,000	568.00	48,280,000	
東京急行電鉄	289,000	826.00	238,714,000	
京浜急行電鉄	146,000	1,221.00	178,266,000	
小田急電鉄	85,100	2,232.00	189,943,200	
京王電鉄	148,000	883.00	130,684,000	
京成電鉄	39,800	2,654.00	105,629,200	
富士急行	15,000	1,011.00	15,165,000	
新京成電鉄	7,000	420.00	2,940,000	
東日本旅客鉄道	102,800	10,275.00	1,056,270,000	
西日本旅客鉄道	51,100	7,350.00	375,585,000	
東海旅客鉄道	44,200	18,620.00	823,004,000	
西武ホールディングス	73,300	1,965.00	144,034,500	
鴻池運輸	7,700	1,425.00	10,972,500	
西日本鉄道	65,000	489.00	31,785,000	
ハマキョウレックス	3,500	2,083.00	7,290,500	
サカイ引越センター	1,800	3,100.00	5,580,000	
近鉄グループホールディングス	535,000	420.00	224,700,000	
阪急阪神ホールディングス	67,100	3,760.00	252,296,000	
南海電気鉄道	112,000	552.00	61,824,000	
京阪ホールディングス	119,000	717.00	85,323,000	
神戸電鉄	13,000	381.00	4,953,000	

名古屋鉄道	193,000	522.00	100,746,000	
山陽電気鉄道	20,000	607.00	12,140,000	
トランコム	1,600	5,500.00	8,800,000	
日本通運	205,000	569.00	116,645,000	
ヤマトホールディングス	95,000	2,248.50	213,607,500	
山九	70,000	716.00	50,120,000	
日新	21,000	364.00	7,644,000	
丸運	2,800	255.00	714,000	
丸全昭和運輸	19,000	449.00	8,531,000	
センコー	24,000	720.00	17,280,000	
トナミホールディングス	11,000	352.00	3,872,000	
ニッコンホールディングス	18,200	2,410.00	43,862,000	
日本石油輸送	600	2,510.00	1,506,000	
福山通運	33,000	649.00	21,417,000	
セイノーホールディングス	38,000	1,248.00	47,424,000	
神奈川中央交通	6,000	722.00	4,332,000	
日立物流	11,300	2,346.00	26,509,800	
丸和運輸機関	1,300	2,571.00	3,342,300	
C & F ロジホールディングス	5,200	1,577.00	8,200,400	
日本郵船	449,000	247.00	110,903,000	
商船三井	278,000	364.00	101,192,000	
川崎汽船	203,000	296.00	60,088,000	
N S ユナイテッド海運	24,000	230.00	5,520,000	
明治海運	5,100	441.00	2,249,100	
飯野海運	27,200	510.00	13,872,000	
共栄タンカー	6,000	229.00	1,374,000	
九州旅客鉄道	40,000	3,385.00	135,400,000	
日本航空	95,700	3,660.00	350,262,000	
A N A ホールディングス	986,000	327.40	322,816,400	
パスコ	5,000	412.00	2,060,000	
三菱倉庫	35,000	1,582.00	55,370,000	
三井倉庫ホールディングス	30,000	335.00	10,050,000	
住友倉庫	39,000	634.00	24,726,000	
澁澤倉庫	13,000	351.00	4,563,000	
ヤマタネ	2,300	1,628.00	3,744,400	
東陽倉庫	10,000	298.00	2,980,000	
乾汽船	3,700	993.00	3,674,100	
日本トランスシティ	12,000	461.00	5,532,000	
ケイヒン	10,000	157.00	1,570,000	
中央倉庫	3,000	1,096.00	3,288,000	
安田倉庫	4,100	782.00	3,206,200	
東洋埠頭	14,000	189.00	2,646,000	
宇徳	4,700	424.00	1,992,800	
上組	63,000	1,055.00	66,465,000	
サンリツ	1,200	521.00	625,200	
キムラユニティー	1,300	1,202.00	1,562,600	
キューソー流通システム	1,500	2,644.00	3,966,000	
郵船ロジスティクス	5,200	1,177.00	6,120,400	
近鉄エクスプレス	9,500	1,702.00	16,169,000	

東海運	2,700	452.00	1,220,400	
エーアイティー	3,500	1,095.00	3,832,500	
内外トランスライン	2,000	1,095.00	2,190,000	
東京放送ホールディングス	34,900	2,044.00	71,335,600	
日本テレビホールディングス	47,800	2,020.00	96,556,000	
朝日放送	4,600	780.00	3,588,000	
テレビ朝日ホールディングス	14,600	2,313.00	33,769,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	34,600	500.00	17,300,000	
テレビ東京ホールディングス	4,300	2,574.00	11,068,200	
日本B S放送	800	1,049.00	839,200	
ビジョン	600	3,895.00	2,337,000	
U－N E X T	1,100	1,165.00	1,281,500	
ワイヤレスゲート	1,600	1,541.00	2,465,600	
コネクシオ	4,400	1,569.00	6,903,600	
日本通信	39,200	180.00	7,056,000	
クロップス	200	602.00	120,400	
日本電信電話	421,100	4,771.00	2,009,068,100	
K D D I	518,900	2,935.50	1,523,230,950	
光通信	6,300	10,970.00	69,111,000	
N T T ドコモ	391,900	2,691.00	1,054,602,900	
エムティーアイ	8,500	686.00	5,831,000	
GMOインターネット	19,100	1,522.00	29,070,200	
カドカワ	15,500	1,620.00	25,110,000	
学研ホールディングス	16,000	308.00	4,928,000	
ゼンリン	7,000	2,194.00	15,358,000	
昭文社	2,600	710.00	1,846,000	
インプレスホールディングス	3,200	147.00	470,400	
東京電力ホールディングス	450,600	433.00	195,109,800	
中部電力	175,100	1,483.50	259,760,850	
関西電力	216,800	1,243.00	269,482,400	
中国電力	73,400	1,223.00	89,768,200	
北陸電力	52,000	1,117.00	58,084,000	
東北電力	132,700	1,440.00	191,088,000	
四国電力	47,800	1,093.00	52,245,400	
九州電力	117,300	1,243.00	145,803,900	
北海道電力	50,100	807.00	40,430,700	
沖縄電力	7,900	2,614.00	20,650,600	
電源開発	42,300	2,690.00	113,787,000	
エフオン	2,300	1,001.00	2,302,300	
イーレックス	2,300	3,670.00	8,441,000	
東京瓦斯	570,000	516.20	294,234,000	
大阪瓦斯	515,000	431.50	222,222,500	
東邦瓦斯	134,000	794.00	106,396,000	
北海道瓦斯	14,000	278.00	3,892,000	
広島ガス	8,700	372.00	3,236,400	
西部瓦斯	59,000	262.00	15,458,000	
静岡ガス	16,000	721.00	11,536,000	
メタウォーター	3,000	2,945.00	8,835,000	
アイネット	2,800	1,228.00	3,438,400	

松竹	35,000	1,319.00	46,165,000	
東宝	34,300	3,260.00	111,818,000	
エイチ・アイ・エス	9,000	2,927.00	26,343,000	
東映	20,000	1,004.00	20,080,000	
ラックランド	800	1,998.00	1,598,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	32,400	5,360.00	173,664,000	
共立メンテナンス	4,300	6,930.00	29,799,000	
イチネンホールディングス	5,700	1,196.00	6,817,200	
建設技術研究所	3,200	1,094.00	3,500,800	
スペース	2,900	1,285.00	3,726,500	
アインホールディングス	6,800	8,530.00	58,004,000	
燦ホールディングス	1,100	1,590.00	1,749,000	
ピー・シー・エー	800	1,560.00	1,248,000	
スバル興業	4,000	520.00	2,080,000	
東京テアトル	21,000	152.00	3,192,000	
タナベ経営	1,100	1,395.00	1,534,500	
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,051.00	735,700	
ナガワ	900	4,550.00	4,095,000	
よみうりランド	11,000	462.00	5,082,000	
東京都競馬	38,000	258.00	9,804,000	
常磐興産	2,000	1,614.00	3,228,000	
カナモト	7,900	2,885.00	22,791,500	
東京ドーム	22,000	1,094.00	24,068,000	
D T S	5,400	2,587.00	13,969,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	20,400	3,405.00	69,462,000	
シーイーシー	3,400	1,839.00	6,252,600	
カプコン	12,500	2,391.00	29,887,500	
西尾レントオール	4,500	3,300.00	14,850,000	
アイ・エス・ピー	400	896.00	358,400	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	29,000	37.00	1,073,000	
日本空港ビルデング	16,700	3,955.00	66,048,500	
トランス・コスモス	6,500	2,617.00	17,010,500	
乃村工藝社	12,100	1,912.00	23,135,200	
ジャステック	3,400	1,035.00	3,519,000	
S C S K	14,400	4,165.00	59,976,000	
藤田観光	18,000	370.00	6,660,000	
K N T－C Tホールディングス	29,000	138.00	4,002,000	
日本管財	5,100	1,789.00	9,123,900	
トーカイ	2,600	4,100.00	10,660,000	
白洋舎	600	2,700.00	1,620,000	
セコム	57,700	8,194.00	472,793,800	
日本システムウエア	1,900	1,614.00	3,066,600	
セントラル警備保障	2,400	1,898.00	4,555,200	
アイネス	6,700	1,144.00	7,664,800	
丹青社	9,600	867.00	8,323,200	
メイテック	6,700	4,350.00	29,145,000	
T K C	4,800	3,420.00	16,416,000	
アサツー ディ・ケイ	9,000	2,891.00	26,019,000	
富士ソフト	7,900	2,824.00	22,309,600	

応用地質	5,300	1,466.00	7,769,800	
船井総研ホールディングス	7,300	1,958.00	14,293,400	
N S D	11,300	1,751.00	19,786,300	
進学会	2,300	571.00	1,313,300	
丸紅建材リース	4,000	240.00	960,000	
オオバ	3,000	482.00	1,446,000	
コナミホールディングス	23,700	4,605.00	109,138,500	
学究社	800	1,627.00	1,301,600	
ベネッセホールディングス	18,600	3,340.00	62,124,000	
イオンディライト	6,400	3,470.00	22,208,000	
ナック	3,000	991.00	2,973,000	
福井コンピュータホールディングス	1,400	2,830.00	3,962,000	
ニチイ学館	10,300	882.00	9,084,600	
ダイセキ	9,800	2,317.00	22,706,600	
ステップ	2,000	1,402.00	2,804,000	
日鉄住金物産	4,600	4,890.00	22,494,000	
元気寿司	1,300	2,269.00	2,949,700	
トラスコ中山	12,000	2,568.00	30,816,000	
ヤマダ電機	175,300	577.00	101,148,100	
オートバックスセブン	19,400	1,802.00	34,958,800	
モリト	4,200	974.00	4,090,800	
アークランドサカモト	8,800	1,423.00	12,522,400	
ニトリホールディングス	22,700	12,250.00	278,075,000	
グルメ杵屋	4,000	1,041.00	4,164,000	
愛眼	4,200	197.00	827,400	
ケーユーホールディングス	2,600	914.00	2,376,400	
吉野家ホールディングス	18,600	1,666.00	30,987,600	
加藤産業	8,400	2,932.00	24,628,800	
イノテック	5,200	696.00	3,619,200	
イエローハット	5,000	2,789.00	13,945,000	
松屋フーズ	2,500	4,170.00	10,425,000	
J B C Cホールディングス	4,300	806.00	3,465,800	
J Kホールディングス	4,600	672.00	3,091,200	
サガミチェーン	6,600	1,376.00	9,081,600	
日伝	2,100	3,500.00	7,350,000	
関西スーパーマーケット	4,100	1,534.00	6,289,400	
ミロク情報サービス	3,700	1,789.00	6,619,300	
北沢産業	4,000	219.00	876,000	
杉本商事	3,000	1,558.00	4,674,000	
因幡電機産業	7,300	4,000.00	29,200,000	
王将フードサービス	3,900	4,245.00	16,555,500	
ブレナス	5,800	2,495.00	14,471,000	
ミニストップ	4,100	2,166.00	8,880,600	
アークス	9,800	2,585.00	25,333,000	
バローホールディングス	11,400	2,774.00	31,623,600	
バイテックホールディングス	2,300	1,375.00	3,162,500	
ミスミグループ本社	58,900	2,075.00	122,217,500	
藤久	500	1,745.00	872,500	
アルテック	4,300	217.00	933,100	

ベルク	2,300	4,530.00	10,419,000	
大庄	3,000	1,595.00	4,785,000	
タキヒヨー	8,000	483.00	3,864,000	
ファーストリテイリング	8,700	34,990.00	304,413,000	
ソフトバンクグループ	236,100	8,789.00	2,075,082,900	
蔵王産業	600	1,507.00	904,200	
スズケン	23,800	3,835.00	91,273,000	
サンドラッグ	10,000	7,440.00	74,400,000	
サックスパー ホールディングス	5,300	1,255.00	6,651,500	
ジェコス	3,700	1,130.00	4,181,000	
ヤマザワ	1,200	1,859.00	2,230,800	
やまや	900	1,721.00	1,548,900	
ルネサスイーストン	4,800	615.00	2,952,000	
ベルーナ	14,000	849.00	11,886,000	
合 計	80,377,100	—	119,939,478,880	

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。

「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		555,149,420	614,766
コール・ローン		12,096,597	547,417,862
国債証券		111,482,950,600	104,617,617,300
地方債証券		8,712,383,705	7,819,272,887
特殊債券		11,929,987,179	10,320,032,306
社債券		8,080,609,220	6,278,678,880
未収入金		977,700,000	201,515,500
未収利息		526,178,865	435,379,724
前払費用		4,240,941	7,147,304
流動資産合計		142,281,296,527	130,227,676,529
資産合計		142,281,296,527	130,227,676,529
負債の部			
流動負債			
未払解約金		1,220,714,241	631,982,642
未払利息		—	1,587

その他未払費用		—	603
流動負債合計		1,220,714,241	631,984,832
負債合計		1,220,714,241	631,984,832
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,637,231,314	103,517,691,052
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		28,423,350,972	26,078,000,645
元本等合計		141,060,582,286	129,595,691,697
純資産合計		141,060,582,286	129,595,691,697
負債純資産合計		142,281,296,527	130,227,676,529

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

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（平成28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1 期首元本額	145,599,818,302円	112,637,231,314円
期中追加設定元本額	20,917,964,505円	22,629,021,598円
期中一部解約元本額	53,880,551,493円	31,748,561,860円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	1,165,481,769円	805,542,526円
日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,475,655,804円	3,377,347,591円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	118,068,530円	45,229,358円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	6,850,158,087円	3,031,368,685円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	1,738,192円	1,752,663円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	66,210,122円	33,898,683円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	48,238,130円	40,616,272円

バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	20,871,418,406円	18,938,672,963円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	83,382,907円	46,166,168円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	11,523,951,706円	9,360,599,138円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	3,388,876,404円	3,036,249,629円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	26,358,049円	22,644,378円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	861,692,718円	798,228,832円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	2,813,677,488円	3,150,743,255円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,282,599,221円	1,421,063,351円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	10,926,324,967円	9,655,281,859円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	967,179,722円	817,937,244円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	3,602,900,305円	3,440,393,057円
日本債券インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	236,460,798円	221,733,796円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	85,553,492円	82,238,772円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	47,310,904円	45,007,945円
日本債券インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	1,334,458,108円	2,720,841,307円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	61,812,496円	62,109,085円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	5,390,636,692円	4,868,743,728円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	52,428,279円	37,981,209円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	56,478,381円	56,422,288円
バランスファンドVA50D＜適格機関投資家限定＞	443,409円	— 円
バランスファンドVA10A＜適格機関投資家限定＞	1,661,098,501円	1,561,604,322円
日本債券インデックス・ファンドVA3＜適格機関投資家限定＞	6,919,654,462円	9,632,197,940円
日本債券インデックス・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,139,155,035円	3,072,055,263円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	4,101,545,966円	3,612,051,964円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	15,133,234,444円	13,620,961,501円

4 資産インデックスバランス V A 5 0 <適格機関投資家限定>	18,902,051円	15,928,925円
T a d リスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金 <適格機関投資家限定>	1,265,180,071円	1,050,932,168円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド（年金） <適格機関投資家限定>	492,449,114円	— 円
フレックス資産配分戦略ファンド <適格機関投資家限定>	192,174,876円	— 円
T a d リスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル） <適格機関投資家限定>	351,635,700円	231,158,237円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	— 円	837,041,606円
グローバルバランス 4 0 V A <適格機関投資家限定>	262,609,337円	225,199,272円
グローバルバランス 4 0 V A 2 <適格機関投資家限定>	3,148,233,745円	2,898,801,674円
グローバルバランス 4 0 V A 3 <適格機関投資家限定>	191,933,757円	168,092,663円
グローバルバランス 5 0 V A <適格機関投資家限定>	88,700,940円	74,013,725円
ワールドバランス V A 0 8 0 9 <適格機関投資家限定>	— 円	286,522,190円
ワールドバランス V A 0 9 0 2 <適格機関投資家限定>	— 円	112,315,820円
世界株式 V C ファンド <適格機関投資家限定>	1,331,228,229円	— 円
計	112,637,231,314円	103,517,691,052円
2 受益権の総数	112,637,231,314口	103,517,691,052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28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	（平成28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	3,542,878,200	△2,754,395,300
地方債証券	116,381,829	△143,895,653
特殊債券	155,596,813	△155,860,543
社債券	14,831,330	△82,272,300
合計	3,829,688,172	△3,136,423,796

（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27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2523円 （12,523円）	1.2519円 （12,519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）	200,000,000	244,782,000	
	第101回利付国債（20年）	100,000,000	124,571,000	
	第102回利付国債（20年）	200,000,000	249,824,000	
	第103回利付国債（20年）	200,000,000	247,600,000	
	第104回利付国債（20年）	150,000,000	182,364,000	
	第105回利付国債（20年）	100,000,000	121,840,000	
	第106回利付国債（20年）	200,000,000	245,948,000	
	第107回利付国債（20年）	200,000,000	244,318,000	
	第108回利付国債（20年）	100,000,000	119,845,000	
	第109回利付国債（20年）	100,000,000	120,108,000	
	第110回利付国債（20年）	200,000,000	244,932,000	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	247,958,000	
	第112回利付国債（20年）	200,000,000	245,554,000	
	第112回利付国債（5年）	100,000,000	100,889,000	
	第113回利付国債（20年）	200,000,000	246,010,000	
	第113回利付国債（5年）	500,000,000	503,780,000	
	第114回利付国債（20年）	300,000,000	369,882,000	

第114回利付国債（5年）	100,000,000	100,877,000	
第115回利付国債（20年）	300,000,000	373,620,000	
第115回利付国債（5年）	300,000,000	302,157,000	
第116回利付国債（20年）	200,000,000	249,522,000	
第116回利付国債（5年）	200,000,000	201,668,000	
第117回利付国債（5年）	600,000,000	605,238,000	
第118回利付国債（20年）	400,000,000	489,624,000	
第118回利付国債（5年）	500,000,000	504,665,000	
第119回利付国債（5年）	550,000,000	553,850,000	
第120回利付国債（5年）	500,000,000	504,980,000	
第121回利付国債（5年）	200,000,000	201,474,000	
第122回利付国債（20年）	300,000,000	359,634,000	
第122回利付国債（5年）	550,000,000	554,213,000	
第123回利付国債（20年）	500,000,000	620,290,000	
第123回利付国債（5年）	600,000,000	604,812,000	
第124回利付国債（5年）	500,000,000	504,090,000	
第125回利付国債（5年）	500,000,000	504,310,000	
第126回利付国債（20年）	400,000,000	491,476,000	
第127回利付国債（20年）	400,000,000	486,080,000	
第128回利付国債（20年）	400,000,000	486,552,000	
第128回利付国債（5年）	300,000,000	302,802,000	
第129回利付国債（5年）	1,350,000,000	1,362,717,000	
第12回利付国債（30年）	300,000,000	375,771,000	
第130回利付国債（20年）	200,000,000	240,550,000	
第130回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,716,473,000	
第132回利付国債（20年）	200,000,000	237,884,000	
第133回利付国債（20年）	300,000,000	361,050,000	
第135回利付国債（20年）	300,000,000	356,958,000	
第136回利付国債（20年）	200,000,000	234,948,000	
第137回利付国債（20年）	150,000,000	178,540,500	
第139回利付国債（20年）	200,000,000	235,160,000	
第13回利付国債（30年）	300,000,000	371,565,000	
第140回利付国債（20年）	200,000,000	238,120,000	
第141回利付国債（20年）	200,000,000	238,340,000	
第142回利付国債（20年）	500,000,000	603,280,000	
第143回利付国債（20年）	300,000,000	352,761,000	
第144回利付国債（20年）	200,000,000	232,168,000	
第145回利付国債（20年）	450,000,000	535,941,000	
第146回利付国債（20年）	370,000,000	440,658,900	
第147回利付国債（20年）	360,000,000	422,766,000	
第148回利付国債（20年）	500,000,000	579,095,000	
第149回利付国債（20年）	500,000,000	578,785,000	
第14回ポーランド共和国	100,000,000	100,241,000	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	391,500,000	
第150回利付国債（20年）	400,000,000	455,948,000	
第151回利付国債（20年）	300,000,000	331,383,000	
第152回利付国債（20年）	350,000,000	386,123,500	
第153回利付国債（20年）	350,000,000	391,737,500	
第154回利付国債（20年）	140,000,000	154,037,800	

第155回利付国債（20年）	150,000,000	159,474,000	
第156回利付国債（20年）	700,000,000	667,471,000	
第157回利付国債（20年）	1,000,000,000	914,110,000	
第158回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,110,394,000	
第159回利付国債（20年）	500,000,000	490,865,000	
第15回利付国債（30年）	200,000,000	264,612,000	
第16回利付国債（30年）	200,000,000	264,622,000	
第17回利付国債（30年）	200,000,000	261,334,000	
第18回利付国債（30年）	100,000,000	129,190,000	
第19回利付国債（30年）	200,000,000	258,474,000	
第1回利付国債（30年）	300,000,000	394,710,000	
第1回利付国債（40年）	160,000,000	224,544,000	
第20回利付国債（30年）	300,000,000	397,920,000	
第21回利付国債（30年）	200,000,000	258,382,000	
第22回利付国債（30年）	100,000,000	132,855,000	
第23回利付国債（30年）	100,000,000	133,015,000	
第24回利付国債（30年）	320,000,000	425,760,000	
第25回利付国債（30年）	100,000,000	129,545,000	
第26回利付国債（30年）	150,000,000	197,131,500	
第27回利付国債（30年）	320,000,000	428,214,400	
第28回利付国債（30年）	300,000,000	402,855,000	
第290回利付国債（10年）	500,000,000	509,025,000	
第291回利付国債（10年）	100,000,000	101,697,000	
第292回利付国債（10年）	400,000,000	408,508,000	
第293回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,027,550,000	
第294回利付国債（10年）	400,000,000	410,492,000	
第295回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,125,927,000	
第296回利付国債（10年）	100,000,000	102,775,000	
第297回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,236,180,000	
第298回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,645,296,000	
第299回利付国債（10年）	400,000,000	412,648,000	
第29回利付国債（30年）	200,000,000	265,472,000	
第2回利付国債（30年）	380,000,000	483,432,200	
第2回利付国債（40年）	500,000,000	677,790,000	
第300回利付国債（10年）	700,000,000	725,046,000	
第301回利付国債（10年）	600,000,000	623,808,000	
第302回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,037,340,000	
第303回利付国債（10年）	600,000,000	624,684,000	
第304回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,142,416,000	
第305回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,041,720,000	
第306回利付国債（10年）	800,000,000	838,512,000	
第307回利付国債（10年）	900,000,000	940,554,000	
第308回利付国債（10年）	700,000,000	733,649,000	
第309回利付国債（10年）	800,000,000	833,120,000	
第30回利付国債（30年）	350,000,000	459,252,500	
第310回利付国債（10年）	900,000,000	936,531,000	
第311回利付国債（10年）	600,000,000	620,040,000	
第312回利付国債（10年）	800,000,000	840,736,000	
第313回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,057,870,000	

