

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年9月25日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートイング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	当初自己設定 分散投資コア戦略ファンドA 100万円 分散投資コア戦略ファンドS 100万円 継続募集額 分散投資コア戦略ファンドA 上限10兆円 分散投資コア戦略ファンドS 上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したこと等に伴い、平成25年3月12日に提出した有価証券届出書（平成25年5月2日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じたので、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「1 ファンドの性格」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

(3)ファンドの仕組み

<訂正前>

（前略）

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年2月28日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年2月28日現在）

（後略）

<訂正後>

（前略）

委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年7月31日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年7月31日現在）

（後略）

2 投資方針

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

(2)投資対象

<訂正前>

（前略）

- 投資対象ファンドの概要 -

（中略）

以下の内容は、平成25年5月2日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

（後略）

<訂正後>

（前略）

- 投資対象ファンドの概要 -

（中略）

以下の内容は、平成25年7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

（後略）

(3)運用体制

<訂正前>

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年5月2日現在のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

<訂正後>

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年9月25日現在のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

4 手数料等及び税金

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」につきまして、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

(5)課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

上記は、平成25年2月28日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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。

<訂正後>

（前略）

上記は、平成25年7月31日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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。

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

以下の記載は、平成25年7月31日現在の状況について記載してあります。

分散投資コア戦略ファンドA

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	227,138,600	39.94
投資証券	ルクセンブルク	59,137,652	10.40
親投資信託受益証券	日本	280,857,138	49.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,559,341	0.27
合計(純資産総額)		568,692,731	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資信託受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	84,990,071	1.0030	85,252,095	1.0124	86,043,947	15.13
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	66,274,223	1.2583	83,393,749	1.2614	83,598,304	14.70
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	34,362.378	1,729.81	59,440,595	1,721.00	59,137,652	10.40
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	59,327,745	0.9587	56,880,056	0.9568	56,764,786	9.98
日本	親投資信託受益証券	FRM シグマ リンク マザーファンド	63,833,504	0.8929	57,001,879	0.8694	55,496,848	9.76
日本	投資信託受益証券	FOFs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	46,658,991	0.9019	42,083,313	0.9069	42,315,038	7.44
日本	投資信託受益証券	FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	41,830,774	1.0040	42,000,427	1.0044	42,014,829	7.39
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	14,837,982	2.2919	34,007,703	2.2694	33,673,316	5.92
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	21,201,958	1.6098	34,131,850	1.5699	33,284,953	5.85

日本	親投資信託 受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザー ファンド	15,215,036	1.3856	21,083,056	1.3727	20,885,679	3.67
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	13,257,807	1.4058	18,638,159	1.4019	18,586,119	3.27
日本	親投資信託 受益証券	グローバルREITインデックス マザー ファンド	8,324,217	1.1521	9,591,155	1.1257	9,370,571	1.65
日本	親投資信託 受益証券	グローバル・コモディティ(米ドル建 て) マザーファンド	21,322,014	0.4500	9,596,659	0.4314	9,198,316	1.62
日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	8,740,550	1.0697	9,350,406	1.0229	8,940,708	1.57
日本	親投資信託 受益証券	新興国株式インデックス マザーファン ド	3,923,915	1.9927	7,819,513	1.9935	7,822,324	1.38

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	39.94
投資証券	10.40
親投資信託受益証券	49.39
合計	99.73

(注) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成25年 7月10日)	258,830,299	258,830,299	9,811	9,811
平成25年 3月末日	1,000,001		10,000	
4月末日	1,018,901		10,189	
5月末日	2,748,794		10,084	
6月末日	2,690,244		9,726	
7月末日	568,692,731		9,773	

分配の推移

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成25年 3月29日～平成25年 7月10日)	0

収益率の推移

期 間	収益率 (%)
第1期計算期間(平成25年 3月29日 ~ 平成25年 7月10日)	1.9

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成25年 3月29日 ~ 平成25年 7月10日)	263,825,167		263,825,167

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

分散投資コア戦略ファンドS

(1)投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	34,345,286	25.25
投資証券	ルクセンブルク	10,352,248	7.61
親投資信託受益証券	日本	90,330,130	66.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,005,408	0.74
合計(純資産総額)		136,033,072	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
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	6,071,296	2.2897	13,902,019	2.2694	13,778,199	10.13
日本	投資信託受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	14,255,205	0.9587	13,667,746	0.9568	13,639,380	10.03
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	8,665,328	1.6066	13,922,466	1.5699	13,603,698	10.00
日本	親投資信託受益証券	FRM シグマ リンク マザーファンド	15,243,055	0.8930	13,612,427	0.8694	13,252,312	9.74
日本	親投資信託受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	8,995,865	1.3863	12,471,305	1.3727	12,348,623	9.08
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	8,234,679	1.2584	10,363,012	1.2614	10,387,224	7.64
ルクセンブルク	投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H, JPY}	6,015.252	1,730.01	10,406,451	1,721.00	10,352,248	7.61

日本	投資信託 受益証券	ヘッジファンド・リターン・ターゲ ットファンド・為替ヘッジあり（適格機 関投資家専用）	10,196,470	1.0039	10,236,336	1.0124	10,322,906	7.59
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	6,928,045	1.4047	9,731,975	1.4019	9,712,426	7.14
日本	投資信託 受益証券	FOFs用米ドル建新興国債券インデック ス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専 用）	5,775,804	0.9009	5,203,687	0.9069	5,238,076	3.85
日本	投資信託 受益証券	FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッ ジあり（適格機関投資家専用）	5,122,386	1.0039	5,142,558	1.0044	5,144,924	3.78
日本	親投資信託 受益証券	グローバルREITインデックス マザー ファンド	3,960,248	1.1510	4,558,325	1.1257	4,458,051	3.28
日本	親投資信託 受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建 て）マザーファンド	10,012,314	0.4493	4,498,840	0.4314	4,319,312	3.18
日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	4,194,793	1.0722	4,497,834	1.0229	4,290,853	3.15
日本	親投資信託 受益証券	新興国株式インデックス マザーファン ド	2,096,530	1.9920	4,176,407	1.9935	4,179,432	3.07

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	25.25
投資証券	7.61
親投資信託受益証券	66.40
合計	99.26

(注) 投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成25年 7月10日)	54,287,050	54,287,050	9,915	9,915
平成25年 3月末日	1,000,002		10,000	
4月末日	1,032,728		10,327	
5月末日	1,563,823		10,214	
6月末日	1,494,732		9,763	

7月末日	136,033,072		9,824	
------	-------------	--	-------	--

分配の推移

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成25年 3月29日 ~ 平成25年 7月10日)	0

収益率の推移

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成25年 3月29日 ~ 平成25年 7月10日)	0.9

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成25年 3月29日 ~ 平成25年 7月10日)	54,750,331		54,750,331

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	7,133,737,000	26.88
国債証券	日本	12,989,678,000	48.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,417,911,143	24.18
合計(純資産総額)		26,541,326,143	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第375回国庫短期証券		13,000,000,000	99.91	12,989,179,000	99.92	12,989,678,000	0.0	2014/06/20	48.94
日本	株式	東急不動産	不動産業	351,000	1,006.70	353,354,339	936.00	328,536,000			1.24
日本	株式	日本電気硝子	ガラス・土石製品	453,000	509.13	230,637,681	527.00	238,731,000			0.90
日本	株式	日新製鋼ホールディングス	鉄鋼	272,200	870.72	237,010,057	856.00	233,003,200			0.88
日本	株式	NKSJホールディングス	保険業	94,000	2,389.97	224,657,249	2,463.00	231,522,000			0.87

日本	株式	ジェイ エフイーホールディングス	鉄鋼	102,400	2,257.86	231,205,061	2,217.00	227,020,800			0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	71,500	3,229.19	230,887,095	3,135.00	224,152,500			0.84
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	6,400	35,385.93	226,470,000	33,550.00	214,720,000			0.81
日本	株式	三菱地所	不動産業	82,000	2,812.20	230,600,897	2,491.00	204,262,000			0.77
日本	株式	SUMCO	金属製品	234,800	1,024.38	240,526,067	865.00	203,102,000			0.77
日本	株式	大和証券グループ本社	証券、商品先物取引業	147,000	834.50	122,672,909	836.00	122,892,000			0.46
日本	株式	KDDI	情報・通信業	22,600	5,166.47	116,762,234	5,410.00	122,266,000			0.46
日本	株式	ダイキン工業	機械	29,900	4,070.66	121,712,895	4,080.00	121,992,000			0.46
日本	株式	日本精工	機械	132,000	930.61	122,841,167	918.00	121,176,000			0.46
日本	株式	日野自動車	輸送用機器	80,000	1,558.01	124,641,000	1,507.00	120,560,000			0.45
日本	株式	神戸製鋼所	鉄鋼	767,000	125.66	96,387,871	155.00	118,885,000			0.45
日本	株式	豊田通商	卸売業	45,400	2,644.59	120,064,801	2,604.00	118,221,600			0.45
日本	株式	J.フロントリテイリング	小売業	150,000	807.54	121,131,476	780.00	117,000,000			0.44
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	91,300	1,326.33	121,094,822	1,281.00	116,955,300			0.44
日本	株式	ヤマハ	その他製品	92,600	1,077.73	99,797,834	1,258.00	116,490,800			0.44
日本	株式	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	保険業	45,800	2,607.59	119,427,834	2,542.00	116,423,600			0.44
日本	株式	日本軽金属ホールディングス	非鉄金属	885,800	116.76	103,426,978	131.00	116,039,800			0.44
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	85,700	1,184.60	101,520,546	1,325.00	113,552,500			0.43
日本	株式	ジェイテクト	機械	91,000	1,120.28	101,945,480	1,233.00	112,203,000			0.42
日本	株式	ミネベア	電気機器	286,000	395.78	113,194,990	385.00	110,110,000			0.41
日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	261,000	447.46	116,787,644	418.00	109,098,000			0.41
日本	株式	清水建設	建設業	265,000	373.37	98,945,505	408.00	108,120,000			0.41
日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	33,100	3,120.74	103,296,494	3,260.00	107,906,000			0.41
日本	株式	ヤフー	情報・通信業	2,051	54,257.87	111,282,894	52,200.00	107,062,200			0.40
日本	株式	スカパーJSATホールディングス	情報・通信業	2,077	51,283.14	106,515,096	51,400.00	106,757,800			0.40

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	26.88
国債証券	48.94
合計	75.82

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.39
		建設業	0.41
		食料品	0.35
		パルプ・紙	0.41
		化学	1.54
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	2.18
		非鉄金属	1.65
		金属製品	0.77
		機械	3.07
		電気機器	2.41
		輸送用機器	1.63
		その他製品	0.44
		電気・ガス業	0.40
		海運業	0.40
		情報・通信業	2.06
		卸売業	1.62
		小売業	1.25
		証券、商品先物取引業	0.46
保険業	2.54		
不動産業	2.01		
合計			26.88

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	193,173,690,200	77.56
	ポーランド	101,965,000	0.04
	小計	193,275,655,200	77.60
地方債証券	日本	15,846,079,168	6.36
特殊債券	日本	22,295,745,579	8.95
	アメリカ	206,620,000	0.08
	韓国	199,994,000	0.08
	スウェーデン	100,662,000	0.04
	小計	22,803,021,579	9.15
社債券	日本	14,514,814,910	5.83
	オーストラリア	407,062,000	0.16
	オランダ	404,986,000	0.16
	アメリカ	207,544,000	0.08
	スウェーデン	102,387,000	0.04
	イギリス	100,866,000	0.04
	韓国	99,822,000	0.04
	小計	15,837,481,910	6.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,315,185,029	0.53
合計(純資産総額)		249,077,422,886	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	3,570,000,000	99.16	3,540,229,200	100.47	3,586,779,000	0.8	2022/09/20	1.44
日本	国債証券	第105回利付国債 (5年)	2,940,000,000	99.46	2,924,230,400	99.96	2,938,853,400	0.2	2017/06/20	1.18
日本	国債証券	第87回利付国債(5 年)	2,820,000,000	100.57	2,836,186,800	100.53	2,835,171,600	0.5	2014/12/20	1.14
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	2,640,000,000	99.27	2,620,965,600	99.87	2,636,752,800	0.2	2017/09/20	1.06
日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	2,620,000,000	98.94	2,592,350,000	100.30	2,628,017,200	0.8	2022/12/20	1.06
日本	国債証券	第99回利付国債(5 年)	2,600,000,000	100.49	2,612,766,000	100.77	2,620,254,000	0.4	2016/09/20	1.05
日本	国債証券	第88回利付国債(5 年)	2,570,000,000	100.65	2,586,859,200	100.62	2,586,088,200	0.5	2015/03/20	1.04
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	2,390,000,000	105.26	2,515,717,000	105.46	2,520,541,800	1.7	2017/03/20	1.01

日本	国債証券	第296回利付国債 (10年)	2,100,000,000	105.41	2,213,684,000	106.17	2,229,675,000	1.5	2018/09/20	0.90
日本	国債証券	第288回利付国債 (10年)	2,090,000,000	105.68	2,208,774,700	106.04	2,216,256,900	1.7	2017/09/20	0.89
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	2,080,000,000	104.49	2,173,418,300	105.56	2,195,835,200	1.3	2019/12/20	0.88
日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	2,160,000,000	97.10	2,097,380,900	98.34	2,124,208,800	0.6	2023/03/20	0.85
日本	国債証券	第264回利付国債 (10年)	2,070,000,000	101.80	2,107,260,000	101.58	2,102,706,000	1.5	2014/09/20	0.84
日本	国債証券	第110回利付国債 (5年)	2,000,000,000	99.43	1,988,670,000	100.16	2,003,200,000	0.3	2018/03/20	0.80
日本	国債証券	第97回利付国債(5 年)	1,960,000,000	100.56	1,971,168,000	100.76	1,974,896,000	0.4	2016/06/20	0.79
日本	国債証券	第103回利付国債 (5年)	1,940,000,000	99.96	1,939,262,800	100.39	1,947,682,400	0.3	2017/03/20	0.78
日本	国債証券	第102回利付国債 (5年)	1,880,000,000	100.10	1,881,931,000	100.43	1,888,215,600	0.3	2016/12/20	0.76
日本	国債証券	第85回利付国債(5 年)	1,780,000,000	100.75	1,793,456,800	100.67	1,791,997,200	0.7	2014/09/20	0.72
日本	国債証券	第322回利付国債 (10年)	1,730,000,000	100.08	1,731,401,300	101.62	1,758,147,100	0.9	2022/03/20	0.71
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,660,000,000	104.48	1,734,368,000	105.32	1,748,395,000	1.3	2018/12/20	0.70
日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	1,680,000,000	101.03	1,697,388,000	102.57	1,723,310,400	1.0	2021/12/20	0.69
日本	国債証券	第324回利付国債 (10年)	1,690,000,000	99.16	1,675,837,800	100.62	1,700,562,500	0.8	2022/06/20	0.68
日本	国債証券	第312回利付国債 (10年)	1,620,000,000	103.07	1,669,734,000	104.46	1,692,300,600	1.2	2020/12/20	0.68
日本	国債証券	第329回利付国債 (2年)	1,670,000,000	100.13	1,672,208,200	100.15	1,672,638,600	0.2	2015/06/15	0.67
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	1,660,000,000	99.73	1,655,603,800	100.09	1,661,510,600	0.8	2023/06/20	0.67
日本	国債証券	第273回利付国債 (10年)	1,590,000,000	103.09	1,639,146,900	102.94	1,636,873,200	1.5	2015/09/20	0.66
日本	国債証券	第89回利付国債(5 年)	1,610,000,000	100.53	1,618,565,200	100.53	1,618,613,500	0.4	2015/06/20	0.65
日本	国債証券	第107回利付国債 (5年)	1,620,000,000	99.10	1,605,501,000	99.80	1,616,824,800	0.2	2017/12/20	0.65
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	1,530,000,000	104.96	1,606,025,700	105.46	1,613,614,500	1.5	2017/12/20	0.65
日本	国債証券	第111回利付国債 (5年)	1,600,000,000	100.21	1,603,456,000	100.61	1,609,872,000	0.4	2018/03/20	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	77.60
地方債証券	6.36
特殊債券	9.15
社債券	6.36
合計	99.47

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	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 (%)
債券先物取引	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	3	431,010,945	430,860,000	430,860,000	0.17

(注)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、計算期間末日に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。

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	87,202,570,602	54.52
	イギリス	14,742,519,746	9.22
	カナダ	7,176,362,798	4.49
	スイス	6,985,876,488	4.37
	フランス	6,240,516,282	3.90
	ドイツ	6,068,301,838	3.79
	オーストラリア	5,015,287,857	3.14
	オランダ	2,415,842,895	1.51
	スウェーデン	2,253,148,450	1.41
	スペイン	2,080,978,065	1.30
	香港	1,712,508,617	1.07
	イタリア	1,381,552,350	0.86
	アイルランド	1,174,703,741	0.73
	シンガポール	1,099,933,318	0.69
	デンマーク	798,962,610	0.50
	ベルギー	786,979,691	0.49
	ジャージー	747,096,356	0.47
バミューダ	653,577,114	0.41	
アンティル	633,189,947	0.40	

	フィンランド	558,240,086	0.35
	ノルウェー	464,718,085	0.29
	イスラエル	337,996,351	0.21
	ルクセンブルク	249,042,888	0.16
	オーストリア	200,426,978	0.13
	ケイマン	184,323,980	0.12
	ポルトガル	115,096,870	0.07
	ニュージーランド	85,954,786	0.05
	パナマ	83,443,521	0.05
	ガーンジー	43,045,176	0.03
	マン島	37,942,466	0.02
	リベリア	35,450,294	0.02
	モーリシャス	18,666,337	0.01
	ギリシャ	12,484,786	0.01
	小計	151,596,741,369	94.79
投資信託受益証券	オーストラリア	58,664,834	0.04
	シンガポール	24,149,748	0.02
	香港	14,890,315	0.01
	小計	97,704,897	0.06
投資証券	アメリカ	2,250,020,419	1.41
	オーストラリア	398,542,425	0.25
	フランス	209,841,043	0.13
	イギリス	191,221,305	0.12
	香港	65,375,200	0.04
	シンガポール	55,101,872	0.03
	カナダ	37,356,379	0.02
	オランダ	19,521,639	0.01
	小計	3,226,980,282	2.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,014,217,296	3.14
合計(純資産総額)		159,935,643,844	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
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	56,045	43,296.43	2,426,548,710	44,461.62	2,491,851,806	1.56
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	267,257	9,060.63	2,421,516,898	9,200.88	2,459,000,868	1.54
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	166,898	8,592.78	1,434,119,265	9,138.11	1,525,132,883	0.95

アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	618,956	2,314.68	1,432,690,025	2,400.99	1,486,112,365	0.93
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	473,980	3,433.78	1,627,546,753	3,123.84	1,480,641,475	0.93
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	115,850	12,400.25	1,436,569,472	12,336.50	1,429,183,803	0.89
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,933	86,434.96	1,377,168,243	87,381.43	1,392,248,381	0.87
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	163,052	7,930.74	1,293,124,453	7,889.55	1,286,407,754	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	298,259	3,974.20	1,185,341,395	4,242.94	1,265,495,280	0.79
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	192,083	6,912.21	1,327,718,993	6,542.85	1,256,772,177	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	227,981	5,355.16	1,220,876,555	5,426.76	1,237,199,630	0.77
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,113,004	1,110.56	1,236,060,059	1,100.39	1,224,747,530	0.77
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	63,066	20,379.06	1,285,225,949	19,224.66	1,212,422,458	0.76
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	399,159	2,840.39	1,133,769,946	2,910.03	1,161,566,101	0.73
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	329,402	3,548.53	1,168,894,328	3,473.99	1,144,340,439	0.72
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	41,848	26,656.87	1,115,537,030	24,430.19	1,022,354,800	0.64
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,014	7,534.84	1,032,378,841	6,991.36	957,914,541	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	238,836	4,173.30	996,735,234	3,954.58	944,497,406	0.59
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	181,002	5,079.56	919,411,098	5,078.58	919,233,571	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	644,503	1,309.36	843,891,604	1,424.12	917,850,643	0.57
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	98,234	9,156.74	899,504,061	8,745.79	859,134,288	0.54
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,929,683	294.45	862,662,444	291.61	854,342,349	0.53
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	180,683	4,670.56	843,892,527	4,712.74	851,512,724	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	171,447	4,984.42	854,564,815	4,945.19	847,838,607	0.53
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	317,596	2,343.13	744,169,096	2,517.71	799,615,768	0.50
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,141,569	720.44	822,438,134	674.78	770,310,572	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	91,929	8,084.73	743,221,548	8,347.58	767,385,490	0.48
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	99,742	7,583.54	756,398,005	7,639.45	761,974,141	0.48

イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	224,700	3,369.05	757,026,388	3,306.27	742,920,307	0.46
フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	71,103	11,271.43	801,432,736	10,414.40	740,495,367	0.46

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	94.79
投資信託受益証券	0.06
投資証券	2.02
合計	96.86

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.22
		素材	5.39
		資本財	7.26
		商業・専門サービス	0.91
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	1.56
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.66
		メディア	2.84
		小売	3.09
		食品・生活必需品小売り	2.27
		食品・飲料・タバコ	6.37
		家庭用品・パーソナル用品	1.88
		ヘルスケア機器・サービス	2.93
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.55
		銀行	7.53
		各種金融	5.48
		保険	4.62
		不動産	0.69
		ソフトウェア・サービス	6.13
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.88		
電気通信サービス	3.43		
公益事業	3.31		
半導体・半導体製造装置	1.45		
合計			94.79

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	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	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	56	22,615,289.50	23,585,800	2,313,295,264	1.45
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	16	2,229,300	2,310,720	219,980,544	0.14
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	29	2,237,133	2,263,160	238,831,274	0.15
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	119	3,138,925.50	3,285,590	427,290,979	0.27
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	23	2,761,411	2,879,025	254,937,663	0.16
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	50	3,129,007.50	3,261,500	487,496,405	0.30

(注)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、計算期間末日に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。

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	90,335,549,256	39.52
	フランス	23,045,094,026	10.08
	イタリア	21,944,925,857	9.60
	ドイツ	20,132,995,981	8.81
	イギリス	16,695,267,324	7.30
	スペイン	11,298,513,280	4.94
	オランダ	6,343,788,401	2.78
	ベルギー	6,133,135,330	2.68
	カナダ	5,698,969,873	2.49
	オーストリア	4,086,382,485	1.79
	オーストラリア	3,189,941,462	1.40
	メキシコ	2,283,773,294	1.00
	デンマーク	1,918,308,505	0.84
	アイルランド	1,809,854,412	0.79
	ポーランド	1,774,071,345	0.78
	フィンランド	1,521,572,575	0.67
南アフリカ	1,261,772,785	0.55	

	スウェーデン	1,234,731,653	0.54
	マレーシア	1,113,831,881	0.49
	シンガポール	905,915,779	0.40
	スイス	840,158,651	0.37
	ノルウェー	724,971,203	0.32
	小計	224,293,525,358	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,282,985,024	1.87
合計(純資産総額)		228,576,510,382	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	33,900,000	10,089.48	3,420,336,974	10,050.70	3,407,190,571	2.625	2014/07/31	1.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,047.31	2,793,153,625	10,027.72	2,787,706,757	1.375	2015/11/30	1.22
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	20,700,000	10,206.45	2,112,735,150	10,174.26	2,106,073,372	2.500	2015/03/31	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	20,600,000	9,865.86	2,032,368,643	9,811.63	2,021,197,767	0.875	2017/02/28	0.88
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	9,816.62	1,982,958,179	9,822.55	1,984,156,876	0.375	2015/06/15	0.87
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,168.71	1,952,392,732	10,139.78	1,946,838,968	2.375	2015/02/28	0.85
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,784.24	1,898,143,781	9,713.36	1,884,393,411	0.750	2017/06/30	0.82
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	9,743.82	1,753,888,779	9,738.65	1,752,957,791	0.250	2016/04/15	0.77
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,110.86	1,516,629,052	10,086.34	1,512,951,052	1.750	2015/07/31	0.66
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	10,526.16	1,473,663,498	10,448.01	1,462,721,448	2.750	2016/11/30	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,793.44	1,371,081,781	9,795.35	1,371,349,965	0.250	2015/07/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,864.08	1,390,602,758	10,627.31	1,360,296,043	3.125	2019/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,653.55	1,331,694,612	10,589.00	1,323,625,043	4.250	2015/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,127.33	1,326,680,838	10,103.19	1,323,518,917	1.875	2015/06/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	10,086.72	1,270,927,154	10,061.62	1,267,765,227	2.125	2014/11/30	0.55

アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	13,100,000	9,706.08	1,271,497,631	9,590.38	1,256,340,435	0.750	2018/02/28	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	10,077.52	1,259,691,055	10,044.00	1,255,500,625	2.375	2014/08/31	0.55
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000	13,499.05	1,241,913,515	13,403.66	1,233,137,481	4.250	2014/08/01	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	10,293.41	1,235,210,327	10,225.98	1,227,118,727	4.250	2014/08/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	11,300,000	10,070.85	1,138,006,547	10,031.36	1,133,543,894	2.625	2014/06/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,823.70	1,129,726,431	9,826.39	1,130,034,850	0.375	2015/04/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,242.99	1,101,813,475	11,105.83	1,088,371,922	4.500	2017/05/15	0.48
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	13,834.52	1,092,927,390	13,732.23	1,084,846,928	3.500	2015/04/25	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	11,500,000	9,702.44	1,115,781,638	9,347.67	1,074,982,663	2.000	2023/02/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.5% 03/31/19	11,000,000	9,948.79	1,094,367,829	9,751.48	1,072,663,795	1.500	2019/03/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,216.60	1,052,310,092	10,186.14	1,049,172,872	2.000	2016/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,642.25	1,011,014,191	10,548.38	1,002,096,959	3.000	2017/02/28	0.44
スペイン	国債証券	SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000	13,608.95	1,007,062,462	13,518.04	1,000,335,496	4.400	2015/01/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	9,500,000	10,809.48	1,026,901,435	10,477.12	995,327,145	3.125	2021/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	9,800,000	10,237.86	1,003,310,896	10,125.80	992,328,610	1.875	2017/08/31	0.43

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.13
合計	98.13

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	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 (%)
-------	-------	-----	---------	----	----	-------------	-------------	----------	----------

債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	18	2,182,900.14	2,184,328.08	214,238,898	0.09
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	9	1,137,848.54	1,137,796.92	111,595,121	0.05
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	804,586.50	803,437.50	78,801,150	0.03
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	11	1,214,914	1,214,950	158,004,247	0.07
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	11	1,384,404	1,384,020	179,991,801	0.08
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	16	2,283,004	2,279,200	296,409,960	0.13

(注) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、計算期間末日に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。

新興国株式インデックス マザーファンド

(1) 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	韓国	2,690,254,271	14.20
	台湾	2,081,816,436	10.99
	ブラジル	1,931,834,210	10.20
	中国	1,801,396,917	9.51
	南アフリカ	1,274,481,549	6.73
	インド	1,163,473,440	6.14
	ロシア	1,058,653,303	5.59
	メキシコ	996,679,765	5.26
	香港	804,283,521	4.25
	マレーシア	707,461,904	3.74
	ケイマン	667,726,971	3.53
	インドネシア	525,567,768	2.78
	タイ	483,517,557	2.55
	トルコ	346,266,037	1.83
	チリ	312,688,557	1.65
	ポーランド	288,879,508	1.53
	フィリピン	197,946,883	1.05
	コロンビア	178,456,879	0.94
	バミューダ	139,284,484	0.74
	チェコ	50,590,372	0.27
エジプト	47,787,668	0.25	
ハンガリー	38,850,758	0.21	
ペルー	19,150,959	0.10	
アメリカ	16,931,923	0.09	

	モロッコ	13,091,821	0.07
	ルクセンブルク	5,063,769	0.03
	小計	17,842,137,230	94.21
投資信託受益証券	ブラジル	43,601,241	0.23
	南アフリカ	37,963,283	0.20
	メキシコ	7,709,532	0.04
	小計	89,274,056	0.47
投資証券	メキシコ	22,599,741	0.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		985,211,810	5.20
合計(純資産総額)		18,939,222,837	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	5,650	118,905.62	671,816,785	113,520.00	641,388,000	3.39
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,261,389	300.64	379,229,018	333.53	420,723,687	2.22
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	310,000	1,089.47	337,736,199	1,053.11	326,464,875	1.72
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,623,620	72.78	263,732,515	72.73	263,573,059	1.39
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,736,515	64.49	240,980,828	64.38	240,588,596	1.27
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	51,400	3,367.68	173,099,264	4,599.54	236,416,356	1.25
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	305,776	875.13	267,595,846	769.92	235,425,504	1.24
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,966,340	120.43	236,807,844	101.66	199,901,663	1.06
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	8,207	18,951.27	155,533,147	20,900.00	171,526,300	0.91
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	131,890	1,176.18	155,126,681	1,255.58	165,598,894	0.87
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	19,911	5,462.88	108,771,555	8,300.00	165,261,300	0.87
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,963,200	40.01	158,581,032	41.23	163,438,404	0.86
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	146,151	1,086.48	158,791,471	1,118.11	163,413,186	0.86
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	898,000	201.78	181,202,154	178.61	160,398,964	0.85
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	26,964	5,858.94	157,980,663	5,865.18	158,148,821	0.84
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	85,719	1,682.68	144,238,079	1,828.89	156,771,479	0.83
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	212,540	880.19	187,076,406	707.28	150,326,608	0.79

台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	510,048	298.13	152,063,570	257.34	131,260,342	0.69
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	37,200	3,487.39	129,731,272	3,527.83	131,235,536	0.69
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	106,700	1,268.72	135,372,742	1,209.60	129,064,906	0.68
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	28,008	3,727.08	104,388,077	4,532.09	126,935,056	0.67
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	102,415	1,555.73	159,330,815	1,218.62	124,805,909	0.66
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,068,000	129.85	138,684,865	116.63	124,564,044	0.66
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	23,871	3,891.96	92,905,021	4,817.79	115,005,488	0.61
コロンビア	株式	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	エネルギー	22,762	4,576.14	104,162,175	4,470.48	101,757,211	0.54
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	151,500	901.59	136,591,315	665.60	100,839,202	0.53
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	75,895	1,298.11	98,520,119	1,316.79	99,938,194	0.53
韓国	株式	POSCO	素材	3,320	28,829.46	95,713,813	28,644.00	95,098,080	0.50
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,297,400	79.79	103,526,316	72.73	94,369,632	0.50
メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO UBD	食品・飲料・タバコ	96,840	903.03	87,450,074	968.17	93,757,679	0.50

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	94.21
投資信託受益証券	0.47
投資証券	0.12
合計	94.80

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	11.09
		素材	8.92
		資本財	4.40
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.60
		自動車・自動車部品	3.58
		耐久消費財・アパレル	0.86
		消費者サービス	0.56
		メディア	1.56
		小売	1.68

	食品・生活必需品小売り	2.22
	食品・飲料・タバコ	5.40
	家庭用品・パーソナル用品	1.08
	ヘルスケア機器・サービス	0.50
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.99
	銀行	18.22
	各種金融	2.35
	保険	3.02
	不動産	1.79
	ソフトウェア・サービス	3.09
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.03
	電気通信サービス	7.52
	公益事業	3.09
	半導体・半導体製造装置	7.55
合計		94.21

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	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	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引所	買建	アメリカドル	217	10,144,359	10,260,845	1,006,383,677	5.31

(注)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、計算期間末日に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。

新興国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	2,167,897,357	9.98
	マレーシア	2,156,246,075	9.93
	ブラジル	2,153,043,211	9.91
	ポーランド	2,152,961,507	9.91
	南アフリカ	2,147,175,060	9.88
	ロシア	2,136,847,627	9.84
	トルコ	2,044,782,402	9.41
	インドネシア	1,910,947,830	8.80
	タイ	1,550,578,050	7.14
	ハンガリー	1,165,995,867	5.37
	コロンビア	711,529,589	3.28

	ナイジェリア	397,451,360	1.83
	ペルー	390,502,886	1.80
	フィリピン	114,743,399	0.53
	チリ	29,251,203	0.13
	小計	21,229,953,423	97.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		495,409,035	2.28
合計(純資産総額)		21,725,362,458	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	230,000,000	319.92	735,821,600	314.73	723,885,210	7.850	2018/03/10	3.33
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	216,500,000	303.32	656,702,898	302.72	655,389,492	7.000	2015/06/03	3.02
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	5,283.12	501,896,904	4,640.11	440,810,967	12.500	2016/01/05	2.03
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	140,000,000	310.65	434,923,848	310.18	434,253,050	7.600	2021/04/14	2.00
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	6,900,000,000	6.38	440,779,633	5.95	410,836,325	12.000	2015/10/22	1.89
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	33,800,000	1,251.66	423,062,279	1,187.59	401,407,110	10.500	2026/12/21	1.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	12,000,000	3,330.47	399,656,635	3,336.91	400,429,932	0.000	2016/01/01	1.84
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,000,000	3,637.39	363,739,482	3,647.19	364,719,188	0.000	2015/04/01	1.68
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	8,200,000	4,360.03	357,523,043	4,221.93	346,198,741	10.000	2017/01/01	1.59
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	104,500,000	320.99	335,439,230	309.39	323,319,875	8.150	2027/02/03	1.49
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	9,900,000	3,211.68	317,956,629	3,218.84	318,665,969	5.500	2015/04/25	1.47
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	49.87	336,678,682	44.30	299,082,459	7.000	2019/10/23	1.38
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,194.40	282,704,481	3,238.69	286,624,271	4.750	2016/10/25	1.32
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000	3,031.69	291,042,821	2,976.15	285,711,000	3.314	2017/10/31	1.32
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	5,500,000	5,340.28	293,715,922	5,098.84	280,436,258	9.000	2017/03/08	1.29
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	85,000,000	315.37	268,071,016	312.24	265,404,828	3.250	2017/06/16	1.22

ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000	3,499.91	264,243,813	3,488.38	263,372,979	5.750	2022/09/23	1.21
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 06/15/32	27,700,000,000	1.16	322,241,856	0.94	262,429,800	8.250	2032/06/15	1.21
マレーシア	国債証券	MGS 3.172% 07/15/16	8,700,000	3,023.72	263,063,740	3,002.65	261,231,350	3.172	2016/07/15	1.20
トルコ	国債証券	TURKGB 6.5% 01/07/15	5,000,000	4,957.05	247,852,710	4,933.91	246,695,604	6.500	2015/01/07	1.14
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	4,670,000	5,507.96	257,221,986	5,189.75	242,361,371	10.000	2015/06/17	1.12
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	23,850,000	1,039.48	247,917,976	990.18	236,157,930	7.250	2020/01/15	1.09
トルコ	国債証券	TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000	5,863.26	266,778,359	5,163.36	234,933,266	9.500	2022/01/12	1.08
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	500,000,000	45.52	227,616,536	45.83	229,166,206	8.000	2015/02/12	1.05
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	7,500,000	3,070.25	230,269,237	3,047.85	228,588,990	3.741	2015/02/27	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	20,000,000	1,200.40	240,080,783	1,142.41	228,483,000	13.500	2015/09/15	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	21,000,000	1,097.36	230,445,700	1,046.78	219,823,800	8.250	2017/09/15	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	20,100,000	1,080.00	217,081,903	1,037.80	208,597,800	8.000	2018/12/21	0.96
トルコ	国債証券	TURKGB 10.5% 01/15/20	3,800,000	6,050.70	229,926,891	5,454.67	207,277,583	10.500	2020/01/15	0.95
トルコ	国債証券	TURKGB 6.3% 02/14/18	4,350,000	4,736.97	206,058,502	4,588.79	199,612,634	6.300	2018/02/14	0.92

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.72
合計	97.72

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	14,752,807,300	98.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		248,787,777	1.66
合計(純資産総額)		15,001,595,077	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,666	999,081.94	1,664,470,513	1,067,000.00	1,777,622,000	11.85
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,430	943,871.76	1,349,736,628	1,036,000.00	1,481,480,000	9.88
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5,004	171,055.53	855,961,895	193,000.00	965,772,000	6.44
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,705	117,144.67	668,310,361	121,800.00	694,869,000	4.63
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,985	190,209.50	567,775,363	198,100.00	591,328,500	3.94
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	671	951,344.22	638,351,978	850,000.00	570,350,000	3.80
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,986	269,696.74	535,617,742	268,300.00	532,843,800	3.55
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	597	809,134.97	483,053,579	833,000.00	497,301,000	3.31
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	582	791,406.78	460,598,748	841,000.00	489,462,000	3.26
日本	投資証券	G L P投資法人	4,423	85,414.91	377,790,152	96,000.00	424,608,000	2.83
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,830	97,881.98	374,887,998	109,500.00	419,385,000	2.80
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,008	99,130.53	397,315,174	97,100.00	389,176,800	2.59
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	885	501,365.96	443,708,878	428,500.00	379,222,500	2.53
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	555	628,006.29	348,543,492	644,000.00	357,420,000	2.38
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	494	641,593.49	316,947,186	701,000.00	346,294,000	2.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	953	326,656.90	311,304,034	359,000.00	342,127,000	2.28
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	613	490,121.33	300,444,377	548,000.00	335,924,000	2.24
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	377	767,623.04	289,393,888	877,000.00	330,629,000	2.20
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	847	353,338.78	299,277,954	379,000.00	321,013,000	2.14
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	356	821,272.73	292,373,092	870,000.00	309,720,000	2.06
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	541	516,081.03	279,199,839	521,000.00	281,861,000	1.88
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	690	331,988.32	229,071,947	390,000.00	269,100,000	1.79
日本	投資証券	福岡リート投資法人	332	685,391.36	227,549,933	745,000.00	247,340,000	1.65
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,309	31,049.51	195,891,419	37,750.00	238,164,750	1.59

日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	3,203	58,235.15	186,527,216	66,800.00	213,960,400	1.43
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	408	489,146.17	199,571,638	510,000.00	208,080,000	1.39
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	295	639,839.72	188,752,720	672,000.00	198,240,000	1.32
日本	投資証券	プレミア投資法人	473	347,740.69	164,481,351	378,500.00	179,030,500	1.19
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	363	502,809.44	182,519,829	489,500.00	177,688,500	1.18
日本	投資証券	積水ハウス・S I投資法人	384	426,994.41	163,965,854	449,500.00	172,608,000	1.15

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.34
合計	98.34

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	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 (%)
不動産投信指数先物取引	東証REIT指数先物	東京証券取引所	買建	円	190	245,492,400	248,710,000	248,710,000	1.66

(注) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、計算期間末日に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。

グローバルREITインデックス マザーファンド

(1) 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	13,689,832,076	67.37
	オーストラリア	2,056,770,249	10.12
	イギリス	1,202,623,261	5.92
	フランス	1,033,763,273	5.09
	シンガポール	768,060,534	3.78
	カナダ	545,982,345	2.69
	香港	383,166,096	1.89
	オランダ	218,735,418	1.08
	ベルギー	113,592,138	0.56
	ニュージーランド	69,564,287	0.34