第314回利付国債（10年）	900,000,000	944,721,000	
第315回利付国債（10年）	750,000,000	792,675,000	
第316回利付国債（10年）	500,000,000	526,280,000	
第317回利付国債（10年）	600,000,000	633,090,000	
第318回利付国債（10年）	250,000,000	262,640,000	
第319回利付国債（10年）	700,000,000	740,362,000	
第31回利付国債（30年）	500,000,000	648,105,000	
第320回利付国債（10年）	700,000,000	736,967,000	
第321回利付国債（10年）	300,000,000	316,497,000	
第322回利付国債（10年）	700,000,000	734,930,000	
第323回利付国債（10年）	200,000,000	210,364,000	
第324回利付国債（10年）	400,000,000	418,592,000	
第325回利付国債（10年）	500,000,000	524,200,000	
第326回利付国債（10年）	300,000,000	313,233,000	
第327回利付国債（10年）	700,000,000	734,972,000	
第328回利付国債（10年）	500,000,000	519,790,000	
第329回利付国債（10年）	500,000,000	526,790,000	
第32回利付国債（30年）	380,000,000	501,763,400	
第330回利付国債（10年）	900,000,000	949,833,000	
第331回利付国債（10年）	500,000,000	521,095,000	
第332回利付国債（10年）	600,000,000	625,848,000	
第333回利付国債（10年）	700,000,000	730,212,000	
第334回利付国債（10年）	400,000,000	417,268,000	
第335回利付国債（10年）	800,000,000	829,040,000	
第336回利付国債（10年）	200,000,000	207,336,000	
第337回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,021,070,000	
第338回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,028,960,000	
第339回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,029,010,000	
第33回利付国債（30年）	250,000,000	314,810,000	
第340回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,338,272,000	
第341回利付国債（10年）	600,000,000	612,366,000	
第342回利付国債（10年）	800,000,000	802,160,000	
第343回利付国債（10年）	700,000,000	701,617,000	
第344回利付国債（10年）	2,130,000,000	2,134,047,000	
第345回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,000,970,000	
第34回利付国債（30年）	500,000,000	653,155,000	
第35回利付国債（30年）	400,000,000	506,380,000	
第36回利付国債（30年）	420,000,000	533,038,800	
第371回利付国債（2年）	1,000,000,000	1,006,640,000	
第372回利付国債（2年）	400,000,000	402,740,000	
第37回利付国債（30年）	450,000,000	562,257,000	
第38回利付国債（20年）	100,000,000	103,196,000	
第38回利付国債（30年）	400,000,000	491,588,000	
第39回利付国債（20年）	100,000,000	103,088,000	
第39回利付国債（30年）	330,000,000	413,424,000	
第3回利付国債（30年）	300,000,000	378,564,000	
第3回利付国債（40年）	250,000,000	340,640,000	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	104,024,000	
第40回利付国債（30年）	380,000,000	467,377,200	

第４１回利付国債（２０年）	100,000,000	103,557,000	
第４１回利付国債（３０年）	150,000,000	181,014,000	
第４２回利付国債（３０年）	300,000,000	362,094,000	
第４３回利付国債（３０年）	300,000,000	362,163,000	
第４４回利付国債（３０年）	200,000,000	241,482,000	
第４５回利付国債（２０年）	650,000,000	701,135,500	
第４５回利付国債（３０年）	320,000,000	370,556,800	
第４６回利付国債（３０年）	400,000,000	463,120,000	
第４７回利付国債（２０年）	600,000,000	650,250,000	
第４７回利付国債（３０年）	200,000,000	236,672,000	
第４８回利付国債（２０年）	300,000,000	330,222,000	
第４８回利付国債（３０年）	200,000,000	226,854,000	
第４９回利付国債（２０年）	100,000,000	109,050,000	
第４９回利付国債（３０年）	50,000,000	56,694,500	
第４回利付国債（４０年）	250,000,000	342,332,500	
第５０回利付国債（２０年）	50,000,000	54,115,500	
第５０回利付国債（３０年）	500,000,000	490,740,000	
第５１回利付国債（２０年）	350,000,000	381,934,000	
第５１回利付国債（３０年）	600,000,000	511,140,000	
第５２回利付国債（２０年）	100,000,000	110,067,000	
第５２回利付国債（３０年）	550,000,000	496,292,500	
第５３回利付国債（３０年）	150,000,000	138,928,500	
第５５回利付国債（２０年）	500,000,000	553,125,000	
第５７回利付国債（２０年）	800,000,000	884,208,000	
第５回利付国債（３０年）	100,000,000	125,772,000	
第５回利付国債（４０年）	130,000,000	171,083,900	
第６０回利付国債（２０年）	700,000,000	759,731,000	
第６１回利付国債（２０年）	350,000,000	372,491,000	
第６３回利付国債（２０年）	500,000,000	558,320,000	
第６５回利付国債（２０年）	400,000,000	452,636,000	
第６８回利付国債（２０年）	500,000,000	578,190,000	
第６９回利付国債（２０年）	300,000,000	344,790,000	
第６回利付国債（３０年）	100,000,000	129,010,000	
第６回利付国債（４０年）	150,000,000	193,480,500	
第７０回利付国債（２０年）	600,000,000	704,934,000	
第７２回利付国債（２０年）	600,000,000	694,392,000	
第７４回利付国債（２０年）	300,000,000	348,477,000	
第７６回利付国債（２０年）	200,000,000	229,928,000	
第７７回利付国債（２０年）	300,000,000	347,304,000	
第７８回利付国債（２０年）	250,000,000	288,455,000	
第７回利付国債（３０年）	300,000,000	383,244,000	
第７回利付国債（４０年）	160,000,000	196,948,800	
第８０回利付国債（２０年）	100,000,000	117,040,000	
第８１回利付国債（２０年）	200,000,000	233,200,000	
第８３回利付国債（２０年）	300,000,000	353,565,000	
第８５回利付国債（２０年）	200,000,000	236,596,000	
第８８回利付国債（２０年）	400,000,000	482,624,000	
第８９回利付国債（２０年）	400,000,000	478,916,000	
第８回利付国債（３０年）	300,000,000	361,953,000	

	第8回利付国債（40年）	50,000,000	56,927,000	
	第90回利付国債（20年）	300,000,000	360,606,000	
	第91回利付国債（20年）	300,000,000	363,459,000	
	第92回利付国債（20年）	340,000,000	406,748,800	
	第93回利付国債（20年）	300,000,000	357,009,000	
	第94回利付国債（20年）	300,000,000	360,003,000	
	第95回利付国債（20年）	150,000,000	183,531,000	
	第96回利付国債（20年）	100,000,000	120,312,000	
	第97回利付国債（20年）	150,000,000	182,581,500	
	第98回利付国債（20年）	100,000,000	120,676,000	
	第99回利付国債（20年）	200,000,000	241,928,000	
	第9回利付国債（30年）	100,000,000	114,541,000	
	第9回利付国債（40年）	440,000,000	358,278,800	
国債証券	小計	95,530,000,000	104,617,617,300	
地方債証券	第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,278,000	
	第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,641,000	
	第10回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	120,603,000	
	第10回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,489,000	
	第111回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,446,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,204,000	
	第120回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	102,430,000	
	第124回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,321,000	
	第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,915,000	
	第129回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,181,000	
	第12回東京都公募公債（20年）	100,000,000	120,905,000	
	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,504,000	
	第135回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	101,019,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,124,000	
	第13回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,530,000	
	第145回神奈川県公募公債	40,000,000	40,054,800	
	第147回神奈川県公募公債	50,000,000	50,324,000	
	第149回神奈川県公募公債	9,000,000	9,096,390	
	第14回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	121,509,000	
	第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,919,000	
	第188回神奈川県公募公債	100,000,000	105,084,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,820,000	
	第2回兵庫県公募公債（30年）	100,000,000	128,017,000	
	第301回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,032,300	
	第305回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	40,402,800	
	第309回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,138,900	
	第30回2号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	102,887,000	
	第312回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,174,800	
	第316回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,264,600	
	第31回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	102,838,000	
	第320回大阪府公募公債（10年）	10,000,000	10,323,300	
	第323回大阪府公募公債（10年）	40,000,000	41,354,800	
	第324回大阪府公募公債（10年）	8,000,000	8,273,920	
	第325回大阪府公募公債（10年）	6,000,000	6,215,580	

第326回大阪府公募公債（10年）	56,000,000	58,093,840	
第346回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,860,000	
第368回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,466,000	
第374回大阪府公募公債（10年）	134,000,000	141,290,940	
第387回大阪府公募公債（10年）	44,040,000	45,237,447	
第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	131,479,000	
第3回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	110,383,000	
第468回名古屋市長市公募公債（10年）	100,000,000	103,561,000	
第480回名古屋市長市公募公債（10年）	100,000,000	104,283,000	
第49回共同発行市場公募地方債	15,500,000	15,548,515	
第4回横浜市公募公債（30年）	100,000,000	130,110,000	
第56回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,064,750	
第57回共同発行市場公募地方債	5,000,000	5,069,000	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	123,730,000	
第60回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,160,600	
第61回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,181,000	
第62回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,435,000	
第63回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,251,100	
第649回東京都公募公債	2,300,000	2,323,000	
第652回東京都公募公債	1,400,000	1,419,474	
第658回東京都公募公債	10,000,000	10,257,800	
第662回東京都公募公債	10,000,000	10,262,500	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,801,000	
第722回東京都公募公債	100,000,000	104,639,000	
第738回東京都公募公債	100,000,000	102,175,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,650,000	
第7回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,923,000	
第82回川崎市公募公債	130,000,000	135,064,800	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,296,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,215,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,518,000	
第90回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,970,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,213,000	
平成18年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,013,700	
平成18年度第7回千葉県公募公債	2,000,000	2,000,400	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	101,670,000	
平成19年度第14回北海道公募公債	10,000,000	10,170,600	
平成19年度第1回愛知県公募公債（10年）	21,700,000	21,792,008	
平成19年度第1回岡山県公募公債（10年）	42,200,000	42,757,884	
平成19年度第1回広島県公募公債	13,800,000	13,862,790	
平成19年度第1回埼玉県公募公債	13,150,000	13,191,422	
平成19年度第1回静岡県公募公債	18,300,000	18,387,291	
平成19年度第1回千葉県公募公債	2,000,000	2,009,060	
平成19年度第1回大分県公募公債	15,670,000	15,871,829	
平成19年度第2回熊本県公募公債（10年）	30,000,000	30,385,200	
平成19年度第4回大阪市公募公債	10,000,000	10,062,800	

平成19年度第5回福岡市公募公債	13,700,000	13,922,762	
平成19年度第9回大阪市公募公債	30,000,000	30,385,500	
平成19年度第9回北海道公募公債	21,000,000	21,274,680	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	103,158,000	
平成20年度第1回浜松市公募公債	11,000,000	11,330,550	
平成20年度第2回札幌市公募公債	22,550,000	23,125,476	
平成20年度第2回大阪市公募公債	20,000,000	20,515,600	
平成20年度第3回大阪市公募公債	30,000,000	30,770,700	
平成20年度第7回千葉県公募公債	1,000,000	1,028,580	
平成20年度第7回兵庫県公募公債	10,000,000	10,249,800	
平成20年度第8回大阪市公募公債	40,000,000	41,231,600	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	103,868,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	20,000,000	20,659,600	
平成21年度第1回千葉県公募公債	40,000,000	41,322,800	
平成21年度第2回熊本県公募公債（10年）	10,000,000	10,360,400	
平成21年度第2回広島県公募公債	16,160,000	16,727,377	
平成21年度第2回新潟県公募公債	10,000,000	10,426,100	
平成21年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	103,841,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	40,000,000	41,407,200	
平成21年度第3回埼玉県公募公債	20,000,000	20,763,800	
平成21年度第6回北海道公募公債	60,000,000	62,402,400	
平成21年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,196,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	12,000,000	12,447,960	
平成22年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	119,917,000	
平成23年度第2回北九州市公募公債	11,000,000	11,541,310	
平成23年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	104,734,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,269,000	
平成24年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	104,375,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債（15年）	100,000,000	110,850,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,164,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	104,206,000	
平成24年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,315,000	
平成24年度第5回京都府公募公債	30,000,000	31,276,500	
平成24年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,285,000	
平成24年度第8回京都府公募公債	30,000,000	31,158,000	
平成24年度第8回福岡市公募公債	100,000,000	103,698,000	
平成24年度第9回北海道公募公債	7,400,000	7,703,252	
平成25年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,164,000	
平成25年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,075,000	
平成25年度第7回北海道公募公債	100,000,000	104,597,000	
平成26年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	111,102,000	
地方債証券 小計	7,300,870,000	7,819,272,887	

特殊債券	い第757号農林債	100,000,000	100,458,000	
	い第758号農林債	100,000,000	100,558,000	
	い第763号商工債	100,000,000	100,536,000	
	い第763号農林債	100,000,000	100,536,000	
	い第772号農林債	100,000,000	100,597,000	
	第103回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	104,008,000	
	第10回日本政策金融公庫社債	100,000,000	121,430,000	
	第10回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,123,100	
	第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,370,000	
	第11回関西国際空港	100,000,000	101,386,000	
	第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,334,000	
	第11回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,587,000	
	第12回政府保証東日本高速道路債券	22,000,000	22,338,800	
	第13回沖縄振興開発金融公庫債券	10,000,000	10,387,900	
	第13回公営企業債券（20年）	10,000,000	11,605,700	
	第13回政府保証西日本高速道路債券	4,000,000	4,061,800	
	第149回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,022,000	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	5,000,000	5,030,300	
	第14回地方公共団体金融機構債券（20 年）	100,000,000	122,345,000	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	10,000,000	10,238,000	
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,000,390	
	第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構 債券	29,115,000	30,250,776	
	第171回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	114,683,000	
	第172回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	121,526,000	
	第179号商工債（3年）	100,000,000	100,106,000	
	第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構 債券	29,706,000	30,939,393	
	第186回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	103,990,000	
	第189回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	103,252,000	
	第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	103,999,000	
	第18回政府保証日本高速道路保有・債務返 済機構債券	100,000,000	109,973,000	
	第18回政府保証日本政策投資銀行債券	1,000,000	1,009,250	
	第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構 債券	29,781,000	30,879,918	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債 券	100,000,000	142,343,000	
	第191回政府保証中小企業債券	16,000,000	16,155,040	
	第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	105,327,000	
	第19回都市再生債券	50,000,000	51,096,000	
	第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,961,000	52,847,576	
	第200回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債券	1,000,000	1,051,160	

第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,284,000	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,461,000	
第20回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,171,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	106,407,420	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,028,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,374,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,085,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	116,243,000	
第24回政府保証中日本高速道路債券	20,000,000	20,503,000	
第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,196,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,894,000	73,728,810	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	20,000,000	20,692,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,498,000	
第283回信金中金債（5年）	100,000,000	100,458,000	
第284回信金中金債（5年）	100,000,000	100,558,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,265,000	41,040,743	
第28回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	111,086,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人）	200,000,000	200,524,000	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,527,000	20,385,211	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,294,000	43,170,185	
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	106,948,000	
第2回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,568,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,090,000	36,540,620	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,844,000	48,840,363	
第300回信金中金債（5年）	100,000,000	100,566,000	
第303回信金中金債（5年）	100,000,000	100,681,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,029,000	
第30回政府保証地方公共団体金融機構債券	174,000,000	182,275,440	
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	10,015,300	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,505,000	43,380,855	
第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	114,000,000	120,061,380	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,413,000	44,209,619	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,475,000	43,122,469	
第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	3,000,000	3,008,910	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	105,427,000	
第342回東京交通債券	30,000,000	33,561,300	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	50,222,000	

第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,851,000	25,066,685	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	7,000,000	7,043,960	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,691,000	49,621,794	
第36回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,611,000	
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,816,000	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000	1,008,410	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,623,000	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,438,000	21,480,338	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,064,000	51,762,029	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,250,000	52,833,855	
第39回日本政策投資銀行社債	10,000,000	10,101,400	
第40回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,617,000	
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	1,010,030	
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	66,679,800	
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	1,012,520	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,919,000	63,972,869	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,416,000	126,428,107	
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	9,118,980	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,829,000	55,250,232	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,241,000	
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	68,868,360	
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	13,184,990	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,439,000	
第4回公営企業債券（30年）	100,000,000	135,895,000	
第50回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,824,000	
第51回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,933,000	
第51回日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,441,000	
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	11,168,190	
第55回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,738,000	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,078,000	68,427,564	
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	2,043,460	
第5回国際協力機構債券	100,000,000	118,457,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,216,000	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,253,000	
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	8,195,920	

第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,228,000	69,375,154	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,137,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,598,000	73,220,009	
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	79,192,960	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,841,000	76,245,588	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	18,496,000	19,713,961	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,180,000	28,077,483	
第6回中小企業債券	10,000,000	10,084,700	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,294,000	69,349,490	
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	63,611,380	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,602,000	67,974,168	
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	103,087,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,584,000	70,061,629	
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	68,266,440	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,287,000	73,922,480	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,796,000	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,550,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,416,000	
第873回政府保証公営企業債券	90,000,000	90,000,000	
第874回政府保証公営企業債券	9,000,000	9,024,300	
第875回政府保証公営企業債券	74,000,000	74,314,500	
第879回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,138,320	
第880回政府保証公営企業債券	15,000,000	15,189,000	
第881回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,390,000	
第882回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,016,040	
第885回政府保証公営企業債券	40,000,000	40,854,000	
第886回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,071,970	
第89回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,325,000	
第8回公営企業債券（30年）	10,000,000	12,906,900	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,600,000	25,019,540	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,201,000	
第96回都市再生債券	100,000,000	103,133,000	
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	103,850,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,799,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,650,000	41,211,722	
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,806,000	26,391,351	
特殊債券 小計	9,640,572,000	10,320,032,306	

社債券	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	109,269,000	
	第11回三井住友銀行	100,000,000	101,679,000	
	第11回電源開発	100,000,000	113,178,000	
	第12回パナソニック	100,000,000	100,716,000	
	第12回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	100,883,000	
	第13回オリックス	100,000,000	100,823,000	
	第13回東京地下鉄	100,000,000	115,486,000	
	第14回トヨタ自動車	100,000,000	104,738,000	
	第14回武田薬品工業	100,000,000	101,062,000	
	第16回ジェイ エフ イー ホールディングス	100,000,000	100,205,000	
	第17回東日本旅客鉄道	100,000,000	108,817,000	
	第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	100,000,000	100,381,000	
	第20回大阪瓦斯	100,000,000	106,021,000	
	第23回三菱UFJリース	100,000,000	100,642,000	
	第245回四国電力	100,000,000	107,819,000	
	第25回日本郵船	100,000,000	115,372,000	
	第261回北海道電力	12,000,000	12,241,680	
	第27回エヌ・ティ・ティ・データ	100,000,000	103,507,000	
	第281回北陸電力	100,000,000	102,274,000	
	第28回東京瓦斯	100,000,000	119,738,000	
	第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ	100,000,000	100,525,000	
	第2回あおぞら銀行	100,000,000	100,235,000	
	第32回東日本旅客鉄道	100,000,000	114,446,000	
	第33回大成建設	100,000,000	100,805,000	
	第354回中国電力	100,000,000	102,351,000	
	第37回三菱化学	100,000,000	102,908,000	
	第382回東北電力	10,000,000	10,053,200	
	第394回九州電力	100,000,000	101,043,000	
	第39回野村ホールディングス	100,000,000	100,760,000	
	第3回GLP投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,485,000	
	第3回富士フイルムホールディングス	100,000,000	103,402,000	
	第400回九州電力	100,000,000	104,970,000	
	第42回ソフトバンク	100,000,000	100,030,000	
	第445回東北電力	100,000,000	102,997,000	
	第46回伊藤忠商事	100,000,000	100,350,000	
	第473回関西電力	100,000,000	103,330,000	
	第47回東海旅客鉄道	100,000,000	127,201,000	
	第486回中部電力	100,000,000	102,494,000	
	第4回ヒューリック	100,000,000	100,544,000	
	第4回プレミアム投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,605,000	
	第4回森トラスト総合リート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,999,000	
	第4回東京地下鉄	10,000,000	11,914,000	
	第506回中部電力	100,000,000	102,493,000	
	第525回東京電力	100,000,000	100,151,000	

第531回東京電力	100,000,000	100,962,000	
第536回東京電力	100,000,000	101,359,000	
第545回東京電力	100,000,000	102,335,000	
第54回日立キャピタル	100,000,000	100,578,000	
第57回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	111,901,000	
第60回トヨタファイナンス	100,000,000	100,405,000	
第63回日本電信電話	100,000,000	102,664,000	
第65回三菱地所	100,000,000	116,182,000	
第69回東日本旅客鉄道	100,000,000	103,891,000	
第6回ノルデア・バンク・アクツィエボラ グ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,040,000	
第6回株式会社りそな銀行	100,000,000	105,575,000	
第7回みずほコーポレート銀行	100,000,000	105,337,000	
第7回三井住友信託銀行	100,000,000	100,557,000	
第84回住友不動産	100,000,000	100,320,000	
第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 円貨社債（2014）	100,000,000	99,980,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,513,000	
第9回モルガン・スタンレー円貨債券	100,000,000	100,295,000	
第9回沖縄電力	100,000,000	100,888,000	
第9回三菱UFJ信託銀行	100,000,000	105,954,000	
社債券 小計	6,032,000,000	6,278,678,880	
合計	118,503,442,000	129,035,601,373	

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。

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

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		3,682,348,691	1,367,957,919
金銭信託		2,636,234,789	4,492,904
コール・ローン		57,415,699	8,466,292,050
株式		117,258,392,917	139,438,631,523
投資証券		3,210,321,908	3,582,271,737
派生商品評価勘定		154,175,708	375,670,213
未収入金		96,098,389	144,393,914
未収配当金		240,434,552	219,380,022
未収利息		1	—

差入委託証拠金		1,511,987,097	796,071,656
流動資産合計		128,847,409,751	154,395,161,938
資産合計		128,847,409,751	154,395,161,938
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		56,853,548	2,856,449
未払金		—	273,195,387
未払解約金		1,418,716,000	384,527,000
未払利息		—	24,554
その他未払費用		—	4,227
流動負債合計		1,475,569,548	660,607,617
負債合計		1,475,569,548	660,607,617
純資産の部			
元本等			
元本	1	69,950,993,970	68,935,347,698
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		57,420,846,233	84,799,206,623
元本等合計		127,371,840,203	153,734,554,321
純資産合計		127,371,840,203	153,734,554,321
負債純資産合計		128,847,409,751	154,395,161,938

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

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1 期首元本額	80,290,033,338円	69,950,993,970円
期中追加設定元本額	22,408,813,834円	23,903,475,646円
期中一部解約元本額	32,747,853,202円	24,919,121,918円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	7,404,464,299円	7,004,593,233円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	7,007,507,550円	7,234,508,783円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	37,966,903円	44,923,909円
AMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	348,830,019円	97,946,394円
外国株式インデックス・ファンドVA1（適格機関投資家専用）	3,076,645,691円	2,663,695,142円
外国株式インデックス・ファンドVA2（適格機関投資家専用）	264,414,758円	122,321,797円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	15,425,761円	5,192,452円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	2,025,097,086円	721,585,785円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	366,021円	345,680円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	28,538,491円	13,272,284円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	16,187,131円	11,657,030円

バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	13,143,616,943円	10,902,057,634円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	22,523,943円	11,273,103円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,782,091,006円	1,319,591,896円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,236,269,890円	1,015,988,141円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	133,045,853円	108,973,796円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	136,147,847円	115,136,413円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,171,209,274円	1,218,981,655円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	348,193,513円	353,741,885円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,930,127,488円	2,356,434,489円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	405,577,482円	307,234,854円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	1,613,319,080円	1,431,115,885円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	55,507,311円	48,447,224円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	58,846,125円	53,276,626円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	26,045,962円	24,321,122円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	428,549,962円	367,238,380円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	2,668,011円	1,752,358円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	7,079,130円	6,718,882円
バランスファンドVA50D＜適格機関投資家限定＞	120,390円	— 円
バランスファンドVA10A＜適格機関投資家限定＞	56,333,060円	50,323,234円
外国株式インデックス・ファンドVA3＜適格機関投資家限定＞	9,085,167,180円	11,340,588,509円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	409,583,792円	335,156,133円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	52,316,340円	44,808,656円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	272,448,392円	104,297,715円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	75,618,215円	22,926,685円

ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン	— 円	266,750,954円
ステート・ストリート先進国株式インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	— 円	427,433,449円
グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	— 円	156,684,133円
グローバルバランス４０ＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	— 円	1,220,909,666円
グローバルバランス４０ＶＡ３＜適格機関投資家限定＞	— 円	115,007,449円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	— 円	56,273,473円
ワールドバランスＶＡ０８０９＜適格機関投資家限定＞	— 円	155,788,874円
ワールドバランスＶＡ０９０２＜適格機関投資家限定＞	— 円	51,191,647円
ワールドエクイティ・ファンドＶＬ＜適格機関投資家限定＞	16,273,144,071円	17,024,880,289円
計	69,950,993,970円	68,935,347,698円
2 受益権の総数	69,950,993,970口	68,935,347,698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、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。 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。

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28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	△12,436,831,976	9,249,499,198
投資証券	△170,301,366	130,700,901
合計	△12,607,133,342	9,380,200,099

(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28年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	4,257,318,443	—	4,342,631,634	85,313,191
	S&P 60	239,628,250	—	246,723,432	7,095,182
	SPI 200	241,469,486	—	248,367,750	6,898,264
	FTSE100INDEX	555,929,742	—	572,379,492	16,449,750
	FSMI INDEX	297,365,203	—	300,819,923	3,454,720
	EURO STOXX 50	849,015,477	—	864,729,545	15,714,068
	合 計	6,440,726,601	—	6,575,651,776	134,925,175

(単位：円)

区 分	種 類	(平成29年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	6,894,638,995	—	7,142,584,149	247,945,154
	S&P 60	440,162,621	—	449,983,695	9,821,074
	SPI 200	377,122,444	—	386,068,420	8,945,976
	FTSE100INDEX	826,147,914	—	844,004,607	17,856,693
	FSMI INDEX	408,258,365	—	417,173,328	8,914,963
	EURO STOXX 50	1,321,382,089	—	1,328,855,837	7,473,748
	合 計	10,267,712,428	—	10,568,670,036	300,957,608

(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28年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,782,531,674	—	1,755,844,800	△26,686,874
	カナダ・ドル	60,625,073	—	60,137,700	△487,373
	オーストラリア・ドル	99,137,433	—	98,740,080	△397,353
	イギリス・ポンド	253,246,565	—	247,841,250	△5,405,315
	ユーロ	286,388,688	—	280,430,320	△5,958,368
	売建				
	アメリカ・ドル	832,617,570	—	832,082,160	535,410
	カナダ・ドル	24,256,040	—	24,230,560	25,480
	オーストラリア・ドル	63,033,849	—	63,235,080	△201,231
	イギリス・ポンド	233,823,220	—	233,415,570	407,650
	香港・ドル	21,069,972	—	21,083,040	△13,068
	スウェーデン・クローナ	20,536,320	—	20,490,240	46,080
	デンマーク・クローネ	46,652,760	—	46,569,600	83,160
	イスラエル・シェケル	21,764,385	—	21,774,200	△9,815
	ユーロ	226,608,042	—	226,149,440	458,602
	合 計	3,972,291,591	—	3,932,024,040	△37,603,015

(単位：円)

区 分	種 類	(平成29年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		

市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	5,832,703,182	—	5,893,194,400	60,491,218
	カナダ・ドル	362,020,736	—	365,233,600	3,212,864
	オーストラリア・ドル	260,739,540	—	264,567,600	3,828,060
	イギリス・ポンド	656,815,835	—	660,200,700	3,384,865
	デンマーク・クローネ	13,346,320	—	13,218,400	△127,920
	ユーロ	1,131,126,880	—	1,129,897,500	△1,229,380
	売建				
	アメリカ・ドル	194,648,652	—	192,921,300	1,727,352
	カナダ・ドル	10,472,352	—	10,336,800	135,552
	オーストラリア・ドル	11,387,250	—	11,242,200	145,050
	イギリス・ポンド	25,519,995	—	25,231,500	288,495
	合 計	8,498,780,742	—	8,566,044,000	71,856,156

(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27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8209円 (18,209円)	2.2301円 (22,301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	21,745	66.77	1,451,913.65	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,461	25.07	61,697.27	
	APACHE CORP	15,239	55.44	844,850.16	
	BAKER HUGHES	16,849	60.76	1,023,745.24	
	CABOT OIL GAS CORP	15,721	23.11	363,312.31	
	CHENIERE ENERGY INC	7,511	46.71	350,838.81	
	CHEVRON CORPORATION	73,695	110.33	8,130,769.35	
	CIMAREX ENERGY CO	3,800	132.02	501,676.00	
	CONCHO RESOURCES INC	5,000	140.06	700,300.00	
	CONOCOPHILLIPS	48,106	47.51	2,285,516.06	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,400	45.97	202,268.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,800	114.12	205,416.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	18,540	44.17	818,911.80	
	DIAMONDBACK ENERGY	3,100	107.63	333,653.00	
	EOG RESOURCES INC	22,606	99.03	2,238,672.18	
	EQT CORPORATION	6,000	62.07	372,420.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	162,451	81.76	13,281,993.76	
	HALLIBURTON CO	33,214	53.71	1,783,923.94	
	HELMERICH & PAYNE	4,700	68.26	320,822.00	
	HESS CORP	10,400	51.75	538,200.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,043	29.92	210,726.56	
	KINDER MORGAN INC	75,972	21.77	1,653,910.44	
	MARATHON OIL CORP	26,957	16.23	437,512.11	
	MARATHON PETROLEUM CORP	20,575	50.02	1,029,161.50	
	MURPHY OIL CORP	7,400	28.09	207,866.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	15,731	39.31	618,385.61	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	7,500	41.82	313,650.00	
	NOBLE ENERGY INC	16,000	37.05	592,800.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM	29,802	66.27	1,974,978.54	
	ONEOK INC NEW	8,200	53.64	439,848.00	
	PARSLEY ENERGY A	6,000	31.82	190,920.00	
	PHILLIPS 66	18,483	78.66	1,453,872.78	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	6,624	192.00	1,271,808.00	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	3,041	31.93	97,099.13	
	RANGE RESOURCES CORP	7,400	31.27	231,398.00	
	SCHLUMBERGER LTD	54,762	80.65	4,416,555.30	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	17,000	8.68	147,560.00	
	SPECTRA ENERGY CORP	25,966	41.09	1,066,942.94	
	TARGA RESOURCES CORP	6,500	58.69	381,485.00	
	TECHNIPFMC PLC	9,800	32.10	314,580.00	
	TESORO CORP	4,882	86.64	422,976.48	
	VALERO ENERGY CORP	18,703	65.49	1,224,859.47	
	WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	33,860	5.70	193,002.00	
	WILLIAMS COS	29,241	28.20	824,596.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	7,947	141.50	1,124,500.50	
	ALBEMARLE CORP	3,700	91.92	340,104.00	
	ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	2,755	121.81	335,586.55	
	AVERY DENNISON CORP	3,757	79.41	298,343.37	

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4,700	29.65	139,355.00	
BALL CORP	6,552	73.27	480,065.04	
CELANESE CORP DEL COM SER A	5,572	89.64	499,474.08	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,000	34.11	341,100.00	
CROWN HOLDINGS INC	5,900	52.78	311,402.00	
DOW CHEMICAL CO	43,873	61.26	2,687,659.98	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	34,195	77.49	2,649,770.55	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,655	80.25	453,813.75	
ECOLAB INC	10,326	123.95	1,279,907.70	
FMC CORP	5,800	58.23	337,734.00	
FREEPORT MCMORAN INC	49,566	14.91	739,029.06	
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	3,289	122.37	402,474.93	
INT'L PAPER CO	15,890	52.15	828,663.50	
LYONDELLBASELL INDU CL A	14,445	92.91	1,342,084.95	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,300	217.55	500,365.00	
MONSANTO CO	17,133	109.00	1,867,497.00	
MOSAIC CO/THE	13,401	33.59	450,139.59	
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	20,347	37.01	753,042.47	
NUCOR CORP	12,271	63.90	784,116.90	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,100	95.26	390,566.00	
PPG INDUSTRIES	10,447	102.37	1,069,459.39	
PRAXAIR	11,073	117.42	1,300,191.66	
SEALED AIR CORP	7,503	47.76	358,343.28	
SHERWIN-WILLIAMS CO	3,063	311.35	953,665.05	
VALSPAR CORP	2,800	111.00	310,800.00	
VULCAN MATERIALS CO	5,356	119.33	639,131.48	
WESTROCK COMPANY	10,625	52.66	559,512.50	
WR GRACE & CO	2,616	71.33	186,599.28	
3M CO	23,582	182.95	4,314,326.90	
ACUITY BRANDS INC	1,800	220.29	396,522.00	
AERCAP HOLDINGS NV	6,369	46.65	297,113.85	
AGCO CORP	2,461	63.99	157,479.39	
AMETEK INC	9,800	54.50	534,100.00	
ARCONIC INC	17,329	29.91	518,310.39	
B/E AEROSPACE INC	4,154	62.83	260,995.82	
BOEING CO	23,270	172.71	4,018,961.70	
CATERPILLAR	22,671	98.85	2,241,028.35	
CUMMINS ENGINE CO	6,512	152.91	995,749.92	
DEERE & CO	10,395	110.27	1,146,256.65	
DOVER CORP	6,214	79.94	496,747.16	
EATON CORP PLC	17,961	71.63	1,286,546.43	
EMERSON ELECTRIC CO	25,449	61.89	1,575,038.61	
FASTENAL CO	11,300	50.71	573,023.00	
FLOWSERVE CORP	5,200	48.37	251,524.00	
FLUOR CORP	5,311	56.43	299,699.73	
FORTIVE CORPORATION	12,034	57.69	694,241.46	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,700	57.06	382,302.00	

GENERAL DYNAMICS CORP	10,460	189.06	1,977,567.60	
GENERAL ELECTRIC CO	348,502	30.37	10,584,005.74	
GRAINGER (WW)	2,167	254.96	552,498.32	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,617	124.56	3,564,533.52	
HUNTINGTON INGALLS IND	1,800	211.91	381,438.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,718	130.31	1,657,282.58	
INGERSOLL-RAND PLC	10,031	80.99	812,410.69	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,400	57.61	311,094.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,400	64.95	610,530.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	8,500	38.82	329,970.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	36,524	41.91	1,530,720.84	
L3 TECHNOLOGIES INC	3,100	168.23	521,513.00	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	10,398	265.35	2,759,109.30	
MASCO CORP	12,790	33.52	428,720.80	
MIDDLEBY CORP	2,300	138.21	317,883.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,740	243.58	1,641,729.20	
PACCAR INC	14,306	68.85	984,968.10	
PARKER HANNIFIN CORP	5,228	153.89	804,536.92	
PENTAIR PLC	6,834	58.13	397,260.42	
RAYTHEON COMPANY	11,726	152.86	1,792,436.36	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,322	151.92	808,518.24	
ROCKWELL COLLINS	5,309	93.46	496,179.14	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,000	207.14	828,560.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	41.54	290,780.00	
SMITH (A.O.) CORP	5,600	49.59	277,704.00	
SNAP-ON	2,204	172.57	380,344.28	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,760	126.65	729,504.00	
TEXTRON	11,152	48.35	539,199.20	
TRANSDIGM GROUP INC	2,100	249.74	524,454.00	
UNITED RENTALS INC	3,696	126.03	465,806.88	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	31,031	112.15	3,480,126.65	
WABCO HOLDINGS INC	2,300	115.56	265,788.00	
WABTEC CORPORATION	3,625	87.77	318,166.25	
XYLEM INC	6,754	47.80	322,841.20	
CINTAS CORP	3,699	118.61	438,738.39	
DUN & BRADSTREET CORP	1,600	108.20	173,120.00	
EQUIFAX INC	4,803	130.14	625,062.42	
IHS MARKIT LIMITED	13,002	40.20	522,680.40	
MANPOWER GROUP	2,854	97.35	277,836.90	
NIELSEN HOLDINGS PLC	13,350	45.08	601,818.00	
REPUBLIC SERVICES INC	9,302	60.75	565,096.50	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	5,340	48.59	259,470.60	
STERICYCLE INC	3,237	85.15	275,630.55	
VERISK ANALYTICS INC	6,600	84.90	560,340.00	
WASTE CONNECTIONS INC	6,509	83.60	544,152.40	
WASTE MANAGEMENT (NEW)	17,320	72.45	1,254,834.00	
AMERCO	300	381.21	114,363.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP	5,902	46.91	276,862.82	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,900	79.06	466,454.00	
CSX CORP	37,805	48.54	1,835,054.70	
DELTA AIR LINES INC	7,900	51.23	404,717.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,084	56.50	400,246.00	
FEDEX CORP	9,940	193.70	1,925,378.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,457	101.04	349,295.28	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	253,000	0.38	96,140.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,149	86.89	360,506.61	
MACQUARIE INFRA CORP	3,000	79.50	238,500.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,569	122.78	1,420,441.82	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,610	57.32	378,885.20	
UNION PACIFIC CORP	32,766	109.82	3,598,362.12	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3,127	75.96	237,526.92	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	27,197	106.90	2,907,359.30	
AUTOLIV INC	3,500	105.87	370,545.00	
BORGWARNER INC	9,100	42.38	385,658.00	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	10,812	75.46	815,873.52	
FORD MOTOR COMPANY	144,325	12.58	1,815,608.50	
GENERAL MOTORS CO	55,099	37.22	2,050,784.78	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	11,400	36.07	411,198.00	
HARLEY-DAVIDSON	7,258	56.93	413,197.94	
LEAR CORP	2,850	142.37	405,754.50	
TESLA INC	5,100	272.23	1,388,373.00	
COACH INC	10,583	38.21	404,376.43	
DR HORTON INC	13,066	30.49	398,382.34	
GARMIN LTD	5,000	50.81	254,050.00	
HANESBRANDS INC	16,224	21.02	341,028.48	
HARMAN INTERNATIONAL	2,900	111.01	321,929.00	
HASBRO INC	4,500	98.50	443,250.00	
LEGGETT & PLATT INC	5,091	48.62	247,524.42	
LENNAR CORP-CL A	7,512	46.46	349,007.52	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,500	66.73	300,285.00	
MATTEL	13,461	26.10	351,332.10	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	7,600	38.30	291,080.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	221.55	553,875.00	
NEWELL BRANDS INC	17,044	46.64	794,932.16	
NIKE B	53,004	56.75	3,007,977.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	2,789	87.16	243,089.24	
PULTE GROUP INC	12,363	21.40	264,568.20	
PVH CORP	3,300	90.32	298,056.00	
RALPH LAUREN CORP	2,374	78.39	186,097.86	
TOLL BROTHERS INC	7,000	31.49	220,430.00	
UNDER ARMOUR INC CLASS A	6,924	21.88	151,497.12	
UNDER ARMOUR INC CLASS A	6,973	19.75	137,716.75	
VF CORP	13,198	52.68	695,270.64	
WHIRLPOOL CORP	2,974	177.19	526,963.06	
ARAMARK	9,300	35.75	332,475.00	
BLOCK (H&R)	9,284	20.51	190,414.84	

CARNIVAL CORP	14,066	55.40	779,256.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,201	427.61	513,559.61	
DARDEN RESTAURANTS	4,719	76.73	362,088.87	
DOMINO'S PIZZA INC	1,900	187.93	357,067.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	6,717	58.50	392,944.50	
LAS VEGAS SANDS CORP	16,000	52.03	832,480.00	
MARRIOTT INT'L A	13,344	89.36	1,192,419.84	
MCDONALD'S CORP	32,728	127.80	4,182,638.40	
MELCO CROWN ENTERTAINMENT LTD- ADR	3,132	16.99	53,212.68	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	17,900	26.60	476,140.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	6,893	47.69	328,727.17	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,700	95.21	637,907.00	
STARBUCKS CORP	58,052	57.35	3,329,282.20	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,800	84.85	407,280.00	
WYNN RESORTS LTD	3,100	95.91	297,321.00	
YUM! BRANDS INC	14,558	68.40	995,767.20	
CBS CORP-CL B	16,777	65.69	1,102,081.13	
CHARTER COMMUNICATION-A	8,525	326.55	2,783,838.75	
COMCAST CORP-CL A	95,106	75.32	7,163,383.92	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	6,145	28.68	176,238.60	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,435	28.09	265,029.15	
DISH NETWORK CORP-A	8,572	62.89	539,093.08	
DISNEY (WALT) CO NEW	59,586	110.06	6,558,035.16	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	15,439	24.50	378,255.50	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	4,200	86.44	363,048.00	
LIBERTY GLOBAL PLC A	10,199	36.75	374,813.25	
LIBERTY GLOBAL PLC SERIES C	23,080	35.58	821,186.40	
LIBERTY LILAC GROUP-CL C	2,879	26.54	76,408.66	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,973	38.02	151,053.46	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	7,862	37.86	297,655.32	
NEWS CORP - CLASS A	15,956	13.08	208,704.48	
OMNICOM GROUP	9,788	85.34	835,307.92	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,900	76.04	220,516.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	78,764	4.94	389,094.16	
TEGNA INC	9,100	24.37	221,767.00	
TIME WARNER INC	31,194	96.48	3,009,597.12	
TWENTY FIRST CENTURY FOX	16,814	29.92	503,074.88	
TWENTY FIRST CENTURY FOX INC	43,407	30.35	1,317,402.45	
VIACOM INC-CLASS B	14,017	43.99	616,607.83	
ADOVANCE AUTO PARTS	2,950	161.58	476,661.00	
AMAZON COM INC	15,808	845.07	13,358,866.56	
AUTONATION INC	3,027	47.77	144,599.79	
AUTOZONE INC	1,181	741.05	875,180.05	
BED BATH & BEYOND INC	6,887	41.14	283,331.18	
BEST BUY COMPANY INC	11,786	45.24	533,198.64	
CARMAX INC	8,250	67.02	552,915.00	

DICK'S SPORTING GOODS INC	4,200	49.79	209,118.00	
DOLLAR GENERAL CORP	11,409	77.67	886,137.03	
DOLLAR TREE INC	9,103	80.00	728,240.00	
EXPEDIA INC	4,327	119.41	516,687.07	
FOOT LOCKER, INC.	5,595	71.00	397,245.00	
GAP	9,054	24.47	221,551.38	
GENUINE PARTS CO	6,100	100.67	614,087.00	
HOME DEPOT	48,539	143.00	6,941,077.00	
KOHL'S CORP	8,221	41.97	345,035.37	
L BRANDS INC	9,560	57.51	549,795.60	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	16,987	19.30	327,849.10	
LKQ CORP	11,565	31.94	369,386.10	
LOWE'S COMPANIES	34,606	76.74	2,655,664.44	
MACY'S INC	12,062	32.30	389,602.60	
NETFLIX INC	16,807	142.22	2,390,291.54	
NORDSTROM INC	5,800	45.69	265,002.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,828	268.12	1,026,363.36	
PRICELINE GROUP INC/THE	1,943	1,637.40	3,181,468.20	
ROSS STORES INC	15,812	68.55	1,083,912.60	
SIGNET JEWELERS LTD	2,964	73.91	219,069.24	
STAPLES	25,339	9.31	235,906.09	
TARGET CORP	21,405	65.79	1,408,234.95	
TIFFANY & CO	5,225	86.18	450,290.50	
TJX COMPANIES INC	26,111	77.19	2,015,508.09	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,144	72.18	371,293.92	
TRIPADVISOR INC	5,071	47.06	238,641.26	
ULTA BEAUTY INC	2,316	275.15	637,247.40	
COSTCO WHOLESALE CORP	17,087	175.86	3,004,919.82	
CVS HEALTH CORPORATION	41,823	79.69	3,332,874.87	
KROGER CO	35,992	34.01	1,224,087.92	
RITE AID CORP	41,700	5.94	247,698.00	
SYSCO CORP	20,803	52.35	1,089,037.05	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,729	85.86	3,067,691.94	
WAL-MART STORES	60,716	69.37	4,211,868.92	
WHOLE FOODS MARKET INC	13,034	30.91	402,880.94	
ALTRIA GROUP INC	76,732	72.97	5,599,134.04	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	23,084	44.69	1,031,623.96	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,324	48.20	449,416.80	
BUNGE LIMITED	5,375	77.78	418,067.50	
CAMPBELL SOUP CO (US)	7,110	58.48	415,792.80	
COCA-COLA CO	161,807	41.23	6,671,302.61	
CONAGRA BRANDS INC	16,727	39.61	662,556.47	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,716	161.32	1,083,425.12	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	7,662	93.98	720,074.76	
GENERAL MILLS	23,261	59.23	1,377,749.03	
HORMEL FOODS CORP	11,600	37.26	432,216.00	
INGREDION INC	2,700	120.79	326,133.00	