	ドイツ	30,077,916	0.15
	イタリア	17,295,512	0.09
	イスラエル	3,886,891	0.02
	小計	20,133,349,996	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		186,351,354	0.92
合計(純資産総額)		20,319,701,350	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	84,140	15,205.84	1,279,419,802	15,861.49	1,334,586,408	6.57
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	25,840	22,583.60	583,560,305	23,883.68	617,154,355	3.04
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	39,150	14,504.80	567,862,960	15,647.68	612,606,797	3.01
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	547,800	942.20	516,139,597	1,006.81	551,532,435	2.71
アメリカ	投資証券	HCP INC	123,340	4,424.84	545,760,155	4,381.23	540,381,352	2.66
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	79,570	6,437.08	512,199,063	6,652.76	529,360,622	2.61
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	135,240	3,466.37	468,792,334	3,815.31	515,982,794	2.54
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	77,220	6,070.76	468,784,488	6,432.08	496,685,711	2.44
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	87,010	5,555.77	483,408,109	5,655.29	492,067,026	2.42
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,850	13,002.01	427,116,166	13,461.48	442,209,618	2.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	40,990	10,216.59	418,778,166	10,663.25	437,086,929	2.15
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	45,990	7,748.13	356,336,921	8,450.57	388,641,843	1.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	201,440	1,469.96	296,110,525	1,767.40	356,025,378	1.75
香港	投資証券	LINK REIT	618,500	505.75	312,808,988	480.70	297,312,950	1.46
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	210,150	1,211.40	254,576,057	1,410.24	296,363,921	1.46
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	122,880	1,892.98	232,609,594	2,102.83	258,396,389	1.27
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	111,540	1,931.30	215,418,192	2,196.99	245,052,487	1.21
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	272,400	802.76	218,673,450	889.34	242,257,986	1.19
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	37,010	5,677.97	210,141,708	6,229.06	230,537,540	1.13
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	52,810	4,078.49	215,385,505	4,335.13	228,938,532	1.13
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	829,000	272.73	226,096,576	270.96	224,628,327	1.11
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	25,000	7,535.54	188,388,628	8,945.87	223,646,920	1.10
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	621,000	306.57	190,381,005	324.97	201,811,648	0.99
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	34,590	6,115.85	211,547,264	5,564.07	192,461,471	0.95
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,580	10,256.47	180,308,804	10,413.15	183,063,240	0.90

オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	406,200	399.02	162,085,538	418.84	170,133,417	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	67,710	2,340.78	158,494,764	2,501.03	169,345,418	0.83
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	10,160	14,245.53	144,734,630	16,090.02	163,474,643	0.80
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	22,920	6,571.08	150,609,374	7,025.47	161,023,781	0.79
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	193,200	711.85	137,529,778	782.47	151,174,256	0.74

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.08
合計	99.08

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	イギリス	5,816,844,290	79.88
	ジャージー	1,084,174,358	14.89
	アメリカ	266,513,078	3.66
	小計	7,167,531,726	98.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		114,205,945	1.57
合計(純資産総額)		7,281,737,671	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	84,900,000	1,341.98	1,139,348,117	1,277.00	1,084,174,358	0.0		14.89
イギリス	社債券	CS USD COM 004 10/25/13	10,000,000	9,047.21	904,721,305	8,711.46	871,146,560	0.0	2013/10/25	11.96

イギリス	社債券	UBS USD COM 001 08/14/13	10,000,000	8,970.39	897,039,680	8,516.28	851,628,640	0.0	2013/08/14	11.70
イギリス	社債券	CS USD COM 003 08/30/13	10,000,000	8,796.79	879,679,520	8,354.45	835,445,440	0.0	2013/08/30	11.47
イギリス	社債券	BAR USD COM 020 09/27/13	10,000,000	8,753.14	875,314,960	8,319.04	831,904,752	0.0	2013/09/27	11.42
イギリス	社債券	UBS USD COM 003 05/16/14	6,200,000	9,616.58	596,228,320	9,161.65	568,022,473	0.0	2014/05/16	7.80
イギリス	社債券	BAR USD COM 022 04/25/14	5,000,000	9,779.48	488,974,112	9,277.19	463,859,552	0.0	2014/04/25	6.37
イギリス	社債券	BAR USD COM 023 06/27/14	5,000,000	9,720.90	486,045,248	9,195.29	459,764,712	0.0	2014/06/27	6.31
イギリス	社債券	UBS USD COM 002 11/07/13	5,000,000	9,034.14	451,707,440	8,579.05	428,952,880	0.0	2013/11/07	5.89
イギリス	社債券	BAR USD COM 021 01/31/14	3,000,000	9,462.26	283,868,040	8,995.30	269,859,273	0.0	2014/01/31	3.71
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	7,390,000	3,805.50	281,226,745	3,606.40	266,513,078	0.0	2036/06/12	3.66
イギリス	社債券	BAR USD COM 024 07/25/14	2,500,000	9,733.26	243,331,576	9,450.40	236,260,008	0.0	2014/07/25	3.24

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注3)償還期限は、償還期限の定めがない場合「 」と記載しております。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	98.43
合計	98.43

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

FRM シグマ リンク マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	ケイマン	3,793,541,950	97.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		117,419,051	3.00
合計(純資産総額)		3,910,961,001	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
ケイマン	社債券	QUART X 0% 03/3 1/22	4,405,000,000	89.96	3,963,058,400	86.11	3,793,541,950	0.0	2022/03/31	97.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.00
合計	97.00

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。


投資不動産物件

該当事項はありません。

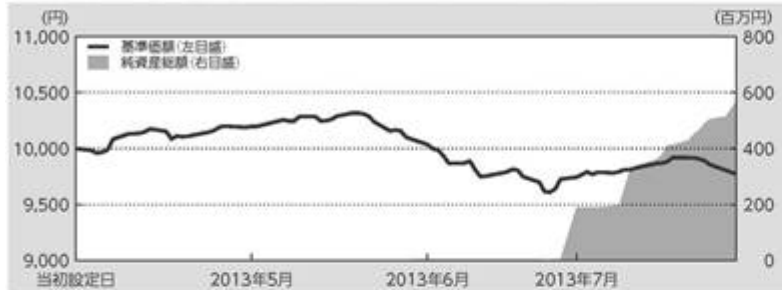
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報)交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2013年3月29日
 作成基準日：2013年7月31日

分散投資コア戦略ファンドA
基準価額・純資産の推移


基準価額	9,773円
純資産総額	569百万円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

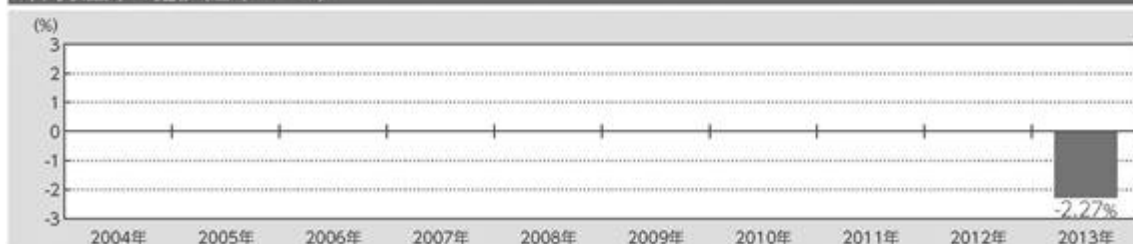
設定来分配金合計額:0円

決算期	2013年7月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-


※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

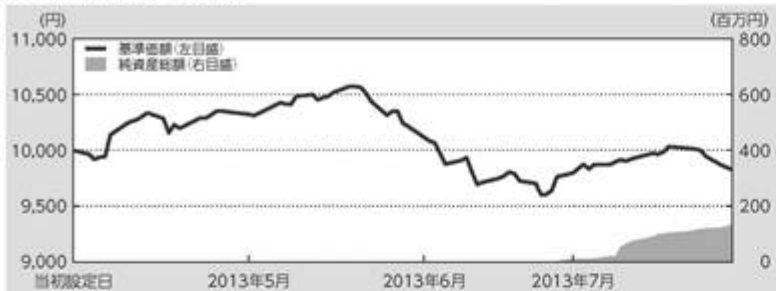
投資信託証券	投資比率
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	15.1%
国内債券インデックス マザーファンド	14.7%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{HL, JPY}	10.4%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	10.0%
FRM シグマリンク マザーファンド	9.8%
FOFs 用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7.4%
FOFs 用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7.4%
外国債券インデックス マザーファンド	5.9%
新興国債券インデックス マザーファンド	5.9%
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	3.7%

年間収益率の推移(暦年ベース)

 ※2013年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。
 ※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。


運用実績

 当初設定日：2013年3月29日
 作成基準日：2013年7月31日

分散投資コア戦略ファンドS
基準価額・純資産の推移


基準価額	9,824円
純資産総額	136百万円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

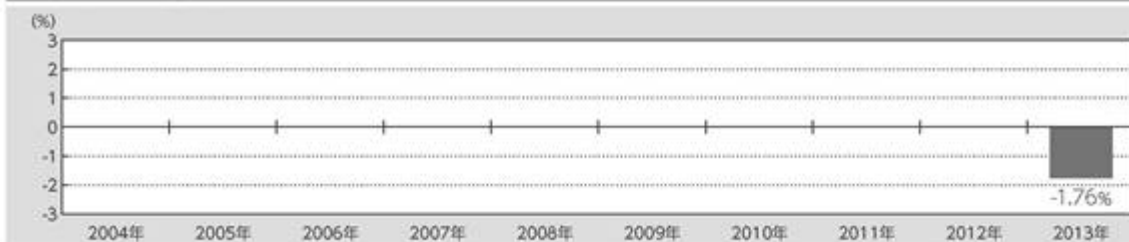
設定来分配金合計額:0円

決算期	2013年7月	-	-	-	-
分配金	0円	-	-	-	-

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国債券インデックス マザーファンド	10.1%
TCAファンド(適格機関投資家専用)	10.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	10.0%
FRM シグマリンク マザーファンド	9.7%
ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	9.1%
国内債券インデックス マザーファンド	7.6%
Global Absolute Return Strategies Fund - Class D ^{ヘルダ}	7.6%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7.6%
外国株式インデックス マザーファンド	7.1%
FOFs 用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	3.9%

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2013年は当初設定日から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(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1期計算期間(平成25年3月29日から平成25年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1財務諸表

分散投資コア戦略ファンドA

(1)貸借対照表

項目	第1期 (平成25年 7月10日現在) 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,489,243
投資信託受益証券	100,639,891
投資証券	25,925,595
親投資信託受益証券	127,561,129
未収利息	17
流動資産合計	265,615,875
資産合計	265,615,875
負債の部	
流動負債	
未払金	6,721,000
未払受託者報酬	2,666
未払委託者報酬	61,660
その他未払費用	250
流動負債合計	6,785,576
負債合計	6,785,576
純資産の部	
元本等	

元本	263,825,167
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,994,868
（分配準備積立金）	(1,674,990)
元本等合計	258,830,299
純資産合計	258,830,299
負債純資産合計	265,615,875

(2)損益及び剰余金計算書

項目	第1期 自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日 金額(円)
営業収益	
受取利息	132
有価証券売買等損益	1,739,434
営業収益合計	1,739,566
営業費用	
受託者報酬	2,666
委託者報酬	61,660
その他費用	250
営業費用合計	64,576
営業利益又は営業損失（ ）	1,674,990
経常利益又は経常損失（ ）	1,674,990
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,674,990
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,669,858
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,669,858
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,994,868

(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	(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
--------------------	---

2. その他	<p>(2)投資証券 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p> <p>ファンドの計算期間 第1期(自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成25年 3月29日から平成25年 7月10日までとなっております。</p>
--------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成25年 7月10日現在)
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	262,825,167円
期中一部解約元本額	- 円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	263,825,167口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,994,868円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9811円 (9,811円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第1期 自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日
費用控除後の配当等収益額	A	74,758円 (77,506円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,600,232円
収益調整金額	C	70,140円
分配準備積立金額	D	- 円

当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	1,745,130円
当ファンドの期末残存口数	F	263,825,167口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	66.14円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。これらは、市場リスク(株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、商品(コモディティ)の価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク、カンントリーリスク、ヘッジファンドの運用手法に係るリスク、仕組み債券に係るリスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券 「(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。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成25年 7月10日現在)
	計算期間(自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日)の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	76,127
投資証券	249,595
親投資信託受益証券	1,413,982
合計	1,739,704

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)附属明細表

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	26,730,245	25,530,056	
	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	38,684,782	38,499,095	
	F0Fs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	19,954,510	17,847,313	
	F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	18,711,037	18,763,427	
投資信託受益証券 小計		104,080,574	100,639,891	
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H} , JPY	15,020.623	25,925,595	

投資証券 小計		15,020,623	25,925,595	
親投資信託 受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	6,972,432	9,647,056	
	国内債券インデックス マザーファンド	29,632,171	37,238,749	
	外国株式インデックス マザーファンド	6,103,008	8,541,159	
	外国債券インデックス マザーファンド	6,751,268	15,457,703	
	新興国株式インデックス マザーファンド	1,781,006	3,507,513	
	新興国債券インデックス マザーファンド	9,311,151	15,005,850	
	J-REITインデックス マザーファンド	3,410,195	3,641,406	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	3,818,270	4,392,155	
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファン ド	9,771,371	4,416,659	
FRM シグマ リンク マザーファンド	28,668,614	25,712,879		
親投資信託受益証券 小計		106,219,486	127,561,129	
合計		210,315,080.623	254,126,615	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

分散投資コア戦略ファンドS

(1)貸借対照表

項目	第1期 (平成25年 7月10日現在) 金額(円)
資産の部	
流動資産	

コール・ローン	4,265,710
投資信託受益証券	13,349,327
投資証券	4,057,451
親投資信託受益証券	35,783,610
未収利息	6
流動資産合計	57,456,104
資産合計	57,456,104
負債の部	
流動負債	
未払金	3,161,000
未払受託者報酬	325
未払委託者報酬	7,716
その他未払費用	13
流動負債合計	3,169,054
負債合計	3,169,054
純資産の部	
元本等	
元本	54,750,331
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	463,281
（分配準備積立金）	(236,214)
元本等合計	54,287,050
純資産合計	54,287,050
負債純資産合計	57,456,104

(2)損益及び剰余金計算書

項目	第1期 自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日 金額(円)
営業収益	
受取利息	17
有価証券売買等損益	244,251
営業収益合計	244,268
営業費用	
受託者報酬	325
委託者報酬	7,716
その他費用	13
営業費用合計	8,054

営業利益又は営業損失()	236,214
経常利益又は経常損失()	236,214
当期純利益又は当期純損失()	236,214
剰余金減少額又は欠損金増加額	699,495
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	699,495
期末剰余金又は期末欠損金()	463,281

(3)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 第1期(自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成25年 3月29日から平成25年 7月10日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成25年 7月10日現在)
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	53,750,331円
期中一部解約元本額	- 円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	54,750,331口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 463,281円

4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9915円 (9,915円)
------------------------------	---------------------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第1期 自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日
費用控除後の配当等収益額	A	26,196円 (27,072円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	210,018円
収益調整金額	C	20,167円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	256,381円
当ファンドの期末残存口数	F	54,750,331口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	46.82円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。これらは、市場リスク(株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、商品(コモディティ)の価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク、カントリーリスク、ヘッジファンドの運用手法に係るリスク、仕組み債券に係るリスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券 「(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。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成25年 7月10日現在)
	計算期間(自 平成25年 3月29日 至 平成25年 7月10日)の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	5,505
投資証券	10,451
親投資信託受益証券	228,402
合計	244,358

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)附属明細表

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資信託 受益証券	TCAファンド(適格機関投資家専用)	5,581,349	5,330,746	
	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替 ヘッジあり(適格機関投資家専用)	4,014,607	3,995,336	
	FOfs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあ り(適格機関投資家専用)	2,230,196	1,994,687	
	FOfs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関 投資家専用)	2,022,894	2,028,558	
投資信託受益証券 小計		13,849,046	13,349,327	
投資証券	Global Absolute Return Strategies Fund-Class D ^{A, H} , JPY	2,350.783	4,057,451	
投資証券 小計		2,350.783	4,057,451	
親投資信託 受益証券	ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド	3,540,984	4,899,305	
	国内債券インデックス マザーファンド	3,202,843	4,025,012	
	外国株式インデックス マザーファンド	2,764,541	3,868,975	
	外国債券インデックス マザーファンド	2,376,406	5,441,019	
	新興国株式インデックス マザーファンド	814,668	1,604,407	
	新興国債券インデックス マザーファンド	3,339,207	5,381,466	
	J-REITインデックス マザーファンド	1,531,967	1,635,834	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,580,740	1,818,325	
	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファン ド	3,937,701	1,779,840	
	FRM シグマ リンク マザーファンド	5,942,053	5,329,427	
親投資信託受益証券 小計		29,031,110	35,783,610	
合計		42,882,506.783	53,190,388	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

<参考>

「分散投資コア戦略ファンドA」、「分散投資コア戦略ファンドS」は、「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」、「グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド」、「FRM シグマ リンク マザーファンド」の受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成25年7月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,022,210,338
株式	9,651,431,200
国債証券	5,994,924,000
未収入金	3,935,075,590
未収配当金	6,323,750
未収利息	10,666
流動資産合計	26,609,975,544
資産合計	26,609,975,544
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,765,259
流動負債合計	2,765,259
負債合計	2,765,259
純資産の部	
元本等	
元本	19,230,537,464
剰余金	
剰余金又は欠損金()	7,376,672,821
元本等合計	26,607,210,285
純資産合計	26,607,210,285
負債純資産合計	26,609,975,544

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 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、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	14,418,262,777円
計算期間中の追加設定元本額	5,423,517,057円
計算期間中の一部解約元本額	611,242,370円
計算日の元本額	19,230,537,464円
計算日の元本額の内訳	
ART テクニカル運用日本株式ファンド	11,467,899,858円
コア投資戦略ファンド(安定型)	650,539,720円
コア投資戦略ファンド(成長型)	913,732,068円
ART テクニカル運用日本株式ファンド(SMA専用)	6,187,073,975円
分散投資コア戦略ファンドA	6,972,432円
分散投資コア戦略ファンドS	3,540,984円
ART テクニカル運用日本株式ファンド(適格機関投資家専用)	778,427円
2. 計算日における受益権総数	19,230,537,464口
3. 1口当たり純資産額	1.3836円
(1万口当たり純資産額)	(13,836円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。これらは、市場リスク(株価変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式及び国債証券 「(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。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	39,376,744
国債証券	96,000
合計	39,280,744

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月27日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
当ファンドは、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本水産	1,047,900	206.00	215,867,400	
大成建設	270,000	407.00	109,890,000	
清水建設	265,000	436.00	115,540,000	
鹿島建設	293,000	375.00	109,875,000	
日揮	35,000	3,780.00	132,300,000	
千代田化工建設	94,000	1,239.00	116,466,000	
キリンホールディングス	61,000	1,585.00	96,685,000	
北越紀州製紙	218,500	436.00	95,266,000	
住友化学	893,000	329.00	293,797,000	
日産化学工業	70,800	1,458.00	103,226,400	
日本曹達	196,000	530.00	103,880,000	
信越化学工業	16,500	6,900.00	113,850,000	
三井化学	369,000	237.00	87,453,000	
三菱ケミカルホールディングス	218,000	491.00	107,038,000	
宇部興産	464,000	191.00	88,624,000	
富士フイルムホールディングス	49,000	2,318.00	113,582,000	
JXホールディングス	199,400	497.00	99,101,800	
日本電気硝子	169,000	492.00	83,148,000	
住友大阪セメント	356,000	325.00	115,700,000	
太平洋セメント	692,000	341.00	235,972,000	
新日鐵住金	394,000	291.00	114,654,000	
神戸製鋼所	767,000	139.00	106,613,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	45,600	2,392.00	109,075,200	
日本軽金属ホールディングス	885,800	133.00	117,811,400	
三井金属鉱業	902,000	229.00	206,558,000	
三菱マテリアル	280,000	337.00	94,360,000	
古河機械金属	2,044,000	190.00	388,360,000	
古河電気工業	341,000	226.00	77,066,000	
住友電気工業	85,700	1,318.00	112,952,600	
フジクラ	257,000	365.00	93,805,000	
SUMCO	82,300	1,119.00	92,093,700	
小松製作所	42,700	2,338.00	99,832,600	
クボタ	60,000	1,589.00	95,340,000	

荏原製作所	188,000	556.00	104,528,000	
ダイキン工業	23,600	4,415.00	104,194,000	
日本精工	101,000	999.00	100,899,000	
NTN	663,000	336.00	222,768,000	
ジェイテクト	91,000	1,194.00	108,654,000	
IHI	247,000	425.00	104,975,000	
ミネベア	561,000	382.00	214,302,000	
日立製作所	136,000	664.00	90,304,000	
三菱電機	87,000	1,046.00	91,002,000	
安川電機	74,000	1,264.00	93,536,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	403,000	429.00	172,887,000	
TDK	24,000	3,705.00	88,920,000	
ミツミ電機	136,600	714.00	97,532,400	
パイオニア	388,500	205.00	79,642,500	
横河電機	87,400	1,297.00	113,357,800	
アドバンテスト	57,200	1,640.00	93,808,000	
カシオ計算機	225,100	916.00	206,191,600	
京セラ	10,100	10,810.00	109,181,000	
太陽誘電	56,400	1,551.00	87,476,400	
大日本スクリーン製造	168,000	562.00	94,416,000	
三井造船	593,000	165.00	97,845,000	
川崎重工業	305,000	335.00	102,175,000	
いすゞ自動車	119,000	802.00	95,438,000	
スズキ	43,400	2,447.00	106,199,800	
富士重工業	42,000	2,673.00	112,266,000	
オリンパス	66,900	2,969.00	198,626,100	
ヤマハ	92,600	1,209.00	111,953,400	
中部電力	74,200	1,482.00	109,964,400	
日本郵船	378,000	283.00	106,974,000	
川崎汽船	488,000	210.00	102,480,000	
ANAホールディングス	450,000	220.00	99,000,000	
トレンドマイクロ	33,100	3,260.00	107,906,000	
双日	1,645,400	178.00	292,881,200	
丸紅	294,000	707.00	207,858,000	
豊田通商	35,200	2,815.00	99,088,000	
三井物産	78,800	1,309.00	103,149,200	
住友商事	146,500	1,328.00	194,552,000	
三菱商事	55,500	1,816.00	100,788,000	
NKSJホールディングス	45,200	2,510.00	113,452,000	

第一生命保険	1,478	155,100.00	229,237,800	
東京海上ホールディングス	34,400	3,480.00	119,712,000	
T & Dホールディングス	154,500	1,395.00	215,527,500	
合計	21,068,278	-	9,651,431,200	

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第375回国庫短期証券	6,000,000,000	5,994,924,000	
	国債証券 小計	6,000,000,000	5,994,924,000	
	合計	6,000,000,000	5,994,924,000	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,281,012,409
国債証券	190,870,263,800
地方債証券	15,708,496,523
特殊債券	22,853,726,678
社債券	15,500,190,740
派生商品評価勘定	929,055
未収入金	501,980,400
未収利息	644,144,887
前払費用	24,587,329
流動資産合計	247,385,331,821
資産合計	247,385,331,821
負債の部	
流動負債	
前受金	230,000
未払金	902,567,400
未払解約金	624,119,085
流動負債合計	1,526,916,485
負債合計	1,526,916,485
純資産の部	
元本等	
元本	195,639,739,622
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	50,218,675,714
元本等合計	245,858,415,336
純資産合計	245,858,415,336
負債純資産合計	247,385,331,821

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	192,009,892,353円
計算期間中の追加設定元本額	24,061,351,407円
計算期間中の一部解約元本額	20,431,504,138円
計算日の元本額	195,639,739,622円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	3,779,674円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	880,009,678円
SBI資産設計オープン(分配型)	16,506,779円
SMT 国内債券インデックス・オープン	3,000,546,596円
世界経済インデックスファンド	106,124,470円
マイセレクション25	163,900,936円
マイセレクション50	135,056,525円
マイセレクション75	44,620,984円
DCマイセレクション25	10,520,826,771円
DCマイセレクション50	13,312,365,573円
DCマイセレクション75	3,742,646,897円
DC日本債券インデックス・オープン	371,388,153円

DC日本債券インデックス・オープンS	42,738,777,684円
DC日本債券インデックス・オープンP	13,753,380,038円
DCマイセレクションS25	3,552,160,815円
DCマイセレクションS50	4,287,730,229円
DCマイセレクションS75	775,540,553円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	36,409,056円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	725,217,796円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	380,280,814円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	85,372,767円
DC世界経済インデックスファンド	62,199,918円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	21,002,119,629円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	62,800,439円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	504,356,321円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	66,676,507円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,573,510円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,895,498円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	2,154,363,761円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,460,645,198円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,671,886,739円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	870,620,254円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	17,772,537,343円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,858,248,359円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,599,232,109円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,897,668,020円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,336,859,412円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,639,757,686円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,444,325,466円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,899,025,310円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,910,101,006円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	300,925,979円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,292,478,615円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,622,100,037円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,723,873,343円
コア投資戦略ファンド(成長型)	812,991,361円
分散投資コア戦略ファンドA	29,632,171円
分散投資コア戦略ファンドS	3,202,843円

2. 担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 103,830,000円

なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

3. 計算日における受益権総数	195,639,739,622口
4. 1口当たり純資産額	1.2567円
(1万口当たり純資産額)	(12,567円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。 これらは、市場リスク(金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	470,500,650
地方債証券	59,857,960
特殊債券	83,576,158
社債券	40,997,370
合計	654,932,138

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	426,960,945	-	427,890,000	929,055
	合計	426,960,945	-	427,890,000	929,055

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第319回利付国債(2年)	970,000,000	969,941,800	
	第320回利付国債(2年)	1,280,000,000	1,279,923,200	
	第321回利付国債(2年)	1,280,000,000	1,279,910,400	
	第322回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,049,853,000	
	第323回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,219,731,600	
	第324回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,219,719,400	
	第326回利付国債(2年)	730,000,000	729,810,200	
	第327回利付国債(2年)	710,000,000	709,808,300	
	第328回利付国債(2年)	1,170,000,000	1,169,672,400	
	第329回利付国債(2年)	1,670,000,000	1,672,555,100	
	第330回利付国債(2年)	100,000,000	100,139,000	
	第85回利付国債(5年)	1,780,000,000	1,792,495,600	
	第86回利付国債(5年)	300,000,000	301,749,000	
	第87回利付国債(5年)	2,820,000,000	2,835,594,600	
	第88回利付国債(5年)	2,570,000,000	2,586,448,000	
	第89回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,618,565,200	
	第90回利付国債(5年)	220,000,000	220,743,600	
	第91回利付国債(5年)	200,000,000	201,202,000	
	第92回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,264,813,200	
	第93回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,604,119,200	
	第94回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,122,554,100	
	第95回利付国債(5年)	620,000,000	627,632,200	
	第96回利付国債(5年)	1,470,000,000	1,484,156,100	
	第97回利付国債(5年)	1,960,000,000	1,974,327,600	
	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,619,812,000	
	第100回利付国債(5年)	100,000,000	100,444,000	
第101回利付国債(5年)	1,020,000,000	1,027,670,400		
第102回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,887,708,000		
第103回利付国債(5年)	1,940,000,000	1,946,731,800		
第104回利付国債(5年)	410,000,000	409,922,100		
第105回利付国債(5年)	2,940,000,000	2,937,118,800		
第106回利付国債(5年)	2,640,000,000	2,635,063,200		

第107回利付国債(5年)	1,620,000,000	1,615,723,200	
第108回利付国債(5年)	790,000,000	784,446,300	
第109回利付国債(5年)	390,000,000	386,751,300	
第110回利付国債(5年)	2,000,000,000	2,001,840,000	
第111回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,608,880,000	
第112回利付国債(5年)	1,020,000,000	1,024,712,400	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	168,498,000	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	321,531,000	
第3回利付国債(40年)	340,000,000	364,412,000	
第4回利付国債(40年)	530,000,000	566,782,000	
第5回利付国債(40年)	740,000,000	749,812,400	
第6回利付国債(40年)	200,000,000	197,100,000	
第263回利付国債(10年)	410,000,000	417,269,300	
第264回利付国債(10年)	2,070,000,000	2,104,237,800	
第265回利付国債(10年)	530,000,000	540,557,600	
第266回利付国債(10年)	470,000,000	478,685,600	
第267回利付国債(10年)	590,000,000	600,053,600	
第268回利付国債(10年)	760,000,000	777,662,400	
第269回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,458,414,100	
第270回利付国債(10年)	1,460,000,000	1,493,185,800	
第271回利付国債(10年)	680,000,000	694,144,000	
第272回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,099,692,500	
第273回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,637,604,600	
第274回利付国債(10年)	530,000,000	547,664,900	
第275回利付国債(10年)	280,000,000	288,652,000	
第276回利付国債(10年)	480,000,000	497,169,600	
第277回利付国債(10年)	410,000,000	425,969,500	
第278回利付国債(10年)	720,000,000	751,896,000	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	461,850,400	
第280回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,471,694,000	
第281回利付国債(10年)	750,000,000	790,605,000	
第282回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,321,614,000	
第283回利付国債(10年)	280,000,000	294,579,600	
第284回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,167,697,800	
第285回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,521,234,900	
第286回利付国債(10年)	870,000,000	923,870,400	
第287回利付国債(10年)	540,000,000	575,542,800	
第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,216,633,100	
第289回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,613,645,100	

第290回利付国債（10年）	270,000,000	284,121,000	
第291回利付国債（10年）	840,000,000	880,042,800	
第292回利付国債（10年）	860,000,000	916,923,400	
第293回利付国債（10年）	870,000,000	933,744,900	
第294回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,164,556,000	
第295回利付国債（10年）	100,000,000	105,866,000	
第296回利付国債（10年）	2,300,000,000	2,439,219,000	
第297回利付国債（10年）	560,000,000	591,869,600	
第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,745,589,600	
第299回利付国債（10年）	1,480,000,000	1,557,093,200	
第300回利付国債（10年）	830,000,000	882,489,200	
第301回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,531,900,800	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	211,602,000	
第303回利付国債（10年）	980,000,000	1,036,702,800	
第304回利付国債（10年）	550,000,000	578,506,500	
第305回利付国債（10年）	1,900,000,000	1,997,964,000	
第306回利付国債（10年）	1,440,000,000	1,522,872,000	
第307回利付国債（10年）	600,000,000	630,654,000	
第308回利付国債（10年）	600,000,000	629,658,000	
第309回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,305,007,200	
第310回利付国債（10年）	1,430,000,000	1,466,894,000	
第311回利付国債（10年）	160,000,000	161,870,400	
第312回利付国債（10年）	1,620,000,000	1,682,046,000	(注)
第313回利付国債（10年）	980,000,000	1,023,639,400	
第314回利付国債（10年）	680,000,000	700,094,000	
第315回利付国債（10年）	1,230,000,000	1,274,808,900	
第316回利付国債（10年）	620,000,000	637,930,400	
第317回利付国債（10年）	680,000,000	699,176,000	
第318回利付国債（10年）	1,520,000,000	1,550,521,600	
第319回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,294,486,200	
第320回利付国債（10年）	1,680,000,000	1,711,970,400	
第321回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,425,634,000	
第322回利付国債（10年）	1,730,000,000	1,746,884,800	
第323回利付国債（10年）	930,000,000	938,146,800	
第324回利付国債（10年）	1,690,000,000	1,689,290,200	
第325回利付国債（10年）	3,270,000,000	3,265,781,700	
第326回利付国債（10年）	300,000,000	296,583,000	
第327回利付国債（10年）	2,620,000,000	2,614,262,200	
第328回利付国債（10年）	2,160,000,000	2,111,659,200	

第329回利付国債（10年）	920,000,000	915,777,200	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	47,770,000	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	181,318,400	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	133,814,400	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	132,118,800	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	54,544,500	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	212,473,200	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	197,677,800	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	50,802,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	227,812,800	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	143,614,400	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	89,532,900	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	201,878,800	
第13回利付国債（30年）	320,000,000	334,307,200	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	333,927,000	
第15回利付国債（30年）	320,000,000	361,766,400	
第16回利付国債（30年）	270,000,000	305,075,700	
第17回利付国債（30年）	310,000,000	344,909,100	
第18回利付国債（30年）	370,000,000	404,854,000	
第19回利付国債（30年）	260,000,000	284,471,200	
第20回利付国債（30年）	230,000,000	260,065,600	
第21回利付国債（30年）	280,000,000	306,294,800	
第22回利付国債（30年）	300,000,000	339,294,000	
第23回利付国債（30年）	290,000,000	328,016,100	
第24回利付国債（30年）	240,000,000	271,483,200	
第25回利付国債（30年）	320,000,000	349,833,600	
第26回利付国債（30年）	540,000,000	600,787,800	
第27回利付国債（30年）	500,000,000	566,625,000	
第28回利付国債（30年）	510,000,000	578,931,600	
第29回利付国債（30年）	840,000,000	937,918,800	
第30回利付国債（30年）	540,000,000	592,104,600	
第31回利付国債（30年）	660,000,000	710,146,800	
第32回利付国債（30年）	850,000,000	932,501,000	
第33回利付国債（30年）	730,000,000	753,900,200	
第34回利付国債（30年）	920,000,000	988,908,000	
第35回利付国債（30年）	900,000,000	928,449,000	
第36回利付国債（30年）	1,140,000,000	1,175,351,400	
第37回利付国債（30年）	860,000,000	867,327,200	
第38回利付国債（30年）	540,000,000	531,765,000	

第 3 9 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	151,008,000	
第 2 6 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	21,048,400	
第 2 7 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	52,920,000	
第 2 8 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	21,643,800	
第 2 9 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	65,358,000	
第 3 0 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	86,268,000	
第 3 1 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	87,216,000	
第 3 2 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	54,778,000	
第 3 3 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	156,182,600	
第 3 4 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	56,029,500	
第 3 5 回利付国債（ 2 0 年）	10,000,000	11,132,700	
第 3 6 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	77,984,900	
第 3 7 回利付国債（ 2 0 年）	70,000,000	78,291,500	
第 3 8 回利付国債（ 2 0 年）	20,000,000	22,249,600	
第 3 9 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	553,925,000	
第 4 0 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	110,111,000	
第 4 1 回利付国債（ 2 0 年）	330,000,000	350,869,200	
第 4 2 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	89,987,200	
第 4 3 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	160,855,800	
第 4 4 回利付国債（ 2 0 年）	170,000,000	191,940,200	
第 4 5 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	325,655,500	
第 4 6 回利付国債（ 2 0 年）	170,000,000	188,637,100	
第 4 7 回利付国債（ 2 0 年）	90,000,000	99,930,600	
第 4 8 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	147,127,500	
第 4 9 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	154,589,400	
第 5 0 回利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	239,621,800	
第 5 1 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	109,698,000	
第 5 2 回利付国債（ 2 0 年）	110,000,000	121,793,100	
第 5 3 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	88,679,200	
第 5 4 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	223,464,000	
第 5 5 回利付国債（ 2 0 年）	140,000,000	154,214,200	
第 5 6 回利付国債（ 2 0 年）	150,000,000	165,223,500	
第 5 7 回利付国債（ 2 0 年）	240,000,000	262,682,400	
第 5 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	328,818,000	
第 5 9 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	215,894,000	
第 6 0 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	368,270,000	
第 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	240,000,000	243,876,000	
第 6 2 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	318,825,600	
第 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	218,214,000	

第64回利付国債（20年）	320,000,000	352,672,000	
第65回利付国債（20年）	420,000,000	462,957,600	
第66回利付国債（20年）	230,000,000	251,194,500	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	143,373,100	
第68回利付国債（20年）	290,000,000	328,677,300	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	437,977,800	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	461,824,000	
第71回利付国債（20年）	300,000,000	340,194,000	
第72回利付国債（20年）	610,000,000	685,816,900	
第73回利付国債（20年）	390,000,000	434,272,800	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	224,894,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	146,187,600	
第76回利付国債（20年）	280,000,000	308,630,000	
第77回利付国債（20年）	240,000,000	267,211,200	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	187,317,900	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	300,561,300	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	247,394,400	
第81回利付国債（20年）	160,000,000	177,966,400	
第82回利付国債（20年）	650,000,000	730,476,500	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	325,655,500	
第84回利付国債（20年）	690,000,000	766,769,400	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	325,365,500	
第86回利付国債（20年）	340,000,000	389,544,800	
第87回利付国債（20年）	290,000,000	328,810,700	
第88回利付国債（20年）	550,000,000	629,750,000	
第89回利付国債（20年）	320,000,000	362,540,800	
第90回利付国債（20年）	560,000,000	633,880,800	
第91回利付国債（20年）	440,000,000	503,434,800	
第92回利付国債（20年）	970,000,000	1,084,848,000	
第93回利付国債（20年）	360,000,000	397,598,400	
第94回利付国債（20年）	500,000,000	558,485,000	
第95回利付国債（20年）	600,000,000	684,540,000	
第96回利付国債（20年）	300,000,000	334,641,000	
第97回利付国債（20年）	590,000,000	664,770,700	
第98回利付国債（20年）	320,000,000	356,435,200	
第99回利付国債（20年）	820,000,000	911,389,000	
第100回利付国債（20年）	550,000,000	617,518,000	
第101回利付国債（20年）	255,000,000	293,209,200	
第102回利付国債（20年）	400,000,000	459,352,000	

第103回利付国債（20年）	270,000,000	306,460,800	
第104回利付国債（20年）	340,000,000	376,618,000	
第105回利付国債（20年）	540,000,000	597,072,600	
第106回利付国債（20年）	370,000,000	414,081,800	
第107回利付国債（20年）	180,000,000	198,516,600	
第108回利付国債（20年）	600,000,000	645,048,000	
第109回利付国債（20年）	200,000,000	214,378,000	
第110回利付国債（20年）	890,000,000	978,946,600	
第111回利付国債（20年）	300,000,000	333,447,000	
第112回利付国債（20年）	640,000,000	702,035,200	
第113回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,246,977,600	
第114回利付国債（20年）	540,000,000	588,940,200	
第115回利付国債（20年）	560,000,000	618,632,000	
第116回利付国債（20年）	470,000,000	518,405,300	
第117回利付国債（20年）	700,000,000	761,642,000	
第118回利付国債（20年）	950,000,000	1,016,215,000	
第119回利付国債（20年）	380,000,000	395,397,600	
第121回利付国債（20年）	990,000,000	1,041,272,100	
第122回利付国債（20年）	160,000,000	165,880,000	
第123回利付国債（20年）	680,000,000	733,862,800	
第124回利付国債（20年）	410,000,000	436,227,700	
第125回利付国債（20年）	380,000,000	414,861,200	
第126回利付国債（20年）	430,000,000	456,225,700	
第127回利付国債（20年）	360,000,000	376,704,000	
第128回利付国債（20年）	620,000,000	646,827,400	
第129回利付国債（20年）	500,000,000	513,935,000	
第130回利付国債（20年）	740,000,000	758,181,800	
第131回利付国債（20年）	450,000,000	454,099,500	
第132回利付国債（20年）	330,000,000	332,095,500	
第133回利付国債（20年）	760,000,000	776,666,800	
第134回利付国債（20年）	370,000,000	377,118,800	
第135回利付国債（20年）	180,000,000	180,639,000	
第136回利付国債（20年）	530,000,000	523,221,300	
第137回利付国債（20年）	290,000,000	290,205,900	
第138回利付国債（20年）	750,000,000	726,427,500	
第139回利付国債（20年）	520,000,000	512,179,200	
第140回利付国債（20年）	920,000,000	919,328,400	
第141回利付国債（20年）	860,000,000	858,116,600	
第142回利付国債（20年）	280,000,000	284,090,800	

	第143回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,067,622,300	
	第144回利付国債(20年)	250,000,000	240,670,000	
	第145回利付国債(20年)	500,000,000	497,405,000	
	第9回ポーランド共和国国貨債券	100,000,000	101,973,000	
	国債証券 小計	183,505,000,000	190,870,263,800	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,153,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,525,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	107,372,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	103,712,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,104,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,018,000	
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,103,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	196,530,000	
	第618回東京都公募公債	100,000,000	101,835,000	
	第622回東京都公募公債	100,000,000	102,139,000	
	第633回東京都公募公債	129,000,000	135,102,990	
	第639回東京都公募公債	50,000,000	52,572,000	
	第649回東京都公募公債	102,000,000	108,134,280	
	第650回東京都公募公債	140,000,000	149,116,800	
	第674回東京都公募公債	100,000,000	105,383,000	
	第678回東京都公募公債	100,000,000	105,369,000	
	第683回東京都公募公債	100,000,000	104,595,000	
	第691回東京都公募公債	100,000,000	103,783,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	103,349,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	103,221,000	
	平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	104,286,000	
	平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	105,531,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	116,372,300	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	106,993,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	104,164,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	112,006,000	
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	106,355,000	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	105,456,000	
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	105,987,000	
	第167回神奈川県公募公債	140,000,000	148,670,200	
	第172回神奈川県公募公債	200,000,000	209,994,000	
	第53回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,688,000	
	第72回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,991,000	