JM SMUCKER CO	4,288	135.95	582,953.60	
KELLOGG CO	10,287	72.90	749,922.30	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,449	97.59	434,177.91	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	7,585	87.50	663,687.50	
MOLSON COORS BREWING CO-B	7,200	101.59	731,448.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	62,061	42.50	2,637,592.50	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,440	43.63	717,277.20	
PEPSICO INC	56,436	108.15	6,103,553.40	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC- W/I	60,651	103.66	6,287,082.66	
REYNOLDS AMERICAN INC	33,449	60.73	2,031,357.77	
THE HERSHEY COMPANY	6,100	107.25	654,225.00	
THE KRAFT HEINZ CO/THE	23,655	96.65	2,286,255.75	
TYSON FOODS INC-CL A	11,426	65.26	745,660.76	
WHITEWAVE FOODS CO	7,400	55.17	408,258.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,600	49.70	526,820.00	
CLOROX CO	4,983	133.71	666,276.93	
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,262	71.98	2,394,198.76	
COTY INC	19,092	18.89	360,647.88	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,214	80.02	177,164.28	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,613	85.00	732,105.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,157	131.93	1,867,733.01	
PROCTER & GAMBLE CO	100,539	91.09	9,158,097.51	
SPECTRUM BRANDS	1,000	133.91	133,910.00	
ABBOTT LABORATORIES	68,177	44.69	3,046,830.13	
AETNA INC	13,573	125.27	1,700,289.71	
ALIGN TECHNOLOGY	2,800	101.77	284,942.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,542	90.76	684,511.92	
ANTHEM INC	10,155	160.25	1,627,338.75	
BARD (C.R.) INC	2,992	242.41	725,290.72	
BAXTER INTERNATIONAL	19,243	49.73	956,954.39	
BECTON DICKINSON	8,190	180.90	1,481,571.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,148	25.39	1,324,037.72	
CARDINAL HEALTH INC	12,771	80.71	1,030,747.41	
CENTENE CORP	6,500	67.61	439,465.00	
CERNER CORP	11,888	56.15	667,511.20	
CIGNA CORP	10,024	143.56	1,439,045.44	
DANAHER CORP	24,069	84.05	2,022,999.45	
DAVITA INC	7,000	66.90	468,300.00	
DENTSPLY SIRONA INC	9,500	62.68	595,460.00	
DEXCOM	3,300	81.89	270,237.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,300	89.74	744,842.00	
ENVISION HEALTHCARE CORP	4,571	71.59	327,237.89	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	24,772	69.97	1,733,296.84	
HCA HOLDINGS INC	12,633	84.63	1,069,130.79	
HENRY SCHEIN INC	3,400	168.11	571,574.00	
HOLOGIC INC	9,616	40.00	384,640.00	
HUMANA	5,749	204.60	1,176,245.40	

IDEXX LABORATORIES	3,400	142.23	483,582.00	
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	1,446	724.66	1,047,858.36	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,844	139.59	536,583.96	
MCKESSON CORP	8,958	150.25	1,345,939.50	
MEDNAX INC	3,700	70.07	259,259.00	
MEDTRONIC PLC	55,305	78.88	4,362,458.40	
PATTERSON COS INC	3,500	44.08	154,280.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,746	95.64	549,547.44	
RESMED INC	5,633	72.27	407,096.91	
STRYKER CORP	13,167	126.34	1,663,518.78	
TELEFLEX	1,700	179.91	305,847.00	
THE COOPER COS INC	1,831	195.91	358,711.21	
UNITED HEALTH GROUP INC	37,291	157.62	5,877,807.42	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,720	122.95	457,374.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,960	83.61	331,095.60	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,031	116.87	821,712.97	
ABBVIE INC	62,923	61.77	3,886,753.71	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,220	51.63	682,548.60	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8,763	128.82	1,128,849.66	
ALKERMES PLC	5,900	54.57	321,963.00	
ALLERGAN PLC	14,725	247.35	3,642,228.75	
AMGEN INC	29,514	173.29	5,114,481.06	
BIOGEN INC	8,501	288.94	2,456,278.94	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,321	89.87	568,068.27	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	65,263	54.59	3,562,707.17	
CELGENE CORP	30,713	121.16	3,721,187.08	
GILEAD SCIENCES INC	51,810	69.85	3,618,928.50	
ILLUMINA INC	5,900	163.37	963,883.00	
INCYTE CORP	6,708	120.49	808,246.92	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,601	137.19	356,831.19	
JOHNSON & JOHNSON	107,925	118.86	12,827,965.50	
LILLY (ELI) & CO	38,973	80.39	3,133,039.47	
MALLINCKRODT PLC	4,713	54.74	257,989.62	
MERCK & CO	108,460	65.39	7,092,199.40	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,107	471.55	522,005.85	
MYLAN NV	16,500	42.05	693,825.00	
PERRIGO CO PLC	5,879	84.47	496,599.13	
PFIZER	238,088	33.62	8,004,518.56	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	5,132	76.75	393,881.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,977	371.18	1,105,002.86	
SEATTLE GENETICS	3,900	65.50	255,450.00	
SHIRE PLC-ADR	136	181.08	24,626.88	
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	220	116.71	25,676.20	
THERMO ELECTRON CORP	15,571	158.64	2,470,183.44	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,706	168.16	286,880.96	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,510	88.33	840,018.30	
WATERS CORPORATION	3,327	154.33	513,455.91	

ZOETIS INC	18,295	52.51	960,670.45	
BANK OF AMERICA CORP	397,987	24.52	9,758,641.24	
BB&T CORPORATION	30,800	47.96	1,477,168.00	
CIT GROUP INC	7,400	43.72	323,528.00	
CITIGROUP INC	112,251	60.17	6,754,142.67	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,100	37.84	798,424.00	
COMERICA	7,022	72.37	508,182.14	
FIFTH THIRD BANCORP	30,120	27.54	829,504.80	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,606	95.60	535,933.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	42,615	14.13	602,149.95	
JPMORGAN CHASE & CO	141,790	90.23	12,793,711.70	
KEYCORP	42,591	18.96	807,525.36	
M & T BANK CORP	5,791	167.91	972,366.81	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	17,669	15.19	268,392.11	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	12,000	19.19	230,280.00	
PNC BANK CORP	19,787	126.86	2,510,178.82	
REGIONS FINANCIAL CORP	52,945	15.38	814,294.10	
SIGNATURE BANK	2,000	159.30	318,600.00	
SUNTRUST BANKS	19,664	59.59	1,171,777.76	
US BANCORP	68,335	54.88	3,750,224.80	
WELLS FARGO COMPANY	188,597	58.09	10,955,599.73	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,300	168.42	387,366.00	
ALLY FINANCIAL INC.	15,175	23.21	352,211.75	
AMERICAN EXPRESS	30,815	79.71	2,456,263.65	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,696	128.99	863,717.04	
BANK NEW YORK MELLO CORP	42,557	47.14	2,006,136.98	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	47,834	168.57	8,063,377.38	
BLACKROCK INC	4,790	388.76	1,862,160.40	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	19,899	91.81	1,826,927.19	
CME GROUP INC	12,489	122.62	1,531,401.18	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,532	71.30	1,178,731.60	
E*TRADE FINANCIAL CORP	12,200	37.17	453,474.00	
EATON VANCE CORP	4,400	43.53	191,532.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	15,105	42.53	642,415.65	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,284	250.38	3,576,427.92	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,725	58.40	1,327,140.00	
INVESCO LTD	17,180	32.54	559,037.20	
LEUCADIA NATIONAL CORP	13,700	25.56	350,172.00	
MOODY'S CORPORATION	6,849	112.90	773,252.10	
MORGAN STANLEY	56,488	46.15	2,606,921.20	
MSCI INC	3,670	94.27	345,970.90	
NASDAQ INC	4,340	71.51	310,353.40	
NAVIENT CORP	15,156	15.45	234,160.20	
NORTHERN TRUST CORP	8,905	87.20	776,516.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,115	78.86	403,368.90	
S&P GLOBAL INC	10,478	130.39	1,366,226.42	
SCHWAB (CHARLES) CORP	46,016	41.55	1,911,964.80	
SEI INVESTMENTS CO COM	5,200	50.49	262,548.00	

STATE STREET CORP	15,631	80.67	1,260,952.77	
SYNCHRONY FINANCIAL	33,715	36.68	1,236,666.20	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,693	71.10	689,172.30	
TD AMERITRADE HLDG CORP COM	10,900	43.15	470,335.00	
VOYA FINANCIAL INC	8,054	41.90	337,462.60	
AFLAC	16,555	71.10	1,177,060.50	
ALLEGHANY CORP	648	636.79	412,639.92	
ALLSTATE CORP	15,028	80.44	1,208,852.32	
AMERICAN INT'L GROUP	42,017	62.50	2,626,062.50	
AON PLC	10,634	117.53	1,249,814.02	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,650	94.02	437,193.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,900	56.94	392,886.00	
ASSURANT INC	2,700	96.75	261,225.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,586	68.56	245,856.16	
CHUBB LTD	17,984	136.19	2,449,240.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,937	72.67	431,441.79	
EVEREST RE GROUP LTD	1,800	235.12	423,216.00	
FNF GROUP	10,102	37.64	380,239.28	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	15,309	48.36	740,343.24	
LINCOLN NATIONAL CORP	10,015	71.69	717,975.35	
LOEWS CORP	11,505	46.98	540,504.90	
MARKEL CORP	535	964.71	516,119.85	
MARSH & MCLENNAN COS	20,275	73.52	1,490,618.00	
METLIFE INC	36,771	52.97	1,947,759.87	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,186	62.12	694,874.32	
PROGRESSIVE CORP	22,589	38.57	871,257.73	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,435	111.11	1,937,202.85	
REINSURANCE GRP AMERICA	2,500	129.09	322,725.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,628	146.04	237,753.12	
TORCHMARK CORP	4,950	77.12	381,744.00	
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	11,834	121.95	1,443,156.30	
UNUM GROUP	9,932	48.51	481,801.32	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,028	128.35	645,343.80	
WR BERKLEY CORP	4,210	70.56	297,057.60	
XL GROUP LIMITED	11,600	40.95	475,020.00	
CBRE GROUP INC	12,684	35.68	452,565.12	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,000	6.89	303,160.00	
JONES LANG LASALLE INC	1,900	116.28	220,932.00	
ACCENTURE PLC-CL A	24,397	121.23	2,957,648.31	
ACTIVISION BLIZZARD INC	23,200	45.33	1,051,656.00	
ADOBE SYSTEMS	19,428	119.67	2,324,948.76	
AKAMAI TECHNOLOGIES	6,772	62.34	422,166.48	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,300	235.04	540,592.00	
ALPHABET INC-CL A	11,612	846.55	9,830,138.60	
ALPHABET INC-CL C	12,181	828.07	10,086,720.67	
ANSYS INC	3,600	100.27	360,972.00	
AUTODESK INC	8,037	86.40	694,396.80	

AUTOMATIC DATA PROCESS	17,963	99.68	1,790,551.84	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,500	68.58	308,610.00	
CA INC	13,125	32.09	421,181.25	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,400	30.20	344,280.00	
CDK GLOBAL INC	5,200	65.47	340,444.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	5,003	101.21	506,353.63	
CITRIX SYSTEMS INC	5,870	80.50	472,535.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,655	57.96	1,371,043.80	
COMPUTER SCIENCES CORP	5,500	70.56	388,080.00	
COSTAR GROUP	1,300	209.69	272,597.00	
DELL TECHNOLOGIES-CL V	8,429	64.59	544,429.11	
EBAY INC	41,922	33.76	1,415,286.72	
ELECTRONIC ARTS	12,524	87.30	1,093,345.20	
FACEBOOK INC-A	92,152	133.53	12,305,056.56	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	11,530	82.05	946,036.50	
FIRST DATA CORP A	12,100	16.37	198,077.00	
FISERV INC	8,853	111.98	991,358.94	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,081	166.47	512,894.07	
FORTINET INC	5,600	37.46	209,748.00	
GARTNER INC	3,300	103.13	340,329.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	5,100	77.95	397,545.00	
IBM CORP	35,661	180.67	6,442,872.87	
INTUIT CORP	9,726	119.86	1,165,758.36	
MASTERCARD INC-CLASS A	38,114	109.42	4,170,433.88	
MERCADOLIBRE	1,600	198.43	317,488.00	
MICROSOFT CORP	290,632	64.62	18,780,639.84	
MOBILEYE NV	6,563	45.65	299,600.95	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	10,800	16.96	183,168.00	
ORACLE CORP	121,559	42.06	5,112,771.54	
PAYCHEX INC	13,051	59.13	771,705.63	
PAYPAL HOLDINGS INC	42,822	41.96	1,796,811.12	
RED HAT INC	7,300	82.60	602,980.00	
SABRE CORP	6,900	21.30	146,970.00	
SALESFORCE COM INC COM	24,570	81.47	2,001,717.90	
SERVICENOW INC	5,984	92.74	554,956.16	
SPLUNK INC	5,300	64.37	341,161.00	
SYMANTEC CORP	25,600	28.80	737,280.00	
SYNOPSYS INC	6,515	70.51	459,372.65	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6,616	54.47	360,373.52	
TWITTER INC	20,747	16.62	344,815.14	
VANTIV INC CL A	5,787	64.86	375,344.82	
VERISIGN INC	3,799	82.30	312,657.70	
VISA INC-CLASS A SHARES	74,195	87.46	6,489,094.70	
VMWARE INC	3,000	91.22	273,660.00	
WESTERN UNION CO	19,216	19.82	380,861.12	
WORKDAY INC CLASS A	4,172	88.43	368,929.96	
YAHOO! INC	34,808	45.10	1,569,840.80	

ZILLOW GROUP INC-C	4,200	35.39	148,638.00	
AMPHENOL CORP-CL A	12,400	69.46	861,304.00	
APPLE INC	210,067	135.72	28,510,293.24	
ARROW ELECTRONICS INC	4,000	73.50	294,000.00	
AVNET	4,912	46.41	227,965.92	
CDW CORP/DE	5,600	59.99	335,944.00	
CISCO SYSTEMS	196,682	33.74	6,636,050.68	
CORNING	37,428	27.65	1,034,884.20	
FLEX LTD	24,045	16.44	395,299.80	
FLIR SYSTEMS INC	5,300	36.62	194,086.00	
FS NETWORKS INC	2,700	143.35	387,045.00	
HARRIS CORP	4,400	109.46	481,624.00	
HEWLETT-PACKARD CO	69,403	15.95	1,106,977.85	
HP ENTERPRISE CO	65,276	24.40	1,592,734.40	
JUNIPER NETWORKS INC	13,708	28.39	389,170.12	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,343	79.31	503,063.33	
NETAPP INC	11,848	40.17	475,934.16	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,940	154.76	454,994.40	
SEAGATE TECHNOLOGY	11,378	47.14	536,358.92	
TE CONNECTIVITY LTD	13,962	75.21	1,050,082.02	
TRIMBLE INC	9,343	31.18	291,314.74	
WESTERN DIGITAL CORP	10,792	74.91	808,428.72	
XEROX CORP	34,568	7.44	257,185.92	
AT & T INC	241,013	41.48	9,997,219.24	
CENTURYLINK INC	21,161	24.28	513,789.08	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	43,629	3.29	143,539.41	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	12,200	57.30	699,060.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,100	108.47	553,197.00	
SPRINT CORP W/I	37,012	9.30	344,211.60	
T MOBILE US INC	11,608	63.92	741,983.36	
VERIZON COMMUNICATIONS	159,384	49.19	7,840,098.96	
ZAYO GROUP HOLDINGS	6,200	30.83	191,146.00	
AES CORPORATION	25,262	11.46	289,502.52	
ALLIANT ENERGY CORP	8,590	38.08	327,107.20	
AMEREN CORPORATION	9,677	53.37	516,461.49	
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,085	64.11	1,223,539.35	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,100	73.81	524,051.00	
ATMOS ENERGY CORP	3,858	76.04	293,362.32	
CALPINE CORP	12,527	11.47	143,684.69	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,456	26.51	409,738.56	
CMS ENERGY CORP	11,000	43.22	475,420.00	
CONSOLIDATED EDISON	11,359	73.50	834,886.50	
DOMINION RESOURCES INC/VA	24,703	73.77	1,822,340.31	
DTE ENERGY	7,166	98.12	703,127.92	
DUKE ENERGY CORP	26,865	78.36	2,105,141.40	
EDISON INTERNATIONAL	12,616	76.34	963,105.44	
ENTERGY CORP	7,220	73.55	531,031.00	
EVERSOURCE ENERGY	12,871	56.15	722,706.65	

	EXELON CORP	35,309	35.58	1,256,294.22	
	FIRSTENERGY CORP	17,116	31.01	530,767.16	
	NEXTERA ENERGY INC	18,290	126.86	2,320,269.40	
	NISOURCE INC	12,100	22.70	274,670.00	
	OGE ENERGY CORP	8,712	34.62	301,609.44	
	PG&E CORP	19,634	63.92	1,255,005.28	
	PINNACLE WEST CAPITAL	4,197	78.70	330,303.90	
	PPL CORPORATION	26,066	35.63	928,731.58	
	PUBLIC SV ENTERPRISE CO	19,602	43.49	852,490.98	
	SCANA CORP	5,168	65.65	339,279.20	
	SEMPRA ENERGY	9,141	105.85	967,574.85	
	SOUTHERN CO	38,439	47.80	1,837,384.20	
	UGI CORP	6,500	47.46	308,490.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	12,786	57.54	735,706.44	
	WESTAR ENERGY	5,300	53.05	281,165.00	
	XCEL ENERGY INC	19,644	42.00	825,048.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	31,000	13.13	407,030.00	
	ANALOG DEVICES	12,129	82.48	1,000,399.92	
	APPLIED MATERIALS	43,741	35.67	1,560,241.47	
	BROADCOM LIMITED	15,846	210.41	3,334,156.86	
	INTEL CORP	184,728	36.48	6,738,877.44	
	KLA-TENCOR CORPORATION	6,248	88.46	552,698.08	
	LAM RESEARCH CORP	6,400	114.90	735,360.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	9,133	64.92	592,914.36	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	15.81	286,161.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,300	45.11	509,743.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,710	71.68	552,652.80	
	MICRON TECHNOLOGY	39,630	23.35	925,360.50	
	NVIDIA CORP	21,000	107.23	2,251,830.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	11,391	102.40	1,166,438.40	
	QORVO INC	5,125	67.12	343,990.00	
	QUALCOMM	58,718	56.46	3,315,218.28	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC.	7,751	96.35	746,808.85	
	TEXAS INSTRUMENTS	39,586	76.44	3,025,953.84	
	XILINX INC	10,410	60.06	625,224.60	
アメリカ・ドル 小計		12,453,644		815,449,925.69 (92,047,987,612)	
カナダ・ドル	ALTAGAS LTD	5,713	31.35	179,102.55	
	ARC RESOURCES LTD	15,063	21.53	324,306.39	
	CAMECO CORP	16,622	15.35	255,147.70	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,390	39.37	1,668,894.30	
	CENOVUS ENERGY INC	33,348	17.88	596,262.24	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	19,712	16.24	320,122.88	
	ENBRIDGE INC	36,671	54.97	2,015,804.87	
	ENCANA CORP	38,345	16.20	621,189.00	
	HUSKY ENERGY INC	15,927	16.35	260,406.45	
	IMPERIAL OIL LTD	11,285	42.87	483,787.95	
	INTER PIPELINE LTD	13,189	29.51	389,207.39	

KEYERA CORP	7,042	41.31	290,905.02	
PEMBINA PIPELINE CORP	15,007	42.86	643,200.02	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,864	28.71	197,065.44	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,236	29.90	216,356.40	
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	9,500	26.03	247,285.00	
SUNCOR ENERGY INC	65,630	42.13	2,764,991.90	
TOURMALINE OIL CORP	7,700	31.65	243,705.00	
TRANSCANADA CORP	34,012	62.24	2,116,906.88	
VERESEN INC	11,900	14.05	167,195.00	
VERMILION ENERGY TRUST	4,600	52.05	239,430.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,455	61.32	518,460.60	
AGRIUM INC	5,148	135.64	698,274.72	
BARRICK GOLD CORP	45,976	26.41	1,214,226.16	
CCL INDUSTRIES INC	1,100	270.00	297,000.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	30,800	4.80	147,840.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	26,228	15.00	393,420.00	
FRANCO NEV CORP	7,062	88.06	621,879.72	
GOLDCORP INC	31,883	22.76	725,657.08	
KINROSS GOLD CORP	44,963	5.06	227,512.78	
METHANEX CORP	3,781	66.23	250,415.63	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	33,530	24.50	821,485.00	
SILVER WHEATON CORCOM NPV	16,300	28.22	459,986.00	
TECK RESOURCES LTD	24,708	27.98	691,329.84	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	33,539	4.53	151,931.67	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,100	52.95	164,145.00	
YAMANA GOLD INC	42,813	4.04	172,964.52	
BOMBARDIER INC.	69,741	2.53	176,444.73	
CAE Inc.	12,550	20.42	256,271.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	8,102	25.45	206,195.90	
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,613	57.68	381,437.84	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,025	93.85	2,911,696.25	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,613	195.89	1,099,530.57	
LINAMAR CORP	1,800	60.87	109,566.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,538	59.60	926,064.80	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,615	32.78	282,399.70	
RESTAURANT BRANDS INTERN	8,233	70.67	581,826.11	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,356	28.03	486,488.68	
CANADIAN TIRE CORP.	2,931	157.49	461,603.19	
DOLLARAMA INC	4,495	102.96	462,805.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	17,100	61.39	1,049,769.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,466	17.15	110,891.90	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	3,700	20.10	74,370.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,672	68.19	591,343.68	
METRO INC	9,900	40.17	397,683.00	
WESTON (GEORGE)	1,936	110.60	214,121.60	
SAPUTO INC	9,607	45.77	439,712.39	
VALENT PHARMACEUTICALS INTE	12,591	21.02	264,662.82	
BANK MONTREAL	24,994	101.41	2,534,641.54	

	BANK OF NOVA SCOTIA	46,922	81.82	3,839,158.04	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	15,414	116.49	1,795,576.86	
	NATIONAL BANK OF CANADA	13,946	58.23	812,075.58	
	ROYAL BANK OF CANADA	58,042	99.09	5,751,381.78	
	TRONTO-DOMINION BANK	72,435	69.44	5,029,886.40	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	34,630	48.91	1,693,753.30	
	CI FINANCIAL CORP	9,853	27.90	274,898.70	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	14,700	13.92	204,624.00	
	IGM FINANCIAL INC	4,733	42.02	198,880.66	
	ONEX CORPORATION	3,609	94.87	342,385.83	
	THOMSON CORP	13,262	58.87	780,733.94	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	857	618.00	529,626.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	11,246	37.40	420,600.40	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,993	58.48	233,510.64	
	INTACT FINANCIAL CORP	5,300	96.69	512,457.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	76,420	24.83	1,897,508.60	
	POWER CORP OF CANADA	14,888	32.23	479,840.24	
	POWER FINANCIAL CORP	10,858	35.61	386,653.38	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,591	49.89	1,176,954.99	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,141	20.53	105,544.73	
	CGI GROUP INC	8,884	63.73	566,177.32	
	CONSTELLATION SOFTWARE	755	610.94	461,259.70	
	OPEN TEXT CORP	9,084	43.87	398,515.08	
	BLACKBERRY LTD	22,600	9.79	221,254.00	
	BCE INC	5,415	58.76	318,185.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	13,904	57.52	799,758.08	
	TELUS CORP	7,932	43.93	348,452.76	
	ATCO LTD -CLASS I	3,514	45.73	160,695.22	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,700	36.68	209,076.00	
	EMERA	2,000	45.27	90,540.00	
	FORTIS INC	15,600	43.20	673,920.00	
	HYDRO ONE	6,400	23.84	152,576.00	
カナダ・ドル 小計		1,606,348		66,683,787.63 (5,746,808,818)	
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	10,482	29.77	312,049.14	
	OIL SEARCH LTD	53,914	7.19	387,641.66	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	76,018	6.87	522,243.66	
	SANTOS	65,542	3.99	261,512.58	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	30,190	31.75	958,532.50	
	ALUMINA LTD	118,405	1.96	232,073.80	
	AMCOR	46,966	14.76	693,218.16	
	BHP BILLITON LTD	125,027	26.64	3,330,719.28	
	BORAL LIMITED	38,622	6.09	235,207.98	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	69,110	6.88	475,476.80	
	INCITEC PIVOT LTD	64,405	3.78	243,450.90	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	17,696	18.68	330,561.28	
	NEWCREST MINING	29,806	22.99	685,239.94	
	ORICA	16,138	18.47	298,068.86	