第271回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,797,000	
第284回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,235,000	
第290回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,013,000	
第291回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,158,000	
第307回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,343,000	
第311回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,991,000	
第345回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,493,000	
第349回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,258,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	105,019,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	103,370,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	207,866,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	106,363,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,454,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,515,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,502,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	105,380,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	106,613,872	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,753,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,990,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	110,963,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,407,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	210,096,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,643,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,362,000	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,802,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,477,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,017,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	99,351,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	102,276,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	105,149,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,816,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	200,619,640	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	106,371,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,812,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	206,158,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	101,737,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	98,718,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	105,553,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,660,000	

平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	106,465,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,815,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	122,485,200	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	101,810,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,297,000	
平成22年度第1回長野県公募公債	100,000,000	100,648,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,834,000	
第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,775,000	
第29回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,144,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,427,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,649,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,124,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	126,852,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,542,000	
第46回共同発行市場公募地方債	136,500,000	143,962,455	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,515,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	168,840,144	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,132,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,712,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,373,566	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,808,000	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,965,200	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,394,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,582,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,506,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	154,225,836	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,460,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,788,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,670,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	259,870,000	
第97回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,270,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,122,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,721,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,337,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,792,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,561,000	
第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,155,000	
平成17年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,301,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,056,000	

	平成16年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,838,000	
	平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	103,217,000	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	106,190,000	
	平成22年度第2回大阪市公募公債(5年)	100,000,000	100,495,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,351,000	
	第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	109,617,000	
	第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	108,642,000	
	第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	103,987,000	
	平成22年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,418,000	
	平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	105,011,040	
	平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	103,587,000	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,185,000	
	平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,889,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	213,046,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	106,461,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,521,000	
	平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	103,172,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,392,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	106,161,000	
	平成23年度第1回北九州市公募公債(5年)	100,000,000	100,383,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	103,198,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	101,885,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	105,469,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	112,683,000	
	地方債証券 小計	15,030,190,000	15,708,496,523	
特殊債券	第42回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	99,196,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,088,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	111,926,460	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,399,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	201,274,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,312,000	
	第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,233,000	
	第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,707,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,662,000	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,807,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,207,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,312,000	
	第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,637,000	

第 2 1 回道路債券	100,000,000	113,030,000	
第 2 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,097,000	
第 3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,375,000	
第 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,214,000	
第 3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,269,000	
第 3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	335,367,900	
第 3 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,535,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,469,000	
第 4 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,076,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	111,722,000	
第 4 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,137,000	
第 4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,050,000	
第 4 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,475,000	
第 4 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,335,000	
第 4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,516,000	
第 4 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,696,000	
第 5 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,570,000	
第 5 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,522,200	
第 5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,695,410	
第 6 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,214,000	
第 6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	193,286,280	
第 8 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,985,000	
第 8 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,150,000	
第 8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,029,000	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,940,000	
第 9 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,208,000	
第 9 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,754,000	
第 1 0 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	144,528,780	
第 1 0 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,999,000	
第 1 1 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,688,000	
第 1 1 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,452,000	
第 1 1 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,692,000	
第 1 2 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,958,000	
第 1 2 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,166,000	
第 1 2 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,055,000	
第 1 2 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,536,000	
第 1 3 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,210,000	
第 1 3 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	102,622,000	
第 1 4 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,621,000	

第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,755,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,184,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,500,000	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	103,904,340	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	48,897,120	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	146,745,170	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	185,486,990	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	215,002,740	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,184,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,964,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,615,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	333,030,000	
第3回公営企業債券（20年）	10,000,000	10,070,600	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,014,000	
第6回地方公共団体金融機構債券（5年）	100,000,000	100,559,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,141,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	112,186,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,393,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,050,800	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,514,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,248,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,956,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,326,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	102,977,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,523,080	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,605,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,262,200	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,231,900	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,615,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	98,313,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	106,603,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	107,692,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,755,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,059,000	
第848回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,849,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	143,453,800	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	135,380,640	
第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,936,000	
第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,573,000	

第 8 6 7 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,087,000	
第 8 7 1 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,541,000	
第 8 7 2 回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,262,000	
第 8 7 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,481,000	
第 8 7 5 回政府保証公営企業債券	212,000,000	223,810,520	
第 8 7 6 回政府保証公営企業債券	122,000,000	129,888,520	
第 3 回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	108,512,560	
第 5 回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,046,400	
第 7 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,857,000	
第 8 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,360,000	
第 1 9 3 回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	105,687,920	
第 2 0 0 回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,477,000	
第 1 4 5 回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	102,188,000	
第 1 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,619,000	
第 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,039,900	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	106,354,000	
第 1 8 2 回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,161,500	
第 4 3 回都市再生債券	100,000,000	103,473,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	111,772,000	
第 3 2 2 回東京交通債券	10,000,000	10,668,500	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	106,520,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,289,200	
第 1 9 0 回政府保証預金保険機構債	200,000,000	199,324,000	
第 1 9 1 回政府保証預金保険機構債	100,000,000	99,619,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,689,000	49,623,403	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	34,209,000	36,288,223	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	35,296,000	37,777,661	
第 3 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	108,915,000	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,576,000	50,968,644	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	38,267,000	40,471,944	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	29,915,000	31,325,193	
第 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,711,000	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	62,054,000	66,452,387	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	38,589,000	40,562,441	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	32,552,000	34,707,593	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	44,221,000	46,690,742	
第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,642,000	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	32,267,000	34,441,473	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	49,358,000	52,129,451	

第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	52,317,000	54,700,039	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	52,794,000	55,122,215	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,158,000	64,287,846	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,687,000	65,160,845	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,249,000	64,498,361	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,753,000	71,334,423	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,049,000	73,763,698	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,241,000	75,695,564	
第 3 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,416,000	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,172,000	154,170,028	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,103,000	50,463,895	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,198,000	83,780,444	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,474,000	49,688,662	
第 4 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,558,000	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,098,000	48,477,193	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,928,000	91,832,003	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,413,000	44,363,676	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,851,000	92,152,184	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,372,000	92,902,832	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,685,000	49,959,485	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,234,000	185,349,464	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,475,000	93,405,485	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,217,000	48,990,020	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,177,000	94,596,085	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,931,000	94,454,139	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,497,000	95,144,417	
第 5 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,946,000	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,314,000	191,137,093	
第 6 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,796,000	
第 6 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,993,000	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,494,000	192,597,683	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,550,000	96,281,850	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,954,000	97,992,202	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,187,000	98,330,353	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,736,000	98,753,772	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,264,000	97,603,313	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,746,000	99,877,664	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	156,463,500	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,731,000	

第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,177,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,091,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	111,511,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	152,406,660	
い第718号商工債	100,000,000	100,741,000	
い第721号商工債	150,000,000	150,981,000	
い第722号商工債	100,000,000	100,580,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,533,000	
い第729号商工債	100,000,000	101,216,000	
い第731号商工債	100,000,000	101,269,000	
い第738号商工債	100,000,000	100,604,000	
い第741号商工債	100,000,000	100,576,000	
い第715号農林債	100,000,000	100,676,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,702,000	
い第722号農林債	100,000,000	100,631,000	
い第723号農林債	200,000,000	201,314,000	
い第740号農林債	100,000,000	100,669,000	
い第743号農林債	100,000,000	100,450,000	
い第746号農林債	100,000,000	100,040,000	
い第752号農林債	100,000,000	99,673,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	100,908,000	
第243回信金中金債（5年）	100,000,000	100,806,000	
第247回信金中金債（5年）	100,000,000	100,664,000	
第258回信金中金債（5年）	100,000,000	100,897,000	
第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,912,000	
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,792,000	
第267回信金中金債（5年）	200,000,000	201,188,000	
第139号商工債（3年）	100,000,000	100,112,000	
第5回S B A B銀行A B（p u b l）円貨債券	100,000,000	100,588,000	
第10回韓国輸出入銀行円貨債券	100,000,000	100,684,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	103,362,000	
第19回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,585,000	
第22回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	203,144,000	
第28回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	101,549,000	
第33回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	101,214,000	
第43回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,781,000	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,622,000	
特殊債券 小計	21,968,311,000	22,853,726,678	

社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	102,232,000	
	第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,596,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	104,251,000	
	第9回現代キャピタル・サービズ・インク円貨社債	100,000,000	99,801,000	
	第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,492,000	
	第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,328,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,230,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,212,000	
	第16回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	200,000,000	204,064,000	
	第17回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	200,000,000	200,530,000	
	第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,797,000	
	第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,720,000	
	第13回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,797,000	
	第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,593,000	
	第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,899,000	
	第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,279,000	
	第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	107,348,000	
	第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	105,159,000	
	第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,097,000	
	第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,885,000	
	第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,912,000	
	第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,218,000	
	第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,363,000	
	第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
	第8回昭和シェル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,218,000	
	第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	99,295,000	
	第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,541,000	
	第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,757,000	
	第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,057,000	
	第15回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,409,000	
	第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,112,000	
	第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	105,158,000	

第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,624,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,789,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,177,000	
第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	99,844,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,892,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	99,745,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	102,058,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,996,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,997,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,036,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,104,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,786,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	101,984,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,632,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,310,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	100,431,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,163,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,062,000	
第77回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,748,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,736,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,381,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,310,000	
第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	302,217,000	
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	116,910,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,003,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,049,000	
第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,015,000	
第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,326,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,019,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,157,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,173,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	109,077,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,712,000	

第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,256,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,660,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,245,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,523,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,443,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,637,000	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,842,000	
第133回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,892,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,773,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,637,000	
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,239,000	
第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,024,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,046,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,650,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,781,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,343,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	111,504,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,538,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債	100,000,000	101,209,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,611,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,164,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	98,590,000	
第7回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,367,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,097,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,966,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,592,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,033,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,166,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	201,954,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,188,990	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,273,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,183,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,971,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,843,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,392,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,246,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,953,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,082,000	

第17回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,870,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,921,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,260,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,807,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,805,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,309,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	116,130,000	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	9,967,700	
第510回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,009,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,439,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,180,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,095,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,151,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,567,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,092,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,558,000	
第405回中部電力株式会社社債	50,000,000	53,311,000	
第408回中部電力株式会社社債	50,000,000	53,934,500	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,503,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,418,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,686,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,733,000	
第489回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,106,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,006,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,933,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,038,000	
第248回北陸電力株式会社社債	100,000,000	109,754,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,828,000	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	107,243,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	109,497,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,771,200	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,896,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,782,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,519,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,917,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,780,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,643,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,047,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,723,350	

第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,225,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	208,966,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,349,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,660,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	111,327,000	
第42回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	100,649,000	
社債券 小計	15,120,000,000	15,500,190,740	
合計	235,623,501,000	244,932,677,741	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,236,078,279
コール・ローン	325,985,412
株式	151,426,261,857
投資信託受益証券	102,809,505
投資証券	3,304,365,614
派生商品評価勘定	111,765,459
未収入金	27,408,447
未収配当金	233,262,346
未収利息	495
差入委託証拠金	1,504,900,170
流動資産合計	162,272,837,584
資産合計	162,272,837,584
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,543,574
未払解約金	298,312,261
流動負債合計	302,855,835
負債合計	302,855,835
純資産の部	
元本等	
元本	115,731,046,967
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,238,934,782
元本等合計	161,969,981,749
純資産合計	161,969,981,749
負債純資産合計	162,272,837,584

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券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を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	121,911,611,131円
計算期間中の追加設定元本額	5,423,273,913円
計算期間中の一部解約元本額	11,603,838,077円
計算日の元本額	115,731,046,967円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,058,489,118円
SBI資産設計オープン(分配型)	20,086,684円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,990,053,131円
世界経済インデックスファンド	763,172,934円
マイセレクション25	12,299,914円
マイセレクション50	46,500,655円
マイセレクション75	57,982,420円
外国株式インデックス・オープン	1,153,201,669円
DCマイセレクション25	821,049,631円
DCマイセレクション50	4,502,473,351円
DCマイセレクション75	5,067,669,776円
DC外国株式インデックス・オープン	5,404,928,927円
DCマイセレクションS25	271,826,921円
DCマイセレクションS50	1,475,720,624円
DCマイセレクションS75	1,076,932,625円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	6,280,692円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	128,980,187円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	132,628,000円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	60,224,199円
DC世界経済インデックスファンド	434,133,864円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	10,974,249,060円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	174,761,609円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	90,592,025円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	422,377,291円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	960,119,558円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,869,923,817円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,631,528,653円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,970,634,381円

バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,449,208,505円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,155,182,580円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,090,267,781円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	15,285,090,789円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	6,848,513,154円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,168,573,443円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,275,336,760円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	389,783,904円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,145,093,640円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	6,033,720,895円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,031,910,281円
コア投資戦略ファンド(安定型)	560,678,436円
コア投資戦略ファンド(成長型)	709,997,534円
分散投資コア戦略ファンドA	6,103,008円
分散投資コア戦略ファンドS	2,764,541円
2. 計算日における受益権総数	115,731,046,967口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3995円 (13,995円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>
-------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,810,372,739
投資信託受益証券	10,290,976
投資証券	206,396,846

合計	3,027,060,561
----	---------------

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	6,310,491,210	-	6,417,942,392	107,451,182
	合計	6,310,491,210	-	6,417,942,392	107,451,182

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			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	84,119,670	-	83,937,900	181,770
	オーストラリアドル	7,334,080	-	7,410,400	76,320
	イギリスポンド	10,551,380	-	10,512,600	38,780
	ユーロ	25,998,100	-	25,834,000	164,100
	計	128,003,230	-	127,694,900	308,330
	売 建				
	アメリカドル	519,777,123	-	519,808,200	31,077
	カナダドル	39,369,840	-	39,368,200	1,640
	オーストラリアドル	33,277,320	-	33,344,400	67,080
	イギリスポンド	82,647,115	-	82,599,000	48,115
	スイスフラン	36,340,045	-	36,340,500	455
	香港ドル	13,039,700	-	13,040,000	300
	スウェーデンクローナ	10,408,160	-	10,402,000	6,160
	ユーロ	106,041,430	-	105,919,400	122,030
	計	840,900,733	-	840,821,700	79,033
	合計	968,903,963	-	968,516,600	229,297

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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たレートを用いております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	29,816	88.36	2,634,541.76	
	APACHE CORP	23,335	81.46	1,900,869.10	
	BAKER HUGHES	26,316	48.96	1,288,431.36	
	CABOT OIL & GAS CORP	12,534	71.77	899,565.18	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,763	64.99	959,447.37	
	CHENIERE ENERGY INC	12,228	29.53	361,092.84	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	31,811	21.14	672,484.54	
	CHEVRON CORP	115,850	123.27	14,280,829.50	
	CIMAREX ENERGY CO	5,441	70.18	381,849.38	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,143	27.95	479,146.85	
	CONCHO RESOURCES INC	6,186	88.34	546,471.24	
	CONOCOPHILLIPS	69,091	63.50	4,387,278.50	
	CONSOL ENERGY INC	14,265	27.83	396,994.95	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	91.72	286,258.12	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,000	156.57	469,710.00	
	DENBURY RESOURCES INC	22,245	17.49	389,065.05	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,974	55.61	1,277,584.14	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,348	70.04	304,533.92	
	ENERGEN CORP	4,302	55.78	239,965.56	
	ENSCO PLC-CL A	13,861	59.32	822,234.52	
	EOG RESOURCES INC	16,186	142.22	2,301,972.92	
	EQT CORPORATION	8,967	81.38	729,734.46	
	EXXON MOBIL	267,257	93.34	24,945,768.38	
	FMC TECHNOLOGIES INC	14,145	58.16	822,673.20	
	HALLIBURTON CO	55,503	44.31	2,459,337.93	
	HELMERICH & PAYNE	6,624	65.37	433,010.88	
	HESS CORP	18,309	68.57	1,255,448.13	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,189	41.97	511,572.33	
	KINDER MORGAN INC	40,098	39.52	1,584,672.96	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,264	85.70	536,824.80	
MARATHON OIL CORP	42,154	36.37	1,533,140.98		
MARATHON PETROLEUM CORP	19,707	70.12	1,381,854.84		

MURPHY OIL CORP	10,789	62.65	675,930.85	
NABORS INDUSTRIES LTD	19,925	16.00	318,800.00	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	25,413	73.14	1,858,706.82	
NOBLE CORP	15,867	39.28	623,255.76	
NOBLE ENERGY INC	22,820	63.86	1,457,285.20	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	47,980	89.94	4,315,321.20	
OCEANEERING INTL INC	6,800	80.00	544,000.00	
PEABODY ENERGY CORP	16,869	15.70	264,843.30	
PHILLIPS 66	35,169	58.51	2,057,738.19	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,884	153.49	1,210,115.16	
QEP RESOURCES INC	11,161	29.29	326,905.69	
RANGE RESOURCES CORP	9,700	79.98	775,806.00	
ROWAN COMPANIES PLC	8,660	35.21	304,918.60	
SCHLUMBERGER	79,281	76.54	6,068,167.74	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,913	38.73	809,960.49	
SPECTRA ENERGY CORP	39,797	35.59	1,416,375.23	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	9,499	28.01	266,066.99	
TESORO CORP	8,166	52.98	432,634.68	
ULTRA PETROLEUM CORP	9,110	20.60	187,666.00	
VALERO ENERGY CORP	32,935	34.28	1,129,011.80	
WEATHERFORD INTL LTD	47,709	14.43	688,440.87	
WHITING PETROLEUM CORP	7,534	48.83	367,885.22	
WILLIAMS COS	40,595	33.53	1,361,150.35	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,367	95.96	1,186,737.32	
AIRGAS INC	4,122	99.23	409,026.06	
ALBEMARLE CORP	5,600	64.69	362,264.00	
ALCOA	63,694	7.91	503,819.54	
ASHLAND INC	4,469	85.38	381,563.22	
BALL CORP	8,456	43.68	369,358.08	
CELANESE CORP-SERIES A	10,037	46.59	467,623.83	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,753	181.20	680,043.60	
CROWN HOLDINGS INC	8,530	41.87	357,151.10	
DOW CHEMICAL CO	71,737	34.02	2,440,492.74	
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	55,650	53.91	3,000,091.50	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,170	73.43	673,353.10	
ECOLAB INC	15,812	88.46	1,398,729.52	
FMC CORP	8,200	61.93	507,826.00	
FREEMPORT-MCMOR-B	61,668	27.64	1,704,503.52	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,854	79.58	386,281.32	
INT'L PAPER CO	24,966	46.89	1,170,655.74	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,705	68.97	1,772,873.85	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,855	101.18	288,868.90	
MEADWESTVACO CORP	11,116	34.88	387,726.08	
MONSANTO CO	31,865	101.40	3,231,111.00	
MOSAIC CO/THE	17,752	56.45	1,002,100.40	
NEWMONT MINING CORP	29,588	27.07	800,947.16	
NUCOR CORP	18,922	44.79	847,516.38	
OWENS-ILLINOIS INC	9,681	28.72	278,038.32	
PPG INDUSTRIES INC	8,509	156.53	1,331,913.77	
PRAXAIR INC	17,642	117.59	2,074,522.78	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	4,515	105.43	476,016.45	
SEALED AIR CORP	11,574	26.09	301,965.66	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,235	183.71	961,721.85	
SIGMA-ALDRICH	7,174	82.34	590,707.16	
VULCAN MATERIALS CO	7,736	48.89	378,213.04	
3 M COMPANY	39,044	113.35	4,425,637.40	
AGCO CORP	6,228	52.74	328,464.72	
AMETEK INC	14,491	44.54	645,429.14	
BOEING CO	42,789	104.68	4,479,152.52	
CATERPILLAR	39,018	85.33	3,329,405.94	
CUMMINS INC	10,743	112.62	1,209,876.66	
DANAHER CORP	34,947	66.62	2,328,169.14	
DEERE&CO	22,043	83.91	1,849,628.13	
DOVER CORP	10,405	79.53	827,509.65	
EATON CORP	28,061	68.11	1,911,234.71	
EMERSON ELECTRIC CO	43,010	57.61	2,477,806.10	
FASTENAL CO	16,785	47.13	791,077.05	
FLOWERVE CORP	8,598	55.75	479,338.50	
FLUOR CORP	9,680	59.01	571,216.80	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,895	79.86	1,429,094.70	
GENERAL ELECTRIC CO	618,956	23.62	14,619,740.72	
GRAINGER (WW) INC	3,520	261.75	921,360.00	
HONEYWELL INTL INC	44,352	81.39	3,609,809.28	
ILLINOIS TOOL WORKS	25,545	71.14	1,817,271.30	
INGERSOLL-RAND PLC	17,650	58.03	1,024,229.50	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,267	55.98	462,786.66	

JOY GLOBAL INC	6,782	49.48	335,573.36	
KBR INC	9,414	32.47	305,672.58	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,355	88.57	474,292.35	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,332	109.57	1,789,497.24	
MASCO CORP	21,437	20.00	428,740.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,418	85.53	1,147,641.54	
PACCAR INC	21,555	54.96	1,184,662.80	
PALL CORP	6,617	69.35	458,888.95	
PARKER HANNIFIN CORP	8,885	98.01	870,818.85	
PENTAIR LTD	12,202	58.89	718,575.78	
PRECISION CASTPARTS CORP	8,723	233.93	2,040,571.39	
QUANTA SERVICES INC	13,188	27.16	358,186.08	
RAYTHEON COMPANY	19,439	67.44	1,310,966.16	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,327	88.16	734,108.32	
ROCKWELL COLLIN	7,819	66.45	519,572.55	
ROPER INDUSTRIES INC	5,890	128.46	756,629.40	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	35.96	251,720.00	
SPX CORP	2,519	74.39	187,388.41	
STANLEY BLACK&DECKER	9,068	80.58	730,699.44	
TEXTRON	16,174	26.89	434,918.86	
TRANSDIGM GROUP INC	2,832	159.80	452,553.60	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	51,869	98.02	5,084,199.38	
XYLEM INC	11,923	28.54	340,282.42	
ADT CORPORATION	13,832	42.02	581,220.64	
AVERY DENNISON CORP	5,957	45.00	268,065.00	
CINTAS CORP	6,706	47.22	316,657.32	
DUN & BRADSTREET CORP	2,435	102.92	250,610.20	
EQUIFAX INC	7,175	59.83	429,280.25	
IHS INC-CLASS A	3,625	107.79	390,738.75	
IRON MOUNTAIN INC	8,702	27.36	238,086.72	
MANPOWER GROUP	4,455	59.09	263,245.95	
NIELSEN HOLDINGS NV	13,430	34.23	459,708.90	
REPUBLIC SERVICES INC	17,278	34.78	600,928.84	
ROBERT HALF INTL INC	8,611	33.54	288,812.94	
STERICYCLE INC	5,128	114.15	585,361.20	
TYCO INTERNATIONAL LTD	27,758	35.32	980,412.56	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,032	61.50	555,468.00	
WASTE MANAGEMENT INC	26,324	41.24	1,085,601.76	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,593	58.39	560,135.27	
CSX CORP	60,803	24.06	1,462,920.18	
DELTA AIR LINES INC	12,452	19.33	240,697.16	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,300	39.66	487,818.00	
FEDEX CORP	17,794	103.15	1,835,451.10	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,843	26.30	627,070.90	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,871	76.35	448,250.85	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,561	114.95	754,186.95	
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,734	74.39	1,393,622.26	
SOUTHWEST AIRLINES CO	10,842	13.10	142,030.20	
UNION PACIFIC CORP	27,954	159.41	4,456,147.14	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	32.00	172,512.00	
UNITED PARCEL SERVICE B	43,503	89.73	3,903,524.19	
AUTOLIV INC	6,106	79.16	483,350.96	
BORGWARNER INC	7,364	86.73	638,679.72	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	18,500	53.78	994,930.00	
FORD MOTOR COMPANY	218,981	16.84	3,687,640.04	
GENERAL MOTORS CO	44,898	34.92	1,567,838.16	
HARLEY-DAVIDSON	13,516	54.20	732,567.20	
JOHNSON CONTROLS INC	40,882	36.25	1,481,972.50	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,054	69.26	488,560.04	
COACH INC	16,774	58.01	973,059.74	
DR HORTON INC	16,578	21.22	351,785.16	
FOSSIL GROUP INC	3,299	109.07	359,821.93	
GARMIN LTD	8,014	35.17	281,852.38	
HASBRO INC	6,870	47.23	324,470.10	
LEGGETT & PLATT INC	8,864	31.69	280,900.16	
LENNAR CORP-CL A	10,200	35.01	357,102.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,482	65.44	424,182.08	
MATTEL INC	20,582	46.39	954,798.98	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,720	113.42	421,922.40	
NEWELL RUBBERMAID	18,525	26.91	498,507.75	
NIKE B	42,770	63.93	2,734,286.10	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,200	98.61	414,162.00	
PULTE GROUP INC	22,200	19.05	422,910.00	
PVH CORP	4,650	130.86	608,499.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,911	177.63	694,710.93	
TOLL BROTHERS INC	9,562	32.95	315,067.90	

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,800	61.68	296,064.00	
VF CORP	5,268	198.48	1,045,592.64	
WHIRLPOOL CORP	5,027	114.29	574,535.83	
BLOCK H & R INC	17,408	29.21	508,487.68	
CARNIVAL CORPORATION	23,000	35.16	808,680.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,854	386.33	716,255.82	
DARDEN RESTAURANTS INC	8,264	51.89	428,818.96	
INT'L GAME TECHNOLOGY	16,160	17.21	278,113.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	24,626	53.11	1,307,886.86	
MARRIOTT INTL A	14,928	41.74	623,094.72	
MCDONALD'S CORP	59,908	99.99	5,990,200.92	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,672	34.75	336,102.00	
STARBUCKS CORP	44,764	68.13	3,049,771.32	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,573	66.19	766,016.87	
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,163	59.05	482,025.15	
WYNN RESORTS LTD	5,148	126.64	651,942.72	
YUM BRANDS INC	26,927	73.00	1,965,671.00	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	18.70	198,238.70	
CBS CORP-CL B	35,035	51.29	1,796,945.15	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,616	125.67	454,422.72	
COMCAST CORP-CL A	126,788	42.67	5,410,043.96	
COMCAST CORP-SPECIAL A	30,335	40.79	1,237,364.65	
DIRECTV	32,527	62.41	2,030,010.07	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	8,670	81.94	710,419.80	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,403	73.70	398,201.10	
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,629	41.74	568,874.46	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	26,860	15.36	412,569.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,258	77.93	955,265.94	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	9,451	73.04	690,301.04	
LIBERTY MEDIA CORP	5,649	134.14	757,756.86	
NEWS CORP-CLASS A	22,802	15.72	358,447.44	
OMNICOM GROUP	15,617	64.74	1,011,044.58	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	5,475	70.82	387,739.50	
SIRIUS XM RADIO INC	206,155	3.59	740,096.45	
THE WALT DISNEY CO	102,466	64.94	6,654,142.04	
TIME WARNER CABLE-A	17,654	114.06	2,013,615.24	
TIME WARNER INC	55,845	61.28	3,422,181.60	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	91,209	30.11	2,746,302.99	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	26,238	30.20	792,387.60	
VIACOM INC-CLASS B	26,514	69.08	1,831,587.12	
ADVANCE AUTO PARTS	4,623	83.20	384,633.60	
AMAZON.COM	21,724	291.51	6,332,763.24	
AUTOZONE INC	2,124	434.56	923,005.44	
BED BATH & BEYOND INC	14,108	75.57	1,066,141.56	
BEST BUY COMPANY INC	16,090	29.73	478,355.70	
CARMAX INC	14,687	48.67	714,816.29	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,200	49.25	305,350.00	
DOLLAR GENERAL CORP	18,572	51.80	962,029.60	
DOLLAR TREE INC	13,574	52.83	717,114.42	
EXPEDIA INC	6,277	63.03	395,639.31	
FAMILY DOLLAR STORES	6,337	63.95	405,251.15	
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,982	42.69	340,751.58	
GAP	18,617	43.94	818,030.98	
GENUINE PARTS CO	9,252	83.63	773,744.76	
HOME DEPOT	89,324	79.70	7,119,122.80	
J.C. PENNEY CO INC	11,122	17.05	189,630.10	
KOHL'S CORP	13,348	53.69	716,654.12	
L BRANDS INC	14,644	50.57	740,547.08	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	30,632	23.53	720,770.96	
LKQ CORP	19,000	26.30	499,700.00	
LOWES COMPANIES	66,313	43.81	2,905,172.53	
MACY'S INC	23,614	50.37	1,189,437.18	
NETFLIX INC	3,011	247.13	744,108.43	
NORDSTROM INC	9,415	62.67	590,038.05	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,007	116.51	816,385.57	
PETSMART INC	6,100	69.53	424,133.00	
PRICELINE.COM INC	3,141	897.06	2,817,665.46	
ROSS STORES INC	13,285	66.51	883,585.35	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,537	43.44	110,207.28	
STAPLES INC	40,259	16.31	656,624.29	
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,623	71.77	2,628,432.71	
TIFFANY & CO	8,110	75.53	612,548.30	
TJX COMPANIES INC	43,566	51.26	2,233,193.16	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,470	120.20	537,294.00	
TRIPADVISOR INC	6,995	62.74	438,866.30	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,800	99.53	378,214.00	

URBAN OUTFITTERS INC	7,459	41.95	312,905.05	
COSTCO WHOLESALE CORP	25,948	113.35	2,941,205.80	
CVS CAREMARK CORPORATION	73,335	60.15	4,411,100.25	
KROGER CO	30,429	37.15	1,130,437.35	
SAFEWAY INC	15,052	24.98	375,998.96	
SYSCO CORP	34,904	35.02	1,222,338.08	
WALGREEN CO	53,480	46.45	2,484,146.00	
WAL-MART STORES	99,742	77.03	7,683,126.26	
WHOLE FOODS MKT INC	22,402	54.71	1,225,613.42	
ALTRIA GROUP INC	119,716	36.27	4,342,099.32	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,229	35.72	1,401,259.88	
BEAM INC	9,155	63.23	578,870.65	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,852	69.66	546,970.32	
BUNGE LIMITED	9,331	73.72	687,881.32	
CAMPBELL SOUP CO (US)	11,922	45.34	540,543.48	
COCA-COLA CO	238,836	40.83	9,751,673.88	
COCA-COLA ENTERPRISES	15,650	35.75	559,487.50	
CONAGRA	26,013	35.56	925,022.28	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,671	51.26	495,735.46	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	11,655	46.60	543,123.00	
GENERAL MILLS INC	38,514	49.53	1,907,598.42	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	8,307	72.96	606,078.72	
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,250	90.81	839,992.50	
HORMEL FOODS CORP	9,753	39.77	387,876.81	
JM SMUCKER CO	6,389	104.62	668,417.18	
KELLOGG CO	16,009	65.92	1,055,313.28	
KRAFT FOODS GROUP INC	35,072	55.38	1,942,287.36	
LORILLARD INC	22,596	45.79	1,034,670.84	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,531	70.30	529,429.30	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	12,063	70.25	847,425.75	
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,347	50.33	420,104.51	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	100,627	29.03	2,921,201.81	
MONSTER BEVERAGE CORP	8,382	59.80	501,243.60	
PEPSICO INC	91,929	82.77	7,608,963.33	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	98,234	89.18	8,760,508.12	
REYNOLDS AMERICAN INC	19,762	50.20	992,052.40	
TYSON FOODS INC	18,671	26.32	491,420.72	
AVON PRODUCTS INC	27,701	21.96	608,313.96	

CHURCH & DWIGHT CO INC	8,912	62.43	556,376.16	
CLOROX COMPANY	7,719	85.13	657,118.47	
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,716	58.98	3,286,129.68	
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,136	104.97	434,155.92	
ESTEE LAUDER CO-CL A	14,127	66.59	940,716.93	
HERBALIFE LTD	5,219	48.90	255,209.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	23,088	98.53	2,274,860.64	
PROCTER & GAMBLE CO	163,052	79.57	12,974,047.64	
ABBOTT LABORATORIES	93,556	34.74	3,250,135.44	
AETNA INC	22,530	63.29	1,425,923.70	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,710	55.91	766,526.10	
BARD C R INC	5,008	108.45	543,117.60	
BAXTER INTERNATIONAL	32,518	71.45	2,323,411.10	
BECTON DICKINSON & CO	11,553	98.76	1,140,974.28	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	80,854	9.15	739,814.10	
CARDINAL HEALTH	20,303	48.01	974,747.03	
CAREFUSION CORP	13,118	37.31	489,432.58	
CERNER CORP	18,254	47.54	867,795.16	
CIGNA CORP	17,033	74.65	1,271,513.45	
COVIDIEN PLC	28,117	57.97	1,629,942.49	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	5,341	116.00	619,556.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	8,916	41.96	374,115.36	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,227	65.74	475,102.98	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	48,753	63.82	3,111,416.46	
HCA HOLDINGS INC	15,475	36.87	570,563.25	
HENRY SCHEIN INC	5,641	99.07	558,853.87	
HOLOGIC INC	16,992	18.69	317,580.48	
HUMANA INC	9,454	85.18	805,291.72	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,390	419.30	1,002,127.00	
LABORATORY CRP OF AMER	5,326	95.86	510,550.36	
MCKESSON CORP	13,872	116.01	1,609,290.72	
MEDTRONIC	60,241	52.88	3,185,544.08	
OMNICARE INC	7,014	48.98	343,545.72	
PATTERSON COMPANIES INC	6,126	38.55	236,157.30	
QUEST DIAGNOSTICS	10,148	58.00	588,584.00	
RESMED INC	8,978	43.79	393,146.62	
ST JUDE MEDICAL INC	16,849	47.37	798,137.13	
STRYKER CORP	18,132	66.07	1,197,981.24	

UNITEDHEALTH GROUP INC	61,049	67.97	4,149,500.53	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,099	66.30	470,663.70	
WELLPOINT INC	18,110	84.09	1,522,869.90	
ZIMMER HOLDINGS INC	10,087	76.88	775,488.56	
ABBVIE INC	94,152	43.32	4,078,664.64	
ACTAVIS INC	7,614	125.71	957,155.94	
AGILENT TECHNOLOGIES	20,667	44.60	921,748.20	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,628	95.73	1,113,148.44	
ALLERGAN INC	17,732	87.25	1,547,117.00	
AMGEN	44,580	98.29	4,381,768.20	
BIOGEN IDEC INC	14,029	219.40	3,077,962.60	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,511	59.44	446,453.84	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	97,528	44.54	4,343,897.12	
CELGENE CORP	24,942	124.66	3,109,269.72	
FOREST LABORATORIES INC	14,275	42.60	608,115.00	
GILEAD SCIENCES INC	90,642	54.37	4,928,205.54	
HOSPIRA INC	10,412	39.44	410,649.28	
ILLUMINA INC	7,915	73.95	585,314.25	
JOHNSON & JOHNSON	166,898	88.88	14,833,894.24	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	10,149	74.40	755,085.60	
LILLY (ELI) & CO	60,814	51.79	3,149,557.06	
MERCK & CO	180,683	47.62	8,604,124.46	
MYLAN INC	23,561	31.18	734,631.98	
ONYX PHARMACEUTICALS INC	4,289	135.18	579,787.02	
PERRIGO CO	5,318	126.42	672,301.56	
PFIZER	399,159	28.35	11,316,157.65	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,545	235.70	1,071,256.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,302	87.27	1,859,025.54	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,996	79.99	1,039,550.04	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	14,903	19.85	295,824.55	
WATERS CORP	5,509	102.19	562,964.71	
ZOETIS INC	29,863	30.98	925,155.74	
BB&T CORP	41,689	35.05	1,461,199.45	
CIT GROUP INC	12,244	49.17	602,037.48	
COMERICA INC	12,167	42.54	517,584.18	
FIFTH THIRD BANCORP	52,136	18.80	980,156.80	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,400	39.64	253,696.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	9.73	320,613.23	

KEY CORP	55,029	11.88	653,744.52	
M & T BANK CORP	7,259	117.57	853,440.63	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,108	14.59	410,095.72	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,088	15.29	337,725.52	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,476	76.26	2,400,359.76	
REGIONS FINL CORP	84,188	10.20	858,717.60	
SUNTRUST BANKS	32,102	34.33	1,102,061.66	
US BANCORP	110,991	37.29	4,138,854.39	
WELLS FARGO & CO	298,259	42.70	12,735,659.30	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,300	166.41	549,153.00	
AMERICAN EXPRESS	59,218	77.61	4,595,908.98	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,120	84.92	1,029,230.40	
BANK NEW YORK CO	69,211	29.34	2,030,650.74	
BANK OF AMERICA CORP	644,503	13.53	8,720,125.59	
BLACKROCK INC	8,099	263.38	2,133,114.62	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,681	65.53	2,272,645.93	
CITIGROUP	181,002	50.21	9,088,110.42	
CME GROUP INC	18,876	76.70	1,447,789.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,508	50.28	1,483,662.24	
EATON VANCE CORP	7,818	38.81	303,416.58	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,228	139.46	1,147,476.88	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,341	156.94	4,133,956.54	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,327	175.35	758,739.45	
INVESCO LTD	26,264	32.05	841,761.20	
JPMORGAN CHASE & CO	227,981	54.89	12,513,877.09	
LEGG MASON INC	7,601	31.68	240,799.68	
LEUCADIA NATIONAL CORP	18,488	26.10	482,536.80	
MCGRAW-HILL FINANCIAL	16,178	55.51	898,040.78	
MOODY'S CORP	11,940	61.66	736,220.40	
MORGAN STANLEY	87,616	25.44	2,228,951.04	
NASDAQ OMX GROUP	7,871	33.22	261,474.62	
NORTHERN TRUST CORP	13,902	61.13	849,829.26	
NYSE EURONEXT	15,717	41.02	644,711.34	
PRICE T ROWE GROUP INC	15,359	76.57	1,176,038.63	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,476	44.48	332,532.48	
SCHWAB (CHARLES) CORP	69,374	22.20	1,540,102.80	
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,731	29.71	259,398.01	
SLM CORP	27,003	23.27	628,359.81	

STATE STREET CORP	27,214	68.83	1,873,139.62	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	15,221	26.33	400,768.93	
ACE LTD	20,211	92.38	1,867,092.18	
AFLAC	27,861	58.52	1,630,425.72	
ALLEGHANY CORP	1,001	398.91	399,308.91	
ALLSTATE CORP	28,439	50.55	1,437,591.45	
AMERICAN INT'L GROUP	83,539	45.78	3,824,415.42	
AON PLC	17,631	65.37	1,152,538.47	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,772	52.41	459,740.52	
ASSURANT INC	5,682	52.41	297,793.62	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,195	46.43	334,063.85	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	63,717	115.80	7,378,428.60	
CHUBB CORPORATION	15,545	87.00	1,352,415.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,869	48.10	474,698.90	
EVEREST RE GROUP LTD	3,222	126.85	408,710.70	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	23.92	310,314.16	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,705	31.55	779,442.75	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,170	39.44	637,744.80	
LOEWS CORP	20,311	45.27	919,478.97	
MARSH & MCLENNAN COS	32,664	40.84	1,333,997.76	
METLIFE INC	55,368	48.78	2,700,851.04	
PARTNERRE LTD	3,128	90.05	281,676.40	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17,476	38.66	675,622.16	
PROGRESSIVE CORP	34,174	26.11	892,283.14	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	27,578	78.10	2,153,841.80	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,172	85.90	272,474.80	
TORCHMARK CORP	5,579	68.06	379,706.74	
TRAVELERS COS INC/THE	22,513	82.05	1,847,191.65	
UNUM GROUP	17,659	31.42	554,845.78	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,123	41.78	464,718.94	
WR BERKLEY CORP	8,075	42.85	346,013.75	
XL GROUP PLC	17,569	31.34	550,612.46	
CBRE GROUP INC-A	16,741	23.51	393,580.91	
REALOGY HOLDINGS CORP	6,927	47.76	330,833.52	
WEYERHAEUSER CO	32,480	28.73	933,150.40	
ACCENTURE PLC-CL A	38,379	74.10	2,843,883.90	
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,926	14.90	416,097.40	
ADOBE SYSTEMS INC	28,381	47.26	1,341,286.06	

AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,333	43.56	493,665.48	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,162	183.78	581,112.36	
ANSYS INC	5,900	75.94	448,046.00	
AUTODESK INC	14,251	34.39	490,091.89	
AUTOMATIC DATA PROCESS	28,890	71.04	2,052,345.60	
BMC SOFTWARE	7,660	45.46	348,223.60	
CA INC	20,690	29.07	601,458.30	
CITRIX SYSTEMS INC	11,103	64.14	712,146.42	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,975	66.55	1,196,236.25	
COMPUTER SCIENCES CORP	9,142	47.28	432,233.76	
EBAY	69,503	54.49	3,787,218.47	
ELECTRONIC ARTS INC	20,059	23.56	472,590.04	
EQUINIX INC	3,100	187.04	579,824.00	
FACEBOOK INC-A	95,302	25.46	2,426,388.92	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,541	44.43	779,346.63	
FISERV INC	7,952	89.56	712,181.12	
GOOGLE INC-CL A	15,933	905.24	14,423,188.92	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	63,066	191.30	12,064,525.80	
INTUIT INC	16,772	63.24	1,060,661.28	
LINKEDIN CORP - A	5,200	189.34	984,568.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	6,323	593.59	3,753,269.57	
MICROSOFT CORP	473,980	34.35	16,281,213.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,487	19.02	294,562.74	
ORACLE CORP	225,597	31.51	7,108,561.47	
PAYCHEX INC	19,498	38.15	743,848.70	
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	41.79	288,351.00	
RED HAT INC	12,093	48.14	582,157.02	
SAIC INC	19,851	14.11	280,097.61	
SALESFORCE.COM INC	33,752	38.72	1,306,877.44	
SYMANTEC CORP	41,051	22.85	938,015.35	
SYNOPSYS INC	9,382	36.24	340,003.68	
TERADATA CORP	10,792	51.76	558,593.92	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	25.28	288,874.56	
VERISIGN INC	9,971	45.28	451,486.88	
VISA INC-CLASS A SHARES	31,532	187.20	5,902,790.40	
VMWARE INC-CLASS A	5,218	66.13	345,066.34	
WESTERN UNION CO	33,878	17.21	583,040.38	

YAHOO	59,038	26.67	1,574,543.46	
AMPHENOL CORPORATION	9,512	81.75	777,606.00	
APPLE INC	56,045	422.12	23,657,715.40	
ARROW ELECTRONICS INC	6,842	41.07	281,000.94	
AVNET INC	8,881	34.99	310,746.19	
CISCO SYSTEMS	317,596	25.14	7,984,363.44	
CORNING	87,703	14.77	1,295,373.31	
DELL INC	88,025	13.36	1,176,014.00	
EMC CORP	125,500	24.79	3,111,145.00	
F5 NETWORKS INC	5,014	69.33	347,620.62	
FLEXTRONICS INTL LTD	42,618	7.79	331,994.22	
FLIR SYSTEMS INC	8,635	28.77	248,428.95	
HARRIS CORP	7,124	49.90	355,487.60	
HEWLETT-PACKARD CO	116,313	25.47	2,962,492.11	
JUNIPER NETWORKS INC	30,344	19.67	596,866.48	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,795	58.03	858,553.85	
NETAPP INC	21,467	38.66	829,914.22	
QUALCOMM	102,339	59.39	6,077,913.21	
SANDISK CORP	14,405	59.80	861,419.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,238	45.73	879,753.74	
TE CONNECTIVITY LTD	25,033	46.57	1,165,786.81	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,000	27.25	436,000.00	
WESTERN DIGITAL CORP	12,902	66.20	854,112.40	
XEROX CORP	69,252	9.40	650,968.80	
AT&T INC	329,402	35.60	11,726,711.20	
CENTURYLINK INC	37,539	35.39	1,328,505.21	
CROWN CASTLE INTL CORP	17,584	72.69	1,278,180.96	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	63,307	3.99	252,594.93	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,748	74.37	576,218.76	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	180,594	7.06	1,274,993.64	
T-MOBILE US INC	10,975	24.09	264,387.75	
VERIZON COMMUNICATIONS	171,447	50.96	8,736,939.12	
WINDSTREAM CORP	38,003	7.98	303,263.94	
AES CORP	40,707	12.03	489,705.21	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,120	51.03	363,333.60	
AMEREN CORPORATION	15,296	34.36	525,570.56	
AMERICAN ELECTRIC POWER	28,929	44.57	1,289,365.53	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,567	41.46	438,107.82	

CALPINE CORP	20,101	21.01	422,322.01	
CENTERPOINT ENERGY INC	25,554	23.86	609,718.44	
CMS ENERGY CORP	16,700	27.45	458,415.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	17,445	57.88	1,009,716.60	
DOMINION RESOURCES	34,328	57.34	1,968,367.52	
DTE ENERGY COMPANY	11,016	66.83	736,199.28	
DUKE ENERGY CORP	41,972	68.16	2,860,811.52	
EDISON INTL	18,436	47.13	868,888.68	
ENTERGY CORP	10,608	69.14	733,437.12	
EXELON CORP	52,124	30.81	1,605,940.44	
FIRSTENERGY CORP	24,911	36.81	916,973.91	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,934	59.02	291,204.68	
MDU RESOURCES GROUP INC	12,623	27.43	346,248.89	
NEXTERA ENERGY INC	24,838	81.35	2,020,571.30	
NISOURCE INC	18,279	29.71	543,069.09	
NORTHEAST UTILITIES	18,723	42.19	789,923.37	
NRG ENERGY INC	17,935	27.65	495,902.75	
OGE ENERGY CORP	12,400	34.93	433,132.00	
ONEOK INC	12,458	42.63	531,084.54	
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	19.60	281,730.40	
PG&E CORP	26,134	45.37	1,185,699.58	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,000	56.78	397,460.00	
PPL CORPORATION	34,717	29.90	1,038,038.30	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	30,137	32.27	972,520.99	
SCANA CORP	7,835	50.11	392,611.85	
SEMPRA ENERGY	13,767	80.96	1,114,576.32	
SOUTHERN CO	51,760	44.12	2,283,651.20	
WISCONSIN ENERGY CORP	14,762	41.37	610,703.94	
XCEL ENERGY INC	29,084	28.85	839,073.40	
ALTERA CORPORATION	20,453	33.59	687,016.27	
ANALOG DEVICES	19,122	46.26	884,583.72	
APPLIED MATERIALS	71,480	15.65	1,118,662.00	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,410	37.58	579,107.80	
BROADCOM CORP-CL A	30,854	33.67	1,038,854.18	
CREE INC	7,602	68.55	521,117.10	
INTEL CORP	294,606	23.14	6,817,182.84	
KLA-TENCOR CORP	10,643	58.15	618,890.45	
LAM RESEARCH CORP	9,670	47.47	459,034.90	

	LINEAR TECHNOLOGY CORP	14,528	37.60	546,252.80	
	LSI CORP	39,045	7.29	284,638.05	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,622	11.72	358,889.84	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,304	27.73	507,569.92	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,179	37.80	460,366.20	
	MICRON TECHNOLOGY	63,987	13.14	840,789.18	
	NVIDIA CORP	39,713	14.24	565,513.12	
	TEXAS INSTRUMENTS	65,806	36.24	2,384,809.44	
	XILINX INC	16,448	40.15	660,387.20	
	アメリカドル小計	18,360,538		906,835,631.14 (91,717,355,733)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	6,922	36.91	255,491.02	
	ARC RESOURCES LTD	18,664	27.86	519,979.04	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	6.85	137,369.90	
	BAYTEX ENERGY CORP	7,544	40.88	308,398.72	
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,435	13.93	145,359.55	
	CAMECO CORP	23,549	23.12	544,452.88	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	64,900	31.97	2,074,853.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,862	19.81	571,756.22	
	CENOVUS ENERGY INC	44,478	31.65	1,407,728.70	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,215	36.80	817,512.00	
	ENBRIDGE	45,292	45.38	2,055,350.96	
	ENCANA CORP	43,667	17.95	783,822.65	
	ENERPLUS CORP	10,454	16.08	168,100.32	
	HUSKY ENERGY INC	20,481	28.39	581,455.59	
	IMPERIAL OIL	17,670	42.58	752,388.60	
	KEYERA CORP	4,636	58.47	271,066.92	
	MEG ENERGY CORP	9,188	30.93	284,184.84	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	19,359	18.32	354,656.88	
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,567	33.10	581,467.70	
	PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	5.21	163,984.75	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	29,712	11.68	347,036.16	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,413	32.09	269,973.17	
	SUNCOR ENERGY	89,157	31.98	2,851,240.86	
	TALISMAN ENERGY INC	61,047	12.25	747,825.75	
	TOURMALINE OIL CORP	8,740	44.08	385,259.20	
	TRANSCANADA CORP	41,816	46.86	1,959,497.76	
	VERMILION ENERGY INC	6,014	52.91	318,200.74	

AGNICO EAGLE MINES	11,012	28.75	316,595.00	
AGRIUM INC	8,901	96.55	859,391.55	
BARRICK GOLD CORP	59,366	14.66	870,305.56	
ELDORADO GOLD CORP	43,374	6.41	278,027.34	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,423	15.70	524,741.10	
FRANCO-NEVADA CORP	9,327	36.25	338,103.75	
GOLDCORP INC	47,438	25.47	1,208,245.86	
KINROSS GOLD CORP	67,919	4.81	326,690.39	
NEW GOLD INC	29,614	6.76	200,190.64	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	50,564	41.60	2,103,462.40	
SILVER WHEATON CORP	22,252	20.44	454,830.88	
TECK RESOURCES LTD-CL B	33,778	22.39	756,289.42	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	25,654	6.27	160,850.58	
YAMANA GOLD INC	47,211	9.59	452,753.49	
BOMBARDIER B	85,798	4.83	414,404.34	
CAE INC	16,121	11.34	182,812.14	
FINNING INTERNATIONAL INC	10,988	22.57	247,999.16	
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,386	44.64	418,991.04	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,042	103.94	2,602,865.48	
CP RAILWAY LIMITED	10,245	128.48	1,316,277.60	
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,795	76.43	1,054,351.85	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,836	43.03	294,153.08	
TIM HORTONS INC	9,165	58.33	534,594.45	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22,741	25.47	579,213.27	
THOMSON REUTERS CORP	22,240	35.00	778,400.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,643	82.21	381,701.03	
DOLLARAMA INC	4,200	75.51	317,142.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,961	58.35	464,524.35	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	79.88	167,108.96	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,078	46.29	327,640.62	
METRO INC	5,624	70.11	394,298.64	
SHOPPERS DRUG MART CORP	12,155	48.47	589,152.85	
WESTON (GEORGE) LTD	3,224	82.10	264,690.40	
SAPUTO INC	7,636	46.60	355,837.60	
CATAMARAN CORPORATION	12,239	50.40	616,845.60	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	17,151	94.59	1,622,313.09	
BANK MONTREAL	38,837	62.57	2,430,031.09	

	BANK NOVA SCOTIA	71,001	55.87	3,966,825.87	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	23,943	74.78	1,790,457.54	
	NATIONAL BANK OF CANADA	9,662	75.31	727,645.22	
	ROYAL BANK OF CANADA	86,150	61.54	5,301,671.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	54,940	84.43	4,638,584.20	
	CI FINANCIAL CORP	9,764	30.78	300,535.92	
	IGM FINANCIAL INC	6,534	46.20	301,870.80	
	ONEX CORP	5,804	48.51	281,552.04	
	GREAT-WEST LIFECO INC	16,992	30.71	521,824.32	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	43.08	264,812.76	
	INTACT FINANCIAL CORP	8,262	59.43	491,010.66	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	108,467	17.98	1,950,236.66	
	POWER CORP OF CANADA	20,816	28.97	603,039.52	
	POWER FINANCIAL CORP	14,791	31.86	471,241.26	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	35,735	32.55	1,163,174.25	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	33,170	38.44	1,275,054.80	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	17,731	17.41	308,696.71	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	17.90	99,058.60	
	CGI GROUP INC - CL A	13,049	30.40	396,689.60	
	OPEN TEXT CORP	3,673	73.25	269,047.25	
	RESEARCH IN MOTION	28,099	10.20	286,609.80	
	BCE INC	15,348	43.33	665,028.84	
	BELL ALIANT INC	5,225	28.11	146,874.75	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,190	40.71	862,644.90	
	TELUS CORP	16,454	31.72	521,920.88	
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	43.77	175,080.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,264	36.36	264,119.04	
	FORTIS INC	11,903	32.42	385,895.26	
	TRANSALTA CORP	15,621	14.50	226,504.50	
	カナダドル小計	2,234,610		73,521,947.43 (7,060,312,611)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	18.04	153,141.56	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	65,165	12.62	822,382.30	
	SANTOS	57,269	13.68	783,439.92	
	WHITEHAVEN COAL LTD	33,110	2.19	72,510.90	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	39,261	36.59	1,436,559.99	
	WORLEYPARSONS LTD	13,182	20.20	266,276.40	

ALUMINA LIMITED	163,150	1.03	168,044.50	
AMCOR	71,875	10.74	771,937.50	
BHP BILLITON LTD	191,303	31.61	6,047,087.83	
BORAL LIMITED	48,581	4.27	207,440.87	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,738	3.33	298,827.54	
ILUKA RESOURCES LTD	26,815	10.50	281,557.50	
INCITEC PIVOT LTD	102,417	2.87	293,936.79	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,080	9.51	267,040.80	
NEWCREST MINING LIMITED	45,621	9.74	444,348.54	
ORICA LTD	21,846	20.57	449,372.22	
RIO TINTO LTD	25,956	52.04	1,350,750.24	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,493	16.96	161,001.28	
ALS LTD	21,808	9.10	198,452.80	
BRAMBLES LTD	92,722	9.31	863,241.82	
SEEK LTD	19,117	9.20	175,876.40	
ASCIANO GROUP	61,334	4.98	305,443.32	
AURIZON HOLDINGS LTD	116,346	4.29	499,124.34	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.32	101,836.68	
TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.35	223,132.45	
TRANSURBAN GROUP	84,248	6.80	572,886.40	
CROWN LTD	25,191	12.68	319,421.88	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	47,591	2.86	136,110.26	
FLIGHT CENTRE LTD	3,263	43.84	143,049.92	
TABCORP HOLDINGS	45,765	3.28	150,109.20	
TATTS GROUP LTD	87,285	3.17	276,693.45	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	2.50	77,030.00	
METCASH LTD	55,380	3.53	195,491.40	
WESFARMERS LIMITED	59,961	39.48	2,367,260.28	
WOOLWORTHS LTD	74,028	33.23	2,459,950.44	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	34,047	12.61	429,332.67	
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	5.85	225,529.20	
COCHLEAR LIMITED	3,583	61.04	218,706.32	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,412	35.91	302,074.92	
SONIC HEALTHCARE LTD	23,448	14.61	342,575.28	
CSL LIMITED	29,675	64.66	1,918,785.50	
AUST AND NZ BANKING GROUP	163,421	28.66	4,683,645.86	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,405	10.35	262,941.75	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	95,850	70.14	6,722,919.00	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK	139,515	29.42	4,104,531.30	
	WESTPAC BANKING	184,872	28.95	5,352,044.40	
	ASX LTD	10,432	34.40	358,860.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	18,200	43.51	791,882.00	
	AMP LTD	174,549	4.40	768,015.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	123,836	5.59	692,243.24	
	QBE INSURANCE GROUP	71,284	16.50	1,176,186.00	
	SUNCORP GROUP LIMITED	76,636	11.87	909,669.32	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,469	9.96	283,551.24	
	TELSTRA CORP	259,408	4.76	1,234,782.08	
	AGL ENERGY LTD	32,770	14.75	483,357.50	
	SP AUSNET	117,439	1.17	137,990.82	
	オーストラリアドル小計	3,644,861		54,740,392.52 (5,071,149,963)	
イギリスポ ド	AMEC PLC	17,698	10.40	184,059.20	
	BG GROUP	202,669	11.55	2,340,826.95	
	BP PLC	1,141,569	4.64	5,306,012.71	
	PETROFAC LTD	16,614	12.84	213,323.76	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	224,700	21.61	4,856,890.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	155,708	22.47	3,498,758.76	
	TULLOW OIL PLC	54,074	10.67	576,969.58	
	ANGLO AMERICAN PLC	82,989	12.82	1,063,918.98	
	ANTOFAGASTA PLC	25,255	8.17	206,459.62	
	BHP BILLITTON PLC	125,757	17.29	2,174,967.31	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	25.99	225,203.35	
	FRESNILLO PLC	11,483	9.51	109,203.33	
	GLENCORE XSTRATA PLC	595,307	2.64	1,573,098.74	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,206	28.34	345,918.04	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,212	42.13	219,581.56	
	REXAM	50,567	4.78	241,963.09	
	RIO TINTO PLC REG	75,691	27.36	2,071,284.21	
	VEDANTA RESOURCES PLC	6,684	10.94	73,122.96	
	BAE SYSTEMS PLC	193,449	4.18	808,810.26	
	BUNZL PLC	20,845	13.77	287,035.65	
COBHAM PLC	67,822	2.81	190,986.75		
IMI PLC	19,153	13.47	257,990.91		
INVENSYS PLC	41,689	4.37	182,305.99		
MEGGITT PLC	49,194	5.56	273,764.61		

MELROSE INDUSTRIES PLC	77,063	2.73	210,381.99	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	111,994	12.04	1,348,407.76	
SMITHS GROUP PLC	23,431	13.71	321,239.01	
TRAVIS PERKINS PLC	14,589	16.22	236,633.58	
WEIR GROUP PLC/THE	12,658	21.62	273,665.96	
WOLSELEY LTD	16,321	32.91	537,124.11	
AGGREKO PLC	15,998	18.03	288,443.94	
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,654	11.73	265,731.42	
CAPITA GROUP PLC	39,034	10.23	399,317.82	
EXPERIAN PLC	60,166	11.87	714,170.42	
G4S PLC	88,705	2.29	203,577.97	
INTERTEK GROUP PLC	9,579	31.00	296,949.00	
SERCO GROUP PLC	31,919	6.82	217,687.58	
EASYJET PLC	9,444	13.35	126,077.40	
NEW GKN	97,251	3.32	323,262.32	
BURBERRY GROUP PLC	26,334	14.40	379,209.60	
PERSIMMON PLC	18,044	12.73	229,700.12	
CARNIVAL PLC	11,677	24.43	285,269.11	
COMPASS GROUP PLC	108,996	8.88	967,884.48	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,984	19.50	311,688.00	
TUI TRAVEL PLC	30,444	3.76	114,652.10	
WHITBREAD PLC	10,679	31.54	336,815.66	
WILLIAM HILL	51,392	4.64	238,458.88	
BRITISH SKY BROADCASTING	62,628	8.19	513,236.46	
ITV PLC	221,382	1.50	332,515.76	
PEARSON	48,692	12.21	594,529.32	
REED ELSEVIER PLC	71,114	7.88	560,378.32	
WPP PLC	75,317	11.71	881,962.07	
KINGFISHER PLC	141,309	3.75	530,473.98	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	96,106	4.53	435,552.39	
NEXT PLC	9,604	47.70	458,110.80	
MORRISON SUPERMARKETS	131,478	2.78	365,508.84	
SAINSBURY (J) PLC	77,167	3.76	290,302.25	
TESCO	479,771	3.43	1,648,493.15	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,220	18.20	386,204.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,949	35.53	4,084,137.97	
COCA-COLA HBC AG-CDI	12,699	17.02	216,136.98	
DIAGEO	149,473	19.97	2,984,975.81	

IMPERIAL-TOBACCO GROUP	58,415	23.40	1,366,911.00
SABMILLER PLC	57,077	32.59	1,860,139.43
TATE & LYLE	27,775	8.81	244,697.75
UNILEVER PLC	76,449	27.62	2,111,521.38
RECKITT BENCKISER PLC	38,511	49.23	1,895,896.53
SMITH & NEPHEW PLC	53,914	7.68	414,329.09
ASTRAZENECA	74,346	32.81	2,439,663.99
GLAXOSMITHKLINE	292,249	17.39	5,082,210.11
SHIRE PLC	33,194	21.99	729,936.06
BARCLAYS	735,885	3.02	2,224,948.29
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,113,004	7.25	8,073,731.01
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,753,130	0.66	1,826,701.75
ROYAL BANK OF SCOTLAND	126,708	3.04	385,699.15
STANDARD CHARTERED PLC	145,296	15.13	2,198,328.48
3I GROUP PLC	62,671	3.67	230,127.91
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,623	3.99	222,269.50
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,852	9.51	122,286.78
ICAP PLC	38,331	4.00	153,324.00
INVESTEC PLC	34,476	4.30	148,246.80
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	11,371	14.99	170,451.29
SCHRODERS PLC	6,124	24.08	147,465.92
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	13.52	155,872.08
AVIVA PIC	177,394	3.65	647,842.88
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,676	2.25	111,920.02
LEGAL & GENERAL GROUP	356,036	1.85	660,802.81
OLD MUTUAL PLC	294,642	1.93	570,721.55
PRUDENTIAL	153,982	11.18	1,721,518.76
RESOLUTION LTD	89,799	3.06	274,874.73
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	229,194	1.24	286,263.30
STANDARD LIFE PLC	141,984	3.80	540,533.08
SAGE GROUP PLC	67,266	3.64	245,117.30
BT GROUP PLC	471,878	3.34	1,576,072.52
INMARSAT PLC	28,187	6.71	189,275.70
VODAFONE GROUP PLC	2,929,683	1.93	5,682,120.17
CENTRICA PLC	309,561	3.77	1,169,521.45
NATIONAL GRID PLC	218,288	7.58	1,654,623.04
SEVERN TRENT PLC	14,198	17.36	246,477.28
SSE PLC	57,087	15.99	912,821.13

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	40,616	7.16	290,810.56	
	ARM HOLDINGS PLC	83,182	8.63	717,860.66	
	イギリスポンド小計	17,353,848		99,895,258.39 (15,003,268,857)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	21,416	47.40	1,015,118.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	575	294.25	169,193.75	
	GIVAUDAN-REG	495	1,279.00	633,105.00	
	HOLCIM LTD	13,638	66.45	906,245.10	
	SIKA AG-BR	138	2,549.00	351,762.00	
	SYNGENTA AG	5,547	388.20	2,153,345.40	
	ABB LTD	130,983	21.08	2,761,121.64	
	GEBERIT AG-REG	2,362	247.80	585,303.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,379	132.80	183,131.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,895	137.10	396,904.50	
	SULZER AG-REG	1,508	163.60	246,708.80	
	ADECCO	7,891	56.75	447,814.25	
	SGS SA	326	2,150.00	700,900.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,458	112.90	390,408.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	31,093	88.35	2,747,066.55	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,837	546.00	1,003,002.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,730	95.50	260,715.00	
	ARYZTA AG	5,586	54.10	302,202.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	877.00	115,764.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	56	3,680.00	206,080.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	43,000.00	258,000.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	192,083	63.20	12,139,645.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,090	105.50	325,995.00	
	ACTELION LTD-REG	6,418	59.90	384,438.20	
	LONZA GROUP AG-REG	3,389	75.00	254,175.00	
	NOVARTIS	137,014	69.10	9,467,667.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	41,848	243.80	10,202,542.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	213	487.50	103,837.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	90,217	26.53	2,393,457.01	
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,983	38.74	541,701.42	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	65.70	123,516.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,099	271.50	298,378.50	
UBS AG-REG	219,419	16.63	3,648,937.97		
BALOISE HOLDING AG	3,007	97.95	294,535.65		

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,929	163.10	314,619.90	
	SWISS RE LTD	21,205	71.40	1,514,037.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,930	253.90	2,267,327.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,464	69.70	241,440.80	
	SWISSCOM	1,396	420.80	587,436.80	
	スイスフラン小計	984,635		60,937,581.14 (6,327,149,049)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	35,500	24.75	878,625.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	124,000	84.00	10,416,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	101,000	11.62	1,173,620.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	13.36	1,095,520.00	
	MTR CORP	92,500	28.30	2,617,750.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	47.25	685,125.00	
	LI & FUNG	346,800	11.02	3,821,736.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	19.78	919,770.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	125,000	35.55	4,443,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	59,600	20.30	1,209,880.00	
	SANDS CHINA LTD	144,000	36.40	5,241,600.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	13.38	1,311,240.00	
	SJM HOLDINGS LTD	124,000	17.54	2,174,960.00	
	WYNN MACAU LTD	98,000	20.25	1,984,500.00	
	BANK EAST ASIA	76,960	27.50	2,116,400.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	220,000	23.35	5,137,000.00	
	HANG SENG BANK	45,500	114.40	5,205,200.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	8.62	1,103,360.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	65,000	116.40	7,566,000.00	
	AIA GROUP LTD	717,200	33.30	23,882,760.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	81,000	103.50	8,383,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	133,000	25.60	3,404,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	66,000	47.30	3,121,800.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	33.70	1,348,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	30.50	1,174,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	236,500	10.64	2,516,360.00	
	SINO LAND CO	183,400	10.58	1,940,372.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	93,000	98.75	9,183,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	93.25	3,776,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	75,000	22.55	1,691,250.00	
	WHARF HOLDINGS	90,000	64.85	5,836,500.00	

	WHEELLOCK & CO LTD	59,000	39.50	2,330,500.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	43,500	38.35	1,668,225.00	
	PCCW LTD	292,000	3.53	1,030,760.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	53.00	1,643,000.00	
	CLP HOLDINGS	105,000	62.55	6,567,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	339,967	19.40	6,595,359.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	81,000	68.60	5,556,600.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	80.65	1,112,970.00	
	香港ドル小計	4,786,227		151,867,167.80 (1,980,347,868)	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	85,300	10.56	900,768.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	0.93	211,447.59	
	SENBCORP INDUSTRIES LTD	63,000	5.05	318,150.00	
	SENBCORP MARINE LTD	54,000	4.42	238,680.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	98,000	4.04	395,920.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	0.84	112,385.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.90	249,555.00	
	SINGAPORE AIRLINES	33,533	10.09	338,347.97	
	GENTING SINGAPORE PLC	363,000	1.35	490,050.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	103,000	4.26	438,780.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	41.20	247,200.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	87,000	1.60	139,635.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	444,000	0.56	248,640.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	123,000	3.11	382,530.00	
	DBS GROUP	101,000	15.95	1,610,950.00	
	OCBC BANK	153,000	9.95	1,522,350.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	75,000	20.08	1,506,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	54,000	7.40	399,600.00	
	CAPITALAND LTD	152,500	3.06	466,650.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	79,000	1.84	145,755.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.78	258,720.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	182,000	2.88	524,160.00	
	KEPPEL LAND LTD	50,000	3.38	169,000.00	
UOL GROUP LIMITED	31,300	6.62	207,206.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	474,243	3.73	1,768,926.39		
STARHUB LTD	38,000	4.14	157,320.00		
	シンガポールドル小計	3,365,239		13,448,725.95 (1,064,063,197)	

ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,789	8.51	347,114.39	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.98	201,932.26	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	4.27	180,018.93	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.30	248,473.60	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.39	137,461.17	
ニュージーランドドル小計		284,132		1,115,000.35 (88,341,477)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,993	138.20	1,933,832.60	
	BOLIDEN AB	17,199	83.35	1,433,536.65	
	ALFA LAVAL AB	18,739	145.90	2,734,020.10	
	ASSA ABLOY B	19,900	275.70	5,486,430.00	
	ATLAS COPCO A	39,998	165.30	6,611,669.40	
	ATLAS COPCO B	23,243	148.00	3,439,964.00	
	SANDVIK AB	63,102	81.95	5,171,208.90	
	SCANIA AB-B SHS	19,061	139.40	2,657,103.40	
	SKANSKA B	23,892	115.60	2,761,915.20	
	SKF AB-B	23,353	163.50	3,818,215.50	
	VOLVO B	87,725	89.15	7,820,683.75	
	SECURITAS B	19,690	60.50	1,191,245.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,127	168.20	2,544,361.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,855	36.10	933,365.50	
	HENNES & MAURITZ B	55,505	235.60	13,076,978.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,270	243.10	2,982,837.00	
	SCA SV CELLULOZA B	34,723	172.00	5,972,356.00	
	ELEKTA AB-B SHS	23,603	107.20	2,530,241.60	
	GETINGE AB-B SHS	12,818	215.10	2,757,151.80	
	NORDEA BANK AB	157,626	77.50	12,216,015.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	91,014	67.85	6,175,299.90	
	SVENSKA HANDELSBK A	29,383	283.80	8,338,895.40	
	SWEDBANK AB-A	53,715	158.70	8,524,570.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	115.30	859,330.90	
	INVESTOR AB-B SHS	27,426	193.10	5,295,960.60	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,279	195.40	2,594,716.60	
RATOS AB-B SHS	12,127	53.30	646,369.10		
ERICSSON (LM) B	179,367	78.60	14,098,246.20		
HEXAGON AB-B SHS	14,104	187.80	2,648,731.20		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,975	495.30	1,968,817.50		
TELE2 AB-B SHS	20,353	81.35	1,655,716.55		

	TELIASONERA AB	138,656	45.50	6,308,848.00	
スウェーデンクローナ小計		1,298,274		147,188,633.25 (2,188,694,976)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	10,529	82.60	869,695.40	
	SEADRILL LTD	22,539	255.50	5,758,714.50	
	STATOIL ASA	66,475	128.10	8,515,447.50	
	SUBSEA 7 SA	15,716	107.10	1,683,183.60	
	NORSK HYDRO	58,546	24.70	1,446,086.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,004	251.80	2,770,807.20	
	ORKLA	45,519	51.35	2,337,400.65	
	DNB ASA	58,845	94.05	5,534,372.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,659	92.50	1,170,957.50	
	TELENOR ASA	42,029	122.50	5,148,552.50	
ノルウェークローネ小計		343,861		35,235,217.30 (576,095,802)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	35	40,360.00	1,412,600.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	79	42,720.00	3,374,880.00	
	DSV A/S	11,822	146.20	1,728,376.40	
	CARLSBERG AS-B	6,151	529.50	3,256,954.50	
	COLOPLAST-B	7,090	333.50	2,364,515.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,854	482.70	894,925.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	24,258	925.50	22,450,779.00	
	NOVOZYMES A/S	13,135	187.90	2,468,066.50	
	DANSKE BANK A/S	39,476	103.20	4,073,923.20	
	TRYG A/S	1,646	491.50	809,009.00	
	TDC A/S	41,126	47.19	1,940,735.94	
デンマーククローネ小計		146,672		44,774,765.34 (775,498,935)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	299	962.00	287,638.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,519	35.50	1,012,424.50	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,186.00	351,946.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	49,326	143.30	7,068,415.80	
	BANK HAPOLIM BM	58,582	16.80	984,177.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	80,820	12.02	971,456.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	36.85	302,170.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	138.70	581,846.50	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	134,167	5.08	681,568.36	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,572	172.70	444,184.40	

	イスラエルシェケル小計	366,841		12,685,827.56 (351,143,706)	
ユーロ	CGG	10,161	18.39	186,911.59	
	ENI	151,528	15.79	2,392,627.12	
	FUGRO NV-CVA	4,431	41.97	185,969.07	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,031	11.65	186,761.15	
	NESTE OIL OYJ	8,623	11.20	96,577.60	
	OMV AG	9,432	34.40	324,507.96	
	REPSOL SA	50,929	16.59	845,166.75	
	SAIPEM	15,771	14.40	227,102.40	
	TECHNIP S.A.	6,058	82.40	499,179.20	
	TENARIS SA	28,127	17.17	482,940.59	
	TOTAL SA	126,832	38.17	4,841,177.44	
	AIR LIQUIDE	18,604	96.46	1,794,541.84	
	AKZO NOBEL	14,190	46.00	652,740.00	
	ARCELORMITTAL	59,519	9.03	537,873.20	
	ARKEMA	3,996	74.05	295,903.80	
	BASF SE	54,709	69.72	3,814,311.48	
	CRH	46,255	15.72	727,359.87	
	FUCHS PETROLUB AG -PREF	2,114	59.39	125,550.46	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,376	50.44	422,485.44	
	IMERYS SA	2,361	47.80	112,867.60	
	K+S AG	10,261	28.31	290,488.91	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,186	53.35	490,073.10	
	LAFARGE (FRANCE)	11,122	47.81	531,798.43	
	LANXESS	5,329	45.46	242,256.34	
	LINDE AG	11,033	144.60	1,595,371.80	
	SOLVAY SA	3,532	101.25	357,615.00	
	STORA ENSO OYJ R	35,297	5.48	193,427.56	
	THYSSEN KRUPP	22,984	14.87	341,772.08	
	UMICORE	7,301	32.36	236,296.86	
	UPM KYMMENE CORP	33,064	7.76	256,576.64	
VOESTALPINE AG	6,910	27.60	190,750.55		
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,183	19.78	181,639.74		
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS-RTS	9,183	1.09	10,055.38		
ALSTOM RGPT	13,216	25.00	330,400.00		
ANDRITZ AG	4,662	41.94	195,547.59		
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,133	28.99	148,831.33		

BOUYGUES ORD	12,099	19.94	241,314.55	
BRENTAG AG	3,068	120.75	370,461.00	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	34,654	41.72	1,445,938.15	
FERROVIAL SA	24,281	12.78	310,311.18	
FIAT INDUSTRIAL	50,975	8.66	441,443.50	
FINMECCANICA SPA	25,448	3.95	100,519.60	
GEA GROUP AG	10,980	28.28	310,569.30	
HOCHTIEF AG	2,174	53.09	115,417.66	
KONE OYJ-B	9,274	63.30	587,044.20	
KONINKLIJKE PHILIPS	57,011	22.12	1,261,083.32	
LEGRAND SA	15,181	38.04	577,485.24	
MAN SE	2,099	84.43	177,218.57	
METSO OYJ	7,612	27.59	210,015.08	
OSRAM LICHT AG	4,722	27.84	131,460.48	
PRYSMIAN SPA	12,810	14.88	190,612.80	
REXEL SA	8,090	18.32	148,208.80	
SAFRAN SA	14,689	42.61	625,898.29	
SAINT-GOBAIN	23,727	31.50	747,519.13	
SCHNEIDER ELECTRIC	31,429	57.26	1,799,624.54	
SIEMENS	47,229	78.82	3,722,589.78	
THALES SA	5,831	37.42	218,225.17	
VALLOUREC	6,501	41.60	270,441.60	
VINCI S.A.	27,619	39.02	1,077,693.38	
WARTSILA OYJ	10,737	35.83	384,706.71	
ZARDOYA OTIS SA	10,201	11.04	112,619.04	
ZODIAC AEROSPACE	2,146	106.70	228,978.20	
BUREAU VERITAS SA	13,900	21.41	297,668.50	
EDENRED	11,350	23.31	264,568.50	
RANDSTAD HOLDING NV	7,714	33.26	256,606.21	
SOCIETE BIC SA	1,800	78.76	141,768.00	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	23,741	14.10	334,748.10	
ADP	2,021	74.72	151,009.12	
ATLANTIA SPA	20,808	12.70	264,261.60	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,664	15.28	224,065.92	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,011	19.80	1,069,687.85	
FRAPORT AG	2,319	47.54	110,245.26	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	35,901	5.83	209,518.23	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	3.20	181,980.80	

TNT EXPRESS	22,191	5.90	131,126.61	
VOPAK	4,421	46.01	203,410.21	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,722	69.03	1,361,409.66	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,343	55.00	183,865.00	
CONTINENTAL AG	6,552	110.95	726,944.40	
DAIMLER AG	57,234	48.92	2,799,887.28	
FIAT ORD	52,136	5.59	291,700.92	
MICHELIN	10,794	72.48	782,349.12	
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,178	32.60	234,002.80	
PIRELLI & CO	14,958	8.89	133,051.41	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,121	59.15	539,507.15	
RENAULT SA	11,410	57.56	656,759.60	
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,614	161.75	1,393,314.50	
VOLKSWAGEN STAMM	1,758	156.55	275,214.90	
ADIDAS AG	12,462	83.74	1,043,567.88	
CHRISTIAN DIOR	3,142	131.85	414,272.70	
HUGO BOSS AG	1,699	85.80	145,774.20	
KERING	4,403	168.15	740,364.45	
LUXOTTICA GROUP SPA	9,878	40.61	401,145.58	
LVMH	14,975	131.40	1,967,715.00	
ACCOR	9,288	27.61	256,441.68	
OPAP SA	14,930	6.23	93,013.90	
SODEXO	5,616	66.90	375,710.40	
AXEL SPRINGER AG	2,489	33.14	82,485.46	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,458	22.35	189,036.30	
JC DECAUX SA	4,621	21.80	100,737.80	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,273	83.90	442,404.70	
LAGADERE S.C.A	6,639	22.60	150,074.59	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	5,503	33.33	183,414.99	
PUBLICIS GROUPE	10,591	56.00	593,096.00	
REED ELSEVIER NV	41,081	13.40	550,485.40	
SES	17,459	23.00	401,644.29	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	36.68	118,125.70	
WOLTERS KLUWER	18,984	17.05	323,677.20	
INDITEX	13,532	97.40	1,318,016.80	
AHOLD (KON.)	60,037	12.25	735,453.25	
CARREFOUR	35,907	21.34	766,434.91	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,608	72.11	260,172.88	

COLRUYT SA	4,857	41.57	201,905.49
DELHAIZE GROUP	6,071	49.53	300,696.63
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	39,901	5.91	236,054.31
JERONIMO MARTINS	15,262	16.01	244,420.93
KESKO OYJ-B SHS	4,473	22.38	100,105.74
METRO STAMM	8,303	24.53	203,714.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV	47,854	70.38	3,367,964.52
DANONE (GROUPE)	34,007	56.35	1,916,294.45
DE MASTER BLENDEERS1753 NV	31,490	12.33	388,429.15
HEINEKEN HOLDING NV	6,278	45.93	288,348.54
HEINEKEN NV	13,724	51.65	708,844.60
KERRY GROUP PLC-A	9,560	45.60	435,936.00
PERNOD-RICARD	12,642	88.23	1,115,403.66
REMY COINTREAU	1,575	83.88	132,111.00
SUEDZUCKER AG	4,926	25.09	123,617.97
UNILEVER NV-CVA	97,030	31.20	3,027,336.00
BEIERSDORF AG	6,056	68.52	414,957.12
HENKEL AG & CO KGAA	7,819	60.76	475,082.44
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,910	72.43	790,211.30
LOREAL	14,398	128.70	1,853,022.60
CELESIO AG	5,912	15.30	90,453.60
ESSILOR INTERNATIONAL	12,150	82.01	996,421.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,839	49.35	633,604.65
FRESENIUS SE&CO KGAA	7,471	94.85	708,624.35
BAYER	50,001	83.47	4,173,583.47
ELAN CORPORATION PLC	34,320	10.91	374,431.20
GRIFOLS SA	9,679	30.45	294,725.55
MERCK KGAA	3,939	115.75	455,939.25
ORION OYJ-CLASS B	5,839	18.57	108,430.23
QIAGEN N.V.	15,109	15.38	232,451.96
SANOFI	71,103	80.34	5,712,415.02
UCB (GROUPE)	6,553	43.10	282,434.30
BANCO BILBAO VIZCAYA	341,500	6.58	2,249,119.00
BANCO DE SABADELL SA	146,060	1.53	223,909.98
BANCO SANTANDER SA	657,265	5.15	3,384,914.75
BNP PARIBAS	59,840	43.90	2,627,275.20
CAIXABANK	54,400	2.69	146,336.00