RIO TINTO LTD	17,237	67.79	1,168,496.23	
SOUTH32 LTD	236,569	2.69	636,370.61	
CIMIC GROUP LTD	4,540	38.43	174,472.20	
BRAMBLES LTD	60,528	10.51	636,149.28	
SEEK LTD	11,699	15.78	184,610.22	
AURIZON HOLDINGS LTD	83,667	5.28	441,761.76	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	20,756	3.48	72,230.88	
SYDNEY AIRPORT	42,048	6.02	253,128.96	
TRANSURBAN GROUP	81,904	10.98	899,305.92	
ARISTOCRAT LEISURE LIMITED	22,072	15.70	346,530.40	
CROWN RESORTS LTD	13,026	11.52	150,059.52	
DOMINO'S PIZZA ENT	2,172	56.10	121,849.20	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,483	30.06	74,638.98	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,278	4.32	156,720.96	
TATTS GROUP LTD	53,769	4.06	218,302.14	
REA GROUP LTD	2,606	55.11	143,616.66	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	24,179	5.10	123,312.90	
WESFARMERS LIMITED	43,833	43.09	1,888,763.97	
WOOLWORTHS LIMITED	49,213	25.49	1,254,439.37	
COCA-COLA AMATIL	21,581	10.00	215,810.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	32,281	11.90	384,143.90	
COCHLEAR LIMITED	2,155	132.08	284,632.40	
HEALTHSCOPE LTD.	51,528	2.33	120,060.24	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,710	71.64	409,064.40	
SONIC HEALTHCARE LIMITED	15,003	21.37	320,614.11	
CSL LIMITED	18,094	120.27	2,176,165.38	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	114,024	30.77	3,508,518.48	
BANK OF QUEENSLAND LTD	15,461	11.49	177,646.89	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	20,189	12.43	250,949.27	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	66,780	85.39	5,702,344.20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	102,417	31.71	3,247,643.07	
WESTPAC BANKING	129,832	33.88	4,398,708.16	
AMP LTD	113,241	5.19	587,720.79	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	7,593	51.74	392,861.82	
CHALLENGER LTD	21,308	11.78	251,008.24	
MACQUARIE GROUP LIMITED	12,448	87.06	1,083,722.88	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	99,210	5.93	588,315.30	
MEDIBANK PRIVATE LTD.	102,132	2.70	275,756.40	
QBE INSURANCE GROUP	52,313	12.68	663,328.84	
SUNCORP GROUP LTD	52,023	13.57	705,952.11	
LENDLEASE GROUP	23,929	14.82	354,627.78	
COMPUTERSHARE LIMITED	20,356	13.63	277,452.28	
TELSTRA CORP	171,684	4.84	830,950.56	
TPG TELECOM LTD	11,648	6.36	74,081.28	
VOCUS GROUP LTD	17,640	4.08	71,971.20	
AGL ENERGY LIMITED	26,961	24.59	662,970.99	
APA GROUP	42,047	8.69	365,388.43	

	AUSNET SERVICES	77,077	1.65	127,177.05	
	DUET GROUP	87,718	2.78	243,856.04	
オーストラリア・ドル 小計		3,105,283		46,664,199.19 (4,039,253,082)	
イギリス・ポンド	BP PLC	749,196	4.46	3,341,414.16	
	PETROFAC	12,271	8.70	106,696.34	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	172,607	20.95	3,616,116.65	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	146,190	21.86	3,194,982.45	
	ANGLO AMERICAN PLC	53,603	13.45	720,960.35	
	ANTOFAGASTA PLC	18,608	8.37	155,748.96	
	BHP BILLITON PLC	81,729	13.95	1,139,710.90	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,171	34.08	176,227.68	
	FRESNILLO PLC	9,924	15.23	151,142.52	
	GLENCORE PLC	471,254	3.19	1,505,420.90	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,201	30.62	251,114.62	
	MONDI PLC	15,496	18.59	288,070.64	
	RANDGOLD RESOURCES	3,901	73.85	288,088.85	
	RIO TINTO PLC REG	48,256	36.00	1,736,974.72	
	ASHTED GROUP PLC	18,827	17.04	320,812.08	
	BAE SYSTEMS PLC	124,141	6.07	752,915.16	
	BUNZL PLC	13,432	21.62	290,399.84	
	COBHAM PLC	77,268	1.13	87,621.91	
	DCC (GB)	3,349	67.80	227,062.20	
	IMI PLC	10,505	12.18	127,950.90	
	MEGGITT PLC	30,402	4.18	127,049.95	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	72,114	6.66	480,279.24	
	SMITHS GROUP PLC	17,162	15.14	259,832.68	
	TRAVIS PERKINS PLC	9,925	15.02	149,073.50	
	WEIR GROUP PLC/THE	9,243	19.50	180,238.50	
	WOLSELEY PLC	10,388	49.91	518,465.08	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	9,592	8.96	85,896.36	
	CAPITA PLC	26,907	5.22	140,454.54	
	EXPERIAN PLC	37,278	16.08	599,430.24	
	G4S PLC	57,203	2.60	148,842.20	
	INTERTEK GROUP PLC	6,776	35.38	239,734.88	
	RELX PLC	42,992	14.84	638,001.28	
	EASYJET PLC	5,750	9.64	55,401.25	
	ROYAL MAIL PLC	29,110	4.11	119,525.66	
	GKN PLC	71,935	3.47	249,830.25	
	BARRATT DEVELOPMENTS	41,916	5.21	218,172.78	
	BURBERRY GROUP PLC	17,517	16.60	290,782.20	
	PERSIMMON PLC	12,323	20.11	247,815.53	
	TAYLOR WIMPEY PLC	127,603	1.78	226,495.32	
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	4,859	29.38	142,757.42	
	CARNIVAL PLC	7,291	43.03	313,731.73	
	COMPASS GROUP PLC	63,905	14.73	941,320.65	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,881	38.89	306,492.09	

MERLIN ENTERTAINMENTS	23,482	4.90	115,014.83	
TUI AG	19,387	11.24	217,909.88	
WHITBREAD PLC	6,964	39.36	274,103.04	
WILLIAM HILL PLC	34,412	2.62	90,297.08	
BRITISH SKY BROADCASTING	42,034	9.95	418,238.30	
ITV PLC	153,433	2.06	315,304.81	
PEARSON	33,288	6.69	222,530.28	
WPP PLC	50,266	19.00	955,054.00	
DIXONS CARPHONE PLC	41,170	3.01	124,004.04	
KINGFISHER PLC	94,185	3.27	308,079.13	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	66,796	3.26	217,420.98	
NEXT PLC	5,830	38.52	224,571.60	
MORRISON SUPERMARKETS	91,346	2.49	227,360.19	
SAINSBURY (J) PLC	58,994	2.68	158,339.89	
TESCO	315,388	1.96	617,372.01	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,973	26.09	364,555.57	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	72,927	50.04	3,649,267.08	
COCA COLA HBC AG CDI	8,311	19.89	165,305.79	
DIAGEO	98,255	22.73	2,233,336.15	
IMPERIAL BRANDS PLC	37,406	37.81	1,414,320.86	
TATE & LYLE	17,684	7.38	130,507.92	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,871	71.00	1,765,841.00	
UNILEVER PLC	50,097	37.97	1,902,183.09	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	14,448	8.28	119,629.44	
SMITH&NEOHEW PLC	36,360	12.03	437,410.80	
ASTRAZENECA PLC	49,396	45.95	2,269,746.20	
GLAXOSMITHKLINE PLC	190,370	16.40	3,121,116.15	
HIKMA PHARMACEUTICALS	5,281	20.34	107,415.54	
SHIRE PLC	34,921	48.36	1,688,779.56	
BARCLAYS PLC	654,066	2.37	1,550,136.42	
HSBC HOLDINGS PLC	780,945	7.08	5,525,185.87	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,504,467	0.67	1,674,486.63	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	131,707	2.42	319,257.76	
STANDARD CHARTERED PLC	126,610	7.73	978,695.30	
3I GROUP PLC	41,014	7.20	295,300.80	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	39,948	2.65	105,742.35	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,112	13.72	138,736.64	
INVESTEC PLC	21,401	5.91	126,372.90	
LONDON STOCK EXCAHNGE GROUP	12,500	31.30	391,250.00	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	5,779	27.88	161,118.52	
SCHRODERS PLC	5,217	30.69	160,109.73	
ADMIRAL GROUP PLC	8,283	18.48	153,069.84	
AVIVA PLC	156,931	4.98	782,144.10	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	51,919	3.54	183,741.34	
LEGAL & GENERAL GROUP	229,787	2.44	560,680.28	
OLD MUTUAL PLC	200,170	2.16	432,567.37	
PRUDENTIAL PLC	100,217	16.14	1,617,502.38	
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,647	5.82	236,362.30	

	ST JAMES'S PLACE PLC	22,509	10.90	245,348.10	
	STANDARD LIFE PLC	79,732	3.67	292,775.90	
	AUTO TRADER GROUP PLC	38,826	4.03	156,313.47	
	SAGE GROUP PLC/THE	42,648	6.34	270,175.08	
	WORLDPAY GROUP PLC	70,886	2.67	189,407.39	
	BT GROUP PLC	330,761	3.16	1,045,535.52	
	INMARSAT PLC	17,618	6.15	108,350.70	
	VODAFONE GROUP PLC	1,038,007	1.98	2,055,253.86	
	CENTRICA PLC	216,138	2.33	502,736.98	
	NATIONAL GRID PLC	146,082	9.61	1,404,140.18	
	SEVERN TRENT PLC	9,476	23.10	218,895.60	
	SSE PLC	40,615	15.24	618,972.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,957	9.51	246,851.07	
イギリス・ポンド 小計		11,656,251		71,761,287.35 (10,061,650,099)	
スイス・フラン	EMS CHEMIE HOLDING AG RE	299	574.00	171,626.00	
	GIVAUDAN-REG	356	1,801.00	641,156.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	17,935	55.85	1,001,669.75	
	SIKA AG-BR	82	5,395.00	442,390.00	
	SYNGETA AG	3,620	427.90	1,548,998.00	
	ABB LTD	76,485	22.76	1,740,798.60	
	GEBERIT AG-REG	1,453	426.90	620,285.70	
	SCHINDLER HLDG AG	946	190.80	180,496.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,670	193.40	322,978.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,902	70.70	487,971.40	
	SGS S.A.	217	2,129.00	461,993.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,150	139.50	299,925.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON REG	20,311	74.80	1,519,262.80	
	THE SWATCH GROUP	1,897	65.95	125,107.15	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,178	336.60	396,514.80	
	DUFREY AG-REG	1,852	142.40	263,724.80	
	ARYZTA AG	3,798	32.79	124,536.42	
	BARRY CALLEBAUT AG REG	86	1,289.00	110,854.00	
	LINDT SPRUENGLI PTG CERT CHF10	41	5,575.00	228,575.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	65,050.00	260,200.00	
	NESTLE SA-REG	122,180	73.85	9,022,993.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,002	127.40	255,054.80	
	ACTELION CHF0.50 (REGD)	3,950	267.00	1,054,650.00	
	GALENCIA AG-REG	151	1,119.00	168,969.00	
	LOMZA AG-REG	2,105	179.60	378,058.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	87,667	77.00	6,750,359.00	
	ROCHE HOLDING AG GENUSS	27,515	243.50	6,699,902.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	78,188	15.31	1,197,058.28	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,511	48.35	411,506.85	
	PARGESA HLDGS SA CHF20(BR)	1,347	65.70	88,497.90	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	667	529.50	353,176.50	
	UBS GROUP AG	142,712	15.81	2,256,276.72	
	BALOISE HOLDING AG REG	1,942	128.80	250,129.60	

	SWISS LIFE HOLDING AG	1,279	313.20	400,582.80	
	SWISS RE LTD	12,934	92.75	1,199,628.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,850	278.60	1,629,810.00	
	SWISS PRIME SITE REG	2,716	85.35	231,810.60	
	SWISSCOM	994	447.90	445,212.60	
スイス・フラン 小計		643,992		43,742,739.87 (4,923,245,372)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	105,123	93.30	9,807,975.90	
	NWS HOLDINGS LTD HKD1	65,540	13.98	916,249.20	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	56,000	11.14	623,840.00	
	MTR CORP	55,148	40.45	2,230,736.60	
	LI & FUNG LTD	254,400	3.48	885,312.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	53,500	27.55	1,473,925.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	34,000	26.90	914,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	99,000	36.85	3,648,150.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	46,800	14.14	661,752.00	
	SANDS CHINA LTD	94,944	32.30	3,066,691.20	
	SHANGRI-LA ASIA	64,000	9.23	590,720.00	
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	6.27	595,650.00	
	WYNN MACAU LTD	75,361	13.86	1,044,503.46	
	WH GROUP LIMITED	316,000	6.02	1,902,320.00	
	BANK EAST ASIA	49,040	33.10	1,623,224.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	140,989	31.40	4,427,054.60	
	HANG SENG BANK	31,000	163.50	5,068,500.00	
	FIRST PACIFIC CO	111,000	5.64	626,040.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,546	200.20	8,918,109.20	
	AIA GROUP LTD	470,484	49.00	23,053,716.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDINGS LTD	110,133	52.15	5,743,435.95	
	HANG LUNG GROUP	35,000	31.50	1,102,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	19.90	1,930,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	40,052	44.00	1,762,288.00	
	HYSAN DEVELOPMENT	24,964	35.30	881,229.20	
	KERRY PROPERTIES LTD	28,500	23.70	675,450.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	226,192	9.31	2,105,847.52	
	SINO LAND	117,200	12.62	1,479,064.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	56,108	108.10	6,065,274.80	
	SWIRE PACIFIC A	20,000	80.35	1,607,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,877	23.25	973,640.25	
	WHARF HOLDINGS	58,125	59.50	3,458,437.50	
	WHEELOK & CO LTD	35,000	48.80	1,708,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	118,000	10.34	1,220,120.00	
	PCCW LIMITED	188,000	4.71	885,480.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	24,000	63.70	1,528,800.00	
	CLP HOLDINGS	62,817	77.10	4,843,190.70	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	92,161	6.68	615,635.48	
	HONGKONG CHINA GAS	309,613	14.94	4,625,618.22	

	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	56,000	69.80	3,908,800.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,000	101.40	1,014,000.00	
香港・ドル 小計		4,012,617		120,213,180.78 (1,747,899,648)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	61,900	6.64	411,016.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	48,560	3.19	154,906.40	
	SINGAPORE TECH ENGR.	67,000	3.62	242,540.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	86,000	0.92	78,690.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	82,000	2.40	196,800.00	
	SATS LIMITED	26,500	4.92	130,380.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	23,800	9.84	234,192.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	224,000	0.98	219,520.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINDS	67,000	3.46	231,820.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,280	42.24	180,787.20	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	332,960	0.43	143,172.80	
	WILMAR INTERL LTD SGDO.5	73,000	3.94	287,620.00	
	DBS GROUP HOLDING	67,968	18.60	1,264,204.80	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	121,863	9.52	1,160,135.76	
	UNITED OVERSEAS BANK	49,852	21.18	1,055,865.36	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	7.59	265,650.00	
	CAPITALAND LIMITED	100,585	3.46	348,024.10	
	CITY DEVELOPMENTS	19,000	9.26	175,940.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES	132,000	2.75	363,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,405	6.53	139,774.65	
	SINGAPORE TELECOM	308,674	4.00	1,234,696.00	
	STARHUB LTD	24,000	2.80	67,200.00	
シンガポール・ドル 小計		1,977,347		8,585,935.07 (683,698,010)	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LTD	25,514	10.09	257,436.26	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	34,695	6.79	235,579.05	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	18,783	8.72	163,787.76	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	69,089	3.48	240,429.72	
	CONTACT ENERGY LIMITED	16,243	4.89	79,428.27	
	MERCURY NZ LTD	31,153	2.97	92,368.64	
	MERIDIAN ENERGY LTD	56,024	2.60	145,662.40	
ニュージーランド・ドル 小計		251,501		1,214,692.10 (98,402,207)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	8,099	190.50	1,542,859.50	
	BOLIDEN AB	10,491	278.00	2,916,498.00	
	ALFA LAVAL AB	12,272	163.20	2,002,790.40	
	ASSA ABLOY AB-B	38,739	174.30	6,752,207.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	27,336	290.70	7,946,575.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,442	261.20	4,033,450.40	
	SANDVIK AB	42,326	121.20	5,129,911.20	
	SKANSKA AB-B	12,783	216.80	2,771,354.40	
	SKF AB-B SHARES	14,989	167.50	2,510,657.50	
	VOLVO AB-B SHS	62,587	118.80	7,435,335.60	
	SECURITAS B	13,372	132.30	1,769,115.60	

	ELECTROLUX AB-SER B	9,549	235.90	2,252,609.10	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,029	76.20	1,373,809.80	
	HENNES & MAURITZ B	36,919	243.20	8,978,700.80	
	ICA GRUPPEN AB	3,600	292.40	1,052,640.00	
	SWEDISH MATCH	7,739	277.20	2,145,250.80	
	SCA SV CELLULOSA AB-B SHS	23,647	273.60	6,469,819.20	
	GETINGE AB-B SHS	7,850	146.10	1,146,885.00	
	NORDEA BANK AB	118,040	108.80	12,842,752.00	
	SKAND. ENSKILDA BANKEN A	61,913	103.60	6,414,186.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	57,875	131.40	7,604,775.00	
	SWEDBANK AB	34,961	231.40	8,089,975.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,013	177.10	1,064,902.30	
	INVESTOR AB SER B NPV	18,537	359.80	6,669,612.60	
	KINNEVIK INV AB	9,233	236.80	2,186,374.40	
	LUNDBERGFÖRETAGEN B	1,492	581.00	866,852.00	
	"ERICSSON (LM) TEL,SEK1 SER B"	118,167	53.20	6,286,484.40	
	HEXAGON AB B SHS	9,815	363.70	3,569,715.50	
	MILLICOM INTL CELLSDR EACH REP 1 US D1.5	2,554	484.70	1,237,923.80	
	TELE2 AB-B SHS	17,316	79.55	1,377,487.80	
	TELIA COMPANY AB	105,058	35.40	3,719,053.20	
スウェーデン・クロネ 小計		926,743		130,160,565.40 (1,649,134,364)	
ノルウェー・ク ローネ	STATOIL ASA	45,953	147.10	6,759,686.30	
	NORSK HYDRO	58,691	48.65	2,855,317.15	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,166	326.00	2,336,116.00	
	SCHIBSTED	2,760	218.50	603,060.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,292	198.00	651,816.00	
	MARINE HARVEST	14,280	144.00	2,056,320.00	
	ORKLA ASA	34,222	75.35	2,578,627.70	
	DNB ASA	37,378	140.40	5,247,871.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,500	132.10	1,122,850.00	
	TELENOR ASA	30,504	132.40	4,038,729.60	
ノルウェー・クロネ 小計		242,746		28,250,393.95 (381,662,822)	
デンマーク・ク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,842	422.10	1,621,708.20	
	NOVOZYMES A/S B SHARES	9,396	277.00	2,602,692.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,062	517.00	4,685,054.00	
	ISS A/C	6,717	253.00	1,699,401.00	
	"DSV, DE SAMMENSLUT VOGN"	6,921	347.80	2,407,123.80	
	A P MOLLER MAERSK A/S	241	11,970.00	2,884,770.00	
	A.P. MOLLER-MAERSK A DKK1000	168	11,480.00	1,928,640.00	
	PANDORA A/S	4,456	826.00	3,680,656.00	
	CARLSBERG B	4,224	614.50	2,595,648.00	
	COLOPLAST B	4,386	492.30	2,159,227.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,790	133.00	637,070.00	
	GENMAB A/S	2,259	1,407.00	3,178,413.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	75,298	247.00	18,598,606.00	

	DANSKE BANK A/S	27,302	242.40	6,618,004.80	
	TRYG A/S	4,970	131.70	654,549.00	
	TDC A/S	35,300	37.52	1,324,456.00	
	DONG ENERGY	5,796	257.30	1,491,310.80	
デンマーク・クローネ 小計		205,128		58,767,330.40 (947,329,366)	
イスラエル・シェケル	FRUTAROM	1,504	196.50	295,536.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,712	17.04	352,932.48	
	ELBIT SYSTEMS LTD	923	437.90	404,181.70	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	35,593	137.50	4,894,037.50	
	BANK HAPOLIM BM	45,583	22.90	1,043,850.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,630	16.06	957,657.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,788	61.05	353,357.40	
	AZRIELI GROUP	1,403	171.80	241,035.40	
	NICE LTD	2,072	256.90	532,296.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	72,807	6.67	485,331.46	
イスラエル・シェケル 小計		246,015		9,560,217.24 (291,491,024)	
ユーロ	ENAGAS	8,825	23.40	206,460.87	
	ENI SPA	98,958	14.12	1,397,286.96	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	19,749	13.70	270,561.30	
	NESTE OYJ	4,680	34.83	163,004.40	
	OMV AG	6,306	35.21	222,002.73	
	REPSOL SA	46,198	13.63	629,447.75	
	SAIPEM EUR1	250,792	0.46	115,991.30	
	SNAM SPA	96,555	3.80	367,295.22	
	TECHNIPFMC PLC	8,486	30.19	256,192.34	
	TENARIS SA	20,564	15.86	326,145.04	
	TOTAL SA	90,321	47.44	4,284,828.24	
	VOPAK	3,294	38.81	127,840.14	
	AIR LIQUIDE	15,273	104.80	1,600,610.40	
	AKZO NOBEL	10,306	62.79	647,113.74	
	ARCELORMITTAL	74,545	8.55	637,210.66	
	ARKEMA	2,812	95.58	268,770.96	
	BASF SE	35,867	89.10	3,195,749.70	
	COVESTRO	2,488	72.10	179,384.80	
	CRH	32,660	32.20	1,051,652.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,589	30.74	202,545.86	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,216	43.68	140,474.88	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,683	85.44	485,555.52	
	IMERYS SA	1,606	76.69	123,164.14	
	K&S AG	7,454	22.75	169,578.50	
	KONINKLIJKE DSM N.V	7,502	61.01	457,697.02	
	LANXESS AG	3,918	67.72	265,326.96	
	LINDE	7,208	152.20	1,097,057.60	
	SOLVAY	2,782	115.90	322,433.80	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	21,462	10.27	220,414.74	
	SYMRISE AG	4,674	57.24	267,539.76	