COMMERZBANK AG	58,251	6.03	351,603.03	
CREDIT AGRICOLE SA	60,165	6.77	407,798.37	
ERSTE GROUP BANK AG	14,003	20.13	281,880.39	
ERSTE GROUP BANK AG-RTS	14,003	0.12	1,680.36	
INTESA SANPAOLO	700,042	1.31	917,055.02	
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	45,054	-	-	
KBC GROEP NV	13,809	30.79	425,248.15	
NATIXIS	55,749	3.43	191,497.81	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	20.40	69,360.00	
SOCIETE GENERALE	42,284	27.73	1,172,746.74	
UNICREDIT SPA	261,344	3.69	964,882.04	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	2.89	157,139.85	
DEUTSCHE BANK NAMEN	61,387	32.47	1,993,542.82	
DEUTSCHE BOERSE	11,621	51.15	594,414.15	
EURAZEO	1,975	44.94	88,766.37	
EXOR SPA	4,687	23.87	111,878.69	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,858	59.26	287,885.08	
ING GROEP	230,632	7.43	1,715,440.81	
MEDIOBANCA	34,666	4.41	153,015.72	
OKO BANK-A	9,611	12.30	118,215.30	
WENDEL	2,120	82.68	175,281.60	
AEGON	106,867	5.69	608,821.29	
AGEAS	13,907	27.90	388,005.30	
ALLIANZ SE-REG	27,454	114.15	3,133,874.10	
ASSICURAZIONI GENERALI	70,308	14.25	1,001,889.00	
AXA	107,869	16.18	1,745,320.42	
CNP ASSURANCES	11,367	11.62	132,141.37	
DELTA LLOYD NV	11,075	16.25	179,968.75	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,891	55.87	217,390.17	
MAPFRE SA	55,064	2.71	149,663.95	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,799	142.25	1,536,157.75	
SAMPO OYJ-A SHS	25,235	32.04	808,529.40	
SCOR SE	9,248	23.51	217,466.72	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	38.92	109,301.40	
IMMOFINANZ AG	58,893	3.06	180,448.15	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	22,953	25.27	580,137.07	
ATOS	3,458	58.08	200,840.64	

CAP GEMINI SA	8,568	38.90	333,295.20
DASSAULT SYSTEMES SA	3,709	98.00	363,482.00
SAP AG	54,881	56.25	3,087,056.25
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,790	23.20	157,561.95
GEMALTO	4,718	71.44	337,053.92
NOKIA CORP	223,066	3.32	740,579.12
BELGACOM	9,742	17.12	166,831.75
DEUTSCHE TELEKOM	168,173	8.90	1,497,748.73
ELISA A	9,087	15.58	141,575.46
ILIAD SA	1,461	177.65	259,546.65
KPN (KON.)	192,845	1.65	318,965.63
ORANGE	111,017	7.34	815,197.83
PORTUGAL TELECOM	41,591	2.85	118,867.07
TELECOM ITALIA ORD	601,478	0.53	323,595.16
TELECOM ITALIA RNC	378,931	0.42	161,045.67
TELEFONICA	246,971	10.10	2,495,641.95
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	5.29	88,527.10
TELEKOM AUSTRIA AG	15,933	4.95	78,979.88
VIVENDI	71,319	15.15	1,080,839.44
ZIGGO NV	10,178	31.10	316,535.80
ACCIONA SA	1,857	40.76	75,691.32
E.ON SE	107,270	12.20	1,308,694.00
ELECTRICITE DE FRANCE	15,393	19.40	298,624.20
ENAGAS	12,304	18.80	231,376.72
ENEL	392,074	2.47	969,206.92
ENEL GREEN POWER SPA	110,043	1.62	179,260.04
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	124,604	2.42	301,915.49
FORTUM OYJ	26,458	14.54	384,699.32
GAS NATURAL SDG SA	21,106	15.34	323,871.57
GDF SUEZ	80,304	15.33	1,231,461.84
IBERDROLA SA	282,941	3.96	1,121,578.12
IBERDROLA SA-RTS	282,941	0.13	37,348.21
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,979	42.01	293,187.79
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	22.01	57,745.34
RWE STAMM	29,150	22.39	652,668.50
SNAM SPA	120,285	3.51	422,922.06
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	17,972	10.02	180,079.44
TERNA SPA	83,672	3.27	273,607.44

VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,733	9.11	198,161.49	
VERBUND AG	4,553	14.40	65,563.20	
ASML HOLDING NV	18,756	63.51	1,191,193.56	
INFINEON TECHNOLOGIES	64,362	6.60	424,982.28	
STMICROELECTRONICS	40,080	7.14	286,251.36	
ユーロ小計	10,225,226		148,806,623.96 (19,222,839,683)	
合計	63,394,964		151,426,261,857 (151,426,261,857)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	335,000.00	247,900.00	
	アメリカドル小計		335,000.00	247,900.00 (25,072,606)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	52,986.00	329,572.92	
		LEND LEASE GROUP	34,217.00	302,136.11	
		SYDNEY AIRPORT	13,063.00	45,067.35	
	オーストラリアドル小計		100,266.00	676,776.38 (62,696,563)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	158,000.00	1,153,400.00	
香港ドル小計		158,000.00	1,153,400.00 (15,040,336)		
投資信託受益証券合計				102,809,505 (102,809,505)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,168.00	490,234.88	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	23,534.00	1,714,687.24	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,422.00	663,522.72	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,321.00	1,005,246.51	
		BOSTON PROPERTIES	9,032.00	969,223.92	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,256.00	372,177.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,831.00	472,835.78	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	300,893.88	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	20,232.00	1,172,849.04	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,867.00	400,118.49	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,065.00	551,855.35	
		HCP INC	27,005.00	1,217,385.40	
		HEALTH CARE REIT INC	16,770.00	1,102,124.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,285.00	769,174.45	

	KIMCO REALTY CORP	25,608.00	564,144.24	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	7,358.00	275,262.78	
	MACERICH CO/THE	8,322.00	523,953.12	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,175.00	483,109.00	
	PROLOGIS INC	29,539.00	1,131,934.48	
	PUBLIC STORAGE	8,695.00	1,349,811.80	
	RAYONIER INC	7,845.00	437,515.65	
	REALTY INCOME CORP	11,551.00	500,389.32	
	REGENCY CENTERS CORP	5,612.00	288,961.88	
	SIMON PROPERTY GROUP	18,466.00	2,986,321.52	
	SL GREEN REALTY CORP	5,669.00	518,713.50	
	UDR INC	16,000.00	413,600.00	
	VENTAS INC	17,389.00	1,200,188.78	
	VORNADO REALTY TRUST	10,010.00	856,055.20	
	アメリカドル小計	471,880.00	22,732,290.69 (2,299,143,880)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	161,701.10	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,483.00	237,454.32	
	カナダドル小計	17,018.00	399,155.42 (38,330,894)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	247,897.91	
	DEXUS PROPERTY GROUP	289,071.00	315,087.39	
	FEDERATION CENTRES	89,917.00	212,204.12	
	GOODMAN GROUP	102,048.00	495,953.28	
	GPT GROUP	105,353.00	414,037.29	
	MIRVAC GROUP	215,406.00	366,190.20	
	STOCKLAND	131,200.00	461,824.00	
	WESTFIELD GROUP	126,076.00	1,482,653.76	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	185,818.00	572,319.44	
	オーストラリアドル小計	1,371,691.00	4,568,167.39 (423,195,027)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	54,509.00	331,414.72	
	HAMMERSON PLC	45,117.00	241,150.36	
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	132,557.85	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	47,061.00	451,314.99	
	SEGRO PLC	46,969.00	137,619.17	
	イギリスポンド小計	233,886.00	1,294,057.09 (194,354,434)	

香港ドル	LINK REIT	136,000.00	5,215,600.00	
香港ドル小計		136,000.00	5,215,600.00 (68,011,424)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	244,200.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	159,500.00	
	CAPITAMALL TRUST	149,000.00	290,550.00	
シンガポールドル小計		370,000.00	694,250.00 (54,929,060)	
ユーロ	CORIO NV	4,573.00	143,523.60	
	FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	99,467.68	
	GECINA SA	1,389.00	124,273.83	
	ICADE	1,564.00	102,285.60	
	KLEPIERRE	6,313.00	202,962.95	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,821.00	1,080,086.55	
ユーロ小計		21,309.00	1,752,600.21 (226,400,895)	
投資証券合計			3,304,365,614 (3,304,365,614)	
合計			3,407,175,119 (3,407,175,119)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率	
アメリカドル	株式	572銘柄	97.5%	59.2%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	28銘柄	2.4%	1.5%
カナダドル	株式	93銘柄	99.5%	4.6%
	投資証券	2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式	56銘柄	91.3%	3.3%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.1%	0.0%
	投資証券	9銘柄	7.6%	0.3%
イギリスポンド	株式	102銘柄	98.7%	9.7%
	投資証券	5銘柄	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式	39銘柄	96.0%	1.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.7%	0.0%

	投資証券	1銘柄	3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	26銘柄	95.1%	0.7%
	投資証券	3銘柄	4.9%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	1.4%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	229銘柄	98.8%	12.4%
	投資証券	6銘柄	1.2%	0.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	315,495,560
コール・ローン	3,010,854,686
国債証券	228,917,866,056
派生商品評価勘定	3,776,136
未収入金	78,895,025
未収利息	2,440,998,323
前払費用	102,987,981
差入委託証拠金	44,011,265
流動資産合計	234,914,885,032
資産合計	234,914,885,032
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,875,381
未払金	3,915,941
未払解約金	594,439,782
流動負債合計	605,231,104
負債合計	605,231,104
純資産の部	
元本等	
元本	102,334,678,750
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	131,974,975,178
元本等合計	234,309,653,928
純資産合計	234,309,653,928
負債純資産合計	234,914,885,032

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
--	---------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)債券先物取引 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	106,156,621,779円
計算期間中の追加設定元本額	6,413,158,744円
計算期間中の一部解約元本額	10,235,101,773円
計算日の元本額	102,334,678,750円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	5,432,881,795円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	272,062,948円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,232,153,502円

財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,711,023,594円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	554,069,464円
SBI資産設計オープン(分配型)	10,682,873円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,308,465,437円
世界経済インデックスファンド	427,406,843円
マイセレクション25	14,776,864円
マイセレクション50	9,266,954円
マイセレクション75	7,017,843円
DCマイセレクション25	968,399,698円
DCマイセレクション50	900,288,047円
DCマイセレクション75	596,446,422円
DC外国債券インデックス・オープン	1,149,756,175円
DCマイセレクションS25	324,899,000円
DCマイセレクションS50	294,127,575円
DCマイセレクションS75	124,884,301円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,766,261円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	34,022,535円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	24,321,195円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	8,575,000円
DC世界経済インデックスファンド	247,055,729円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,798,712,290円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	5,782,595,480円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	34,591,920円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	10,950,405円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	409,836,464円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,326,184,639円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,283,442,787円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	24,524,146,330円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,813,654,709円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,227,644,476円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,263,220,411円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,250,461,979円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,591,120,811円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,800,218,358円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,384,835,504円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,408,611,092円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	534,528,728円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	720,953,321円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	3,827,499,237円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	864,220,077円

グローバル・バランスファンド・シリーズ1	339,963,574円
外国債券ファンド・シリーズ1	266,224,237円
コア投資戦略ファンド(安定型)	616,002,156円
コア投資戦略ファンド(成長型)	600,007,685円
分散投資コア戦略ファンドA	6,751,268円
分散投資コア戦略ファンドS	2,376,406円
F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	991,574,351円
2. 計算日における受益権総数	102,334,678,750口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2896円 (22,896円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
--	---------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「(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。
	(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。
	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	4,405,340,736	
合計	4,405,340,736	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	1,370,918,714	-	1,367,961,674	2,957,040
	合計	1,370,918,714	-	1,367,961,674	2,957,040

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			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	870,664,725	-	870,557,100	107,625
	カナダドル	79,619,410	-	79,613,600	5,810
	イギリスポンド	153,128,520	-	153,132,600	4,080
	ユーロ	942,973,850	-	942,941,000	32,850
	計	2,046,386,505	-	2,046,244,300	142,205
	合計	2,046,386,505	-	2,046,244,300	142,205

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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
に計算したレートを用いております。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 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	T 0.25% 01/15/15	10,000,000.00	9,997,656.30	

T 0.25% 02/15/15	5,700,000.00	5,696,660.14	
T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,811,562.50	
T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,960,351.58	
T 0.25% 10/15/15	8,000,000.00	7,962,187.52	
T 0.25% 12/15/14	10,000,000.00	10,001,171.90	
T 0.375% 03/15/16	4,800,000.00	4,771,125.02	
T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,508,535.18	
T 0.375% 06/15/15	20,200,000.00	20,205,523.48	
T 0.375% 11/15/14	4,000,000.00	4,008,593.76	
T 0.625% 11/30/17	4,000,000.00	3,883,828.12	
T 0.75% 02/28/18	13,100,000.00	12,720,560.59	
T 0.75% 03/31/18	7,500,000.00	7,265,917.95	
T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,101,421.97	
T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,742,187.50	
T 0.875% 01/31/18	3,400,000.00	3,324,562.50	
T 0.875% 02/28/17	20,600,000.00	20,499,816.43	
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,397,812.50	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,587,792.98	
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,942,585.97	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,794,453.12	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	5,953,253.92	
T 1.125% 12/31/19	8,700,000.00	8,265,000.00	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	879,820.31	
T 1.25% 02/29/20	10,000,000.00	9,538,281.30	
T 1.25% 10/31/19	1,700,000.00	1,635,619.14	
T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,323,257.79	
T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,631,820.32	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,860,695.33	
T 1.375% 11/30/15	27,800,000.00	28,374,460.86	
T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	1,970,664.06	
T 1.5% 03/31/19	11,000,000.00	10,866,581.99	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,396,833.97	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,170,146.49	
T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	7,833,281.25	
T 1.75% 05/15/22	10,000,000.00	9,419,335.90	
T 1.75% 05/15/23	2,200,000.00	2,032,765.63	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,415,429.65	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,486,347.68	

T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,065,097.64	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,078,105.48	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,562,792.97	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,679,611.34	
T 2% 02/15/22	10,000,000.00	9,663,085.90	
T 2% 02/15/23	11,500,000.00	10,921,406.25	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,330,625.00	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,005,640.62	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	12,931,734.43	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,565,269.53	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,956,191.43	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,080,664.06	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	19,850,250.04	
T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,447,710.94	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,172,656.24	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	573,364.25	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	12,811,279.25	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,168,984.36	
T 2.5% 03/31/15	20,700,000.00	21,475,037.18	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,053,750.00	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,379,304.71	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,276,855.45	
T 2.625% 06/30/14	16,000,000.00	16,382,812.48	
T 2.625% 07/31/14	33,900,000.00	34,777,957.11	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,694,863.29	
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,257,343.76	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,673,556.64	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	634,429.68	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,035,792.96	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,504,062.48	
T 2.75% 08/15/42	9,200,000.00	7,733,031.29	
T 2.75% 11/15/42	7,000,000.00	5,876,171.90	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	14,861,328.16	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,162,335.95	
T 2.875% 05/15/43	3,000,000.00	2,584,394.52	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,183,740.27	
T 3% 05/15/42	8,000,000.00	7,104,687.52	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,298,294.91	

T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,764,550.79	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,998,544.93	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	13,792,749.95	
T 3.125% 05/15/21	9,500,000.00	10,091,152.32	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,126,542.99	
T 3.125% 11/15/41	7,000,000.00	6,395,566.38	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,804,050.78	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,688,623.05	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,778,085.95	
T 3.375% 11/15/19	7,600,000.00	8,292,906.28	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,245,173.82	
T 3.5% 02/15/39	4,500,000.00	4,461,855.48	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,693,566.43	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,700,546.91	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,310,261.70	
T 3.75% 08/15/41	5,900,000.00	6,074,580.05	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,556,542.95	
T 3.875% 08/15/40	7,000,000.00	7,380,761.71	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,624,546.84	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,705,990.22	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,164,943.35	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	673,417.96	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	12,535,312.56	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,501,953.12	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,117,634.75	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,182,636.73	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	5,608,691.40	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,601,304.68	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	5,607,054.71	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,289,023.44	
T 4.375% 11/15/39	5,300,000.00	6,064,566.39	
T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	2,910,839.85	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,065,003.89	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,330,703.12	
T 4.5% 08/15/39	4,000,000.00	4,667,656.24	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,389,656.25	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,644,628.90	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,367,466.79	

	T 4.75% 02/15/37	1,500,000.00	1,808,818.36	
	T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,486,367.19	
	T 5.0% 05/15/37	500,000.00	623,769.53	
	T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,405,062.51	
	T 5.25% 02/15/29	800,000.00	999,562.50	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,623,476.56	
	T 5.375% 02/15/31	2,900,000.00	3,706,109.36	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,534,710.93	
	T 6.0% 02/15/26	1,900,000.00	2,513,158.19	
	T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	2,996,306.25	
	T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,614,925.78	
	T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,577,763.68	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,531,819.32	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,630,097.66	
	T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,218,314.43	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,439,333.97	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,873,267.58	
	アメリカドル小計	900,400,000.00	928,844,080.05 (93,943,290,256)	
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,635.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	2,700,000.00	2,636,401.50	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,900,000.00	1,739,621.00	
	CAN 1.5% 09/01/17	900,000.00	893,070.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,427,062.00	
	CAN 2% 12/01/14	5,300,000.00	5,364,501.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,076,455.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,057,900.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,100,000.00	3,229,673.00	
	CAN 3% 12/01/15	2,900,000.00	3,020,248.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,900,000.00	2,032,259.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,350,000.00	2,554,050.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,700,000.00	1,903,651.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,050,000.00	3,348,823.75	
	CAN 4% 06/01/16	2,150,000.00	2,313,260.25	
	CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,618,004.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,750,000.00	3,309,363.75	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,950,523.75	
	CAN 4.5% 06/01/15	6,700,000.00	7,121,162.00	

	CAN 5% 06/01/37	2,150,000.00	2,910,895.75	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,700,000.00	2,349,510.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,200,000.00	3,149,520.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	950,000.00	1,532,117.25	
	カナダドル小計	55,150,000.00	60,737,709.00 (5,832,642,195)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,650,000.00	1,478,589.75	
	ACGB 3.25% 04/21/25	650,000.00	603,421.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	850,000.00	746,057.75	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,300,000.00	1,361,438.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,900,000.00	3,076,363.50	
	ACGB 4.5% 10/21/14	2,050,000.00	2,099,948.25	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,250,000.00	1,323,268.75	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,750,000.00	2,903,353.75	
	ACGB 4.75% 10/21/15	1,200,000.00	1,254,696.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,800,000.00	3,081,246.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,500,000.00	2,751,112.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,800,000.00	3,173,954.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,450,000.00	2,797,165.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,350,000.00	2,698,798.75	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,536,576.00	
ACGB 6.25% 04/15/15	2,900,000.00	3,083,367.00		
	オーストラリアドル小計	33,600,000.00	35,969,356.00 (3,332,201,139)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	4,300,000.00	4,288,454.50	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	825,328.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,750,000.00	3,539,925.00	
	UKT 2% 01/22/16	3,650,000.00	3,783,772.50	
	UKT 2.25% 09/07/23	450,000.00	435,348.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	2,750,000.00	2,851,007.50	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,450,000.00	1,351,791.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,800,000.00	1,850,850.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,100,000.00	3,484,756.50	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,000,000.00	3,367,275.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,200,000.00	3,573,776.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,050,000.00	2,246,277.25	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	2,893,281.00	
	UKT 4% 09/07/16	5,000,000.00	5,523,100.00	

	UKT 4.25% 03/07/36	2,700,000.00	3,059,559.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	3,753,733.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,145,347.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,000,000.00	2,294,520.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,500,000.00	2,816,475.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,950,000.00	3,326,302.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,500,000.00	2,830,887.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,500,000.00	2,860,675.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	4,400,000.00	5,114,758.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,550,000.00	2,987,618.25	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,500,000.00	4,113,357.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,700,000.00	4,389,476.50	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,850,000.00	3,118,683.75	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,142,633.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,700,000.00	3,292,798.50	
	UKT 5% 03/07/18	3,150,000.00	3,696,257.25	
	UKT 5% 03/07/25	2,700,000.00	3,322,390.50	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,100,000.00	5,376,037.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,760,000.00	2,408,604.00	
	UKT 8% 06/07/21	2,300,000.00	3,288,850.50	
	UKT 8% 12/07/15	2,195,000.00	2,596,992.30	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,968,562.50	
イギリスポンド小計		99,205,000.00	111,919,461.80 (16,809,183,967)	
スイスフラン	SWISS 3% 01/08/18	3,750,000.00	4,211,812.50	
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	858,788.00	
	SWISS 4% 02/11/23	2,100,000.00	2,665,960.50	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	404,842.50	
スイスフラン小計		6,950,000.00	8,141,403.50 (845,321,925)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	500,000.00	488,635.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	600,000.00	615,171.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	400,000.00	398,550.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	450,000.00	481,702.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	400,000.00	418,500.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	500,000.00	467,080.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,316,531.25	
	SIGB 2.875% 09/01/30	450,000.00	440,181.00	

	SIGB 3% 09/01/24	350,000.00	358,613.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,050,000.00	1,115,105.25	
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	642,267.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,100,000.00	1,167,408.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	2,000,000.00	2,068,030.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	887,668.00	
	SIGB 4% 09/01/18	750,000.00	848,118.75	
	シンガポールドル小計	11,200,000.00	11,713,561.25 (926,776,966)	
マレーシアリン ギット	MGS 3.172% 07/15/16	700,000.00	697,602.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	300,000.00	299,820.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,538,563.25	
	MGS 3.418% 08/15/22	400,000.00	391,846.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	700,000.00	703,055.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,000,000.00	986,865.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,350,000.00	1,343,466.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,116,257.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,000,000.00	2,004,080.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	4,800,000.00	4,846,080.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,114,613.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,150,000.00	1,153,392.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	712,988.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,830,987.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,733,276.25	
	MGS 4.262% 09/15/16	6,100,000.00	6,265,066.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,650,202.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	300,000.00	317,308.50	
MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,341,808.00		
MGS 5.248% 09/15/28	1,350,000.00	1,552,540.50		
	マレーシアリンギット小計	36,900,000.00	37,599,819.00 (1,194,546,249)	
スウェーデンク ローナ	SGB 1.5% 11/13/23	8,700,000.00	8,157,859.50	
	SGB 3% 07/12/16	7,600,000.00	8,011,996.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	6,900,000.00	7,652,376.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,050,000.00	10,111,791.25	
	SGB 3.75% 08/12/17	11,050,000.00	12,109,695.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,800,000.00	13,485,158.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	8,600,000.00	9,212,965.00	

	SGB 5% 12/01/20	12,000,000.00	14,580,960.00	
スウェーデンクローナ小計		75,700,000.00	83,322,800.75 (1,239,010,047)	
ノルウェークローネ	NGB 2% 05/24/23	4,300,000.00	4,070,681.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,500,000.00	9,305,970.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	9,500,000.00	10,395,327.50	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,500,000.00	8,498,287.50	
	NGB 5% 05/15/15	11,500,000.00	12,243,992.50	
ノルウェークローネ小計		41,300,000.00	44,514,258.50 (727,808,126)	
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	4,500,000.00	4,374,337.50	
	DGB 2% 11/15/14	9,050,000.00	9,287,607.75	
	DGB 2.5% 11/15/16	2,400,000.00	2,573,988.00	
	DGB 3% 11/15/21	15,400,000.00	17,286,577.00	
	DGB 4% 11/15/15	15,300,000.00	16,684,650.00	
	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,249,567.00	
	DGB 4% 11/15/19	14,100,000.00	16,700,392.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	18,900,000.00	26,753,989.50	
	DGB 7% 11/10/24	4,300,000.00	6,639,372.00	
デンマーククローネ小計		93,750,000.00	111,550,481.25 (1,932,054,335)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	5,500,000.00	7,453,957.50	
	MBONO 5% 06/15/17	16,400,000.00	16,395,244.00	
	MBONO 6% 06/18/15	73,250,000.00	75,630,258.75	
	MBONO 6.5% 06/10/21	7,500,000.00	7,889,512.50	
	MBONO 7.25% 12/15/16	24,400,000.00	26,300,394.00	
	MBONO 8% 06/11/20	35,300,000.00	40,236,175.50	
	MBONO 8% 12/07/23	24,000,000.00	27,951,960.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	52,750,000.00	63,748,375.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,250,000.00	38,282,846.25	
メキシコペソ小計		271,350,000.00	303,888,723.50 (2,382,487,592)	
ポーランドズロチ	POLGB 3.75% 04/25/18	4,400,000.00	4,486,306.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,600,000.00	2,632,084.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,216,970.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,700,000.00	5,997,369.00	
	POLGB 5% 04/25/16	1,300,000.00	1,367,294.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,600,000.00	6,046,124.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,536,512.00	

	POLGB 5.5% 04/25/15	5,150,000.00	5,379,612.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	5,300,000.00	5,909,208.50	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,550,000.00	1,840,950.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,400,000.00	6,184,215.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,199,014.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	9,200,000.00	9,855,776.00	
	ポーランドズロチ小計	54,300,000.00	58,651,436.25 (1,754,850,972)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	19,800,000.00	23,860,485.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	8,000,000.00	9,196,520.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	12,100,000.00	9,241,375.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	9,200,000.00	7,046,648.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,000,000.00	13,446,020.00	
	SAGB 7% 02/28/31	9,900,000.00	8,548,749.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	14,500,000.00	14,454,760.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	4,300,000.00	4,334,808.50	
	SAGB 8% 12/21/18	12,700,000.00	13,238,924.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	14,000,000.00	14,710,220.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	4,300,000.00	4,245,626.50	
	SAGB 8.75% 12/21/14	6,000,000.00	6,264,660.00	
		南アフリカランド小計	128,800,000.00	128,588,796.50 (1,294,889,180)
ユーロ	BGB 3% 09/28/19	750,000.00	811,972.50	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,650,000.00	3,954,045.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	950,647.50	
	BGB 3.75% 09/28/15	2,250,000.00	2,421,315.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,950,000.00	4,455,145.75	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,601,921.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,531,706.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,000,000.00	1,103,725.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,950,000.00	3,291,949.25	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,600,000.00	2,964,897.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,000,000.00	2,305,040.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,624,075.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,394,094.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	1,950,000.00	2,252,747.25	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,600,000.00	1,876,968.00	
	BGB 5% 03/28/35	2,900,000.00	3,667,630.00	

BGB 5.5% 03/28/28	3,200,000.00	4,145,104.00	
BGB 5.5% 09/28/17	1,650,000.00	1,957,238.25	
BGB 8.0% 03/28/15	1,350,000.00	1,529,624.25	
BTNS 1.75% 02/25/17	1,600,000.00	1,663,640.00	
BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,278,771.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	3,200,000.00	3,358,016.00	
BTNS 2.5% 01/15/15	5,300,000.00	5,487,487.50	
BTNS 2.5% 07/25/16	5,500,000.00	5,834,455.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,276,808.50	
BTPS 2.75% 12/01/15	1,600,000.00	1,627,216.00	
BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,887,267.00	
BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	5,010,691.00	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,864,834.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	800,000.00	815,580.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,599,883.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,293,401.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	6,050,000.00	6,269,826.75	
BTPS 3.75% 08/01/16	6,500,000.00	6,763,835.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	6,500,000.00	6,505,687.50	
BTPS 4% 02/01/17	5,200,000.00	5,430,074.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,000,000.00	3,576,120.00	
BTPS 4% 09/01/20	5,300,000.00	5,395,002.50	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,574,680.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	3,961,177.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,044,119.75	
BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000.00	9,500,840.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,050,000.00	2,129,222.25	
BTPS 4.5% 02/01/18	5,050,000.00	5,353,328.25	
BTPS 4.5% 02/01/20	6,350,000.00	6,637,178.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	3,600,000.00	3,783,240.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	2,703,118.50	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,100,000.00	2,123,394.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	4,600,000.00	4,873,700.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,900,000.00	4,157,829.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,700,000.00	5,915,431.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,212,700.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	900,000.00	851,724.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,190,558.25	

BTPS 5% 03/01/22	2,000,000.00	2,122,780.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,400,000.00	3,540,403.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	3,543,715.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,350,000.00	3,332,446.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,200,000.00	3,205,520.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	4,050,000.00	4,404,334.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	6,000,000.00	6,270,570.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,281,870.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,100,000.00	4,443,539.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,600,000.00	2,864,654.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,000,000.00	5,643,725.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,800,000.00	4,447,501.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,367,020.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,096,376.00	
DBR 1.5% 02/15/23	3,600,000.00	3,565,242.00	
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	2,893,982.50	
DBR 1.75% 07/04/22	4,400,000.00	4,499,858.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,733,861.00	
DBR 2.25% 09/04/20	1,400,000.00	1,515,983.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,400,000.00	3,657,754.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,517,824.00	
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	1,817,325.00	
DBR 3% 07/04/20	4,700,000.00	5,334,641.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,600,000.00	4,133,070.00	
DBR 3.25% 07/04/15	5,300,000.00	5,634,350.50	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,462,090.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,574,693.00	
DBR 3.5% 01/04/16	4,600,000.00	4,984,721.00	
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	4,052,667.50	
DBR 3.75% 01/04/15	2,550,000.00	2,690,976.75	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,509,360.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,500,000.00	4,074,087.50	
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	4,007,610.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,203,957.50	
DBR 4.0% 01/04/37	3,950,000.00	5,056,375.25	
DBR 4.25% 07/04/14	6,100,000.00	6,351,350.50	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,689,664.00	
DBR 4.25% 07/04/18	3,650,000.00	4,305,248.00	

DBR 4.25% 07/04/39	2,350,000.00	3,170,808.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,665,610.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,150,000.00	4,373,349.75	
DBR 4.75% 07/04/40	2,700,000.00	3,932,091.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,650,000.00	3,865,594.75	
DBR 5.625% 01/04/28	2,500,000.00	3,595,837.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	655,079.60	
DBR 6.25% 01/04/24	1,500,000.00	2,159,100.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,300,000.00	2,015,617.50	
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,624,995.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	1,400,000.00	1,398,509.00	
FRTR 1% 05/25/18	2,500,000.00	2,501,587.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	6,300,000.00	6,361,204.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,200,000.00	4,458,636.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	1,300,000.00	1,293,766.50	
FRTR 3% 04/25/22	6,500,000.00	7,010,282.50	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,315,975.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	5,050,000.00	5,448,849.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,586,517.75	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,368,509.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,331,808.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,300,000.00	5,789,720.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,799,487.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,450,000.00	7,391,442.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,800,000.00	5,500,224.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,800,000.00	5,488,536.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	2,733,444.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,600,000.00	1,826,192.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,884,223.00	
FRTR 4% 10/25/38	4,500,000.00	5,136,142.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,000,000.00	7,020,690.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	5,750,000.00	6,582,140.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,000,000.00	4,654,180.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,900,000.00	6,949,315.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	4,510,925.50	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,600,000.00	4,529,088.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,726,675.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,000,000.00	5,336,000.00	

FRTR 5.75% 10/25/32	3,900,000.00	5,463,042.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,271,032.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,554,275.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,606,438.40	
IRISH 3.9% 03/20/23	800,000.00	800,544.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,500,000.00	1,590,427.50	
IRISH 4.5% 02/18/15	700,000.00	740,561.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,600,000.00	3,807,540.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	859,924.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,000,000.00	2,155,680.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	2,144,892.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	500,000.00	557,332.50	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,250,000.00	1,421,218.75	
NETHER 0.75% 04/15/15	1,600,000.00	1,617,984.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,950,000.00	1,987,479.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,150,000.00	1,120,703.75	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,000,000.00	2,068,900.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,241,540.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,500,000.00	1,478,190.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,456,147.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,150,000.00	4,407,673.50	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,550,000.00	2,858,575.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,750,000.00	3,136,278.75	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,900,000.00	2,205,643.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,753,336.25	
NETHER 3.75% 07/15/14	3,850,000.00	3,992,738.75	
NETHER 4% 01/15/37	2,250,000.00	2,796,671.25	
NETHER 4% 07/15/16	2,450,000.00	2,713,203.50	
NETHER 4% 07/15/19	2,150,000.00	2,503,621.25	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,550,000.00	2,933,775.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,700,000.00	3,109,306.50	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,100,000.00	2,896,194.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	818,683.25	
OBL 0.5% 02/23/18	3,000,000.00	2,995,545.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,413,656.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,046,650.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	516,500.00	
OBL 1.75% 10/09/15	2,000,000.00	2,075,140.00	

OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,634,330.00	
OBL 2.5% 02/27/15	6,800,000.00	7,072,136.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,916,375.00	
OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,390,321.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	600,000.00	638,601.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,000,000.00	1,094,570.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	900,000.00	937,791.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	900,000.00	1,013,472.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	2,650,000.00	2,828,119.75	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,200,000.00	3,641,184.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	600,000.00	688,251.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	618,797.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,700,000.00	3,139,722.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,500,000.00	2,783,012.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,100,000.00	2,604,388.50	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,000,000.00	2,084,970.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	700,000.00	803,341.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,500,000.00	1,766,850.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	2,800,000.00	3,276,616.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,400,000.00	1,783,306.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,300,000.00	1,883,544.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	600,000.00	578,808.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	789,340.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	624,996.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	451,622.25	
RFGB 2.75% 07/04/28	650,000.00	678,570.75	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,150,000.00	1,192,072.75	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,150,000.00	1,306,244.75	
RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	458,246.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,400,000.00	1,587,152.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,350,000.00	1,609,483.50	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,514,597.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,071,706.50	
SPGB 3% 04/30/15	1,800,000.00	1,829,772.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,100,000.00	6,199,552.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,600,000.00	1,628,720.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	2,100,000.00	2,146,252.50	
SPGB 3.75% 10/31/15	400,000.00	411,748.00	

	SPGB 3.8% 01/31/17	4,000,000.00	4,098,980.00	
	SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	2,980,740.00	
	SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,709,523.00	
	SPGB 4.1% 07/30/18	3,450,000.00	3,549,480.75	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,600,000.00	2,203,682.00	
	SPGB 4.25% 10/31/16	4,000,000.00	4,169,580.00	
	SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,448,660.00	
	SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000.00	7,704,473.00	
	SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,194,878.00	
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,000,000.00	3,126,120.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	3,100,000.00	3,009,790.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,000,000.00	1,810,180.00	
	SPGB 4.75% 07/30/14	2,700,000.00	2,795,958.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,200,000.00	3,197,408.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	3,650,000.00	3,797,131.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,100,000.00	1,965,831.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,750,000.00	2,896,726.25	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,665,047.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	4,300,000.00	4,670,251.50	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,650,000.00	2,799,446.75	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,111,801.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,398,501.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,650,000.00	2,875,793.25	
	ユーロ小計	682,680,000.00	748,589,589.00 (96,702,803,107)	
	国債証券合計		228,917,866,056 (228,917,866,056)	
	合計		228,917,866,056 (228,917,866,056)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 132銘柄	100.0%	41.0%
カナダドル	国債証券 23銘柄	100.0%	2.5%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.0%	1.5%

イギリスポンド	国債証券	36銘柄	100.0%	7.3%
スイスフラン	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券	9銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券	229銘柄	100.0%	42.2%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	401,575,619
コール・ローン	80,885,717
株式	17,624,189,401
投資信託受益証券	88,199,453
投資証券	23,843,117
派生商品評価勘定	4,778,395
未収入金	567,005
未収配当金	104,914,175
未収利息	122
差入委託証拠金	92,057,351
流動資産合計	18,421,010,355
資産合計	18,421,010,355
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,314,403
流動負債合計	14,314,403
負債合計	14,314,403
純資産の部	
元本等	
元本	9,346,341,776
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,060,354,176
元本等合計	18,406,695,952
純資産合計	18,406,695,952
負債純資産合計	18,421,010,355

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券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を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計
上基準

約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	9,087,882,844円
計算期間中の追加設定元本額	976,118,741円
計算期間中の一部解約元本額	717,659,809円
計算日の元本額	9,346,341,776円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,113,238,203円
世界経済インデックスファンド	286,510,629円
DC新興国株式インデックス・オープン	1,486,193,325円
DC世界経済インデックスファンド	169,754,791円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,483,571,932円
新興国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	443,028,764円
コア投資戦略ファンド(安定型)	162,998,053円
コア投資戦略ファンド(成長型)	198,450,405円
分散投資コア戦略ファンドA	1,781,006円
分散投資コア戦略ファンドS	814,668円
2. 計算日における受益権総数	9,346,341,776口
3. 1口当たり純資産額	1.9694円
(1万口当たり純資産額)	(19,694円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	621,856,096
投資信託受益証券	755,567
投資証券	560,724
合計	621,661,253

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月13日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	693,042,633	-	683,546,598	9,496,035
合計		693,042,633	-	683,546,598	9,496,035

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			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 計	96,619,123 96,619,123	- -	96,579,150 96,579,150	39,973 39,973
合計		96,619,123	-	96,579,150	39,973

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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
に計算したレートを用いております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	22,762	41.12	935,973.44	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	305,776	6.85	2,094,565.60	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,200	4.52	132,071.60	
	LUKOIL-SPON ADR	26,964	57.75	1,557,171.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4,717	121.10	571,228.70	
	ROSNEFT OJSC-GDR	65,294	7.02	458,363.88	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	53,493	7.71	412,698.49	
	TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	11,984	35.11	420,758.24	
	TMK-GDR REG S	6,088	11.33	68,977.04	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	13,664	13.89	189,792.96	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	30,024	13.90	417,333.60	
	SEVERSTAL - GDR REG S	10,625	7.01	74,534.37	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,420	26.74	171,670.80	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	13,652	32.86	448,604.72	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	13,479	54.50	734,605.50	
	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	13,370	54.86	733,478.20	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	66,436	4.85	322,214.60	
	CREDICORP LTD	2,490	117.96	293,720.40	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	146,151	11.21	1,638,352.71	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	99,298	2.83	281,708.42	
LSR GROUP OJSC-GDR REGS	15,764	3.96	62,441.20		
MEGAFON-GDR	4,584	32.00	146,688.00		
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	27,140	18.85	511,589.00		
ORASCOM TELECOM-GDR REG S	55,143	2.79	153,848.97		
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	12,118	18.69	226,485.42		
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	6,706	20.64	138,411.84		
FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	72,272	1.57	113,611.58		
	アメリカドル小計	1,135,614		13,310,900.28 (1,346,264,454)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	208,000	3.95	821,600.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	80,000	14.92	1,193,600.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,297,400	5.30	6,876,220.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	179,500	19.42	3,485,890.00	

CNOOC LTD-R	898,000	13.16	11,817,680.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	156,000	12.62	1,968,720.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,068,000	8.98	9,590,640.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	96,000	5.19	498,240.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	180,000	2.37	426,600.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	59,500	20.55	1,222,725.00	
BBMG CORPORATION - H	57,000	4.19	238,830.00	
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	84,000	3.85	323,400.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	160,000	6.19	990,400.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	78,000	3.89	303,420.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	96,000	3.21	308,160.00	
FOSUN INTERNATIONAL	135,500	5.52	747,960.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	69,000	12.28	847,320.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	110,000	4.70	517,000.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	87,000	4.84	421,080.00	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LIMITED	182,000	2.78	505,960.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	218,000	2.46	536,280.00	
YINGDE GASES GROUP COMPANY	79,500	7.64	607,380.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	24,500	4.61	112,945.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	273,000	1.51	412,230.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	96,000	3.92	376,320.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	32,000	55.80	1,785,600.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	222,000	5.38	1,194,360.00	
CHINA INTL MARINE CO-H	18,200	12.24	222,768.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	102,500	6.01	616,025.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	170,000	3.18	540,600.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	92,000	11.60	1,067,200.00	
CITIC PACIFIC LIMITED -R	71,000	8.28	587,880.00	
CSR CORP LTD-H	100,000	4.22	422,000.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.46	413,280.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	23,000	23.00	529,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	25,200	22.70	572,040.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	21,000	16.50	346,500.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	64,380	5.07	326,406.60	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	97,000	6.16	597,520.00	