THYSSENKRUPP AG	15,587	22.90	356,864.36	
UMICORE	3,961	49.47	195,930.86	
UPM-KYMMENE	21,157	22.74	481,110.18	
VOESTALPINE AG	5,300	40.90	216,743.50	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,386	29.69	248,938.41	
AIRBUS SE	23,002	65.40	1,504,330.80	
ALSTOM	6,471	26.01	168,278.35	
ANDRITZ AG	3,120	50.65	158,028.00	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,209	34.97	147,188.73	
BOUYGUES SA	8,005	35.05	280,535.22	
BRENNTAG AG	5,838	54.54	318,404.52	
CIE DE SAINT-GOBAIN	19,677	45.46	894,516.42	
CNH INDUSTRIAL NV	37,836	8.81	333,335.16	
DASSAULT AVIATION	90	1,076.85	96,916.50	
EIFFAGE EUR4 (POST SUBDIV ISIO	2,090	68.50	143,165.00	
FERROVIAL SA	18,593	17.02	316,452.86	
GEA GROUP AG NPV	6,932	39.49	273,710.02	
HOCHTIEF	724	140.70	101,866.80	
KONE OYJ	13,213	41.62	549,925.06	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	37,343	27.76	1,036,641.68	
LEGRAND PROMESSES EUR4	10,259	55.23	566,604.57	
LEONARDO SPA	16,864	11.83	199,501.12	
MAN SE	1,316	97.25	127,981.00	
METSO OYJ	5,434	28.57	155,249.38	
OSRAM LICHT AG	3,817	57.10	217,950.70	
PRYSMIAN SPA EURO.10	7,536	24.05	181,240.80	
REXEL SA	11,359	15.80	179,472.20	
SAFRAN SA	11,972	64.38	770,757.36	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,701	65.06	1,411,867.06	
SIEMENS AG	29,847	120.60	3,599,548.20	
THALES SA	4,135	89.10	368,428.50	
VINCI SA	19,937	68.21	1,359,902.77	
WARTSILA OYJ	5,554	49.31	273,867.74	
ZARDOYA OTIS	7,561	7.82	59,127.02	
ZODIAC AEROSPACE	8,082	26.30	212,556.60	
BIC	1,100	118.30	130,130.00	
BUREAU VERITAS	10,721	18.66	200,000.25	
EDENRED	8,188	20.75	169,901.00	
RANDSTAD HOLDING NV	5,309	55.50	294,649.50	
RELX NV	39,931	16.47	657,463.91	
WOLTERS KLUWER CVA	12,133	37.33	452,924.89	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	25,699	13.76	353,618.24	
ADP	1,341	107.50	144,157.50	
AENA SA	2,679	135.00	361,665.00	
ATLANTIA SPA	15,789	22.13	349,410.57	
BOLLORE	25,923	3.66	94,955.94	
DEUTSCHE POST AG-REG	37,550	31.90	1,197,657.25	
FRAPORT AG NPV	1,722	59.38	102,252.36	

GROUPE EUROTUNNEL SE-REGR	20,314	9.02	183,130.71	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	34,329	6.01	206,145.64	
LUFTHANSA	9,110	13.50	122,985.00	
BAYER MOTOREN WERKEUR1	12,853	85.03	1,092,890.59	
BAYER MOTOREN WERKNON-VTG PRF EUR1	2,336	69.38	162,071.68	
CONTINENTAL	4,264	190.85	813,784.40	
DAIMLER AG	37,613	67.61	2,543,014.93	
FERRARI NV	4,837	61.45	297,233.65	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,441	10.64	387,732.24	
MICHELIN B	7,204	105.35	758,941.40	
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,789	36.40	174,319.60	
PEUGEOT SA	17,661	18.53	327,170.02	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE (PREF)	6,513	53.97	351,506.61	
RENAULT SA	7,822	87.08	681,139.76	
SCHAEFFLER	5,805	14.76	85,652.77	
VALEO SA	9,501	58.77	558,373.77	
VOLKSWAGEN STAMM	1,284	144.85	185,987.40	
VOLKSWAGEN VORZUG	7,489	140.25	1,050,332.25	
ADIDAS AG	7,284	148.45	1,081,309.80	
CHRISTIAN DIOR	2,160	198.65	429,084.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,005	407.50	409,537.50	
HUGO BOSS AG -ORD	2,514	65.24	164,013.36	
KERING	3,071	225.70	693,124.70	
LUXOTTICA GROUP SPA	6,820	48.88	333,361.60	
LVMH	10,898	186.85	2,036,291.30	
SEB	886	123.55	109,465.30	
ACCOR SA	7,734	38.50	297,759.00	
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,299	98.70	325,611.30	
SODEXO	3,773	103.75	391,448.75	
ALTICE NV-A	14,559	20.35	296,275.65	
ALTICE NV-B	3,939	20.34	80,119.26	
AXEL SPRINGER SE	1,652	48.31	79,808.12	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	6,348	17.21	109,217.34	
JC DECAUX SA	2,913	30.20	87,958.03	
LAGARDERE	5,230	23.76	124,264.80	
PROSIEBEN SAT 1 MEDIA SE	8,369	39.00	326,391.00	
PUBLICIS GROUPE	7,640	63.47	484,910.80	
RTL GROUP	1,727	73.05	126,157.35	
SES	13,349	19.70	262,975.30	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,970	52.87	104,153.90	
VIVENDI SA	45,063	16.97	764,719.11	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	42,450	31.02	1,316,799.00	
ZALANDO SE	3,171	37.15	117,802.65	
CARREFOUR	22,947	22.60	518,602.20	
CASINO ORD	2,554	50.95	130,126.30	
COLRUYT NV	2,574	45.46	117,001.17	

DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	23,349	4.96	115,811.04	
JERONIMO MARTINS	10,993	16.14	177,427.02	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	51,116	20.38	1,041,744.08	
METRO STAMM	6,776	29.80	201,924.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	29,914	102.05	3,052,723.70	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	8,900	33.71	300,019.00	
DANONE	22,966	61.00	1,400,926.00	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6	4,005	71.33	285,676.65	
HEINEKEN NV	8,911	76.90	685,255.90	
KERRY GROUP A	6,081	70.51	428,771.31	
PERNOD RICARD	8,232	108.20	890,702.40	
REMY COINTREAU	1,054	86.63	91,308.02	
BEIERSDORF	3,988	85.74	341,931.12	
HENKEL AG & CO KGAA (PREF)	6,888	120.10	827,248.80	
HENKEL KGAA	3,961	104.05	412,142.05	
L'OREAL	9,818	176.10	1,728,949.80	
UNILEVER NV CVA	63,648	44.80	2,851,430.40	
ESSILOR INTERNATIONAL	8,055	107.75	867,926.25	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO KGAA	8,452	75.90	641,506.80	
FRESENIUS SE & CO KGaA	16,179	75.24	1,217,307.96	
BAYER AG	32,338	106.50	3,443,997.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	430	415.15	178,514.50	
GRIFOLS SA	11,668	21.11	246,311.48	
MERCK KGAA	4,944	101.35	501,074.40	
ORION OYJ	3,906	46.70	182,410.20	
QIAGEN N.V.	8,251	26.98	222,570.72	
SANOFI	45,949	81.49	3,744,384.01	
UCB SA	5,025	68.08	342,102.00	
ABN AMRO GROUP	8,619	21.88	188,583.72	
BANCA INTESA SPA	493,599	2.17	1,071,109.83	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT	257,234	6.24	1,605,140.16	
BANCO ESPIRITO SANTO SA-REG	141,192	—	—	
BANCO POPULAR ESPANOL	141,247	0.84	119,212.46	
BANCO SANTANDER SA	569,918	5.14	2,929,378.52	
BANK OF IRELAND	1,109,756	0.23	258,573.14	
BANKIA SA	200,556	0.95	191,330.42	
BANKINTER, S.A.	26,337	7.25	190,916.91	
BCO DE SABADELL EURO.125 (POST SU BDIV	211,266	1.47	309,715.95	
BNP PARIBAS	41,306	55.75	2,302,809.50	
CAIXABANK	129,511	3.37	436,063.53	
COMMERZBANK AG	44,524	7.41	330,011.88	
CREDIT AGRICOLE SA	45,055	11.82	532,550.10	
ERSTE GROUP BANK AG	10,571	29.42	310,945.96	
ING GROUP N.V.	150,809	13.46	2,029,135.09	
INTESA SANPAOLO RSP	42,401	2.08	88,194.08	
KBC BANCASSURANCE HOLDING NV	10,031	58.24	584,205.44	

MEDIOBANCA	23,487	8.05	188,952.91	
NATIXIS	40,646	5.50	223,431.06	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	5,358	21.95	117,608.10	
SOCIETE GENERALE-A	30,342	42.40	1,286,500.80	
UNICREDIT SPA	19,213	12.90	247,847.70	
UNICREDIT SPA-RTS	19,213	12.35	237,280.55	
DEUTSCHE BANK AG-REG	53,443	18.20	972,662.60	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	7,570	83.28	630,429.60	
EURAZEO NPV	1,839	58.90	108,317.10	
EXOR NV	3,827	45.14	172,750.78	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT	3,025	79.73	241,183.25	
WENDEL	1,178	107.10	126,163.80	
AEGON NV	77,098	5.03	387,494.54	
AGEAS	7,620	37.21	283,540.20	
ALLIANZ	17,854	162.80	2,906,631.20	
ASSICURAZIONI GENERALI	45,796	14.86	680,528.56	
AXA	76,844	22.47	1,726,300.46	
CNP ASSURANCES	8,159	17.77	144,944.63	
HANNOVER RUECK SE	2,358	106.50	251,127.00	
MAPFRE SA	44,197	2.89	127,552.54	
MUENCHENER RUECK AG-REG	6,488	177.45	1,151,295.60	
NN GROUP NV	12,882	29.65	381,886.89	
POSTE ITALIANE	18,953	6.06	114,760.41	
SAMPO INSURANCE CO A	17,293	43.35	749,651.55	
SCOR SE	6,412	32.31	207,171.72	
UNIPOLSAI SPA	38,014	2.01	76,408.14	
DEUTSCHE WOHNEN AG BR	12,841	32.13	412,581.33	
VONOVIA SE	18,655	32.88	613,376.40	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	17,619	43.30	762,902.70	
ATOS SE	3,470	105.05	364,523.50	
CAP GEMINI SA	6,560	82.02	538,051.20	
DASSAULT SYSTEMES	5,063	76.02	384,889.26	
GEMALTO	3,361	55.13	185,291.93	
SAP SE	38,409	86.89	3,337,358.01	
UNITED INTERNET	4,853	38.16	185,190.48	
INGENICO GROUP	2,394	80.12	191,807.28	
NOKIA OYJ	230,473	4.70	1,082,762.15	
DEUTSCHE TELEKOM	128,955	15.86	2,045,226.30	
ELISA CORP-A SHARES	5,535	31.24	172,913.40	
ILIAD SA	1,039	195.00	202,605.00	
KPN (KON. PTT NEDERLAND	122,868	2.60	319,579.66	
NUMERICABLE-SFR	3,802	25.95	98,661.90	
ORANGE S.A.	77,918	14.40	1,121,629.61	
PROXIMUS	6,592	27.51	181,312.96	
TELECOM ITALIA SPA	429,026	0.78	336,356.38	
TELECOM ITALIA-RNC	260,935	0.65	168,303.07	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	27,651	3.95	109,138.49	
TELEFONICA S.A.	182,732	9.32	1,703,793.16	

E.ON SE	77,360	7.06	546,393.68	
EDP ELERGIAS DE PORTUGAL	92,540	2.86	264,571.86	
ELEC DE FRANCE EURO.5	12,188	9.05	110,240.46	
ENDESA SA	12,380	19.95	246,981.00	
ENEL SPA	305,898	4.04	1,235,827.92	
ENGIE	62,372	11.08	691,081.76	
FORTUM OYJ	16,606	14.23	236,303.38	
GAS NATURAL SDG-E	13,145	18.05	237,201.52	
IBERDROLA SA	223,591	6.02	1,346,912.18	
INNOGY SE	5,459	33.91	185,087.39	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,112	17.29	295,780.92	
RWE AG	20,770	13.22	274,579.40	
SUEZ	11,127	14.56	161,953.48	
TERNA SPA	59,888	4.37	261,710.56	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,422	16.00	294,752.00	
ASML HOLDING NV	14,537	118.65	1,724,815.05	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	45,255	17.00	769,335.00	
STMICROELECTRONICS NV	24,753	13.32	329,586.19	
ユーロ 小計	9,224,822		140,389,525.91 (16,820,069,099)	
合計	46,552,437		139,438,631,523 (139,438,631,523)	

(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	AGNC INVESTMENT CORP	14,000	272,860.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	2,800	325,864.00	
		AMERICAN TOWER CORP	16,492	1,782,950.12	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,400	404,668.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,415	966,794.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,250	857,437.50	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,000	281,280.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,706	304,151.42	
		COLONY NORTHSTAR INC	20,700	292,698.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	12,966	1,156,956.18	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,400	562,410.00	
		DUKE REALTY CORP	13,600	342,856.00	
		EQUINIX INC	2,627	983,233.56	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	14,143	870,925.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,537	578,689.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,700	363,075.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,700	379,782.00	
		GGP INC	22,087	552,616.74	
		HCP INC	18,800	584,116.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	30,748	565,455.72	
		IRON MOUNTAIN INC	7,457	277,027.55	

		KIMCO REALTY CORP	16,600	403,878.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,400	249,920.00	
		MACERICH CO/THE	5,141	341,413.81	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	4,437	442,013.94	
		NATIONAL RETAIL PPTYS	5,800	259,376.00	
		PROLOGIS INC	21,111	1,059,561.09	
		PUBLIC STORAGE	5,730	1,293,604.80	
		REALTY INCOME CORP	9,374	569,939.20	
		REGENCY CENTERS CORP	4,000	279,000.00	
		SIMON PPTY (SIMON DEBART	12,080	2,187,567.20	
		SL GREEN REALTY CORP	4,000	445,120.00	
		UDR INC	11,000	391,490.00	
		VENTAS INC COM	13,600	845,376.00	
		VEREIT INC	34,092	297,623.16	
		VORNADO REALTY TRUST	6,859	753,049.61	
		WELLTOWER INC	13,691	902,510.72	
		WEYERHAEUSER CO	29,460	987,499.20	
	アメリカ・ドル 小計		459,903	24,414,790.26 (2,755,941,524)	
	カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5,913	138,245.94	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,000	188,230.00	
		SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,100	70,854.00	
	カナダ・ドル 小計		15,013	397,329.94 (34,241,894)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	35,987	334,679.10	
		GOODMAN GROUP	67,133	494,098.88	
		GPT GROUP	73,197	357,201.36	
		MIRVAC GROUP	160,291	344,625.65	
		SCENTRE GROUP	216,177	970,634.73	
		STOCKLAND	89,705	410,848.90	
		VINCINITY CENTERS	133,465	389,717.80	
		WESTFIELD CORP	80,050	725,253.00	
	オーストラリア・ドル 小計		856,005	4,027,059.42 (348,582,263)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO	39,238	239,351.80	
		HAMMERSON	33,098	186,838.21	
		INTU PROPERTIES PLC	36,917	100,967.99	
		LAND SECURITIES GROUP	32,138	338,734.52	
		SEGRO PLC	29,936	149,141.15	
	イギリス・ポンド 小計		171,327	1,015,033.67 (142,317,870)	
	香港・ドル	LINK REIT	86,487	4,588,135.35	
	香港・ドル 小計		86,487	4,588,135.35 (66,711,487)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	77,223	191,513.04	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	96,000	148,800.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	97,221	191,525.37	
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	110,000	190,300.00	

	シンガポール・ドル 小計	380,444	722,138.41 (57,503,881)	
	ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,671,480	0.00
		FONCIERE DES REGIONS	1,467	114,411.33
		GECINA SA	1,359	166,273.65
		ICADE	1,152	79,303.68
		KLEPIERRE	7,556	272,696.04
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,827	844,427.55
	ユーロ 小計	1,686,841	1,477,112.25 (176,972,818)	
投資証券 小計			3,582,271,737 (3,582,271,737)	
合計			3,582,271,737 (3,582,271,737)	

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

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計 額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 603銘柄	97.1%	—	66.2%
	投資証券 38銘柄	—	2.9%	
カナダ・ドル	株式 91銘柄	99.4%	—	4.0%
	投資証券 3銘柄	—	0.6%	
オーストラリア・ドル	株式 63銘柄	92.1%	—	3.1%
	投資証券 8銘柄	—	7.9%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	98.6%	—	7.1%
	投資証券 5銘柄	—	1.4%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	100.0%	—	3.4%
香港・ドル	株式 41銘柄	96.3%	—	1.3%
	投資証券 1銘柄	—	3.7%	
シンガポール・ドル	株式 22銘柄	92.2%	—	0.5%
	投資証券 4銘柄	—	7.8%	
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100.0%	—	0.1%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	100.0%	—	1.2%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100.0%	—	0.3%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	100.0%	—	0.7%
イスラエル・シェケル	株式 10銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式 236銘柄	99.0%	—	11.9%
	投資証券 6銘柄	—	1.0%	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		894,688,759	810,820,120
金銭信託		228,226,721	189,731
コール・ローン		4,970,649	357,522,660
国債証券		157,110,348,596	166,196,492,124
派生商品評価勘定		2,390,400	1,479,000
未収入金		705,397,652	—
未収利息		1,514,348,734	1,407,875,936
前払費用		28,008,805	114,620,888
流動資産合計		160,488,380,316	168,889,000,459
資産合計		160,488,380,316	168,889,000,459
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		427,200	160,000
未払金		—	359,178,529
未払解約金		1,699,257,258	275,044,855
未払利息		—	1,036
その他未払費用		—	62
流動負債合計		1,699,684,458	634,384,482
負債合計		1,699,684,458	634,384,482
純資産の部			
元本等			
元本	1	70,807,053,573	77,564,966,368
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		87,981,642,285	90,689,649,609
元本等合計		158,788,695,858	168,254,615,977
純資産合計		158,788,695,858	168,254,615,977
負債純資産合計		160,488,380,316	168,889,000,459

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。
-------------------	--

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として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。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	93,621,001,523円 15,970,215,085円 38,784,163,035円	70,807,053,573円 26,060,597,551円 19,302,684,756円
元本の内訳 ファンド名 ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン 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） 海外国債インデックス・ファンド 〈適格機関投資家限定〉 外国債券インデックス・ファンド／為替ヘッジ付き（年金1）〈適格機関投資家限定〉 外国債券パッシブ・ファンド〈適格機関投資家限定〉 バランスファンドVA30A〈適格機関投資家限定〉 バランスファンドVA30B〈適格機関投資家限定〉 バランスファンドVA40A〈適格機関投資家限定〉 バランスファンドVA40B〈適格機関投資家限定〉	5,638,579,993円 13,076,343円 61,405,248円 279,991,019円 1,492,168,040円 8,960,328,412円 26,395,685円 3,770,477,898円 317,363円 35,052,645円	5,878,291,541円 14,499,165円 664,054,017円 — 円 1,305,802,680円 7,116,435,899円 10,410,691円 1,737,907,628円 331,129円 19,308,146円

バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	6,470,910円	5,834,988円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	11,276,376,409円	11,011,569,950円
外国債券インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	382,866,199円	210,855,597円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	20,017,905円	11,224,347円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	5,453,974,047円	4,722,521,382円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,985,114,455円	1,902,422,106円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	55,498,781円	54,230,192円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	454,677,212円	458,960,051円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,506,849,551円	1,811,668,610円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	676,329,234円	815,782,815円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	5,046,371,273円	4,785,529,105円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	523,220,146円	473,014,020円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	1,103,520,704円	1,114,952,021円
外国債券インデックス・ファンド（年金）＜適格機関投資家限定＞	288,454,006円	304,834,719円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	114,367,726円	118,602,764円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	65,727,530円	69,820,210円
外国債券インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	716,413,612円	1,529,271,172円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	43,432,480円	47,044,686円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	881,281,263円	855,372,415円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	6,542,069円	5,052,152円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	9,187,897円	9,660,644円
バランスファンドVA50D＜適格機関投資家限定＞	104,299円	— 円
外国債券インデックス・ファンドVA3＜適格機関投資家限定＞	12,829,440,380円	18,690,170,623円
外国債券インデックス・ファンドA＜適格機関投資家限定＞	341,665,536円	254,311,657円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	1,472,157,148円	1,378,196,767円

世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,477,695,241円	2,388,112,501円
外国債券インデックス・ファンドA／為替ヘッジ付き＜適格機関投資家限定＞	1,362,187,622円	2,070,520,583円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	38,772,789円	38,810,880円
外国債券インデックス・ファンド／為替ヘッジ付きVA4＜適格機関投資家限定＞	31,804,629円	12,089,099円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	1,966,382円	543,759,096円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド（年金）＜適格機関投資家限定＞	760,270,336円	837,572,751円
フレックス資産配分戦略ファンド＜適格機関投資家限定＞	596,092,651円	568,264,203円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）＜適格機関投資家限定＞	410,505円	117,634,028円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	— 円	74,905,189円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	— 円	419,336,054円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド（年金）為替ヘッジ付＜適格機関投資家限定＞	— 円	213,706,336円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド／為替ヘッジ付＜適格機関投資家限定＞	— 円	1,711,033,111円
グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	— 円	183,473,284円
グローバルバランス40VA2＜適格機関投資家限定＞	— 円	833,561,516円
グローバルバランス40VA3＜適格機関投資家限定＞	— 円	136,085,959円
グローバルバランス50VA＜適格機関投資家限定＞	— 円	28,157,889円
計	70,807,053,573円	77,564,966,368円
2 受益権の総数	70,807,053,573口	77,564,966,368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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及び信用リスクに晒されております。 デリバティブ取引には、保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用している為替予約取引があり、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。
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28年 2月22日現在）	（平成29年 2月20日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。 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。 「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。	(3)デリバティブ取引 同左 同左
---------------------------	--	-------------------------------------

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△68,571,597	△5,419,853,070
合 計	△68,571,597	△5,419,853,070

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

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(平成28年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	790,585,000	—	789,880,000	705,000
	オーストラリア・ドル	8,050,300	—	8,076,000	△25,700
	イギリス・ポンド	80,830,000	—	80,655,000	175,000
	メキシコ・ペソ	33,841,500	—	33,990,000	△148,500
	ポーランド・ズロチ	54,245,000	—	54,473,000	△228,000
	ユーロ	615,749,400	—	614,264,000	1,485,400
	合 計	1,583,301,200	—	1,581,338,000	1,963,200

(単位：円)

区 分	種 類	(平成29年 2月20日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	ユーロ	479,400,000	—	479,240,000	△160,000
	売建				
	ノルウェー・クローネ	41,055,000	—	40,500,000	555,000
	ユーロ	84,791,000	—	83,867,000	924,000
合 計		605,246,000	—	603,607,000	1,319,000

(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27年 2月21日 至 平成28年 2月22日	自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月20日
該当する事項はありません。	同左

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成28年 2月22日現在)	(平成29年 2月20日現在)
1口当たり純資産額	2.2426円	2.1692円
(1万口当たり純資産額)	(22,426円)	(21,692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	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	-----	------	-----	----

国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 5.25% 29/02/15	500,000	639,940.00	
		US TREASURY N/B 1.0% 18/03/15	5,000,000	5,003,900.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 18/12/15	5,000,000	5,006,050.00	
		US TREASURY N/B 1.875% 21/11/30	6,000,000	5,991,360.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/11/30	3,500,000	3,483,865.00	
		US TREASURY N/B 1.625% 23/05/31	4,000,000	3,874,360.00	
		US TREASURY N/B 2.125% 23/11/30	3,000,000	2,984,310.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	7,500,000	7,212,900.00	
		US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	2,200,000	2,499,156.00	
		US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	3,500,000	3,125,675.00	
		US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	1,500,000	1,898,850.00	
		US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000	1,273,923.00	
		US TREASURY N/B 0.75% 18/03/31	6,200,000	6,186,422.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 18/04/30	5,000,000	5,096,500.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 18/04/30	8,800,000	8,763,216.00	
		US TREASURY N/B 2.375% 18/05/31	2,500,000	2,542,775.00	
		US TREASURY N/B 2.375% 18/06/30	3,000,000	3,054,600.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 18/07/31	2,000,000	2,034,300.00	
		US TREASURY N/B 1.5% 18/08/31	7,600,000	7,648,108.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 18/09/30	8,500,000	8,535,870.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 18/10/31	2,500,000	2,525,500.00	
		US TREASURY N/B 3.75% 18/11/15	4,000,000	4,179,240.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 18/11/30	8,400,000	8,431,500.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 18/11/30	8,200,000	8,210,906.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 18/12/31	12,000,000	12,040,800.00	
		US TREASURY N/B 1.5% 19/01/31	6,000,000	6,033,060.00	
		US TREASURY N/B 2.75% 19/02/15	7,000,000	7,208,880.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 19/02/28	5,000,000	5,013,650.00	
		US TREASURY N/B 1.5% 19/03/31	5,000,000	5,024,800.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 19/04/30	8,900,000	8,892,346.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 19/05/15	7,000,000	7,278,880.00	
		US TREASURY N/B 1.0% 19/06/30	10,000,000	9,923,800.00	
		US TREASURY N/B 3.625% 19/08/15	8,000,000	8,440,320.00	
		US TREASURY N/B 1.0% 19/09/30	8,200,000	8,116,114.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 19/10/31	7,000,000	6,970,180.00	
		US TREASURY N/B 1.0% 19/11/30	11,000,000	10,872,400.00	
		US TREASURY N/B 1.125% 19/12/31	8,200,000	8,125,708.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 20/01/31	9,000,000	8,975,430.00	
		US TREASURY N/B 3.625% 20/02/15	8,800,000	9,347,624.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 20/02/29	12,000,000	11,911,440.00	
		US TREASURY N/B 1.125% 20/03/31	7,900,000	7,806,464.00	
		US TREASURY N/B 3.5% 20/05/15	7,000,000	7,425,740.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 20/08/15	6,900,000	7,129,908.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 20/09/30	10,000,000	10,119,500.00	
		US TREASURY N/B 2.625% 20/11/15	7,500,000	7,753,125.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 20/11/30	6,400,000	6,467,776.00	
		US TREASURY N/B 2.375% 20/12/31	9,000,000	9,220,050.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 21/01/31	8,500,000	8,377,175.00	
		US TREASURY N/B 3.625% 21/02/15	12,000,000	12,865,800.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/02/28	11,000,000	11,103,180.00	
		US TREASURY N/B 2.25% 21/03/31	5,500,000	5,600,980.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 21/05/15	5,500,000	5,792,215.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/05/31	14,500,000	14,608,170.00	
		US TREASURY N/B 2.125% 21/08/15	7,000,000	7,075,460.00	
		US TREASURY N/B 2.125% 21/09/30	3,000,000	3,031,410.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/11/15	10,000,000	10,043,800.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 21/12/31	2,900,000	2,912,586.00	
		US TREASURY N/B 2.0% 22/02/15	8,500,000	8,526,605.00	
		US TREASURY N/B 1.75% 22/05/15	9,500,000	9,386,855.00	

	US TREASURY N/B 2.125% 22/06/30	2,500,000	2,514,650.00	
	US TREASURY N/B 1.625% 22/08/15	6,000,000	5,875,800.00	
	US TREASURY N/B 1.75% 22/09/30	6,500,000	6,394,895.00	
	US TREASURY N/B 1.625% 22/11/15	8,000,000	7,805,920.00	
	US TREASURY N/B 2.0% 23/02/15	8,800,000	8,743,592.00	
	US TREASURY N/B 1.5% 23/03/31	12,000,000	11,562,720.00	
	US TREASURY N/B 1.75% 23/05/15	7,000,000	6,833,750.00	
	US TREASURY N/B 2.5% 23/08/15	4,500,000	4,585,770.00	
	US TREASURY N/B 2.75% 23/11/15	8,400,000	8,683,164.00	
	US TREASURY N/B 2.75% 24/02/15	6,500,000	6,719,115.00	
	US TREASURY N/B 2.5% 24/05/15	10,000,000	10,163,700.00	
	US TREASURY N/B 2.25% 24/11/15	6,500,000	6,467,240.00	
	US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	6,000,000	5,848,620.00	
	US TREASURY N/B 2.125% 25/05/15	5,500,000	5,399,680.00	
	US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	7,500,000	7,275,300.00	
	US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	6,400,000	6,321,024.00	
	US TREASURY N/B 1.625% 26/05/15	8,500,000	7,933,900.00	
	US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	8,000,000	7,365,280.00	
	US TREASURY N/B 5.5% 28/08/15	1,000,000	1,295,630.00	
	US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	1,000,000	1,265,660.00	
	US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	3,500,000	3,836,595.00	
	US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	2,400,000	2,921,064.00	
	US TREASURY N/B 4.375% 39/11/15	2,200,000	2,722,852.00	
	US TREASURY N/B 3.875% 40/08/15	2,000,000	2,304,380.00	
	US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	2,500,000	3,042,875.00	
	US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	2,000,000	2,612,580.00	
	US TREASURY N/B 4.375% 41/05/15	1,900,000	2,358,299.00	
	US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	5,500,000	6,217,805.00	
	US TREASURY N/B 3.125% 41/11/15	1,500,000	1,528,890.00	
	US TREASURY N/B 3.125% 42/02/15	2,000,000	2,037,960.00	
	US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	1,500,000	1,494,375.00	
	US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	2,000,000	1,899,060.00	
	US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	1,400,000	1,327,928.00	
	US TREASURY N/B 3.125% 43/02/15	2,000,000	2,033,600.00	
	US TREASURY N/B 2.875% 43/05/15	2,600,000	2,523,326.00	
	US TREASURY N/B 3.625% 43/08/15	3,800,000	4,223,510.00	
	US TREASURY N/B 3.625% 44/02/15	7,800,000	8,667,438.00	
	US TREASURY N/B 3.375% 44/05/15	5,500,000	5,852,330.00	
	US TREASURY N/B 3.125% 44/08/15	5,500,000	5,589,595.00	
	US TREASURY N/B 3.0% 44/11/15	6,000,000	5,952,180.00	
	US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	5,600,000	5,013,960.00	
	US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	7,800,000	7,728,084.00	
	US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	5,600,000	4,725,448.00	
	US TREASURY N/B 3.875% 18/05/15	4,000,000	4,142,520.00	
	US TREASURY N/B 4.375% 38/02/15	700,000	871,388.00	
	US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	500,000	671,190.00	
	US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	1,000,000	1,292,110.00	
	US TREASURY N/B 8.125% 19/08/15	6,000,000	6,989,280.00	
	US TREASURY N/B 8.875% 19/02/15	650,000	748,793.50	
	US TREASURY N/B 6.5% 26/11/15	1,000,000	1,352,420.00	
	US TREASURY N/B 3.5% 18/02/15	7,500,000	7,689,825.00	
	US TREASURY N/B 4.0% 18/08/15	4,500,000	4,697,235.00	
	US TREASURY N/B 5.375% 31/02/15	1,500,000	2,000,280.00	
	US TREASURY N/B 6.125% 27/11/15	1,000,000	1,342,580.00	
	US TREASURY N/B 6.25% 23/08/15	3,000,000	3,747,060.00	
	US TREASURY N/B 8.0% 21/11/15	7,200,000	9,187,344.00	
	アメリカ・ドル 小計	646,750,000	660,027,026.50 (74,503,850,751)	
	カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 19/06/01	4,300,000	4,583,456.00

	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/06/01	3,300,000	3,595,251.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	850,000	1,194,258.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 17/06/01	4,550,000	4,593,361.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 20/06/01	3,000,000	3,244,200.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 17/03/01	400,000	400,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.5% 18/11/01	1,100,000	1,095,512.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 22/06/01	3,600,000	3,879,720.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/06/01	1,100,000	1,108,371.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 24/06/01	1,500,000	1,604,130.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	800,000	839,752.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	800,000	785,600.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	2,450,000	2,980,155.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	250,000	268,875.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	620,000	683,450.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 18/06/01	3,800,000	3,971,380.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	1,300,000	1,919,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 41/06/01	1,550,000	1,991,657.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	1,100,000	1,563,122.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 8.0% 27/06/01	1,400,000	2,207,394.00	
カナダ・ドル 小計		37,770,000	42,509,742.30 (3,663,489,591)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 18/01/21	1,650,000	1,708,127.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 18/10/21	1,700,000	1,741,374.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/15	3,200,000	3,440,499.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 20/11/21	1,100,000	1,085,163.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 22/07/15	1,750,000	2,052,795.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 23/04/21	2,500,000	2,934,860.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 24/04/21	2,800,000	2,829,503.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	2,200,000	2,290,470.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	3,000,000	3,362,742.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	4,800,000	5,621,102.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	700,000	692,094.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	1,450,000	1,486,025.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,400,000	1,620,283.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	400,000	363,833.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	800,000	755,964.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	800,000	684,583.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	1,100,000	1,139,483.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 19/03/15	3,200,000	3,419,235.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 21/05/15	3,000,000	3,431,715.00	
オーストラリア・ドル 小計		37,550,000	40,659,856.10 (3,519,517,144)	
イギリス・ポンド	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	1,700,000	2,704,567.40	
	UK GILT BOND 4.5% 19/03/07	3,900,000	4,253,843.10	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	2,400,000	3,671,505.60	
	UK GILT BOND 3.75% 19/09/07	4,100,000	4,478,225.00	
	UK GILT BOND 8.0% 21/06/07	1,400,000	1,856,713.60	
	UK GILT BOND 3.75% 21/09/07	3,800,000	4,368,282.40	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	2,000,000	2,832,902.00	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	1,350,000	1,933,854.75	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	2,050,000	3,445,623.60	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,900,000	2,490,805.00	
	UK GILT BOND 2.25% 23/09/07	2,100,000	2,299,573.50	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	1,750,000	1,882,706.00	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	2,500,000	2,564,625.00	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	1,300,000	1,885,078.00	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	780,000	1,043,547.96	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	1,500,000	2,257,590.00	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	2,000,000	2,787,174.00	

	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	1,650,000	2,311,907.40	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	1,000,000	1,509,245.00	
	UK GILT BOND 1.75% 22/09/07	2,000,000	2,123,074.00	
	UK GILT BOND 2.75% 24/09/07	2,000,000	2,266,920.00	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	2,250,000	3,588,903.00	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	2,200,000	2,807,486.00	
	UK GILT BOND 4.0% 22/03/07	1,700,000	1,996,990.00	
	UK GILT BOND 3.75% 20/09/07	3,750,000	4,212,270.00	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	2,900,000	4,441,367.40	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	2,200,000	2,978,646.00	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,450,000	1,879,417.50	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	1,600,000	2,712,323.20	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	1,500,000	2,277,985.50	
	UK GILT BOND 4.75% 20/03/07	3,900,000	4,440,259.20	
イギリス・ポンド 小計		66,630,000	86,303,411.11 (12,100,601,271)	
スイス・フラン	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 3.0% 19/05/12	800,000	871,970.40	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/02/11	550,000	703,190.95	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 3.0% 18/01/08	250,000	258,831.25	
	SWITZERLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 28/04/08	610,000	891,209.39	
スイス・フラン 小計		2,210,000	2,725,201.99 (306,721,483)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.375% 17/04/01	1,150,000	1,152,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.625% 19/10/01	630,000	635,859.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.875% 30/09/01	500,000	520,820.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.375% 33/09/01	330,000	368,775.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	500,000	523,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	320,000	334,924.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.125% 22/09/01	950,000	1,015,550.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.25% 20/09/01	2,100,000	2,228,520.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	900,000	991,800.00	
シンガポール・ドル 小計		7,380,000	7,771,548.80 (618,848,430)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.502% 27/05/31	3,500,000	3,242,095.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.58% 18/09/28	8,800,000	8,840,480.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.378% 19/11/29	3,500,000	3,577,350.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.16% 21/07/15	500,000	507,750.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.418% 22/08/15	2,675,000	2,614,812.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.48% 23/03/15	3,200,000	3,120,000.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.955% 25/09/15	800,000	793,120.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.498% 30/04/15	2,200,000	2,198,900.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.127% 32/04/15	3,350,000	3,155,904.35	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.935% 43/09/30	1,200,000	1,213,200.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.736% 46/03/15	750,000	744,819.00	
マレーシア・リンギット 小計		30,475,000	30,008,431.35 (760,413,650)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	4,300,000	4,432,354.00	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 4.25% 19/03/12	14,500,000	15,960,657.50	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 22/06/01	7,800,000	9,245,160.60	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/13	4,900,000	5,312,937.70	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	7,900,000	10,603,798.70	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 5.0% 20/12/01	11,700,000	14,046,411.60	
スウェーデン・クローナ 小計		51,100,000	59,601,320.10 (755,148,725)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	3,200,000	3,164,320.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 19/05/22	6,800,000	7,386,160.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/05/25	4,300,000	4,794,577.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 24/03/14	4,200,000	4,646,871.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 25/03/13	3,000,000	3,046,590.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/05/24	8,500,000	8,865,500.00	

	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 17/05/19	1,300,000	1,311,375.00	
ノルウェー・クローネ 小計		31,300,000	33,215,394.00 (448,739,972)	
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 19/11/15	5,700,000	6,400,245.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 7.0% 24/11/10	3,000,000	4,609,446.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 3.0% 21/11/15	15,000,000	17,375,850.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/11/15	9,000,000	9,932,742.00	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	2,500,000	2,808,552.50	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	11,700,000	19,790,046.90	
デンマーク・クローネ 小計		46,900,000	60,916,882.40 (981,980,144)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	8,700,000	8,683,313.40	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 17/12/14	5,500,000	5,556,193.50	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 18/12/13	29,500,000	30,332,637.50	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 20/06/11	38,000,000	39,116,250.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 21/06/10	36,500,000	35,671,815.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 24/12/05	45,000,000	52,199,640.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	14,000,000	13,992,090.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	11,000,000	11,762,388.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	11,700,000	14,148,014.40	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	11,000,000	11,651,684.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	14,500,000	14,195,500.00	
メキシコ・ペソ 小計		225,400,000	237,309,525.80 (1,309,948,582)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 18/07/25	2,100,000	2,120,370.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 20/10/25	3,200,000	3,482,240.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 21/10/25	3,500,000	3,916,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 4.0% 23/10/25	3,100,000	3,207,725.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	3,500,000	3,406,025.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	1,800,000	1,629,450.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	3,800,000	4,501,480.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.25% 17/10/25	8,000,000	8,196,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.5% 19/10/25	2,800,000	3,027,108.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 22/09/23	3,000,000	3,379,200.00	
ポーランド・ズロチ 小計		34,800,000	36,866,098.00 (1,021,190,914)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 7.25% 20/01/15	3,000,000	2,960,250.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.75% 21/03/31	22,000,000	21,094,150.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 10.5% 26/12/21	22,000,000	24,602,820.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 7.0% 31/02/28	11,500,000	9,611,861.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.25% 36/03/31	10,000,000	7,272,500.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 6.5% 41/02/28	29,000,000	20,953,660.00	
	SOUTH AFRICAN GOVERNMENT BOND 8.75% 48/02/28	21,500,000	19,892,875.00	
南アフリカ・ランド 小計		119,000,000	106,388,116.00 (919,193,322)	
ユーロ	ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	5,000,000	5,952,910.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 18/06/22	1,000,000	1,025,172.00	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 21/09/28	1,400,000	1,697,292.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 22/09/28	2,100,000	2,617,435.80	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 23/06/22	1,700,000	1,941,231.70	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.6% 24/06/22	1,800,000	2,102,790.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	1,900,000	1,944,860.90	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	2,900,000	3,912,651.00	

BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	1,400,000	1,941,332.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	400,000	503,783.60	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	200,000	212,739.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	1,400,000	2,139,590.60	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	720,000	1,037,250.72	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	580,000	544,464.56	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	400,000	398,597.60	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 20/09/28	2,700,000	3,111,955.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 18/03/28	150,000	157,709.25	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 19/03/28	1,500,000	1,644,807.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 22/03/28	1,000,000	1,218,118.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	1,850,000	2,771,081.70	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	2,450,000	3,907,242.85	
SPANISH GOVERNMENT BOND 3.75% 18/10/31	3,000,000	3,205,485.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.3% 19/10/31	5,900,000	6,589,061.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.85% 20/10/31	2,800,000	3,284,680.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 21/04/30	2,850,000	3,476,430.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.75% 21/07/30	1,500,000	1,530,781.50	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.85% 22/01/31	2,700,000	3,408,177.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.4% 23/01/31	2,300,000	2,922,467.40	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.4% 23/10/31	2,300,000	2,811,701.70	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.8% 24/01/31	3,500,000	4,381,475.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.75% 24/10/31	2,600,000	2,881,093.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	3,200,000	4,016,544.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	1,700,000	1,666,680.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	1,400,000	1,887,480.00	
SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	1,200,000	1,716,739.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	2,700,000	3,118,297.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 20/02/01	3,400,000	3,812,365.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 18/02/01	2,200,000	2,298,553.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 18/08/01	4,200,000	4,477,754.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 21/09/01	4,300,000	5,042,812.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	2,000,000	2,591,288.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	1,200,000	1,725,159.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	2,300,000	2,399,123.10	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	2,000,000	2,162,446.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 18/04/13	1,700,000	1,721,928.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.5% 19/07/04	4,300,000	4,745,583.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 21/01/04	3,200,000	3,596,435.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	1,450,000	2,175,140.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 18/01/04	2,800,000	2,919,408.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	1,650,000	2,235,428.25	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.0% 20/07/04	4,500,000	5,074,371.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 20/09/04	2,500,000	2,764,450.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/04	4,400,000	5,152,901.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.25% 21/09/04	3,200,000	3,616,393.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 22/01/04	2,100,000	2,360,685.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.75% 22/07/04	3,100,000	3,468,782.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 22/09/04	2,000,000	2,215,720.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/02/15	1,900,000	2,112,420.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 23/05/15	500,000	557,111.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.0% 23/08/15	1,200,000	1,379,524.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.5% 24/05/15	2,300,000	2,576,043.70	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 24/08/15	2,500,000	2,709,272.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,300,000	2,376,590.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	1,850,000	2,480,898.10	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 9.0% 23/11/01	1,700,000	2,499,385.90	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/08/01	3,600,000	4,065,321.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 19/02/01	4,800,000	5,189,572.80	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	2,150,000	2,788,100.65	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	4,300,000	5,551,171.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	2,100,000	2,907,093.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	4,300,000	6,013,584.40	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/11/01	2,300,000	3,194,451.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 18/06/01	1,100,000	1,151,696.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 19/03/01	4,500,000	4,899,163.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 20/03/01	3,100,000	3,461,373.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 20/09/01	3,200,000	3,592,384.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 21/03/01	4,100,000	4,610,581.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 22/03/01	3,000,000	3,575,985.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/09/01	3,700,000	4,546,819.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.5% 22/11/01	3,400,000	4,182,618.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 23/08/01	5,200,000	6,244,518.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 24/03/01	4,000,000	4,735,912.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 24/09/01	2,800,000	3,173,651.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	6,000,000	7,355,736.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	2,800,000	3,430,294.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	900,000	871,020.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	700,000	643,961.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	2,000,000	2,582,956.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	1,500,000	1,884,955.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	1,800,000	1,796,443.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	1,100,000	982,031.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	250,000	207,102.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	1,400,000	2,083,649.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.625% 28/01/04	1,300,000	2,038,107.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 20/01/04	3,850,000	4,303,487.65	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.75% 19/01/04	4,800,000	5,216,088.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	2,200,000	3,481,007.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 18/07/04	2,600,000	2,783,625.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	1,400,000	2,347,391.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,800,000	2,993,167.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	1,550,000	2,792,786.90	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,500,000	2,495,478.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 24/01/04	2,400,000	3,473,668.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	1,050,000	1,809,532.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,200,000	1,966,423.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,400,000	2,348,090.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.375% 19/07/04	900,000	1,007,680.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.125% 18/09/15	60,000	61,719.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.375% 20/04/15	1,500,000	1,686,175.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.5% 21/04/15	600,000	697,763.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.5% 23/04/15	700,000	766,470.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.0% 24/04/15	400,000	453,410.40	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	450,000	450,562.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	420,000	516,663.84	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	250,000	244,894.50	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.625% 42/07/04	620,000	812,049.96	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	1,150,000	1,506,946.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	2,600,000	3,902,756.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	1,100,000	1,653,665.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 18/11/25	3,400,000	3,491,817.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 19/10/25	4,200,000	4,673,445.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 20/04/25	4,500,000	5,052,181.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 22/04/25	4,200,000	4,843,818.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 22/10/25	2,500,000	2,795,005.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 23/05/25	4,000,000	4,362,276.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.25% 24/05/25	3,000,000	3,377,685.00	

FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	4,200,000	4,125,219.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	4,000,000	4,917,280.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	3,300,000	3,832,851.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	2,500,000	2,846,602.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 19/04/25	3,700,000	4,083,390.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 21/10/25	5,200,000	6,008,340.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.75% 21/04/25	4,900,000	5,706,486.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 18/04/25	3,000,000	3,162,576.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 18/10/25	4,800,000	5,189,683.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	3,600,000	5,373,334.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	3,000,000	4,445,445.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	2,800,000	4,474,696.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	2,500,000	3,607,080.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	2,400,000	2,432,916.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	3,100,000	3,119,530.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	2,150,000	2,700,369.90	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	2,750,000	3,843,067.25	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,804,330.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 8.5% 19/10/25	4,450,000	5,521,813.65	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	1,700,000	2,513,195.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 20/10/25	6,800,000	7,497,000.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.25% 23/10/25	4,300,000	5,406,003.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 24/11/25	3,800,000	4,134,685.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	3,600,000	3,337,272.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	420,000	356,107.92	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.8% 22/03/15	550,000	570,050.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	2,000,000	2,707,758.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	310,000	297,256.21	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.4% 19/06/18	900,000	1,001,096.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 18/10/18	900,000	974,304.90	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.9% 23/03/20	200,000	242,722.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	740,000	713,854.32	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	580,000	637,414.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 3.4% 24/03/18	950,000	1,132,479.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 19/09/01	3,600,000	3,958,660.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	2,300,000	2,422,033.40	
SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	550,000	545,534.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	1,450,000	2,289,467.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	1,400,000	2,164,876.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.25% 19/01/15	1,700,000	1,763,831.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.25% 22/07/15	1,500,000	1,706,469.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.75% 23/07/15	900,000	1,006,632.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 24/07/15	1,600,000	1,820,376.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	1,300,000	1,292,912.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	1,600,000	1,603,936.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	1,100,000	1,367,084.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	1,180,000	1,634,087.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 18/07/15	1,700,000	1,813,833.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 21/07/15	1,800,000	2,097,849.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.5% 20/07/15	2,300,000	2,622,133.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 23/01/15	800,000	987,716.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 19/07/15	2,700,000	3,005,920.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	1,500,000	2,279,515.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.5% 23/01/15	1,000,000	1,457,665.00	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.95% 19/06/18	1,700,000	1,804,148.80	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.65% 22/04/20	1,200,000	1,441,569.60	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.4% 22/11/22	800,000	963,529.60	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.75% 23/10/20	700,000	780,879.40	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.65% 24/10/21	700,000	776,125.00	