AIR CHINA LIMITED-H	92,000	5.10	469,200.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	4.61	497,880.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	142,500	3.26	464,550.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	51,513	22.85	1,177,072.05	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	1.90	418,000.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	140,000	2.84	397,600.00	
COSCO PACIFIC LIMITED-R	74,000	9.99	739,260.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	48,000	7.65	367,200.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	58,000	6.36	368,880.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	184,000	8.52	1,567,680.00	
BYD CO LTD-H	34,000	28.30	962,200.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	148,000	9.58	1,417,840.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	265,000	2.97	787,050.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	51,250	33.60	1,722,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	102,246	6.97	712,654.62	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	31,000	7.11	220,410.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	206,000	1.54	317,240.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	64,000	5.78	369,920.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	61,000	12.16	741,760.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	25,000	22.10	552,500.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	226,000	10.64	2,404,640.00	
DAH CHONG HONG	28,000	5.66	158,480.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	37,000	10.14	375,180.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	411,000	0.67	275,370.00	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	70,000	7.70	539,000.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	83,500	3.03	253,005.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	21,000	7.65	160,650.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	58,000	24.20	1,403,600.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	111,000	10.78	1,196,580.00	
WUMART STORES INC-H	29,000	14.00	406,000.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	68,000	-	-	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	92,300	3.29	303,667.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	64,000	28.85	1,846,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	94,000	20.00	1,880,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	18,000	55.75	1,003,500.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	39,000	7.72	301,080.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	291,000	10.54	3,067,140.00	
YANTAI CHANGYU PIONEER-B	10,800	31.96	345,168.00	

HENGAN INTL GROUP CO LTD	38,000	80.00	3,040,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	72,000	7.90	568,800.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	61,300	14.80	907,240.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	43,200	18.50	799,200.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	100,000	4.76	476,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	136,000	4.96	674,560.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,211,000	3.03	3,669,330.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,963,200	3.06	12,127,392.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	427,475	4.79	2,047,605.25	
CHINA CITIC BANK-H	517,200	3.39	1,753,308.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,623,620	5.25	19,024,005.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	188,289	12.68	2,387,504.52	
CHINA MINSHENG BANKING-H	252,000	7.52	1,895,040.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	90,000	3.05	274,500.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	3,736,515	4.74	17,711,081.10	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	50,000	10.08	504,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	61,500	12.76	784,740.00	
FAR EAST HORIZON LTD	76,000	4.72	358,720.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	56,000	8.85	495,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	385,000	17.52	6,745,200.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	132,800	24.10	3,200,480.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	54,400	10.46	569,024.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	28,600	22.15	633,490.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	199,000	3.36	668,640.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	207,412	8.48	1,758,853.76	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	99,000	48.85	4,836,150.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	7.52	541,440.00	
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	28,000	9.26	259,280.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	227,040	19.92	4,522,636.80	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	98,000	20.60	2,018,800.00	
CHINA VANKE CO LTD-B	66,200	13.00	860,600.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	212,285	3.89	825,788.65	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	348,000	3.03	1,054,440.00	
FRANSHION PROPERTIES	150,000	2.35	352,500.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	29,500	11.86	349,870.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	45,600	9.99	455,544.00	

	LONGFOR PROPERTIES	68,500	10.86	743,910.00	
	POLY PRORERTY GROUP CO LIMITED	75,000	4.01	300,750.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	14.26	1,098,020.00	
	SHUI ON LAND LTD	209,278	2.10	439,483.80	
	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS-R	157,584	3.84	605,122.56	
	SOHO CHINA LTD	90,500	6.24	564,720.00	
	YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	208,000	1.91	397,280.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	51,400	301.40	15,491,960.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	31,800	15.88	504,984.00	
	LENOVO GROUP LTD	328,000	6.91	2,266,480.00	
	ZTE CORP-H	29,424	11.42	336,022.08	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	114,000	4.41	502,740.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	310,000	80.30	24,893,000.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	678,000	3.73	2,528,940.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	246,000	10.48	2,578,080.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	148,000	7.90	1,169,200.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	137,000	7.97	1,091,890.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	46,000	19.52	897,920.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	91,400	19.24	1,758,536.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	158,000	3.35	529,300.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	36,000	42.60	1,533,600.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	112,000	6.50	728,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	150,000	7.75	1,162,500.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	503,000	1.65	829,950.00	
	香港ドル小計	32,177,311		246,665,887.79 (3,216,523,176)	
マレーシアリ ンギット	BUMI ARMADA BERHAD	43,800	4.00	175,200.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	9,300	25.96	241,428.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	181,600	4.02	730,032.00	
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	10.20	266,220.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	140,500	6.60	927,300.00	
	GAMUDA BHD	88,900	4.90	435,610.00	
	IJM CORP BHD	65,200	5.75	374,900.00	
	MMC CORP BHD	53,800	2.66	143,108.00	
	SIME DARBY BERHAD	150,400	9.43	1,418,272.00	
	AIRASIA BHD	64,800	3.23	209,304.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,419	6.32	192,248.08	

	MISC BHD	56,540	5.24	296,269.60	
	UMW HOLDINGS BHD	20,000	14.52	290,400.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	30,607	4.25	130,079.75	
	GENTING BHD	116,400	9.95	1,158,180.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	137,300	3.87	531,351.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	75,200	2.96	222,592.00	
	PARKSON HOLDINGS BHD	50,285	3.78	190,077.30	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	5,400	58.90	318,060.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	51,300	4.54	232,902.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	9.95	139,300.00	
	IOI CORPORATION BHD	158,340	5.42	858,202.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	23,500	21.46	504,310.00	
	PPB GROUP BERHAD	21,100	14.24	300,464.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	92,500	3.97	367,225.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	83,300	5.47	455,651.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	246,500	8.24	2,031,160.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	23,680	13.82	327,257.60	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,100	14.30	130,130.00	
	MALAYAN BANKING BHD	217,953	10.42	2,271,070.26	
	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	53,300	16.96	903,968.00	
	RHB CAPITAL BHD	32,235	8.45	272,385.75	
	AMMB HOLDINGS BHD	90,500	7.55	683,275.00	
	UEM SUNRISE BHD	68,900	3.06	210,834.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	128,375	6.66	854,977.50	
	DIGI.COM BERHAD	150,100	4.62	693,462.00	
	MAXIS BHD	108,300	6.81	737,523.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	66,300	5.39	357,357.00	
	PETRONAS GAS BHD	27,400	20.94	573,756.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	141,475	8.50	1,202,537.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	320,517	1.62	519,237.54	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	116,500	1.60	186,400.00	
	マレーシアリングット小計	3,591,726		23,064,017.68 (732,743,841)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	7,900	226.00	1,785,400.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	3.12	1,787,136.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	70,700	162.00	11,453,400.00	
	PTT PCL-NVDR	42,900	346.00	14,843,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	36,600	64.25	2,351,550.00	

	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	64,000	17.50	1,120,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	92,734	70.50	6,537,747.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,600	430.00	7,998,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	27,200	157.00	4,270,400.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	60.75	3,408,075.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	72,900	10.70	780,030.00	
	CP ALL PCL-NVDR	239,500	35.75	8,562,125.00	
	SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	5,600	780.00	4,368,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	168,800	28.00	4,726,400.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	17,700	143.00	2,531,100.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	64,700	188.00	12,163,600.00	
	BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	146,300	37.50	5,486,250.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	80,300	176.00	14,132,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	11,600	173.00	2,006,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	199,750	18.20	3,635,450.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	92,600	155.00	14,353,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	79,400	42.00	3,334,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	55,500	273.00	15,151,500.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	182,500	7.65	1,396,125.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	35,600	69.50	2,474,200.00	
	タイパーツ小計	2,442,284		150,657,288.00 (486,623,040)	
フィリピン ペ ソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	81,000	50.00	4,050,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	179,600	24.30	4,364,280.00	
	DMCI HOLDINGS INC	21,700	50.90	1,104,530.00	
	SM INVESTMENTS CORP	15,537	838.00	13,020,006.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	39,080	88.70	3,466,396.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	143.00	3,639,350.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	44,760	118.00	5,281,680.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	47,476	90.30	4,287,082.80	
	BDO UNIBANK INC	67,381	84.80	5,713,908.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	4,515	108.00	487,620.00	
	AYALA CORPORATION	9,900	570.00	5,643,000.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	360,000	4.95	1,782,000.00	
	AYALA LAND INC	342,400	28.90	9,895,360.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	309,750	16.50	5,110,875.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,550.00	2,774,500.00	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	1,730	2,828.00	4,892,440.00		

	ABOITIZ POWER CORP	89,500	32.90	2,944,550.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	5.90	3,577,170.00	
	フィリピンペソ小計	2,247,869		82,034,748.60 (191,140,964)	
インドネシア ルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	740.00	592,370,000.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	17,000	26,150.00	444,550,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	37,500	11,950.00	448,125,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	82,000	20,850.00	1,709,700,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	156,000	14,850.00	2,316,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	106,000	16,000.00	1,696,000,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,850.00	722,475,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,017,500	6,500.00	6,613,750,000.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	322,000	1,920.00	618,240,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	224,000	2,725.00	610,400,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	17,450.00	349,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	456,000	4,325.00	1,972,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	22,500	46,500.00	1,046,250,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	37,500	10,450.00	391,875,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	234,500	6,550.00	1,535,975,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	79,000	27,850.00	2,200,150,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,021,000	1,350.00	1,378,350,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	649,000	9,250.00	6,003,250,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	5,400.00	1,061,100,000.00	
	BANK MANDIRI	507,698	7,500.00	3,807,735,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	375,000	3,825.00	1,434,375,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	524,500	7,250.00	3,802,625,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	210,000	1,390.00	291,900,000.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	825,500	1,110.00	916,305,000.00	
	INDOSAT TBK PT	39,500	4,425.00	174,787,500.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	489,500	11,000.00	5,384,500,000.00	
XL AXIATA TBK PT	172,500	4,225.00	728,812,500.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	578,000	5,500.00	3,179,000,000.00		
	インドネシアルピア小計	9,324,198		51,430,400,000.00 (524,590,080)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	595,923	13.57	8,086,675.11	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	183,992	37.24	6,851,862.08	
	INDUSTRIAS CH S.A.B. -SER B	8,600	81.62	701,932.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,500	402.31	2,615,015.00	

	MEXICHEM SAB DE CV-*	51,190	53.01	2,713,581.90	
	MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	31,700	36.63	1,161,171.00	
	ALFA S.A.B.-A	136,800	31.74	4,342,032.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	31,700	59.44	1,884,248.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	13,400	150.51	2,016,834.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	64.19	1,122,041.20	
	OHL MEXICO SAB DE CV	46,200	34.33	1,586,046.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	136,690	65.68	8,977,799.20	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	14,100	152.03	2,143,623.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,600	46.18	905,128.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	264,380	36.06	9,533,542.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	21,275	95.82	2,038,570.50	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	20,600	179.87	3,705,322.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	96,840	132.00	12,782,880.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	82,900	39.90	3,307,710.00	
	GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	31,500	117.68	3,706,920.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	75,900	42.65	3,237,135.00	
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	55,500	25.47	1,413,585.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	99,300	34.23	3,399,039.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	92,700	74.90	6,943,230.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	128,700	30.81	3,965,247.00	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	59,900	23.15	1,386,685.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,966,340	13.65	26,840,541.00	
	メキシコペソ小計	4,289,710		127,368,395.79 (998,568,222)	
ブラジルレア ル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	6,600	42.20	278,520.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	151,500	13.55	2,052,825.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	212,540	14.98	3,183,849.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,600	52.00	915,200.00	
	BRADSPAR SA -PREF	11,000	20.15	221,650.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	15.81	140,709.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	35,200	5.46	192,192.00	
	DURATEX SA	12,320	12.63	155,601.60	
	FIBRIA CELULOSE SA	14,600	25.60	373,760.00	
	GERDAU SA-PREF	41,100	12.95	532,245.00	
	KLABIN SA-PREF	34,400	10.64	366,016.00	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	12,300	16.09	197,907.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	10,300	7.90	81,370.00	

USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,779	6.58	116,985.82	
VALE SA	62,900	28.39	1,785,731.00	
VALE SA-PREF A	102,415	26.08	2,670,983.20	
EMBRAER SA	28,700	20.62	591,794.00	
MARCOPOLO SA-PREF	15,700	12.56	197,192.00	
WEG SA	12,400	27.75	344,100.00	
MULTIPLUS SA	1,700	28.75	48,875.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	24,700	8.83	218,101.00	
ARTERIS SA	9,100	20.33	185,003.00	
CCR SA	44,000	16.94	745,360.00	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,900	15.00	118,500.00	
LOCALIZA RENT A CAR	6,090	30.75	187,267.50	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	13,400	15.31	205,154.00	
MRV ENGENHARIA	15,300	6.16	94,248.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	20,100	12.40	249,240.00	
KROTON EDUCATIONAL SA	8,800	29.29	257,752.00	
CIA HERING	6,400	31.37	200,768.00	
LOJAS AMERICANAS SA	7,200	12.91	92,952.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	21,858	15.10	330,055.80	
LOJAS RENNER S.A.	6,300	61.38	386,694.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	6,200	96.06	595,572.00	
RAIA DROGASIL SA	9,000	20.20	181,800.00	
BRF SA	34,600	47.50	1,643,500.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	37,200	82.17	3,056,724.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	6,600	81.11	535,326.00	
JBS SA	28,000	6.43	180,040.00	
M DIAS BRANCO SA	2,900	82.81	240,149.00	
SOUZA CRUZ SA	18,700	27.35	511,445.00	
HYPERMARCAS SA	19,800	14.76	292,248.00	
NATURA COSMETICOS SA	8,600	46.98	404,028.00	
ODONTOPREV S.A.	12,400	8.85	109,740.00	
QUALICORP SA	13,300	15.30	203,490.00	
BANCO BRADESCO S.A.	30,800	28.54	879,032.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	106,700	26.00	2,774,200.00	
BANCO DO BRASIL S.A.	26,900	20.41	549,029.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	7,700	13.70	105,490.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	131,890	26.80	3,534,652.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	146,344	7.75	1,134,166.00	

	BM&FBOVESPA SA	95,600	12.27	1,173,012.00	
	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,500	21.45	246,675.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	32,100	17.90	574,590.00	
	PORTO SEGURO SA	5,900	23.23	137,057.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	20,200	18.60	375,720.00	
	BR PROPERTIES SA	9,000	18.33	164,970.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,900	50.33	196,287.00	
	CIELO SA	17,760	55.50	985,680.00	
	TOTVS SA	5,800	33.71	195,518.00	
	OI SA-PREFERENCE	45,431	3.63	164,914.53	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	15,200	47.95	728,840.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	39,200	8.26	323,792.00	
	AES TIETE SA-PREF	6,100	21.46	130,906.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,300	4.44	72,372.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	9,000	8.88	79,920.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	6,800	18.73	127,364.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	27,113	19.98	541,717.74	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,500	27.63	151,965.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	17,100	21.47	367,137.00	
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	3,400	33.05	112,370.00	
	CPFL ENERGIA SA	12,768	20.35	259,828.80	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	12,900	10.90	140,610.00	
	MPX ENERGIA SA	5,100	7.50	38,250.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	10,600	34.50	365,700.00	
	ブラジルリアル小計	2,083,008		42,304,428.19 (1,893,546,205)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	21,825	6,194.40	135,192,780.00	
	CAP SA	3,824	9,368.20	35,823,996.80	
	EMPRESAS CMPC SA	59,660	1,419.40	84,681,404.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,701	20,290.00	95,383,290.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,037	7,918.60	103,234,788.20	
	S.A.C.I. FALABELLA	40,905	5,351.40	218,899,017.00	
	CENCOSUD SA	52,180	2,347.00	122,466,460.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	6,096	7,199.70	43,889,371.20	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,829.90	43,048,438.80	
	VINA CONCHA Y TORO SA	54,191	947.00	51,318,877.00	
	BANCO DE CHILE	982,651	70.63	69,404,640.13	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,588	29,251.00	46,450,588.00	

	BANCO SANTANDER CHILE	3,113,843	28.87	89,896,647.41	
	CORPBANCA	8,419,981	5.55	46,772,994.45	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	8,363.40	50,966,559.60	
	AES GENER SA	104,798	327.87	34,360,120.26	
	AGUAS ANDINAS SA-A	107,808	339.50	36,600,816.00	
	COLBUN SA	410,079	129.92	53,277,463.68	
	E.CL SA	48,523	782.80	37,983,804.40	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	167,149	704.64	117,779,871.36	
	ENERSIS SA	952,738	156.83	149,417,900.54	
	チリペソ小計	14,586,883		1,666,849,828.83 (331,536,430)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,786	50,900.00	141,807,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,210	139,000.00	446,190,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,270	71,500.00	162,305,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	2,213	86,300.00	190,981,900.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	3,756	17,100.00	64,227,600.00	
	HANWHA CORPORATION	1,835	29,650.00	54,407,750.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	62,000.00	87,358,000.00	
	HYUNDAI HYSCO	1,460	36,050.00	52,633,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,908	64,500.00	187,566,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	381	264,500.00	100,774,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	580	83,700.00	48,546,000.00	
	LG CHEM LTD	2,476	257,500.00	637,570,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	163	115,500.00	18,826,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	906	147,500.00	133,635,000.00	
	OCI COMPANY LTD	780	136,000.00	106,080,000.00	
	POSCO	3,320	300,500.00	997,660,000.00	
	CJ CORP	898	117,500.00	105,515,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,470	81,400.00	119,658,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	4,210	6,810.00	28,670,100.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,992	34,300.00	102,625,600.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,110	27,200.00	111,792,000.00	
	DOOSAN CORP	304	126,000.00	38,304,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	2,311	41,000.00	94,751,000.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	4,280	10,800.00	46,224,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,822	27,500.00	50,105,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,000	23,800.00	71,400,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	3,428	55,900.00	191,625,200.00	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,260	185,500.00	419,230,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	430	128,000.00	55,040,000.00	
KCC CORP	260	335,000.00	87,100,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,510	30,650.00	46,281,500.00	
LG CORP	4,420	63,600.00	281,112,000.00	
LS CORP	1,095	68,300.00	74,788,500.00	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	617	59,800.00	36,896,600.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,821	51,900.00	354,009,900.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,603	68,000.00	109,004,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	7,540	37,550.00	283,127,000.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	1,635	64,700.00	105,784,500.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,234	170,000.00	209,780,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	4,700	6,390.00	30,033,000.00	
S-1 CORPORATION	1,294	66,900.00	86,568,600.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	594	182,000.00	108,108,000.00	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	2,198	14,650.00	32,200,700.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,006	29,450.00	59,076,700.00	
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	2,270	31,700.00	71,959,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	3,361	53,200.00	178,805,200.00	
HYUNDAI MOBIS	3,471	254,000.00	881,634,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	8,207	217,500.00	1,785,022,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,719	95,600.00	164,336,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	830	89,200.00	74,036,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	699	169,000.00	118,131,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	13,628	60,400.00	823,131,200.00	
COWAY CO.,LTD.	2,430	58,000.00	140,940,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,431	69,000.00	374,739,000.00	
KANGWON LAND INC	5,180	30,850.00	159,803,000.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	4,110	24,350.00	100,078,500.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	832	159,000.00	132,288,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	665	364,000.00	242,060,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	417	225,000.00	93,825,000.00	
EMART	1,007	211,500.00	212,980,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	404	269,000.00	108,676,000.00	
HITE JINRO CO LTD	2,640	28,100.00	74,184,000.00	
KT&G CORP	5,333	77,600.00	413,840,800.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	1,624,000.00	73,080,000.00	
ORION CORP	159	950,000.00	151,050,000.00	

AMOREPACIFIC CORP	180	910,000.00	163,800,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	446	538,000.00	239,948,000.00	
PACIFIC CORP	121	369,500.00	44,709,500.00	
CELLTRION INC	3,068	44,800.00	137,446,400.00	
YUHAN CORPORATION	366	194,000.00	71,004,000.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	7,870	15,750.00	123,952,500.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	6,090	15,550.00	94,699,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	14,611	32,300.00	471,935,300.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	7,770	10,950.00	85,081,500.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	19,168	34,050.00	652,670,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	22,005	38,500.00	847,192,500.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	16,320	10,850.00	177,072,000.00	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	7,448	9,770.00	72,766,960.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	4,190	6,220.00	26,061,800.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,840	40,150.00	73,876,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,508	37,400.00	56,399,200.00	
SAMSUNG CARD CO	1,896	38,000.00	72,048,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,246	45,300.00	147,043,800.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,202	11,100.00	91,042,200.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,150	49,300.00	105,995,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE	7,630	6,760.00	51,578,800.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,170	30,550.00	96,843,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,076	243,500.00	505,506,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	2,905	108,500.00	315,192,500.00	
NCSOFT CORPORATION	708	172,000.00	121,776,000.00	
NHN CORP	2,232	295,500.00	659,556,000.00	
SK C&C CO LTD	1,235	99,000.00	122,265,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	11,080	27,600.00	305,808,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	392	82,300.00	32,261,600.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,844	80,400.00	228,657,600.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,745	140,000.00	244,300,000.00	
KT CORP	2,340	36,200.00	84,708,000.00	
LG UPLUS CORP	14,670	12,200.00	178,974,000.00	
SK TELECOM	945	213,000.00	201,285,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	13,180	26,950.00	355,201,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,083	56,100.00	60,756,300.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,650	1,237,000.00	6,989,050,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,057	805,000.00	850,885,000.00	

	SK HYNIX INC	27,470	28,350.00	778,774,500.00	
	韓国ウォン小計	393,240		29,082,103,010.00 (2,576,674,326)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	50,240	74.00	3,717,760.00	
	ASIA CEMENT CORP	95,311	36.00	3,431,196.00	
	CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	82,720	15.25	1,261,480.00	
	CHINA STEEL	617,280	23.70	14,629,536.00	
	FENG HSIN IRON & STEEL CO	25,000	50.70	1,267,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	167,050	72.50	12,111,125.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	198,870	72.30	14,378,301.00	
	LCY CHEMICAL CORP	21,796	37.40	815,170.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	250,250	59.40	14,864,850.00	
	TAIWAN CEMENT	203,929	36.30	7,402,622.70	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	72.00	2,448,000.00	
	TSRC CORP	27,830	58.50	1,628,055.00	
	TUNG HO STEEL ENTERPRISE COR	40,000	26.25	1,050,000.00	
	CTCI CORP	33,000	57.20	1,887,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	156,611	32.35	5,066,365.85	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	7,570	173.50	1,313,395.00	
	TAIWAN GLASS IND CORP	65,486	27.35	1,791,042.10	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	83,000	29.90	2,481,700.00	
	WALSIN LIHWA CORP	199,000	8.50	1,691,500.00	
	CHINA AIRLINES LTD	133,203	11.20	1,491,873.60	
	EVA AIRWAYS CORP	95,000	16.80	1,596,000.00	
	EVERGREEN MARINE	106,499	16.10	1,714,633.90	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	18,000	46.75	841,500.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	28,350	15.50	439,425.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	42,900	12.20	523,380.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	88,749	95.10	8,440,029.90	
	CHINA MOTOR CORP	51,000	26.05	1,328,550.00	
	NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	43,309	35.05	1,517,980.45	
	YULON MOTOR COMPANY	56,000	47.90	2,682,400.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	28.25	1,130,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	11,464	217.00	2,487,688.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	15,000	196.00	2,940,000.00	
POU CHEN	117,780	29.00	3,415,620.00		
RUENTEX INDUSTRIES LTD	21,777	64.50	1,404,616.50		
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	2,662	368.00	979,616.00		

FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	48,187	27.75	1,337,189.25	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,000	357.00	4,284,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	27,544	208.50	5,742,924.00	
STANDARD FOODS CORP	11,160	99.80	1,113,768.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	232,835	59.10	13,760,548.50	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	27,000	69.90	1,887,300.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	235,688	16.95	3,994,911.60	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	636,780	8.34	5,310,745.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	603,306	18.60	11,221,491.60	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	288,584	18.10	5,223,370.40	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	319,131	17.70	5,648,618.70	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	271,625	16.65	4,522,556.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	485,876	23.65	11,490,967.40	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	261,559	14.05	3,674,903.95	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	273,063	13.30	3,631,737.90	
TAIWAN BUSINESS BANK	171,003	8.95	1,530,476.85	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	362,744	16.55	6,003,413.20	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	29,000	63.50	1,841,500.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	309,082	38.30	11,837,840.60	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	479,944	15.35	7,367,140.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	381,673	41.60	15,877,596.80	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	113,759	29.00	3,299,011.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	324,826	10.00	3,248,260.00	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	10,000	55.60	556,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	21,600	63.00	1,360,800.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	37,993	52.20	1,983,234.60	
ACER INC	146,375	22.40	3,278,800.00	
ADVANTECH CO LTD	15,600	141.00	2,199,600.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	32,092	261.00	8,376,012.00	
AU OPTRONICS CORP	388,090	10.50	4,074,945.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	33,700	145.50	4,903,350.00	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	17,340	58.30	1,010,922.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	27,807	76.20	2,118,893.40	
CLEVO COMPANY	21,008	52.70	1,107,121.60	
COMPAL ELECTRONICS	224,760	18.85	4,236,726.00	
DELTA ELECTRONICS INC	101,520	146.00	14,821,920.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	40,426	72.00	2,910,672.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	510,048	74.50	37,998,576.00	

	HTC CORPORATION	35,430	188.50	6,678,555.00	
	INVENTEC CO LTD	164,511	18.60	3,059,904.60	
	LARGAN PRECISION CO LTD	5,040	929.00	4,682,160.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	103,058	51.60	5,317,792.80	
	PEGATRON CORP	71,474	50.50	3,609,437.00	
	QUANTA COMPUTER INC	124,270	65.10	8,089,977.00	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	13,354	119.00	1,589,126.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	69,381	39.05	2,709,328.05	
	TPK HOLDING CO LTD	10,969	374.50	4,107,890.50	
	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	19,100	64.70	1,235,770.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	59,000	28.40	1,675,600.00	
	WISTRON CORP	99,171	27.80	2,756,953.80	
	WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	34.45	2,796,892.15	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	9,450	67.00	633,150.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	184,315	99.40	18,320,911.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	81,000	81.50	6,601,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	78,200	109.50	8,562,900.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	362,739	25.35	9,195,433.65	
	EPISTAR CORP	34,000	53.10	1,805,400.00	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	902.00	2,706,000.00	
	KINSUS INTERCONNECT TECH	12,000	110.50	1,326,000.00	
	MEDIATEK INC	60,064	353.50	21,232,624.00	
	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	11,008	220.00	2,421,760.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	26,045	133.00	3,463,985.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	6,599	244.00	1,610,156.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,770	55.90	2,111,343.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	19,570	104.00	2,035,280.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	23,707	72.00	1,706,904.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	161,000	38.00	6,118,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,261,389	106.00	133,707,234.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	86.60	817,937.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	634,000	14.25	9,034,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	32,000	36.50	1,168,000.00	
	新台湾ドル小計	14,668,610		633,846,761.15 (2,129,725,117)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,660	345.60	1,956,096.00	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	294.20	6,516,530.00	

COAL INDIA LTD	21,324	291.40	6,213,813.60	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	43,232	302.15	13,062,548.80	
OIL INDIA LTD	7,461	537.30	4,008,795.30	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	66,754	874.80	58,396,399.20	
ACC LTD	3,062	1,250.75	3,829,796.50	
AMBUJA CEMENTS LTD	32,735	195.15	6,388,235.25	
ASIAN PAINTS LTD	1,215	4,762.55	5,786,498.25	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	49,471	100.85	4,989,150.35	
JINDAL STEEL & POWER LTD	19,814	217.10	4,301,619.40	
JSW STEEL LTD	3,763	608.90	2,291,290.70	
SESA GOA LTD	18,682	143.45	2,679,932.90	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	59,174	84.15	4,979,492.10	
TATA STEEL LTD	14,409	261.65	3,770,114.85	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,438	1,930.25	2,775,699.50	
ADANI ENTERPRISES LTD	7,547	204.80	1,545,625.60	
ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,306	1,034.25	2,384,980.50	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	32,256	186.75	6,023,808.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	37,334	53.10	1,982,435.40	
LARSEN & TOUBRO LTD	10,658	1,428.30	15,222,821.40	
SIEMENS INDIA LTD	7,818	532.25	4,161,130.50	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	11,935	149.30	1,781,895.50	
BAJAJ AUTO LTD	5,066	1,898.20	9,616,281.20	
HERO MOTOCORP LTD	2,195	1,659.70	3,643,041.50	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	14,072	938.10	13,200,943.20	
TATA MOTORS LTD	34,257	289.10	9,903,698.70	
TITAN INDUSTRIES LTD	7,394	239.15	1,768,275.10	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	26,571	246.90	6,560,379.90	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	829	5,278.60	4,375,959.40	
ITC LTD	120,079	347.45	41,721,448.55	
UNITED BREWERIES LTD	4,195	842.95	3,536,175.25	
UNITED SPIRITS LTD	4,068	2,647.30	10,769,216.40	
DABUR INDIA LTD	19,484	156.45	3,048,271.80	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,666	794.80	5,298,136.80	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	27,499	604.95	16,635,520.05	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,650	969.95	2,570,367.50	
CIPLA LTD	15,010	400.15	6,006,251.50	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,694	992.05	2,672,582.70	

DR. REDDY'S LABORATORIES	6,073	2,284.20	13,871,946.60	
LUPIN LTD	6,867	835.50	5,737,378.50	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	575.55	2,034,569.25	
RANBAXY LABORATORIES LTD	6,355	348.95	2,217,577.25	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	17,704	1,079.70	19,115,008.80	
AXIS BANK LTD	14,193	1,264.35	17,944,919.55	
BANK OF BARODA	6,598	568.50	3,750,963.00	
BANK OF INDIA	4,754	230.55	1,096,034.70	
CANARA BANK	3,635	356.00	1,294,060.00	
HDFC BANK LTD	81,765	670.30	54,807,079.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	75,895	830.05	62,996,644.75	
ICICI BANK LTD	20,594	1,034.35	21,301,403.90	
LIC HOUSING FINANCE LTD	19,565	227.65	4,453,972.25	
STATE BANK OF INDIA	6,493	1,894.65	12,301,962.45	
IDFC LTD	47,718	127.65	6,091,202.70	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,709	714.05	9,788,911.45	
POWER FINANCE CORPORATION	9,522	138.60	1,319,749.20	
RELIANCE CAPITAL LTD	4,769	381.05	1,817,227.45	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	13,706	202.55	2,776,150.30	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,385	715.60	5,284,706.00	
DLF LTD	24,294	177.00	4,300,038.00	
UNITECH LTD	52,722	20.30	1,070,256.60	
HCL TECHNOLOGIES LTD	9,433	822.75	7,761,000.75	
INFOSYS LTD	23,871	2,498.20	59,634,532.20	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	23,447	1,504.90	35,285,390.30	
WIPRO LTD	28,992	360.15	10,441,468.80	
BHARTI AIRTEL LTD	25,397	291.65	7,407,035.05	
IDEA CELLULAR LTD	29,763	141.35	4,207,000.05	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	32,379	142.45	4,612,388.55	
GAIL INDIA LTD	25,389	317.35	8,057,199.15	
NTPC LTD	48,348	142.30	6,879,920.40	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	56,375	109.85	6,192,793.75	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,423	379.30	2,815,543.90	
RELIANCE POWER LTD	26,910	75.80	2,039,778.00	
TATA POWER CO LTD	54,425	85.55	4,656,058.75	
インドルピー小計	1,612,930		721,737,131.00 (1,226,953,122)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	943	3,535.00	3,333,505.00

	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	6,181	257.00	1,588,517.00	
	CEZ AS	9,976	470.00	4,688,720.00	
	チェココルナ小計	17,100		9,610,742.00 (48,053,710)	
ハンガリー フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	1,773	16,950.00	30,052,350.00	
	OTP BANK NYRT	11,567	5,010.00	57,950,670.00	
	MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	28,589	321.00	9,177,069.00	
	ハンガリーフォリント小計	41,929		97,180,089.00 (42,943,881)	
ポーランドズ ロチ	GRUPA LOTOS SA	2,227	37.00	82,399.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	15,313	45.97	703,938.61	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	92,344	6.15	567,915.60	
	GRUPA AZOTY SA	3,391	66.19	224,450.29	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,244	63.01	141,394.44	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,215	122.00	880,230.00	
	SYNTHOS SA	33,750	4.40	148,500.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,880	19.00	225,720.00	
	EUROCASH SA	2,543	58.10	147,748.30	
	KERNEL HOLDING SA	3,178	50.50	160,489.00	
	ALIOR BANK SA	2,685	86.90	233,326.50	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	89.30	179,493.00	
	BANK MILLENNIUM SA	22,475	5.16	115,971.00	
	BANK PEKAO SA	6,079	141.85	862,306.15	
	BANK ZACHODNI WBK SA	1,418	280.00	397,040.00	
	BRE BANK SA	761	378.00	287,658.00	
	PKO BANK POLSKI SA	44,071	34.20	1,507,228.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,976	417.25	1,241,736.00	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	36,440	7.70	280,588.00	
	ENEA SA	4,648	13.14	61,074.72	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	36,786	14.57	535,972.02		
TAURON POLSKA ENERGIA SA	40,920	4.25	173,910.00		
	ポーランドズロチ小計	375,354		9,159,088.83 (274,039,937)	
南アフリカ ランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,884	145.00	1,143,180.00	
	SASOL LTD	28,008	428.24	11,994,145.92	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,019	145.53	1,021,475.07	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,805	282.99	1,076,776.95	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	19,447	127.80	2,485,326.60	

ASSORE LTD	1,860	317.59	590,717.40
GOLD FIELDS LTD	33,782	49.50	1,672,209.00
HARMONY GOLD MINING CO LTD	20,054	34.53	692,464.62
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	26,620	89.35	2,378,497.00
KUMBA IRON ORE LTD	3,653	459.00	1,676,727.00
NAMPAK LTD	46,363	32.50	1,506,797.50
NORTHAM PLATINUM LTD	13,846	33.82	468,271.72
PPC LIMITED	30,677	29.00	889,633.00
SAPPI LIMITED	26,526	24.73	655,987.98
BARLOWORLD LTD	13,028	83.50	1,087,838.00
BIDVEST GROUP LTD	16,104	240.74	3,876,876.96
REUNERT LTD	14,365	66.00	948,090.00
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	73,757	25.50	1,880,803.50
NASPERS LTD-N SHS	19,911	752.47	14,982,430.17
IMPERIAL HOLDINGS LTD	12,155	206.55	2,510,615.25
MR PRICE GROUP LTD	11,589	131.10	1,519,317.90
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	10,233	96.11	983,493.63
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	21,406	86.60	1,853,759.60
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	40,114	65.45	2,625,461.30
MASSMART HOLDINGS LTD	5,649	173.35	979,254.15
PICK N PAY STORES LTD	10,581	38.40	406,310.40
SHOPRITE HOLDINGS LTD	21,783	184.95	4,028,765.85
SPAR GROUP LIMITED/THE	10,016	113.25	1,134,312.00
TIGER BRANDS LTD	8,354	291.13	2,432,100.02
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	49,296	36.30	1,789,444.80
NETCARE LTD	36,951	23.45	866,500.95
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	14,257	240.33	3,426,384.81
ABSA GROUP LTD	18,634	141.49	2,636,524.66
NEDBANK GROUP LTD	9,558	174.00	1,663,092.00
STANDARD BANK GROUP LTD	58,855	107.80	6,344,569.00
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	41,558	15.60	648,304.80
FIRSTRAND LTD	153,209	28.80	4,412,419.20
INVESTEC LTD	15,904	64.05	1,018,651.20
REMGRO LTD	24,603	189.50	4,662,268.50
RMB HOLDINGS LTD	34,090	39.06	1,331,555.40
DISCOVERY LIMITED	18,014	86.50	1,558,211.00
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	116.84	727,445.84
MMI HOLDINGS LTD	49,547	20.84	1,032,559.48

	RMI HOLDINGS	40,408	25.29	1,021,918.32	
	SANLAM LTD	87,946	45.87	4,034,083.02	
	MTN GROUP LTD	85,719	180.61	15,481,708.59	
	VODACOM GROUP	17,139	107.29	1,838,843.31	
	南アフリカランド小計	1,320,503		123,996,123.37 (1,248,640,962)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	6,478	43.00	278,554.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	121,601	1.95	237,121.95	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	1,677	23.10	38,738.70	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	25,327	5.14	130,180.78	
	KOC HOLDING AS	31,393	9.04	283,792.72	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	30,142	2.67	80,479.14	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	12,762	11.50	146,763.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	38,131	7.96	303,522.76	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	25.90	84,382.20	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	9,987	12.65	126,335.55	
	ARCELIK AS	15,358	12.60	193,510.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	10,644	40.30	428,953.20	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	9,571	24.80	237,360.80	
	COCA-COLA ICECEK AS	2,991	53.00	158,523.00	
	AKBANK T.A.S.	90,842	7.12	646,795.04	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	124,571	7.30	909,368.30	
	TURKIYE HALK BANKASI	28,740	14.65	421,041.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	85,644	5.12	438,497.28	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	35,938	4.22	151,658.36	
	YAPI VE KREDI BANKASI	41,263	4.08	168,353.04	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	41,483	9.86	409,022.38	
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	21,819	2.63	57,383.97	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	26,540	7.02	186,310.80	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,927	11.45	434,264.15	
	トルコリラ小計	854,087		6,550,912.92 (341,761,127)	
ユーロ	MAROC TELECOM	12,056	8.90	107,298.40	
	ユーロ小計	12,056		107,298.40 (13,860,807)	
	合計	91,174,412		17,624,189,401 (17,624,189,401)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	メキシコペソ	CONTROLADORA COML MEXIC-UB	18,600.00	857,460.00	
	メキシコペソ小計		18,600.00	857,460.00 (6,722,486)	
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER SA	52,500.00	683,025.00	
		BANCO SANTANDER SA-RTS	155,835.00	1,558.35	
		SUL AMERICA SA-UNITS	8,518.00	108,093.42	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500.00	163,125.00	
	ブラジルリアル小計		224,353.00	955,801.77 (42,781,687)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	85,840.00	2,191,495.20	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	166,445.00	1,651,134.40	
	南アフリカランド小計		252,285.00	3,842,629.60 (38,695,280)	
投資信託受益証券合計				88,199,453 (88,199,453)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	72,600.00	3,041,214.00	
	メキシコペソ小計		72,600.00	3,041,214.00 (23,843,117)	
投資証券合計				23,843,117 (23,843,117)	
合計				112,042,570 (112,042,570)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 27銘柄	100.0%	7.6%
香港ドル	株式 137銘柄	100.0%	18.1%
マレーシアリングット	株式 42銘柄	100.0%	4.1%
タイバーツ	株式 25銘柄	100.0%	2.7%
フィリピンペソ	株式 18銘柄	100.0%	1.1%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%	3.0%
メキシコペソ	株式 27銘柄	97.0%	5.6%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.7%	0.0%

	投資証券	1銘柄	2.3%	0.1%
ブラジルリアル	株式	75銘柄	97.8%	10.7%
	投資信託受益証券	4銘柄	2.2%	0.2%
チリペソ	株式	21銘柄	100.0%	1.9%
韓国ウォン	株式	104銘柄	100.0%	14.5%
新台湾ドル	株式	106銘柄	100.0%	12.0%
インドルピー	株式	74銘柄	100.0%	6.9%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	0.3%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	0.2%
ポーランドズロチ	株式	22銘柄	100.0%	1.5%
南アフリカランド	株式	47銘柄	97.0%	7.0%
	投資信託受益証券	2銘柄	3.0%	0.2%
トルコリラ	株式	24銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	株式	1銘柄	100.0%	0.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	312,707,902
コール・ローン	214,179,702
国債証券	20,517,725,982
派生商品評価勘定	310,074
未収利息	299,157,215
前払費用	50,758,112
流動資産合計	21,394,838,987
資産合計	21,394,838,987
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,884
未払金	199,531,691
未払解約金	848,531
流動負債合計	200,394,106
負債合計	200,394,106
純資産の部	
元本等	
元本	13,151,424,114
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,043,020,767
元本等合計	21,194,444,881
純資産合計	21,194,444,881
負債純資産合計	21,394,838,987

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	11,741,364,655円
計算期間中の追加設定元本額	3,384,933,693円
計算期間中の一部解約元本額	1,974,874,234円
計算日の元本額	13,151,424,114円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	2,639,472,310円
世界経済インデックスファンド	365,507,399円
DC新興国債券インデックス・オープン	1,538,786,484円
DC世界経済インデックスファンド	213,563,418円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	577,928,693円

コア投資戦略ファンド(安定型)	885,962,068円
コア投資戦略ファンド(成長型)	837,852,583円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	6,079,700,801円
分散投資コア戦略ファンドA	9,311,151円
分散投資コア戦略ファンドS	3,339,207円
2. 計算日における受益権総数	13,151,424,114口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6116円 (16,116円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成25年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	888,421,552
合計	888,421,552

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月13日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	インドネシアルピア	15,586,167	-	15,874,289	288,122
	ハンガリーフォリント	13,832,896	-	13,854,848	21,952
	計	29,419,063	-	29,729,137	310,074
	売 建				
アメリカドル	15,586,167	-	15,600,051	13,884	
計	15,586,167	-	15,600,051	13,884	
合計		45,005,230	-	45,329,188	296,190

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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
に計算したレートを用いております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 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	マレーシアリングット	MGS 3.172% 07/15/16	5,750,000.00	5,730,306.25		
		MGS 3.197% 10/15/15	1,050,000.00	1,049,370.00		
		MGS 3.26% 03/01/18	800,000.00	796,588.00		
		MGS 3.314% 10/31/17	8,600,000.00	8,561,429.00		
		MGS 3.418% 08/15/22	5,050,000.00	4,947,055.75		
		MGS 3.492% 03/31/20	5,900,000.00	5,871,444.00		
		MGS 3.58% 09/28/18	5,000,000.00	5,010,200.00		
		MGS 3.741% 02/27/15	7,500,000.00	7,572,000.00		
		MGS 3.835% 08/12/15	1,800,000.00	1,822,941.00		
		MGS 3.844% 04/15/33	350,000.00	345,028.25		
		MGS 3.892% 03/15/27	4,300,000.00	4,312,685.00		
		MGS 4.012% 09/15/17	1,500,000.00	1,530,832.50		
		MGS 4.127% 04/15/32	1,300,000.00	1,324,121.50		
		MGS 4.16% 07/15/21	3,100,000.00	3,191,295.00		
		MGS 4.232% 06/30/31	780,000.00	806,126.10		
		MGS 4.24% 02/07/18	3,900,000.00	4,022,557.50		
		MGS 4.262% 09/15/16	2,000,000.00	2,054,120.00		
		MGS 4.378% 11/29/19	3,550,000.00	3,702,348.25		
		MGS 4.392% 04/15/26	2,450,000.00	2,591,352.75		
	マレーシアリングット小計			64,680,000.00	65,241,800.85 (2,072,732,013)	
	タイバーツ	THAIGB 2.8% 10/10/17	30,500,000.00	29,864,380.00		
		THAIGB 3.125% 12/11/15	36,500,000.00	36,691,625.00		
		THAIGB 3.25% 06/16/17	71,500,000.00	71,461,390.00		
		THAIGB 3.45% 03/08/19	51,600,000.00	51,474,096.00		
		THAIGB 3.58% 12/17/27	37,500,000.00	36,068,625.00		
		THAIGB 3.625% 05/22/15	61,600,000.00	62,420,512.00		
		THAIGB 3.625% 06/16/23	46,500,000.00	46,308,187.50		
THAIGB 3.65% 12/17/21		48,200,000.00	48,167,706.00			
THAIGB 3.875% 06/13/19		21,000,000.00	21,452,025.00			
THAIGB 4.125% 11/18/16		15,700,000.00	16,202,243.00			

	THAIGB 4.75% 12/20/24	12,262,000.00	13,242,960.00	
	THAIGB 5.125% 03/13/18	21,700,000.00	23,292,020.50	
	タイパーツ小計	454,562,000.00	456,645,770.00 (1,474,965,837)	
フィリピンペソ	RPGB 7.375% 03/03/21	5,000,000.00	5,934,885.00	
	RPGB 8% 07/19/31	28,000,000.00	40,201,644.00	
	フィリピンペソ小計	33,000,000.00	46,136,529.00 (107,498,112)	
インドネシアルピア	INDOGB 10% 02/15/28	5,700,000,000.00	6,551,437,500.00	
	INDOGB 10% 07/15/17	3,600,000,000.00	3,982,500,000.00	
	INDOGB 10% 09/15/24	2,850,000,000.00	3,250,781,250.00	
	INDOGB 10.5% 08/15/30	4,600,000,000.00	5,453,875,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	5,850,000,000.00	7,133,343,750.00	
	INDOGB 11% 10/15/14	1,000,000,000.00	1,049,375,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	3,400,000,000.00	4,026,875,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	3,000,000,000.00	3,907,500,000.00	
	INDOGB 5.25% 05/15/18	4,000,000,000.00	3,710,000,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	12,300,000,000.00	10,370,437,500.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	7,500,000,000.00	6,206,250,000.00	
	INDOGB 6.25% 04/15/17	12,300,000,000.00	12,000,187,500.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	9,500,000,000.00	7,879,062,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	12,100,000,000.00	11,616,000,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	21,700,000,000.00	19,584,250,000.00	
	INDOGB 7.375% 09/15/16	16,700,000,000.00	16,898,312,500.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	27,700,000,000.00	27,215,250,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	9,200,000,000.00	9,476,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	1,600,000,000.00	1,627,000,000.00	
	INDOGB 9.5% 05/15/41	4,765,000,000.00	5,253,412,500.00	
INDOGB 9.5% 06/15/15	3,420,000,000.00	3,586,725,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	3,400,000,000.00	3,714,500,000.00		
	インドネシアルピア小計	176,185,000,000.00	174,493,075,000.00 (1,779,829,365)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,100,000.00	8,267,116.50	
	MBONO 10% 12/05/24	16,300,000.00	22,039,474.50	
	MBONO 5% 06/15/17	13,600,000.00	13,596,056.00	
	MBONO 6% 06/18/15	12,500,000.00	12,906,187.50	
	MBONO 6.25% 06/16/16	17,000,000.00	17,800,955.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	12,300,000.00	12,919,120.50	

	MBONO 6.5% 06/10/21	20,700,000.00	21,775,054.50	
	MBONO 7% 06/19/14	7,400,000.00	7,604,536.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	8,300,000.00	8,946,445.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	10,000,000.00	11,169,600.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	9,500,000.00	10,605,277.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	14,000,000.00	15,416,100.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	10,650,000.00	11,745,885.00	
	MBONO 8% 06/11/20	12,800,000.00	14,589,888.00	
	MBONO 8% 12/07/23	7,500,000.00	8,734,987.50	
	MBONO 8% 12/17/15	10,500,000.00	11,389,140.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,500,000.00	18,731,750.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	15,700,000.00	18,636,920.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	7,800,000.00	8,943,519.00	
	MBONO 9.5% 12/18/14	20,000,000.00	21,497,700.00	
	メキシコペソ小計	248,150,000.00	277,315,713.50 (2,174,155,193)	
ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/16	12,000,000.00	9,350,508.00	
	BLTN 0% 04/01/15	10,000,000.00	8,489,020.00	
	BNTNF 10% 01/01/15	3,000,000.00	3,012,632.49	
	BNTNF 10% 01/01/17	7,500,000.00	7,343,668.73	
	BNTNF 10% 01/01/21	2,000,000.00	1,894,821.66	
	BNTNF 10% 01/01/23	1,000,000.00	935,642.83	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	2,400,000.00	2,480,736.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000.00	10,208,890.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	2,500,000.00	2,927,625.00	
	ブラジルリアル小計	49,900,000.00	46,643,544.71 (2,087,765,061)	
コロンビアペソ	COLOM 12% 10/22/15	6,644,000,000.00	7,642,460,320.00	
	COLOM 4.375% 03/21/23	850,000,000.00	766,113,500.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	2,970,000,000.00	3,355,535,700.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	925,000,000.00	1,222,170,125.00	
	コロンビアペソ小計	11,389,000,000.00	12,986,279,645.00 (684,376,937)	
ハンガリーフォリント	HGB 5.5% 02/12/16	239,000,000.00	245,411,175.00	
	HGB 5.5% 12/20/18	60,000,000.00	61,848,600.00	
	HGB 5.5% 12/22/16	81,000,000.00	83,378,565.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	137,600,000.00	141,679,152.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	239,000,000.00	258,100,880.00	

	HGB 6.75% 02/24/17	295,000,000.00	315,213,400.00	
	HGB 6.75% 08/22/14	6,000,000.00	6,173,010.00	
	HGB 6.75% 11/24/17	332,000,000.00	356,856,840.00	
	HGB 7% 06/24/22	188,000,000.00	205,878,800.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	166,000,000.00	188,202,500.00	
	HGB 7.75% 08/24/15	240,000,000.00	256,958,400.00	
	HGB 8% 02/12/15	465,000,000.00	492,237,375.00	
ハンガリーフォリント小計		2,448,600,000.00	2,611,938,697.00 (1,154,215,710)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 6.9% 08/12/37	2,300,000.00	2,381,581.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	2,950,000.00	3,436,543.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,250,000.00	2,755,338.75	
	PERUGB 9.91% 05/05/15	910,000.00	1,004,125.85	
ペルーヌエボソル小計		8,410,000.00	9,577,589.10 (349,677,778)	
ポーランドズロチ	POLGB 3.75% 04/25/18	5,900,000.00	6,015,728.50	
	POLGB 4% 10/25/23	3,800,000.00	3,846,892.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	1,350,000.00	1,425,195.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000.00	9,311,704.50	
	POLGB 5% 04/25/16	4,000,000.00	4,207,060.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,426,626.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,400,000.00	5,967,864.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	9,900,000.00	10,341,391.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	5,700,000.00	6,355,186.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,646,448.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,500,000.00	2,856,262.50	
	POLGB 6.25% 10/24/15	4,500,000.00	4,820,760.00	
ポーランドズロチ小計		63,550,000.00	68,221,119.75 (2,041,175,902)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	33,300,000.00	40,128,997.50	
	SAGB 13.5% 09/15/15	20,000,000.00	22,991,300.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	16,600,000.00	12,678,250.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	15,400,000.00	11,795,476.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	18,500,000.00	17,767,955.00	
	SAGB 7% 02/28/31	11,800,000.00	10,189,418.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	21,850,000.00	21,781,828.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	14,300,000.00	14,415,758.50	
	SAGB 8% 12/21/18	17,000,000.00	17,721,395.00	

	SAGB 8.25% 09/15/17	20,000,000.00	21,014,600.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	12,000,000.00	11,848,260.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	6,000,000.00	6,264,660.00	
南アフリカランド小計		206,750,000.00	208,597,898.00 (2,100,580,832)	
ロシアルーブル	RFLB 7% 06/03/15	211,500,000.00	214,578,382.50	
	RFLB 7.6% 04/14/21	124,000,000.00	128,611,560.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	94,500,000.00	98,721,315.00	
	RUSSIA 7.85% 03/10/18	230,000,000.00	240,882,450.00	
ロシアルーブル小計		660,000,000.00	682,793,707.50 (2,096,176,682)	
ナイジェリアナイラ	NIGB 15.1% 04/27/17	120,500,000.00	124,792,812.50	
	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000.00	488,109,375.00	
ナイジェリアナイラ小計		795,500,000.00	612,902,187.50 (383,492,898)	
トルコリラ	TURKGB 10% 06/17/15	4,670,000.00	4,784,555.10	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	3,200,000.00	3,481,760.00	
	TURKGB 11% 08/06/14	3,200,000.00	3,282,544.00	
	TURKGB 6.3% 02/14/18	1,350,000.00	1,234,041.75	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	4,150,000.00	3,710,577.25	
	TURKGB 8% 06/04/14	7,400,000.00	7,387,346.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	4,400,000.00	4,280,034.00	
	TURKGB 9% 01/27/16	3,450,000.00	3,473,925.75	
	TURKGB 9% 03/08/17	2,200,000.00	2,222,418.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000.00	4,691,459.50	
トルコリラ小計		38,570,000.00	38,548,661.35 (2,011,083,662)	
国債証券合計			20,517,725,982 (20,517,725,982)	
合計			20,517,725,982 (20,517,725,982)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
マレーシアリングット	国債証券 19銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 12銘柄	100.0%	7.2%

フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.5%
インドネシアルピア	国債証券	22銘柄	100.0%	8.7%
メキシコペソ	国債証券	20銘柄	100.0%	10.6%
ブラジルリアル	国債証券	9銘柄	100.0%	10.2%
コロンビアペソ	国債証券	4銘柄	100.0%	3.3%
ハンガリーフォリント	国債証券	12銘柄	100.0%	5.6%
ペルーヌエボソル	国債証券	4銘柄	100.0%	1.7%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.0%	9.9%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	10.2%
ロシアルーブル	国債証券	4銘柄	100.0%	10.2%
ナイジェリアナイラ	国債証券	2銘柄	100.0%	1.9%
トルコリラ	国債証券	10銘柄	100.0%	9.8%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「J-REITインデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	194,803,092
投資証券	14,599,253,120
派生商品評価勘定	14,043,000
未収入金	105,290,900
未収配当金	120,730,574
未収利息	295
差入委託証拠金	14,110,000
流動資産合計	15,048,230,981
資産合計	15,048,230,981
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	413,400
前受金	14,309,600
未払金	73,305,669
未払解約金	116,370,265
流動負債合計	204,398,934
負債合計	204,398,934
純資産の部	
元本等	
元本	13,901,728,523
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	942,103,524
元本等合計	14,843,832,047
純資産合計	14,843,832,047
負債純資産合計	15,048,230,981

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
--	---------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 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、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>不動産投信指数先物取引 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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、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を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	14,029,139,907円
計算期間中の追加設定元本額	3,987,402,740円
計算期間中の一部解約元本額	4,114,814,124円
計算日の元本額	13,901,728,523円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	655,251,806円
SBI資産設計オープン(分配型)	11,963,667円
SMT J-REITインデックス・オープン	5,458,008,066円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	7,063,880,450円
コア投資戦略ファンド(安定型)	329,381,960円
コア投資戦略ファンド(成長型)	378,300,412円
分散投資コア戦略ファンドA	3,410,195円
分散投資コア戦略ファンドS	1,531,967円
2. 計算日における受益権総数	13,901,728,523口

3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0678円 (10,678円)
------------------------------	----------------------

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。 これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	1,492,811,258	
合計	1,492,811,258	

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「J-REITインデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月13日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

投資証券関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買 建	218,420,400	-	232,050,000	13,629,600
	合計	218,420,400	-	232,050,000	13,629,600

(注)1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	540	352,080,000	
	M I Dリート投資法人	430	95,202,000	
	森ヒルズリート投資法人	596	358,792,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	353	174,382,000	
	産業ファンド投資法人	366	357,948,000	
	大和ハウスリート投資法人	286	200,486,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,901	620,233,800	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	176	37,980,800	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	480	349,440,000	
	G L P投資法人	4,299	423,021,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	157	110,528,000	
	日本プロロジスリート投資法人	652	565,284,000	
	日本ビルファンド投資法人	1,619	1,837,565,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,390	1,505,370,000	
	日本リテールファンド投資法人	4,864	988,364,800	
	オリックス不動産投資法人	3,721	413,403,100	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,930	559,700,000	
	プレミア投資法人	460	174,800,000	
	東急リアル・エステート投資法人	396	223,740,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	226	126,108,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	861	374,104,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,546	718,207,000	
	森トラスト総合リート投資法人	566	482,798,000	
	インヴィンシブル投資法人	3,154	42,515,920	
	フロンティア不動産投資法人	580	510,980,000	
	平和不動産リート投資法人	1,861	126,734,100	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	346	314,860,000	
	福岡リート投資法人	323	250,002,000	
	ケネディクス不動産投資法人	670	266,660,000	
	積水ハウス・S I投資法人	373	173,818,000	
いちご不動産投資法人	2,182	132,883,800		
大和証券オフィス投資法人	926	337,527,000		
阪急リート投資法人	241	117,608,000		

スターツプロシード投資法人	339	57,291,000	
トップリート投資法人	362	161,452,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	823	325,496,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,129	231,063,300	
日本賃貸住宅投資法人	3,113	215,730,900	
ジャパンエクセレント投資法人	526	285,092,000	
投資証券 小計	54,763	14,599,253,120	
合計	54,763	14,599,253,120	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	190,569,965
コール・ローン	78,769,637
投資証券	20,003,234,850
派生商品評価勘定	61,828
未収入金	422,620,695
未収配当金	71,841,594
未収利息	119
流動資産合計	20,767,098,688
資産合計	20,767,098,688
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,635
未払金	147,785,550
未払解約金	30,930,000
流動負債合計	178,735,185
負債合計	178,735,185
純資産の部	
元本等	
元本	17,897,561,846
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,690,801,657
元本等合計	20,588,363,503
純資産合計	20,588,363,503
負債純資産合計	20,767,098,688

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 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、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、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を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	15,681,399,212円
計算期間中の追加設定元本額	3,115,996,923円
計算期間中の一部解約元本額	899,834,289円
計算日の元本額	17,897,561,846円
計算日の元本額の内訳	

ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	613,506,275円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	657,757,355円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,003,740円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	6,242,373,487円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	9,616,156,698円
コア投資戦略ファンド(安定型)	349,121,780円
コア投資戦略ファンド(成長型)	400,243,501円
分散投資コア戦略ファンドA	3,818,270円
分散投資コア戦略ファンドS	1,580,740円
2. 計算日における受益権総数	17,897,561,846口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1503円 (11,503円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。 これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	1,199,704,213
合計	1,199,704,213

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月13日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			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	37,384,467	-	37,418,100	33,633
	ユーロ	3,894,585	-	3,875,100	19,485
	計	41,279,052	-	41,293,200	14,148
	売 建				
	アメリカドル	283,186,400	-	283,164,000	22,400
	カナダドル	11,522,880	-	11,522,400	480
	オーストラリアドル	41,680,575	-	41,679,000	1,575
	イギリスポンド	22,527,675	-	22,527,000	675
	香港ドル	6,519,850	-	6,520,000	150
	シンガポールドル	11,867,805	-	11,866,500	1,305
	ユーロ	28,419,160	-	28,417,400	1,760
	計	405,724,345	-	405,696,300	28,045
	合計	447,003,397	-	446,989,500	42,193

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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
に計算したレートを用いております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	15,429.00	381,096.30	
		AGREE REALTY CORP	3,700.00	109,261.00	
		ALEXANDER'S INC	490.00	151,669.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,260.00	1,246,975.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,236.00	301,370.68	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	27,580.00	1,157,532.60	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	40,400.00	582,164.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	38,800.00	1,180,684.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,330.00	201,028.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	13,200.00	217,668.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,810.00	4,367,831.10	
		BIOMED REALTY TRUST INC	49,600.00	1,022,256.00	
		BOSTON PROPERTIES	39,750.00	4,265,572.50	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	40,063.00	556,475.07	
		BRE PROPERTIES-CL A	19,950.00	1,012,662.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	22,020.00	1,559,236.20	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	16,142.00	193,865.42	
		CAPLEASE INC	26,000.00	219,960.00	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	43,950.00	978,766.50	
		CEDAR REALTY TRUST INC	12,087.00	66,961.98	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,000.00	123,410.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	11,942.00	268,097.90	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	21,500.00	518,150.00	
		COMMONWEALTH REIT	31,541.00	738,374.81	
		CORESITE REALTY CORP	6,040.00	192,192.80	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	22,870.00	611,086.40	
		CORRECTIONS CORP OF AMERICA	30,900.00	995,289.00	
		COUSINS PROPERTIES INC	26,912.00	277,731.84	
		CUBESMART	33,306.00	549,549.00	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	76,180.00	575,159.00	
DDR CORPORATION	63,900.00	1,086,300.00			

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	50,760.00	493,387.20	
DIGITAL REALTY TRUST INC	33,440.00	2,019,107.20	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	34,060.00	866,145.80	
DUKE REALTY CORP	83,350.00	1,330,266.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	16,553.00	393,630.34	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	8,390.00	486,871.70	
EDUCATION REALTY TRUST INC	30,407.00	324,746.76	
EPR PROPERTIES	12,676.00	638,870.40	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,580.00	860,154.00	
EQUITY ONE INC	16,140.00	372,027.00	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	83,960.00	4,867,161.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	10,160.00	1,653,641.60	
EXCEL TRUST INC	13,200.00	175,824.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	27,430.00	1,185,798.90	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,030.00	1,762,094.10	
FELCOR LODGING TRUST INC	32,000.00	196,160.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24,670.00	396,446.90	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	15,917.00	221,246.30	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	22,330.00	303,688.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	117,480.00	2,395,417.20	
GEO GROUP INC/THE	18,720.00	656,697.60	
GETTY REALTY CORP	8,118.00	168,042.60	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,472.00	46,251.12	
GLIMCHER REALTY TRUST	37,456.00	418,758.08	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	15,300.00	392,598.00	
GYRODYNE CO OF AMERICA INC	216.00	15,498.00	
HCP INC	118,990.00	5,364,069.20	
HEALTH CARE REIT INC	74,670.00	4,907,312.40	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,706.00	626,549.58	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	12,587.00	137,701.78	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	48,708.00	279,096.84	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	21,118.00	758,769.74	
HOME PROPERTIES INC	14,070.00	915,394.20	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	37,230.00	1,008,560.70	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	194,590.00	3,457,864.30	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	10,619.00	222,043.29	
INLAND REAL ESTATE CORP	21,749.00	227,712.03	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	25,695.00	224,574.30	

KILROY REALTY CORPORATION	19,950.00	1,078,696.50	
KIMCO REALTY CORP	106,540.00	2,347,076.20	
KITE REALTY GROUP TRUST	23,534.00	140,497.98	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	25,570.00	665,075.70	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	49,600.00	592,720.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	32,320.00	1,209,091.20	
LTC PROPERTIES INC	8,988.00	356,194.44	
MACERICH CO/THE	35,860.00	2,257,745.60	
MACK-CALI REALTY CORP	22,455.00	547,003.80	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	39,733.00	561,824.62	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,609.00	787,670.65	
MONMOUTH REIT -CL A	8,958.00	90,744.54	
MPG OFFICE TRUST INC	11,508.00	36,135.12	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	31,410.00	1,115,683.20	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,318.00	385,208.46	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	31,314.00	983,885.88	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,463.00	55,639.17	
PARKWAY PROPERTIES INC	10,240.00	184,524.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	16,060.00	422,699.20	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	16,664.00	325,781.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	44,970.00	826,098.90	
POST PROPERTIES	14,230.00	700,400.60	
PROLOGIS INC	130,440.00	4,998,460.80	
PS BUSINESS PARKS INC	4,766.00	348,966.52	
PUBLIC STORAGE	37,900.00	5,883,596.00	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	16,700.00	262,023.00	
REALTY INCOME CORP	51,210.00	2,218,417.20	
REGENCY CENTERS CORP	23,680.00	1,219,283.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	14,385.00	195,923.70	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	7,153.00	104,862.98	
RLJ LODGING TRUST	31,427.00	732,877.64	
ROUSE PROPERTIES INC	5,052.00	102,404.04	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,950.00	523,962.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,425.00	270,424.50	
SAUL CENTERS INC	4,000.00	186,880.00	
SELECT INCOME REIT	7,526.00	205,685.58	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	50,460.00	1,325,079.60	

	SIMON PROPERTY GROUP	81,570.00	13,191,500.40	
	SL GREEN REALTY CORP	23,850.00	2,182,275.00	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	8,600.00	583,768.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	10,099.00	200,970.10	
	STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	46,771.00	418,132.74	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,955.00	175,240.80	
	SUN COMMUNITIES INC	8,730.00	457,626.60	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	42,280.00	532,305.20	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	25,180.00	854,105.60	
	TAUBMAN CENTERS INC	16,890.00	1,297,827.60	
	TERRENO REALTY CORP	5,400.00	103,680.00	
	UDR INC	65,210.00	1,685,678.50	
	UMH PROPERTIES INC	3,180.00	34,693.80	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,900.00	169,923.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	7,960.00	165,488.40	
	VENTAS INC	76,820.00	5,302,116.40	
	VORNADO REALTY TRUST	44,540.00	3,809,060.80	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	18,090.00	493,133.40	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	29,536.00	940,721.60	
	WHITESTONE REIT	3,718.00	60,529.04	
	WINTHROP REALTY TRUST	6,448.00	82,340.96	
	WP CAREY INC	14,920.00	1,018,439.20	
	アメリカドル小計	3,705,450.00	134,487,357.22 (13,602,051,309)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	8,050.00	253,736.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,434.00	261,510.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,610.00	386,883.30	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	3,687.00	97,705.50	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	13,770.00	352,374.30	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,617.00	278,331.02	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	8,736.00	374,337.60	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	23,500.00	226,070.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,730.00	343,801.50	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,619.00	114,374.13	
	DUNDEE INTERNATIONAL REIT	13,294.00	129,350.62	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	13,750.00	433,262.50	

	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,300.00	234,738.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	34,330.00	736,721.80	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	10,154.00	43,052.96	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,012.00	28,317.80	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	8,786.00	141,893.90	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	5,203.00	140,168.82	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	4,401.00	49,291.20	
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,450.00	28,340.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	38,950.00	975,308.00	
	カナダドル小計	265,383.00	5,629,568.95 (540,607,506)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	76,150.00	167,530.00	
	ALE PROPERTY GROUP	47,603.00	127,576.04	
	ASPEN GROUP	262,593.00	47,266.74	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	13,794.00	43,451.10	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	66,849.00	234,639.99	
	BWP TRUST	115,710.00	274,232.70	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	626,500.00	1,224,807.50	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	24,112.00	59,556.64	
	CHARTER HALL GROUP	56,946.00	228,353.46	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	68,710.00	263,846.40	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	626,430.00	695,337.30	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	334,412.00	329,395.82	
	DEXUS PROPERTY GROUP	1,264,443.00	1,378,242.87	
	FEDERATION CENTRES	369,880.00	872,916.80	
	GOODMAN GROUP	394,700.00	1,918,242.00	
	GPT GROUP	432,568.00	1,699,992.24	
	INVESTA OFFICE FUND	159,360.00	476,486.40	
	MIRVAC GROUP	952,600.00	1,619,420.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	167,000.00	266,365.00	
	STOCKLAND	603,000.00	2,122,560.00	
WESTFIELD GROUP	529,000.00	6,221,040.00		
WESTFIELD RETAIL TRUST	813,933.00	2,506,913.64		
	オーストラリアドル小計	8,006,293.00	22,778,172.64 (2,110,169,913)	

イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	32,489.00	142,951.60	
	BRITISH LAND CO PLC	261,000.00	1,586,880.00	
	DERWENT LONDON PLC	22,930.00	568,434.70	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	89,382.00	519,309.42	
	HAMMERSON PLC	186,200.00	995,239.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	179,530.00	156,460.39	
	INTU PROPERTIES PLC	177,600.00	585,192.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	204,150.00	1,957,798.50	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	172,538.00	191,862.25	
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	8,000.00	29,200.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	23,740.00	76,205.40	
	SEGRO PLC	197,370.00	578,294.10	
	SHAFTESBURY PLC	64,670.00	413,564.65	
	WORKSPACE GROUP PLC	27,154.00	120,020.68	
イギリスポンド小計		1,646,753.00	7,921,412.69 (1,189,716,971)	
香港ドル	CHAMPION REIT	831,000.00	2,875,260.00	
	FORTUNE REIT	326,000.00	2,210,280.00	
	LINK REIT	596,500.00	22,875,775.00	
	PROSPERITY REIT	322,000.00	740,600.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	184,000.00	421,360.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	313,000.00	979,690.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	436,000.00	1,757,080.00	
香港ドル小計		3,008,500.00	31,860,045.00 (415,454,986)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	117,000.00	187,200.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	163,000.00	138,550.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	520,266.00	1,144,585.20	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	165,000.00	214,500.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	178,000.00	216,270.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	310,000.00	223,200.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	518,000.00	751,100.00	
	CAPITAMALL TRUST	679,500.00	1,325,025.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	97,000.00	135,800.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	184,000.00	308,200.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	209,000.00	198,550.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	123,000.00	150,675.00	

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	130,000.00	241,150.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	105,600.00	141,504.00	
	KEPPEL REIT	231,000.00	300,300.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	458,000.00	224,420.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	296,000.00	338,920.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	480,000.00	451,200.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	293,160.00	386,971.20	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	382,920.00	419,297.40	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	100,000.00	243,000.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	173,000.00	202,410.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	345,000.00	289,800.00	
	SUNTEC REIT	543,000.00	857,940.00	
	シンガポールドドル小計	6,801,446.00	9,090,567.80 (719,245,724)	
ニュージーランド ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	79,159.00	130,612.35	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	270,542.00	282,716.39	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	242,838.00	273,192.75	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	51,000.00	70,890.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	70,793.00	97,694.34	
	ニュージーランドドル小計	714,332.00	855,105.83 (67,750,034)	
イスラエルシェケ ル	REIT 1 LTD	17,145.00	140,280.39	
	イスラエルシェケル小計	17,145.00	140,280.39 (3,882,961)	
ユーロ	AEDIFICA	2,548.00	126,763.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	16,231.00	138,937.36	
	ALTAREA	870.00	104,400.00	
	ANF IMMOBILIER	1,870.00	42,430.30	
	BEFIMMO S.C.A.	4,100.00	204,651.50	
	BENI STABILI SPA	226,757.00	111,110.93	
	COFINIMMO	4,023.00	345,012.48	
	CORIO NV	25,740.00	807,849.90	
	EUROCOMMERCIAL	9,412.00	274,642.16	
	FONCIERE DES REGIONS	10,061.00	606,879.52	
	GECINA SA	6,856.00	613,406.32	
	HAMBORNER REIT AG	12,171.00	85,562.13	
	ICADE	6,059.00	396,258.60	

	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	32,169.00	24,126.75	
	KLEPIERRE	25,130.00	807,929.50	
	MERCIALYS	14,403.00	222,598.36	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	15,591.00	82,819.39	
	SILIC	2,277.00	186,622.92	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	1,780.00	83,677.80	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	25,000.00	4,638,750.00	
	VASTNED	4,848.00	155,572.32	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,900.00	143,695.00	
	WERELDHAVE NV	5,350.00	280,554.00	
	ユーロ小計	456,146.00	10,484,250.24 (1,354,355,446)	
	投資証券合計		20,003,234,850 (20,003,234,850)	
	合計		20,003,234,850 (20,003,234,850)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 128銘柄	100.0%	68.0%
カナダドル	投資証券 21銘柄	100.0%	2.7%
オーストラリアドル	投資証券 22銘柄	100.0%	10.5%
イギリスポンド	投資証券 14銘柄	100.0%	5.9%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 24銘柄	100.0%	3.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
ユーロ	投資証券 23銘柄	100.0%	6.8%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	68,221,826
コール・ローン	139,611,330
社債券	7,096,518,037
派生商品評価勘定	89,964
未収利息	212
流動資産合計	7,304,441,369
資産合計	7,304,441,369
負債の部	
流動負債	
未払金	91,642,954
流動負債合計	91,642,954
負債合計	91,642,954
純資産の部	
元本等	
元本	15,958,419,477
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,745,621,062
元本等合計	7,212,798,415
純資産合計	7,212,798,415
負債純資産合計	7,304,441,369

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	11,613,553,205円
計算期間中の追加設定元本額	4,403,627,790円
計算期間中の一部解約元本額	58,761,518円
計算日の元本額	15,958,419,477円
計算日の元本額の内訳	
コモディティ・オープン(SMA専用)	14,053,483,683円
コア投資戦略ファンド(安定型)	899,886,323円
コア投資戦略ファンド(成長型)	991,340,399円
分散投資コア戦略ファンドA	9,771,371円
分散投資コア戦略ファンドS	3,937,701円

2. 計算日における受益権総数	15,958,419,477口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 8,745,621,062円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4520円 (4,520円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(商品(コモディティ)の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)社債券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	245,439,620
合計	245,439,620

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月28日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	平成25年 7月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			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 計	100,000,000 100,000,000	- -	100,089,964 100,089,964	89,964 89,964
合計		100,000,000	-	100,089,964	89,964

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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
に計算したレートを用いております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 020 09/27/13	10,000,000.00	8,614,300.00	
		BAR USD COM 021 01/31/14	3,000,000.00	2,794,050.00	
		BAR USD COM 022 04/25/14	5,000,000.00	4,802,250.00	
		BAR USD COM 023 06/27/14	5,000,000.00	4,760,650.00	
		CS USD COM 003 08/30/13	10,000,000.00	8,652,000.00	
		CS USD COM 004 10/25/13	9,800,000.00	8,841,560.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	77,470,000.00	10,264,775.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	7,390,000.00	2,763,121.00	
		UBS USD COM 001 08/14/13	10,000,000.00	8,822,000.00	
		UBS USD COM 002 11/07/13	5,000,000.00	4,443,000.00	
		UBS USD COM 003 05/16/14	5,700,000.00	5,407,590.00	
	アメリカドル小計		148,360,000.00	70,165,296.00 (7,096,518,037)	
	社債券合計			7,096,518,037 (7,096,518,037)	
	合計			7,096,518,037 (7,096,518,037)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 11銘柄	100.0%	100.0%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「FRM シグマ リンク マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	246,882,118
社債券	3,389,376,000
未収利息	374
流動資産合計	3,636,258,492
資産合計	3,636,258,492
純資産の部	
負債の部	
負債合計	-
元本等	
元本	4,054,411,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	418,152,899
元本等合計	3,636,258,492
純資産合計	3,636,258,492
負債純資産合計	3,636,258,492

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月10日現在
1. 計算期間の期首元本額	2,366,118,962円
計算期間中の追加設定元本額	1,688,292,429円
計算期間中の一部解約元本額	- 円
計算日の元本額	4,054,411,391円
計算日の元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,553,304,394円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,466,496,330円
分散投資コア戦略ファンドA	28,668,614円
分散投資コア戦略ファンドS	5,942,053円
2. 計算日における受益権総数	4,054,411,391口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 418,152,899円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8969円 (8,969円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。これらは、市場リスク、先物取引を利用した運用手法に係るリスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)社債券 「(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。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	48,102,150
合計	48,102,150

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「FRM シグマ リンク マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月27日から平成25年7月10日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
当ファンドは、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 7月10日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年7月10日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	QUART X 0% 03/31/22	3,810,000,000	3,389,376,000	
社債券 小計		3,810,000,000	3,389,376,000	
合計		3,810,000,000	3,389,376,000	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考情報）

「分散投資コア戦略ファンドA」、「分散投資コア戦略ファンドS」は、委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託である「F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」、「F0Fs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」及び「TCAファンド（適格機関投資家専用）」、他の委託会社が設定・運用を行う適格機関投資家向け私募投資信託である「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」並びに他の投資顧問会社が設定・運用を行う外国籍円建投資信託証券である「Global Absolute Return Strategies Fund- Class D^{A, H, JPY}」を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「投資信託受益証券」はその投資信託受益証券（振替受益権を含みます。）です。

「F0Fs用米ドル建新興国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」及び「ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」は、平成25年7月10日現在、「分散投資コア戦略ファンドA」、「分散投資コア戦略ファンドS」の計算期間に対応する計算期間の財務諸表につき、運用会社における監査を受けていないため、記載すべき事項はありません。

F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

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項の規定に準じて、第1期計算期間(平成24年8月8日から平成25年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

財務諸表

F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

(1)貸借対照表

項目	第1期 (平成25年 7月10日現在) 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,804,757
親投資信託受益証券	2,270,308,634
派生商品評価勘定	3,052,092
未収利息	4
流動資産合計	2,276,165,487
資産合計	2,276,165,487
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	17,931,091
未払受託者報酬	356,310
未払委託者報酬	2,351,571
その他未払費用	35,575
流動負債合計	20,674,547
負債合計	20,674,547
純資産の部	
元本等	
元本	2,249,116,671
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,374,269
（分配準備積立金）	(32,825,617)
元本等合計	2,255,490,940
純資産合計	2,255,490,940
負債純資産合計	2,276,165,487

(2)損益及び剰余金計算書

項目	第1期 自 平成24年 8月 8日 至 平成25年 7月10日 金額(円)
営業収益	
受取利息	1,421
有価証券売買等損益	311,345,661
為替差損益	322,691,993
営業収益合計	11,344,911
営業費用	
受託者報酬	613,698
委託者報酬	4,050,261
その他費用	61,255
営業費用合計	4,725,214
営業利益又は営業損失（ ）	16,070,125
経常利益又は経常損失（ ）	16,070,125
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,070,125
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（ ）	546,173
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,288,420
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,288,420

剰余金減少額又は欠損金増加額	297,853
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	297,853
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,374,269

(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、基準価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他	ファンドの計算期間 第1期(自 平成24年 8月 8日 至 平成25年 7月10日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、平成24年 8月 8日から平成25年 7月10日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成25年 7月10日現在)
1. 期首元本額	177,500,000円
期中追加設定元本額	2,141,056,671円
期中一部解約元本額	69,440,000円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	2,249,116,671口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0028円 (10,028円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

	第1期 自 平成24年 8月 8日 至 平成25年 7月10日

費用控除後の配当等収益額	A	32,825,617円 (37,549,410円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	1,288,814円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,114,431円
当ファンドの期末残存口数	F	2,249,116,671口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	151.67円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。 これらは、市場リスク(金利変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
--------------------	---

2. 時価の算定方法	<p>(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 (平成25年 7月10日現在)	
	計算期間(自 平成24年 8月 8日 至 平成25年 7月10日)の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券		262,696,363
合計		262,696,363

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
通貨関連

区分	種類	第1期 (平成25年 7月10日現在)		
		契約額等(円)		時価 (円)
		うち1年超	評価損益 (円)	

市場取引 以外の取引	為替予約取引 売 建				
	アメリカドル	913,415,127	-	928,897,420	15,482,293
	カナダドル	56,509,283	-	57,463,261	953,978
	オーストラリアドル	32,916,391	-	33,584,374	667,983
	イギリスポンド	169,054,273	-	167,945,101	1,109,172
	スイスフラン	8,518,543	-	8,398,807	119,736
	シンガポールドル	20,529,639	-	20,736,856	207,217
	スウェーデンクローナ	12,254,737	-	12,275,306	20,569
	ノルウェークローネ	7,143,687	-	7,136,534	7,153
	デンマーククローネ	19,235,851	-	19,199,218	36,633
	メキシコペソ	22,039,895	-	22,574,852	534,957
	ポーランドズロチ	17,309,723	-	17,304,166	5,557
	南アフリカランド	12,382,615	-	12,443,637	61,022
	ユーロ	957,432,430	-	955,661,661	1,770,769
	計	2,248,742,194	-	2,263,621,193	14,878,999
	合計	2,248,742,194	-	2,263,621,193	14,878,999

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において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、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
に計算したレートを用いております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)附属明細表

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 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	外国債券インデックス マザーファンド	991,574,351	2,270,308,634	
親投資信託受益証券 小計		991,574,351	2,270,308,634	
合計		991,574,351	2,270,308,634	

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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
注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表
該当事項はありません。

商品明細表
該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

借入金明細表
該当事項はありません。

< 参考 >

「F0Fs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)」は、「外国債券インデックス マザーファンド」の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ている「親投資信託受益証券」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成25年7月10日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は前記「外国債券インデックス マザーファンド」の状況のとおりであります。

TCAファンド(適格機関投資家専用)

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項の規定に準じて、第6期計算期間(平成24年12月21日から平成25年6月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