	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	900,000	961,651.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	2,000,000	2,788,708.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	400,000	480,972.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	570,000	791,372.04	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	680,000	1,138,745.68	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.5% 21/09/15	1,500,000	1,766,482.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.9% 20/07/15	1,500,000	1,728,628.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	1,100,000	1,668,583.40	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.35% 19/03/15	1,400,000	1,545,691.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	800,000	1,259,757.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	1,700,000	2,133,634.30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	1,400,000	1,928,164.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	4,300,000	5,915,596.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	650,000	872,170.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	750,000	768,881.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.0% 20/04/30	2,800,000	3,152,273.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.1% 18/07/30	2,500,000	2,656,640.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.6% 19/07/30	3,300,000	3,676,800.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.5% 17/07/30	900,000	922,918.50	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	3,000,000	4,307,343.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,900,000	2,774,402.80	
	IRISH GOVERNMENT BOND 4.5% 20/04/18	2,000,000	2,301,364.00	
	ユーロ 小計	454,080,000	544,919,857.65 (65,286,848,145)	
国債証券 小計			166,196,492,124 (166,196,492,124)	
合計			166,196,492,124 (166,196,492,124)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入債券 時価比率	有価証券の合計額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 115銘柄	100.0%	44.6%
カナダ・ドル	国債証券 20銘柄	100.0%	2.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	2.1%
イギリス・ポンド	国債証券 31銘柄	100.0%	7.3%
スイス・フラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.2%
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.8%
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカ・ランド	国債証券 7銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 207銘柄	100.0%	39.3%

(注) 組入債券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

（平成29年3月31日現在）

I 資産総額	3,317,358,078円
II 負債総額	3,093,871円
III 純資産総額（I－II）	3,314,264,207円
IV 発行済口数	2,707,671,747口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2240円

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

（平成29年3月31日現在）

I 資産総額	116,345,107,675円
II 負債総額	165,328,391円
III 純資産総額（I－II）	116,179,779,284円
IV 発行済口数	48,401,754,659口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4003円

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

（平成29年3月31日現在）

I 資産総額	129,254,606,034円
II 負債総額	467,237,176円
III 純資産総額（I－II）	128,787,368,858円
IV 発行済口数	102,403,979,275口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2576円

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

（平成29年3月31日現在）

I 資産総額	153,797,649,316円
II 負債総額	179,261,879円
III 純資産総額（I－II）	153,618,387,437円
IV 発行済口数	68,203,255,001口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.2524円

<参考情報>

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（平成29年3月31日現在）

I 資産総額	167,667,624,824円
II 負債総額	240,780,224円
III 純資産総額（I－II）	167,426,844,600円
IV 発行済口数	77,087,908,748口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.1719円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（1）受益証券の名義書換等

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

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

（2）受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

（3）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（4）内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

<受益権の譲渡>

- 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（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

＜質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて＞

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

第二部【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（本書提出日現在）

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。

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。

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。

④ 最近5年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 会社の意思決定機構

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

② 投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

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

2) 運用実施計画の作成

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

3) 運用の実行

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

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

平成29年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計129本であり、その純資産総額は1,268,094百万円です(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19期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表ならびに第20期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成27年3月31日現在)			当事業年度 (平成28年3月31日現在)		
	金 額		構成比	金 額		構成比
(資産の部)			%			%
流動資産						
預金		8,366,245			6,002,331	
有価証券		38,658			6,448	
差入保証金		61,568			-	
前払金		34,267			94,019	
前払費用		16,572			19,057	
未収入金		631,179			527,437	
未収委託者報酬		620,043			544,116	
未収収益		20,425			28,476	
繰延税金資産		89,899			969,336	
流動資産計		9,878,861	97.4		8,191,223	74.4
固定資産						
有形固定資産		153,132			130,133	
建物附属設備	※1	-			103,983	
器具備品	※1	302			22,098	
リース資産	※1	6,365			4,051	
建設仮勘定		146,463			-	
無形固定資産		804			201	
ソフトウェア	※2	804			201	
投資その他の資産		108,598			2,686,381	
長期差入保証金		80,034			75,114	
繰延税金資産		23,714			2,606,416	
その他投資		4,850			4,850	
固定資産計		262,535	2.6		2,816,715	25.6
資産合計		10,141,396	100.0		11,007,938	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成27年3月31日現在)			当事業年度 (平成28年3月31日現在)		
	金 額		構成比	金 額		構成比
(負債の部)			%			%
流動負債						
預り金		35,845			59,514	
未払金		560,375			586,597	
未払手数料	135,048			112,932		
その他未払金	425,326			473,664		
未払費用		11,999			1,560	
未払法人税等		154,604			3,917,946	
未払消費税等		89,514			39,613	
賞与引当金		53,368			58,531	

リース債務		-			1,861	
流動負債計		905,707	8.9		4,665,626	42.4
固定負債						
退職給付引当金		58,673			73,140	
長期リース債務		6,502			2,834	
固定負債計		65,175	0.6		75,974	0.7
負債合計		970,883	9.6		4,741,600	43.1
(純資産の部)			%			%
株主資本		9,170,513	90.4		6,266,337	56.9
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	8,751,393			5,847,217		
純資産合計		9,170,513	90.4		6,266,337	56.9
負債・純資産合計		10,141,396	100.0		11,007,938	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日			当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日		
	金 額	構成比		金 額	構成比	
営業収益		%			%	
委託者報酬	2,546,857			2,509,890		
投資顧問収入	1,644,728			1,578,998		
その他営業収益 ※ 1	37,200			155,119		
営業収益計	4,228,786	100.0		4,244,008	100.0	
営業費用						
支払手数料	590,805			559,139		
広告宣伝費	16,509			16,680		
公告費	1,190			1,190		
調査費	379,903			410,480		
調査費	257,107			265,829		
委託調査費	120,214			142,735		
図書費	2,581			1,915		
委託計算費	166,328			151,283		
営業雑経費	36,320			42,905		
通信費	5,792			4,838		
印刷費	7,774			11,461		
協会費	10,010			10,719		
諸会費	2,763			4,744		
その他	9,978			11,140		
営業費用計	1,191,058	28.2		1,181,679	27.8	
一般管理費						
給料	1,319,517			1,209,889		

役員報酬	337,945			289,386		
給料・手当	689,216			689,687		
賞与	257,155			187,055		
賞与引当金繰入額	35,199			43,760		
交際費		3,610			2,655	
旅費交通費		32,522			27,724	
租税公課		17,227			99,542	
不動産賃借料		126,366			85,870	
退職給付費用		57,683			80,570	
固定資産減価償却費		16,581			25,224	
福利厚生費		80,872			84,742	
事務手数料 ※ 1		84,588			522,979	
諸経費		183,190			148,610	
一般管理費計		1,922,160	45.5		2,287,811	53.9
営業利益		1,115,567	26.4		774,517	18.2
営業外収益						
受取利息		0			0	
有価証券運用益		678			-	
雑収入		3,846			278	
営業外収益計		4,525	0.1		278	0.0
営業外費用						
支払利息		201			174	
為替差損		2,420			2,081	
有価証券運用損		-			1,242	
雑損失		500			360	
営業外費用計		3,122	0.1		3,858	0.1
経常利益		1,116,969	26.4		770,936	18.2
特別損失						
固定資産減損損失 ※ 2		95,541			-	
固定資産除却損失		3,268			-	
事業再構築費用		-			101,509	
事務処理損失		15,453			173	
特別損失計		114,263	2.7		101,682	2.4
税引前当期純利益		1,002,706	23.7		669,254	15.8
法人税,住民税及び事業税		426,689	10.1		4,035,569	95.1
法人税等調整額		8,861	0.2		△3,462,138	△81.6
当期純利益		567,156	13.4		95,824	2.3

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本 合計	
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,184,237	8,293,357	8,603,357	8,603,357
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156

当期変動額合計	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本 合計	
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513
当期変動額									
剰余金の配当	-	-	-	-	-	△3,000,000	△3,000,000	△3,000,000	△3,000,000
当期純利益	-	-	-	-	-	95,824	95,824	95,824	95,824
当期変動額合計	-	-	-	-	-	△2,904,175	△2,904,175	△2,904,175	△2,904,175
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,847,217	5,956,337	6,266,337	6,266,337

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 ① リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～ 7年 ② リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4.引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(未適用の会計基準等)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1)概要

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」は、日本公認会計士協会における税効果会計に関する会計上の実務指針及び監査上の実務指針（会計処理に関する部分）を企業会計基準委員会に移管するに際して、企業会計基準委員会が、当該実務指針のうち主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について、企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積るという取扱いの枠組みを基本的に踏襲した上で、分類の要件及び繰延税金資産の計上額の取扱いの一部について必要な見直しを行ったもので、繰延税金資産の回収可能性について、「税効果会計に係る会計基準」（企業会計審議会）を適用する際の指針を定めたものであります。

（分類の要件及び繰延税金資産の計上額の取扱いの見直し）

- ・（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い
- ・（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件
- ・（分類2）に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い
- ・（分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い
- ・（分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成28年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
※1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 — 器 具 備 品 11,634千円 リース資産 578千円	※1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 16,731千円 器 具 備 品 17,133千円 リース資産 2,893千円
※2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 10,720千円	※2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 11,323千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

(損益計算書関係)

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日								
※1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・ アンド・ トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の 方針に従って調整額を精算することとしておりま す。当事業年度にステート・ストリート・バンク・ アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われ た調整額24,014千円は、損益計算書のその他営業収 益に、また、当社がステート・ストリート・バン ク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整 額68,801千円は、損益計算書の事務手数料に含まれ ております。	※1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・ アンド・ トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の 方針に従って調整額を精算することとしておりま す。当事業年度にステート・ストリート・バンク・ アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われ た調整額141,249千円は、損益計算書のその他営業収 益に、また、当社がステート・ストリート・バン ク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整 額519,485千円は、損益計算書の事務手数料に含まれ ております。								
※2. 当事業年度において、当社は以下の資産につい て減損損失を計上しました。 <table><tr><th>場所</th><th>用途</th><th>種類</th><th>減損損失 (千円)</th></tr><tr><td>東京都港区</td><td>旧本社</td><td>建物附属設備</td><td>95,541</td></tr></table> 旧本社については、本社移転の意思決定に伴い、 移転予定日以降、将来の使用が見込まれなくなった ため、建物に付帯する資産の帳簿価額を回収可能価 額まで減額し、当該減少額を減損損失として、特別 損失に計上しております。 なお、当該資産の回収可能価額の算定は、使用価 値によっており、減損損失の認定時点から移転予定 時までの減価償却費相当額を使用価値としておりま す。	場所	用途	種類	減損損失 (千円)	東京都港区	旧本社	建物附属設備	95,541	-
場所	用途	種類	減損損失 (千円)						
東京都港区	旧本社	建物附属設備	95,541						
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左								

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	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

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株あたりの配当額	基準日	効力発生日
平成28年3月24日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	483,870.96円	平成27年9月30日	平成28年3月25日

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの。
該当ありません。

（リース取引関係）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
所有権移転外ファイナンス・リース取引	同左
① リース資産の内容 社用車両であります。	
② リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。	

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成27年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	8,366,245	8,366,245	—

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

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

(2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(5)未払手数料

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

(4) 長期差入保証金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

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

記載すべき事項はありません。

平成28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	6,002,331	6,002,331	—
(2)未収委託者報酬	544,116	544,116	—
(3)未収入金	527,437	527,437	—
(4)長期差入保証金	75,114	45,594	△29,520
(5)未払手数料	112,932	112,932	—

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

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

(2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(5)未払手数料

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

(4) 長期差入保証金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

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

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (平成27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28年3月31日現在)	
売買目的の有価証券		売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	38,658千円	貸借対照表計上額	6,448千円
当事業年度の損益		当事業年度の損益	
に含まれた評価差額	△311千円	に含まれた評価差額	1,448千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

2. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
退職給付債務の期首残高	426,295
勤務費用	46,270
利息費用	4,262
数理計算上の差異の発生額	20,018
退職給付の支払額	△ 38,975
退職給付債務の期末残高	457,872

3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
年金資産の期首残高	278,789

期待運用収益	2,052
数理計算上の差異の発生額	△11,804
事業主からの拠出額	50,203
退職給付の支払額	△ 8,106
年金資産の期末残高	311,134

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
年金資産の期首残高	311,134
期待運用収益	2,295
数理計算上の差異の発生額	6,922
事業主からの拠出額	46,651
退職給付の支払額	△ 38,975
年金資産の期末残高	328,027

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

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
積立型制度の退職給付債務	426,295
年金資産	△311,134
	115,161
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	115,161
未認識数理計算上の差異	△ 4,158
未認識過去勤務費用	△ 52,329
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	58,673

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
積立型制度の退職給付債務	457,872
年金資産	△328,027
	129,844
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	129,844
未認識数理計算上の差異	△ 13,096
未認識過去勤務費用	△ 43,608

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	73,140
---------------------	--------

5. 退職給付費用の内訳

（単位：千円）

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付費用	42,241
(1)勤務費用	46,659
(2)利息費用	3,914
(3)期待運用収益（減算）	2,052
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	△15,002

（単位：千円）

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
退職給付費用	61,118
(1)勤務費用	46,270
(2)利息費用	4,262
(3)期待運用収益（減算）	2,295
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	4,158

6. 年金資産に関する事項

前事業年度（平成27年3月31日現在）

①年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.5%
その他	2.5%
合計	100.0%

②長期期待運用収益率の設定方法

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

当事業年度（平成28年3月31日現在）

①年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.7%
その他	2.3%
合計	100.0%

②長期期待運用収益率の設定方法

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

7. 退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日現在)
(1)割引率	1.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

(注) 当事業年度の期首時点において適用した割引率は1.0%でありましたが、期末時点において割引率の再検討を行った結果、割引率の変更により退職給付債務の額に重要な影響を及ぼすと判断し、割引率を0.0%に変更しております。

8. 確定拠出制度

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,442千円であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,211千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成26年4月 1日	自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日	至 平成28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	14,194	連結納税適用に伴う影響額	647,569
未払事業税	11,023	未払事業税	236,325
その他	64,681	賞与引当金繰入超過額	15,182
		その他	70,259
繰延税金資産（流動）合計	89,899	繰延税金資産（流動）合計	969,336
繰延税金負債（流動）との相殺	-	繰延税金負債（流動）との相殺	-
繰延税金資産（流動）の純額	89,899	繰延税金資産（流動）の純額	969,336
繰延税金資産（固定）		繰延税金資産（固定）	
退職給付引当金	20,103	連結納税適用に伴う影響額	2,575,170
その他	3,610	退職給付引当金	23,491
		その他	7,754
繰延税金資産（固定）合計	23,714	繰延税金資産（固定）合計	2,606,416
繰延税金負債（固定）との相殺	-	繰延税金負債（固定）との相殺	-
繰延税金資産（固定）の純額	23,714	繰延税金資産（固定）の純額	2,606,416
繰延税金資産合計	113,613	繰延税金資産合計	3,575,752
繰延税金負債（流動）		繰延税金負債（流動）	
その他	-	その他	-
繰延税金負債（流動）合計	-	繰延税金負債（流動）合計	-
繰延税金資産（流動）との相殺	-	繰延税金資産（流動）との相殺	-
繰延税金負債（流動）の純額	-	繰延税金負債（流動）の純額	-
繰延税金負債（固定）		繰延税金負債（固定）	
事業譲受に係る調整項目	-	事業譲受に係る調整項目	-
繰延税金負債（固定）合計	-	繰延税金負債（固定）合計	-
繰延税金資産（固定）との相殺	-	繰延税金資産（固定）との相殺	-
繰延税金負債（固定）の純額	-	繰延税金負債（固定）の純額	-
繰延税金資産の純額	113,613	繰延税金資産の純額	3,575,752

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 35.6%	法定実効税率 33.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目 7.5%	交際費等永久に損金に算入されない項目 8.1%
その他 0.2%	税率変更差異 40.5%
	その他 3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 43.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 85.6%

（税率変更に伴う影響）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.34%となります。

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。この税率変更により、繰延税金資産は178,278千円減少し、法人税等調整額は178,278千円増加しております。

（企業結合関係等）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は89,966千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および本社オフィス移転に伴う新たな資産除去債務の発生により31,670千円増加しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および旧オフィス賃貸借契約終了に伴う一部の資産除去債務の履行により54,624千円減少しております。

（セグメント情報）

1.セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2.セグメント関連情報

1.商品及びサービスに関する情報

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

2.地域に関する情報

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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日											
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の所 有（被所有） 割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取 事務手数料の支払	162,092 107,442 286,824 24,014 84,588	未収入金 未払金	240,569 7,234
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 事務所賃借料の支払 人件費等の支払	35,271 4,173 135,406	前払金	34,267
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユニテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	440 5,521	-	-
	ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルグ大公国ルクセンブルグ市	12.5万ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	66,188	-	-
	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	407	-	-

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28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・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取 事務手数料の支払	167,037 118,594 235,888 141,249 522,979	未収入金 未払金	228,410 205,912
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 人件費等の支払	38,211 133,176	前払金	94,019
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・エナベット・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	399 10,659	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	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	290	-	-

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役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）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

前事業年度	当事業年度
自 平成26年4月 1日	自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日	至 平成28年3月31日

1株当たり純資産 1,479,115円06銭 1株当たり当期純利益 91,476円79銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	1株当たり純資産 1,010,699円58銭 1株当たり当期純利益 15,455円49銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。
--	--

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
当期純利益 (千円)	567,156	95,824
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)	567,156	95,824
期中平均株式数 (株)	6,200	6,200

(重要な後発事象)

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

当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

期 別 科 目	第20期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
	金額	構成比
(資 産 の 部)		%
流動資産		
預金	2,406,597	
有価証券	90,867	
前払金	127,471	
前払費用	17,048	
未収入金	290,767	
未収委託者報酬	538,329	
未収収益	250,096	
繰延税金資産	1,054,384	
流動資産計	4,775,560	66.1
固定資産		
有形固定資産	120,723	
建物附属設備 ※ 1	97,681	
器具備品 ※ 1	20,148	
リース資産 ※ 1	2,893	
無形固定資産	0	
ソフトウェア	0	
投資その他の資産	2,328,593	

長期差入保証金	73,225		
繰延税金資産	2,250,518		
その他投資	4,850		
固定資産計		2,449,317	33.9
資 産 合 計		7,224,878	100.0
(負 債 の 部)			%
流動負債			
預り金		25,306	
未払金		387,676	
未払手数料	109,598		
その他未払金	278,078		
未払費用		1,806	
未払法人税等		1,078	
未払消費税等 ※ 2		20,978	
賞与引当金		127,002	
リース債務		1,890	
流動負債計		565,739	7.8
固定負債			
退職給付引当金		83,276	
長期リース債務		1,881	
固定負債計		85,158	1.2
負 債 合 計		650,898	9.0
(純 資 産 の 部)			%
株主資本		6,573,979	91.0
資本金	310,000		
利益剰余金	6,263,979		
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	6,154,859		
純 資 産 合 計		6,573,979	91.0
負 債 ・ 純 資 産 合 計		7,224,878	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期 別	第20期中間会計期間 自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日		
科 目	金 額		構 成 比
			%
営業収益			
委託者報酬		1,078,266	
投資顧問収入		694,359	
その他営業収益 ※1		29,879	
営業収益計		1,802,505	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		549,040	
支払手数料	237,136		
その他営業費用	311,904		
一般管理費 ※1 ※ 2		918,065	
営業費用・一般管理費計		1,467,106	81.4
営業利益		335,399	18.6
営業外収益		82,082	4.6
営業外費用		1,904	0.1
経常利益		415,577	23.1
特別損失		32,965	1.8

税引前中間純利益		382,611	21.2
法人税,住民税及び事業税		△ 195,880	△ 10.9
法人税等調整額		270,849	15.0
中間純利益		307,642	17.1

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,847,217	5,956,337	6,266,337	6,266,337
当中間期変動額									
中間純利益	-	-	-	-	-	307,642	307,642	307,642	307,642
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	307,642	307,642	307,642	307,642
当中間期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	6,154,859	6,263,979	6,573,979	6,573,979

[重要な会計方針]

	第20期中間会計期間 自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日
1. 資産の評価基準及び 評価方法	有価証券 売買目的有価証券 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 ① リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 7年 ② リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア(自社利用)については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3. 外貨建の資産及び負債の 本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4.引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理しております。
5.その他中間 財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。 (2) 連結納税制度の適用 当中間会計期間より、親会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

[追加情報]

第20期中間会計期間 自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日
「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年 3 月28日）を当中間会計期間から適用しております。

注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第20期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
※1. 有形固定資産の減価償却累計額	
建物附属設備	23,033千円
器具備品	19,084千円
リース資産	4,051千円
※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20期中間会計期間 自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日

※1. 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間に、ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額25,309千円は、その他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額131,326千円は、一般管理費に含まれております。

※2. 減価償却実施額

有形固定資産	8,252千円
無形固定資産	201千円
リース資産	1,157千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第20期中間会計期間

自 平成28年4月 1日

至 平成28年9月30日

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
普通株式	6,200	—	—	6,200

2. 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間の末日後となるもの

（決議）	株式の種類	配当金の 総額	1株あたり の配当額	基準日	効力発生日
平成28年12月22日 取締役会	普通 株式	995,862千円	160,622.90円	平成28年9月30日	平成28年12月26日

（リース取引）

第20期中間会計期間

自 平成28年4月 1日

至 平成28年9月30日

所有権移転外ファイナンス・リース取引

① リース資産の内容

社用車両であります。

② リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「2.固定資産の減価償却方法」に記載の通りであります。

（金融商品関係）

第20期中間会計期間

自 平成28年4月 1日

至 平成28年9月30日

1. 金融商品の時価等に関する事項

平成28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	2,406,597	2,406,597	—
(2) 未収入金	290,767	290,767	—
(3) 未収委託者報酬	538,329	538,329	—
(4) 長期差入保証金	73,225	45,493	△27,731
(5) 未払手数料	109,598	109,598	—

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

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

(2) 未収入金、(3) 未収委託者報酬及び、(5) 未払手数料

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

(4) 長期差入保証金

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

(有価証券関係)

第20期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	90,867千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	490千円

(資産除去債務関係)

第20期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)
当中間会計期間において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額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20期中間会計期間末 (平成28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20期中間会計期間末 (平成28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20期中間会計期間

自 平成28年4月 1日

至 平成28年9月30日

1株当たり純資産額 1,060,319円34銭

1株当たり中間純利益 49,619円76銭

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

注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第20期中間会計期間 自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日	
中間純利益（千円）	307,642
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）	307,642
期中平均株式数（株）	6,200

（その他）

第20期中間会計期間末

（平成28年9月30日現在）

第20期(平成28年4月1日から平成29年3月31日まで)中間配当については、平成28年12月22日開催の取締役会において、平成28年9月30日の最終の株主名簿に記載又は記録された株主に対し、次のとおり中間配当を行うことを決議致しました。

- | | |
|----------------------|-------------|
| ① 中間配当金額の総額 | 995,862千円 |
| ② 1株当たり中間配当金 | 160,622円90銭 |
| ③ 支払請求権の効力発生日及び支払開始日 | 平成28年12月26日 |

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28年3月末現在）

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28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 (平成28年3月末現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (平成28年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937百万円 (平成28年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	6,707百万円 (平成28年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【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28年 4月 5日
有価証券届出書	平成28年 5月20日
有価証券報告書	平成28年 5月20日
有価証券届出書の訂正届出書	平成28年11月18日
半期報告書	平成28年11月18日

独立監査人の監査報告書

平成28年7月7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 櫻井 雄一郎 印

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 伊藤 雅人 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第19期事業年度の財務諸表、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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年4月5日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御 中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているAMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成28年2月23日から平成29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29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月26日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 櫻井 雄一郎 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 伊藤 雅人 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第20期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成28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28年4月1日から平成28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

（注）上記は中間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、その原本は当社が別途保管しております。