財務諸表

TCAファンド(適格機関投資家専用)

(1)貸借対照表

項目	第5期 (平成24年12月20日現在) 金額(円)	第6期 (平成25年 6月20日現在) 金額(円)

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,445,228,097	6,226,792,840
国債証券	27,193,000,700	30,389,352,500
派生商品評価勘定	322,976,042	93,703,811
未収入金	537,740	-
未収利息	7,435	8,973
差入委託証拠金	1,051,888,822	1,224,486,688
流動資産合計	33,013,638,836	37,934,344,812
資産合計	33,013,638,836	37,934,344,812
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	187,430,514	101,696,969
前受金	285,185,000	69,388,000
未払受託者報酬	15,227,546	17,988,512
未払委託者報酬	106,592,753	125,919,479
その他未払費用	747,969	796,680
流動負債合計	595,183,782	315,789,640
負債合計	595,183,782	315,789,640
純資産の部		
元本等		
元本	33,760,582,842	39,644,461,181
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,342,127,788	2,025,906,009
（分配準備積立金）	(366,528)	(342,323)
元本等合計	32,418,455,054	37,618,555,172
純資産合計	32,418,455,054	37,618,555,172
負債純資産合計	33,013,638,836	37,934,344,812

(2)損益及び剰余金計算書

項目	第5期	第6期
	自 平成24年 6月21日 至 平成24年12月20日 金額(円)	自 平成24年12月21日 至 平成25年 6月20日 金額(円)
営業収益		
受取利息	1,312,008	1,632,392
有価証券売買等損益	12,027,900	11,761,000
派生商品取引等損益	749,642,299	349,488,868
為替差損益	32,053,816	14,331,262

その他収益	46,715	23,439
営業収益合計	704,201,860	350,403,299
営業費用		
受託者報酬	15,227,546	17,988,512
委託者報酬	106,592,753	125,919,479
その他費用	1,822,267	1,815,375
営業費用合計	123,642,566	145,723,366
営業利益又は営業損失（ ）	827,844,426	496,126,665
経常利益又は経常損失（ ）	827,844,426	496,126,665
当期純利益又は当期純損失（ ）	827,844,426	496,126,665
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（ ）	42,190,590	12,053,105
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	241,938,747	1,342,127,788
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,359,048	95,186,195
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,359,048	95,186,195
剰余金減少額又は欠損金増加額	334,894,253	270,784,646
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	334,894,253	270,784,646
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,342,127,788	2,025,906,009

(3)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引及び債券先物取引 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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (平成24年12月20日現在)	第6期 (平成25年 6月20日現在)
1. 期首元本額	26,448,322,302円	33,760,582,842円
期中追加設定元本額	9,019,524,279円	8,344,892,694円
期中一部解約元本額	1,707,263,739円	2,461,014,355円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	33,760,582,842口	39,644,461,181口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>1,342,127,788円</p>	<p>元本の欠損</p> <p>2,025,906,009円</p>
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>0.9602円</p> <p>(9,602円)</p>	<p>0.9489円</p> <p>(9,489円)</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第5期 自 平成24年 6月21日 至 平成24年12月20日	第6期 自 平成24年12月21日 至 平成25年 6月20日
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	- 円
収益調整金額	C	388,284円	682,131円
分配準備積立金額	D	366,528円	342,323円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	754,812円	1,024,454円

当ファンドの期末残存口数	F	33,760,582,842口	39,644,461,181口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	0.22円	0.25円
1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	- 円	- 円

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク（株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク）、信用リスク、先物取引を利用した運用手法に係るリスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って株価指数先物取引、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p>

	<p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第5期 (平成24年12月20日現在)	第6期 (平成25年 6月20日現在)
	計算期間(自 平成24年6月21日 至 平成24年12月20日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年12月21日 至 平成25年 6月20日)の損益に含ま れた評価差額(円)
国債証券	6,072,500	5,026,800
合計	6,072,500	5,026,800

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	第5期 (平成24年12月20日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	9,247,076,356	-	9,560,322,494	313,246,138
	合計	9,247,076,356	-	9,560,322,494	313,246,138

(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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

区分	種類	第6期 (平成25年 6月20日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建	9,060,007,418	-	9,005,233,838	54,773,580
	売 建	158,745,384	-	157,752,144	993,240
合計		9,218,752,802	-	9,162,985,982	53,780,340

(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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

債券関連

区分	種類	第5期 (平成24年12月20日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買 建	37,959,424,966	-	37,772,759,567	186,665,399
	売 建	3,877,280,491	-	3,868,315,702	8,964,789
合計		41,836,705,457	-	41,641,075,269	177,700,610

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等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. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

区分	種類	第6期 (平成25年 6月20日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買 建	22,208,222,068	-	22,202,304,505	5,917,563
	売 建	5,159,039,679	-	5,107,334,934	51,704,745

合計	27,367,261,747	-	27,309,639,439	45,787,182
----	----------------	---	----------------	------------

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)で評価しております。

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の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おります。

・ヘッジ会計が適用されているもの

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)附属明細表

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第337回国庫短期証券	3,700,000,000	3,699,852,000	
	第343回国庫短期証券	6,500,000,000	6,499,259,000	
	第349回国庫短期証券	3,000,000,000	2,999,454,000	
	第352回国庫短期証券	900,000,000	899,469,000	
	第360回国庫短期証券	7,800,000,000	7,794,852,000	
	第361回国庫短期証券	4,000,000,000	3,999,720,000	
	第366回国庫短期証券	4,500,000,000	4,496,746,500	
	国債証券 小計	30,400,000,000	30,389,352,500	
	合計	30,400,000,000	30,389,352,500	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「Global Absolute Return Strategies Fund- Class D^{A, H, JPY}」の状況

なお、下記に記載した情報は監査の対象外であります。

同投資信託証券（以下、「同ファンド」という。）は、ルクセンブルグの法律に基づき設立された円建外国投資信託証券であります。同ファンドは計算期間（2012年1月1日から2012年12月31日まで）が終了し、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠して財務書類が作成されており、監査人による監査を受けております。

同ファンドの「純資産計算書」及び「損益計算書及び純資産変動計算書」などは、Standard Life Investments Limitedから入手した情報に基づき、2012年12月31日現在の財務書類の一部を委託会社が翻訳したものであります。

Standard Life Investments Global SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable

純資産計算書

2012年12月31日現在

	Global Absolute Return Strategies Fund ^ (EUR)
資産	
投資有価証券（時価）（注記2b）	2,663,509,855
取得原価:	2,550,474,755
現金及び現金同等物（注記13）	607,116,540
未収利息及び未収配当金、純額	15,374,752
有価証券売却に係る未収金	456,386
募集に係る未収金	8,013,237
その他の未収金	-
その他の資産（注記12）	15,051,491
スワップ契約に係る未実現評価益（注記2g、7）	43,270,609
先物為替予約に係る未実現評価益（注記2f、6）	34,399,128
先物契約に係る未実現評価益（注記2h、8）	5,818,272
オプション契約（時価）（注記2i、9）	84,215,188
資産合計	3,477,225,458
負債	
銀行当座借越（注記13）	40,798,461
有価証券購入に係る未払金	1,142,427
償還に係る未払金	945,023
未払報酬	1,373,950
スワップ契約に係る未実現評価損（注記2g、7）	44,813,119
先物為替予約に係る未実現評価損（注記2f、6）	47,607,773
先物契約に係る未実現評価損（注記2h、8）	17,140,692
オプション契約（時価）（注記2i、9）	36,289,327
その他の負債（注記12）	-
負債合計	190,110,772
純資産合計	3,287,114,686

^ 本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable

損益計算書及び純資産変動計算書

2012年12月31日に終了した年度

	Global Absolute Return Strategies Fund ^ (EUR)
期初の純資産	1,439,431,596
収益	
受取配当金、純額（注記2d）	11,334,451
受取利息、純額（注記2d）	36,717,216
銀行利息、純額	3,996,765
収益合計	<u>52,048,432</u>
費用	
年間管理手数料（注記3a）	6,379,609
管理事務報酬（注記3d）	161,006
保管料（注記3b）	506,272
専門家報酬	21,970
名義書換代理人報酬	171,534
引受税（注記5a）	307,755
銀行利息、純額	-
諸雑費	176,041
費用合計	<u>7,724,187</u>
純投資収益（損失）	<u>44,324,245</u>
実現純利益（損失）：	
投資有価証券の売却	33,069,434
先物為替予約（注記2f）	(33,455,719)
外国為替契約（注記2c）	(282,547)
スワップ契約（注記2g）	44,807,191
先物契約（注記2h）	(13,252,854)
オプション契約（注記2i）	(32,825,719)
当年度実現純利益（損失）	<u>(1,940,214)</u>
未実現評価純（損）益の変動額：	
投資有価証券	108,322,415
先物為替予約（注記2f）	(2,486,647)
スワップ契約（注記2g）	(16,235,092)
先物契約（注記2h）	(10,115,807)
オプション契約（注記2i）	10,523,924
当年度未実現評価純（損）益の変動額	<u>90,008,793</u>
運用による純資産の増加（減少）額	<u>132,392,824</u>
資本の変動	
募集	1,933,719,305
償還	(218,378,351)
資本の変動による純資産の増加（減少）額	<u>1,715,340,954</u>
配当（注記4）	(50,688)
期末の純資産	<u><u>3,287,114,686</u></u>

^ 本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable

投資証券数変動計算書

2012年12月31日に終了した年度

	期初の 発行済投資証券数	応募投資証券数	償還投資証券数	期末の 発行済投資証券数
Global Absolute Return Strategies Fund ^				
クラスA 累積型投資証券	874,435	6,917,543	(1,209,743)	6,582,235
クラスA 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）	-	2,200	-	2,200
クラスA 累積型投資証券（英ポンド、ヘッジあり）	49,417	105,191	(4,181)	150,427
クラスA 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	100	-	-	100
クラスA 累積型投資証券（スウェーデンクローナ、ヘッジあり）	100	10,444,226	(399,513)	10,044,813
クラスA 累積型投資証券（米ドル、ヘッジあり）	30,152	4,531,806	(455,366)	4,106,592
クラスA 分配型投資証券	310,923	3,095,151	(598,996)	2,807,078
クラスD 累積型投資証券	11,252,024	30,951,479	(9,109,102)	33,094,401
クラスD 累積型投資証券（豪ドル、ヘッジあり）	-	1,610,395	-	1,610,395
クラスD 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）	-	500	-	500
クラスD 累積型投資証券（英ポンド、ヘッジあり）	750,729	14,516,403	(2,238,712)	13,028,420
クラスD 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	100	12,569,462	(6,681)	12,562,881
クラスD 累積型投資証券（スウェーデンクローナ、ヘッジあり）	100	1,991	-	2,091
クラスD 累積型投資証券（シンガポールドル、ヘッジあり）	-	71,809	-	71,809
クラスD 累積型投資証券（米ドル、ヘッジあり）	2,905,669	13,940,085	(3,982,690)	12,863,064
クラスD 分配型投資証券	83,954	13,889,660	(155,172)	13,818,442
クラスZ 累積型投資証券	110,319,972	42,697,528	(947,049)	152,070,451
クラスZ 累積型投資証券（豪ドル、ヘッジあり）	8,265,987	6,155,661	(211,479)	14,210,169
クラスZ 累積型投資証券（カナダドル、ヘッジあり）	6,183,201	10,834,577	(40,528)	16,977,250
クラスZ 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	-	100	-	100
期末の発行済投資証券総数				294,003,418

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable

統計値

	通貨	2012年12月31日	2011年12月31日	2010年12月31日
Global Absolute Return Strategies Fund ^				
純資産総額	EUR	3,287,114,686	1,439,431,596	-
1口当たりの純資産価格：				
クラスA 累積型投資証券	EUR	11.02	10.34	-
クラスA 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）	CHF	10.20	-	-
クラスA 累積型投資証券（英ポンド、ヘッジあり）	GBP	11.05	10.31	-
クラスA 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）	JPY	1,642.00	1,542.00	-
クラスA 累積型投資証券（スウェーデンクローナ、ヘッジあり）	SEK	113.17	104.56	-
クラスA 累積型投資証券（米ドル、ヘッジあり）	USD	10.94	10.24	-
クラスA 分配型投資証券	EUR	10.92	10.35	-

クラスD 累積型投資証券	EUR	11.21	10.43	-
クラスD 累積型投資証券(豪ドル、ヘッジあり)	AUD	10.11	-	-
クラスD 累積型投資証券(スイスフラン、ヘッジあり)	CHF	10.24	-	-
クラスD 累積型投資証券(英ポンド、ヘッジあり)	GBP	11.17	10.36	-
クラスD 累積型投資証券(日本円、ヘッジあり)	JPY	1,661.00	1,549.00	-
クラスD 累積型投資証券(スウェーデンクローナ、ヘッジあり)	SEK	114.59	104.97	-
クラスD 累積型投資証券(シンガポールドル、ヘッジあり)	SGD	10.34	-	-
クラスD 累積型投資証券(米ドル、ヘッジあり)	USD	11.07	10.29	-
クラスD 分配型投資証券	EUR	11.02	10.43	-
クラスZ 累積型投資証券	EUR	11.38	10.50	-
クラスZ 累積型投資証券(豪ドル、ヘッジあり)	AUD	11.92	10.59	-
クラスZ 累積型投資証券(カナダドル、ヘッジあり)	CAD	11.31	10.33	-
クラスZ 累積型投資証券(日本円、ヘッジあり)	JPY	1,540.00	-	-

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。
添付の注記は、本財務諸表の不可欠な一部を成すものです。

Standard Life Investments Global SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable

財務諸表に対する注記

2012年12月31日

1. 組織

スタンダード・ライフ・インベストメント・グローバルSICAV(以下、「当会社」)は、多数の無期限サブファンドを持つオープンエンド型の変動資本を有する会社型投資信託(以下、「SICAV」)としてルクセンブルグ大公国の法律に準拠して2000年11月16日に設立されました。当会社は、欧州委員会指令2009/65/EC(以下、「UCITS指令」)に基づく譲渡可能証券の集合投資事業に関する2010年12月17日制定法(以下、「UCITS法」)のパート1に基づく登録についてルクセンブルグ当局から認可を受けています。当会社は自己運用型のSICAVであり、運用会社を指名していません。

当会社の投資証券の発行及び募集に関してルクセンブルグ法による要求される法定通知は、ルクセンブルグ地方裁判所の会社登記所(以下、「登記所」)に提出されています。当会社の定款も登記所に提出され、2000年12月19日に会社公示集(以下、「官報」)において公表されています。当会社はルクセンブルグ商業登記第B78.797号に基づき登記されています。

2012年12月31日に終了した年度に、投資家に適用される手数料の異なるクラスA、クラスA(ヘッジなし)、クラスA(ヘッジあり)、クラスD、クラスD(ヘッジなし)、クラスD(ヘッジあり)、クラスZ、及びクラスZ(ヘッジあり)の8クラスの投資証券の募集が行われました。クラスD投資証券は機関投資家専用です。

クラスZ投資証券は、スタンダード・ライフ・グループ会社のメンバー、並びにスタンダード・ライフ・インベストメント・リミテッド(以下、「投資顧問会社」)及び関連の副投資顧問会社(場合に応じて)への報酬や他の費用の支払いのために個別の取決めが行われたその他の機関投資家専用です。

2. 重要な会計方針

a) 概要

本財務諸表は、投資信託事業に対するルクセンブルグの法令に準拠して作成されています。

b) 投資評価

当会社の資産価値の決定においては、証券取引所で値付けや取引が行われる各々の有価証券は、その有価証券の通常の主たる市場である証券取引所で入手可能な直近の価格で評価され、店頭市場で取引される各々の有価証券の価格は可能な限り上場証券に近い方法で評価されます。

証券取引所または店頭市場で値付けや取引が行われない有価証券、及びそのように値決めや取引が行われるが建値が入手不可能又は建値が適正市場価格を表していない有価証券の評価は、合理的に予測可能な販売価格を基準に慎重かつ誠実に決定されます。

購入日から90日以内に満期となる短期投資有価証券は、時価にほぼ等しい償却原価で評価されます。割引やプレミアムは満期までの定額法により償却されます。市場状況に重大な変化があった場合、投資有価証券の評価基準は新たな市場利回りに調整されます。

オープンエンド型の投資信託の投資証券又は受益証券は、かかる投資信託事業又はそのエージェントにより報告又は提供される直近の価格又は純資産総額で評価されます。

c) 外国通貨の換算

各々のサブファンドの帳簿と記録は、該当するサブファンドの基準通貨建てとなっています。その他の通貨建ての金額は以下の基準で基準通貨に換算されます。

- () その他の通貨で表された投資評価並びにその他の資産及び負債は、各営業日の為替レートで基準通貨に換算されます。
- () 外国投資有価証券の売買、収益及び費用は、各々の取引日の為替レートを使用して基準通貨に換算されます。

外国為替の実現純利益及び損失は以下を表します：

- () 外国通貨の売却及び保有による為替利益及び損失
- () 有価証券取引の取引日と決済日の間の利益及び損失
- () 計上される配当及び利息と実際に受取る金額の差から生じる利益及び損失

取引の結果生じる利益及び損失は、損益計算書及び純資産の変動計算書に含まれています。

2012年12月31日現在で使用された主な為替レートは以下のとおりです：					
1 USD =	0.9637	AUD	1 USD =	86.4150	JPY
1 USD =	2.0475	BRL	1 USD =	1,070.5750	KRW
1 USD =	0.9957	CAD	1 USD =	3.0580	MYR
1 USD =	0.9137	CHF	1 USD =	12.9858	MXN
1 USD =	6.2303	CNY	1 USD =	5.5619	NOK
1 USD =	19.0385	CZK	1 USD =	1.2165	NZD
1 USD =	5.6459	DKK	1 USD =	3.0910	PLN
1 USD =	0.7568	EUR	1 USD =	6.4977	SEK
1 USD =	0.6176	GBP	1 USD =	1.2211	SGD
1 USD =	7.7504	HKD	1 USD =	30.5900	THB
1 USD =	9,637.5009	IDR	1 USD =	29.0390	TWD
1 USD =	54.7900	INR			

d) 有価証券取引及び投資収益

有価証券取引は取引日基準で計上されます。受取配当金は配当落ち日に発生します。実現利益及び損失は売却有価証券の平均原価を基準に決定されます。受取利息は日単位で発生します。

e) 設立費用

当会社及び各々のサブファンドの設立費用は、スタンダード・ライフ・グループ会社が負担しました。

f) 先物為替予約

先物為替予約は2012年12月31日現在の先物為替予約レートを基準に評価され、その結果生じる未実現評価純損益の純変動額は、損益計算書及び純資産の変動計算書の「先物為替予約の未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。先物為替予約の実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書に開示されています。

g) スワップ契約

金利スワップ契約は最新の市場金利に基づくその公正価値で評価され、その結果生じる未実現評価（損）益の純変動額は損益計算書及び純資産変動計算書の「スワップ契約に係る未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。支払／受取純額は純資産計算書の「スワップ契約に係る未実現評価（損）益」の項目に計上されています。スワップ契約に係る実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書の「スワップ契約に係る実現純利益（損失）」の項目に開示されています。金利スワップの価値は評価日現在の未経過利息の額を含んでいます。スワップ契約に係る受取（支払）利息は損益計算書及び純資産の変動計算書の「スワップ契約に係る実現純利益（損失）」の項目に含まれています。

インフレ連動スワップ契約のリザルトは純資産計算書の「スワップ契約に係る未実現評価損」の項目に計上され、損益計算書及び純資産変動計算書の「スワップ契約に係る実現純利益（損失）」の項目に計上されています。

h) 先物契約

先物契約は2012年12月31日の先物契約為替レートに基づき評価され、その結果生じる未実現評価純損益の純変動額は、損益計算書及び純資産変動計算書の「先物契約に係る未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。先物契約に係る実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書に開示されています。

i) オプション契約

オプション契約は2012年12月31日のオプション契約為替レートに基づき評価され、その結果生じる未実現評価純損益の純変動額は、損益計算書及び純資産変動計算書の「オプション契約に係る未実現評価純（損）益の変動額」の項目に含まれています。オプション契約に係る実現利益（損失）は損益計算書及び純資産変動計算書に開示されています。

j) 連結

当会社は2007年6月11日に（インド株式サブファンドのために）モーリシャス子会社、スタンダード・ライフ・インベストメントGS（モーリシャス・ホールディングス）を設立しました。モーリシャス子会社は全額出資子会社であり、当会社の投資方針に従って出資しています。現在、このモーリシャス子会社はインド／モーリシャスの二重課税防止条約により恩恵を受けています。将来においてこれが変更されないという保証はありません。インド株式ファンドの連結財務諸表はこの子会社のそれぞれの勘定を含んでいます。

3. 費用

a) 年間管理手数料

この年間管理手数料は、投資顧問会社、副投資顧問会社、主要販売会社、及び指名された副販売会社への支払いに使われます。

サブファンド：	年間管理手数料（年率 %）		
	クラスA	クラスD	クラスZ
Standard Life Investments Global SICAV			
Absolute Return Sub-funds			
Global Absolute Return Strategies Fund ^	1.60	0.85	0.00

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

b) 保管料

保管料はサブファンドの資産が投資される地域又は国ごとに決められたレートで計算されます。現在、年率レートは関連サブファンドの純資産価値に対して、最低が0.0025%、最高が0.50%となっています。

c) 取引費用

取引費用は投資有価証券の取得及び売却において発生する場合があります。この費用はエージェント、アドバイザー、並びにブローカー及びディーラーへの報酬及び手数料を含みます。取引費用は損益計算書及び純資産変動計算書の「投資有価証券の売却に係る実現純利益（損失）」に含まれています。

ディーリング手数料は通常、取引所での有価証券及びデリバティブの取引に対して支払われます。取引費用は取引所で行われない取引については費用が取引価格に含まれるため、個別に確認することはできません。

2012年12月31日に終了した年度について、サブファンドは先物の販売及び購入に関する手数料が発生し、これは「先物契約に係る実現純利益（損失）」として損益勘定に含まれています。同様に、2012年12月31日に終了した年度中に、サブファンドはオプションの販売及び購入に係る手数料が発生し、これは「オプション契約に係る実現純利益（損失）」として損益計算書及び純資産変動計算書に含まれています。

以下の表はサブファンドに発生した確認可能な取引費用の概算です：

サブファンド	通貨	概算取引費用 (2012年)	概算取引費用 (2011年)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	EUR	1,191,253	1,170,711

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

d) 管理事務報酬

管理事務報酬は資産価値に基づくスライド制となっています。報酬は以下のとおり計算されます：

資産価値1億ユーロまでは年率0ベース・ポイントで支払
 資産価値1億超2.5億ユーロまでは年率1.25ベース・ポイントで支払
 資産価値2.5億超5億ユーロまでは年率0.75ベース・ポイントで支払
 資産価値5億ユーロ超は年率0.50ベース・ポイントで支払

1サブファンドにつき年間15,000ユーロの定額報酬もあります。

4. 配当金

取締役会はルクセンブルグ法により定められた形式及び条件に基づき中間配当の支払いを決定することができます。2012年12月31日に終了した年度に、当会社は以下の配当を計上しました：

サブファンド	通貨	1株当たりの金額
Global Absolute Return Strategies Fund ^ -クラスA 分配型	EUR	0.1131
Global Absolute Return Strategies Fund ^ -クラスD 分配型	EUR	0.1848

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

Global Absolute Return Strategies Fund クラスA及びD分配型投資証券は、2012年1月4日を配当落ち日及び2012年1月10日を受け渡し日として受益者に総額50,688ユーロを支払いました。

5. 課税

a) 引受税

現在の法令及び実務に従い、当会社はルクセンブルグ所得税の支払い義務がなく、また当会社により支払われた配当金はルクセンブルグ源泉徴収税の支払い義務がありません。ルクセンブルグにおける現行の法規制に従い、本サブファンドは機関投資家専用の投資証券クラスのように0.01%の軽減税率による恩恵を受ける投資証券クラスを除き、年率0.05%の「引受税」が課されます。（かかる条件は、監督官庁及びルクセンブルグにおいてその時々効力のある法規制により解釈されるため）クラスD投資証券は、機関投資家及び、念のため書き添えると、取締役が当該クラスを提供する一般投資家及び機関投資家の代理人となる指名機関専用です。クラスZ投資証券は、スタンダード・ライフ・グループ会社のメンバー、並びに投資顧問会社及び関連の副投資顧問会社（場合に応じて）への報酬や他の費用の支払いのために個別の取決めが行われたその他の機関投資家専用です。引受税は以下のとおり定められた率で、四半期毎に計算され、支払われます：

クラスA このクラスの純資産総額の0.05%
 クラスD このクラスの純資産総額の0.01%
 クラスZ このクラスの純資産総額の0.01%

b) 外国税に関する規定

他の国から受け取った有価証券に係るキャピタル・ゲイン、配当金及び利息は、当該国により課される源泉徴収税又はキャピタル・ゲイン税の対象となる可能性があります。外国キャピタル・ゲイン税及び所得税の対する潜在的責任に備えることは当会社の方針です。

6. 先物為替予約

2012年12月31日現在、当会社は以下の先物為替予約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^					
通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現評価（損）益（ユーロ相当額）
SEK	201	EUR	(23)	01/02/2013	-
GBP	40,487	EUR	(49,264)	01/03/2013	349
USD	11,706	EUR	(8,813)	01/03/2013	46
SEK	992	EUR	(115)	01/03/2013	-
EUR	182	USD	(241)	01/03/2013	-
EUR	1,333,987	JPY	(147,970,000)	01/04/2013	38,147
EUR	245,245	JPY	(27,880,000)	01/04/2013	1,087
EUR	876,144	SEK	(7,517,074)	01/04/2013	755
EUR	1,482,327	USD	(1,958,345)	01/04/2013	350

GBP	4,953	EUR	(6,049)	01/04/2013	21
EUR	4,032	JPY	(460,000)	01/04/2013	3
EUR	6,227,468	JPY	(626,845,105)	01/09/2013	737,922
EUR	26,622,522	USD	(34,389,802)	01/09/2013	599,250
EUR	18,604,672	GBP	(14,873,691)	01/09/2013	379,693
EUR	24,007,380	USD	(31,285,626)	01/09/2013	333,085
EUR	4,650,636	CAD	(5,909,614)	01/09/2013	160,361
EUR	11,624,818	GBP	(9,385,413)	01/09/2013	124,717
EUR	6,509,872	USD	(8,510,134)	01/09/2013	70,128
EUR	2,030,483	CAD	(2,608,809)	01/09/2013	48,243
EUR	1,309,067	AUD	(1,620,496)	01/09/2013	37,599
EUR	2,269,782	AUD	(2,846,702)	01/09/2013	36,212
EUR	1,380,959	USD	(1,784,866)	01/09/2013	30,324
EUR	1,185,102	USD	(1,534,493)	01/09/2013	23,928
EUR	1,072,724	GBP	(858,206)	01/09/2013	21,150
EUR	944,958	GBP	(759,888)	01/09/2013	13,855
EUR	682,500	GBP	(547,898)	01/09/2013	11,152
EUR	2,835,578	GBP	(2,306,400)	01/09/2013	9,509
EUR	664,991	GBP	(535,276)	01/09/2013	9,109
EUR	1,109,612	GBP	(898,243)	01/09/2013	8,980
EUR	681,922	GBP	(550,073)	01/09/2013	7,909
EUR	776,126	GBP	(630,036)	01/09/2013	4,132
EUR	110,245	CAD	(140,936)	01/09/2013	3,159
EUR	136,646	CAD	(177,489)	01/09/2013	1,786
EUR	213,480	AUD	(269,834)	01/09/2013	1,764
EUR	208,781	GBP	(168,986)	01/09/2013	1,720
EUR	89,914	AUD	(113,149)	01/09/2013	1,135
EUR	72,590	AUD	(91,083)	01/09/2013	1,124
EUR	522,666	GBP	(425,773)	01/09/2013	959
SEK	464,875	EUR	(54,073)	01/09/2013	54
EUR	29,251,536	GBP	(23,400,000)	01/10/2013	579,477
EUR	3,708,515	USD	(4,790,208)	01/10/2013	83,728
EUR	30,677,180	GBP	(25,000,000)	01/10/2013	44,639
EUR	5,500,879	DKK	(41,000,000)	01/10/2013	4,836
EUR	99,752	GBP	(80,274)	01/10/2013	1,392
EUR	186,745,324	USD	(241,791,123)	01/14/2013	3,786,847
EUR	1,757,832	USD	(2,235,028)	01/14/2013	66,632
EUR	1,059,243	USD	(1,350,000)	01/14/2013	37,725
EUR	1,366,804	USD	(1,774,038)	01/14/2013	24,425
EUR	1,538,015	USD	(2,004,635)	01/14/2013	21,148
EUR	1,075,541	USD	(1,400,000)	01/14/2013	16,189
EUR	377,532	USD	(481,200)	01/14/2013	13,417
EUR	413,606	USD	(529,125)	01/14/2013	13,228
EUR	815,802	GBP	(655,758)	01/14/2013	12,339
EUR	459,164	USD	(593,098)	01/14/2013	10,379
EUR	274,790	USD	(350,000)	01/14/2013	9,952
EUR	645,937	GBP	(520,000)	01/14/2013	8,811
EUR	478,405	USD	(620,644)	01/14/2013	8,776
EUR	490,741	USD	(638,516)	01/14/2013	7,589
EUR	340,211	USD	(442,775)	01/14/2013	5,173
EUR	380,431	USD	(496,068)	01/14/2013	5,066
EUR	354,383	GBP	(286,030)	01/14/2013	3,927
EUR	379,818	USD	(497,233)	01/14/2013	3,572
EUR	202,826	USD	(263,605)	01/14/2013	3,361
EUR	187,859	GBP	(150,883)	01/14/2013	2,990
EUR	190,585	USD	(248,118)	01/14/2013	2,840
EUR	119,817	GBP	(95,983)	01/14/2013	2,214
EUR	783,046	USD	(1,032,000)	01/14/2013	2,153
EUR	736,950	USD	(971,175)	01/14/2013	2,082

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現評価（損）益（ユーロ相当額）
EUR	333,077	GBP	(270,433)	01/14/2013	1,731
EUR	54,526	USD	(70,085)	01/14/2013	1,494
EUR	131,857	GBP	(106,460)	01/14/2013	1,417
EUR	112,307	GBP	(90,725)	01/14/2013	1,148
EUR	88,019	USD	(115,000)	01/14/2013	1,001
EUR	46,348	USD	(60,220)	01/14/2013	781
EUR	257,075	USD	(338,811)	01/14/2013	703
EUR	151,772	GBP	(123,386)	01/14/2013	595
EUR	79,584	USD	(104,731)	01/14/2013	337
EUR	3,798	USD	(4,968)	01/14/2013	39
USD	29,500,815	JPY	(2,305,114,000)	01/22/2013	2,134,372
USD	60,602,725	JPY	(4,747,169,000)	01/23/2013	4,280,543
USD	41,500,000	JPY	(3,259,742,000)	01/24/2013	2,852,712
USD	29,000,000	JPY	(2,388,947,500)	01/24/2013	1,020,913
EUR	1,999,199	USD	(2,563,135)	02/05/2013	60,112
EUR	1,173,490	USD	(1,500,000)	02/05/2013	38,696
EUR	1,273,611	USD	(1,637,881)	02/05/2013	34,506
EUR	663,437	USD	(861,764)	02/05/2013	11,487
USD	1,731,921	EUR	(1,302,414)	02/05/2013	7,835
EUR	194,975	USD	(249,973)	02/05/2013	5,862
EUR	122,913	USD	(156,691)	02/05/2013	4,372
EUR	120,312	USD	(154,722)	02/05/2013	3,260
EUR	137,874	USD	(178,648)	02/05/2013	2,722
EUR	24,098	USD	(30,598)	02/05/2013	950
EUR	23,286	USD	(29,738)	02/05/2013	788
EUR	18,891	USD	(24,013)	02/05/2013	724
EUR	21,369	USD	(27,385)	02/05/2013	651
USD	140,000	EUR	(105,281)	02/05/2013	633
EUR	16,723	USD	(21,296)	02/05/2013	612
EUR	24,097	USD	(31,073)	02/05/2013	589
EUR	29,804	USD	(38,714)	02/05/2013	516
USD	111,118	EUR	(83,579)	02/05/2013	484
EUR	30,503	USD	(39,774)	02/05/2013	413
EUR	17,001	USD	(21,940)	02/05/2013	403
EUR	11,703	USD	(14,982)	02/05/2013	369
EUR	9,238	USD	(11,794)	02/05/2013	316
EUR	11,353	USD	(14,694)	02/05/2013	237
EUR	5,847	USD	(7,455)	02/05/2013	207
EUR	7,601	USD	(9,815)	02/05/2013	175
EUR	8,627	USD	(11,215)	02/05/2013	143
EUR	4,697	USD	(6,025)	02/05/2013	139
USD	22,682	EUR	(17,061)	02/05/2013	99
EUR	6,746	USD	(8,797)	02/05/2013	91
EUR	17,643	USD	(23,227)	02/05/2013	71
EUR	3,859	USD	(5,017)	02/05/2013	64
EUR	14,204	USD	(18,725)	02/05/2013	37
EUR	1,684	USD	(2,179)	02/05/2013	35
USD	8,303	EUR	(6,249)	02/05/2013	32
EUR	8,209	USD	(10,823)	02/05/2013	22
EUR	310	USD	(401)	02/05/2013	6
EUR	548	USD	(716)	02/05/2013	6
EUR	335	USD	(438)	02/05/2013	4
EUR	99,765,395	USD	(130,334,111)	02/07/2013	1,165,464
EUR	45,499,087	GBP	(37,031,434)	02/07/2013	139,642
EUR	5,493,668	CAD	(7,100,247)	02/07/2013	103,494
EUR	6,132,764	AUD	(7,798,202)	02/07/2013	29,357
EUR	835,752	NZD	(1,309,083)	02/07/2013	23,726
EUR	128,344	JPY	(13,273,326)	02/07/2013	12,106
EUR	683,221	GBP	(549,205)	02/07/2013	10,506

USD	2,540,309	EUR	(1,911,714)	02/07/2013	10,072
EUR	700,619	GBP	(563,807)	02/07/2013	10,017
EUR	6,566,834	SEK	(56,382,117)	02/07/2013	8,377
EUR	640,294	NZD	(1,018,831)	02/07/2013	8,312
EUR	17,970	NZD	(27,993)	02/07/2013	606
EUR	16,533	NZD	(25,802)	02/07/2013	528
EUR	22,018	NZD	(34,655)	02/07/2013	521
SEK	837,509	EUR	(97,169)	02/07/2013	251
EUR	11,271	NZD	(17,869)	02/07/2013	187
EUR	31,384	SEK	(269,317)	02/07/2013	57
EUR	138,289,276	GBP	(111,198,047)	02/08/2013	2,085,457
EUR	50,119,232	USD	(65,056,869)	02/08/2013	903,044
EUR	6,177,980	JPY	(641,185,363)	02/08/2013	562,998
EUR	2,945,239	CAD	(3,826,366)	02/08/2013	40,524
EUR	2,572,526	AUD	(3,238,946)	02/08/2013	37,702
EUR	24,249,516	CHF	(29,250,906)	02/08/2013	11,704
EUR	1,504,781	DKK	(11,216,074)	02/08/2013	985
CAD	6,501,477	EUR	(4,925,309)	02/11/2013	9,745
EUR	13,227	CAD	(17,042)	02/11/2013	292
EUR	8,062	CAD	(10,338)	02/11/2013	215
EUR	13,646	CAD	(17,739)	02/11/2013	181
EUR	7,312	CAD	(9,496)	02/11/2013	104
EUR	2,019	CAD	(2,621)	02/11/2013	29
EUR	15,041	CAD	(19,778)	02/11/2013	28
EUR	479,725	GBP	(388,744)	02/15/2013	3,600
EUR	245,050	GBP	(197,263)	02/15/2013	3,448
GBP	353,006	EUR	(429,330)	02/15/2013	3,023
EUR	293,331	GBP	(237,107)	02/15/2013	2,929
EUR	706,392	GBP	(574,664)	02/15/2013	2,557
EUR	159,735	GBP	(128,999)	02/15/2013	1,740
EUR	91,302	GBP	(73,777)	02/15/2013	941
EUR	8,529	JPY	(872,099)	02/15/2013	892
EUR	55,039	GBP	(44,221)	02/15/2013	879
EUR	61,376	GBP	(49,436)	02/15/2013	828
EUR	76,216	GBP	(61,646)	02/15/2013	714
EUR	43,002	GBP	(34,595)	02/15/2013	630
EUR	9,090	JPY	(970,000)	02/15/2013	596
EUR	47,828	GBP	(38,569)	02/15/2013	590
EUR	101,014	GBP	(82,013)	02/15/2013	567
EUR	34,739	GBP	(27,923)	02/15/2013	540
EUR	25,108	GBP	(20,070)	02/15/2013	526
EUR	30,979	GBP	(24,910)	02/15/2013	470
EUR	21,565	GBP	(17,305)	02/15/2013	370
EUR	8,067	JPY	(880,000)	02/15/2013	360
EUR	16,009	GBP	(12,781)	02/15/2013	356
EUR	5,078	JPY	(540,000)	02/15/2013	349
EUR	10,492	JPY	(1,160,000)	02/15/2013	334
EUR	40,421	GBP	(32,744)	02/15/2013	317
EUR	21,963	GBP	(17,720)	02/15/2013	260
EUR	3,003	JPY	(320,000)	02/15/2013	201
EUR	44,559	GBP	(36,224)	02/15/2013	193
EUR	35,936	GBP	(29,192)	02/15/2013	182
GBP	37,328	EUR	(45,564)	02/15/2013	154
EUR	23,924	GBP	(19,418)	02/15/2013	142
EUR	9,248	JPY	(1,040,000)	02/15/2013	140
EUR	26,082	GBP	(21,186)	02/15/2013	134
EUR	28,844	GBP	(23,451)	02/15/2013	122
EUR	15,938	GBP	(12,917)	02/15/2013	117
EUR	21,816	JPY	(2,480,000)	02/15/2013	99
EUR	2,812	JPY	(310,000)	02/15/2013	97
GBP	396,490	EUR	(485,531)	02/15/2013	80
EUR	1,126	JPY	(120,000)	02/15/2013	75
EUR	4,999	GBP	(4,039)	02/15/2013	52
EUR	2,500	JPY	(280,000)	02/15/2013	48

EUR	6,083	GBP	(4,931)	02/15/2013	43
EUR	14,545	GBP	(11,842)	02/15/2013	41
EUR	466	JPY	(50,000)	02/15/2013	28
EUR	463	JPY	(50,000)	02/15/2013	25
CHF	17,323	EUR	(14,337)	02/15/2013	18
EUR	3,527	GBP	(2,867)	02/15/2013	15
EUR	187	JPY	(20,000)	02/15/2013	11
EUR	51,960	GBP	(42,418)	02/15/2013	7
EUR	8,764	JPY	(1,000,000)	02/15/2013	7
SEK	922,029,500	EUR	(106,527,365)	02/20/2013	682,097
SEK	10,648,134	EUR	(1,215,863)	02/20/2013	22,255
SEK	6,662,458	EUR	(757,083)	02/20/2013	17,598
SEK	16,067,101	EUR	(1,850,696)	02/20/2013	17,515
SEK	13,165,854	EUR	(1,516,492)	02/20/2013	14,374
SEK	6,907,174	EUR	(789,408)	02/20/2013	13,727
SEK	14,614,116	EUR	(1,686,212)	02/20/2013	13,052
SEK	4,858,199	EUR	(555,203)	02/20/2013	9,687
SEK	9,415,502	EUR	(1,085,701)	02/20/2013	9,091
SEK	10,057,091	EUR	(1,160,476)	02/20/2013	8,917
SEK	6,770,779	EUR	(779,821)	02/20/2013	7,455
SEK	10,176,129	EUR	(1,176,154)	02/20/2013	7,081
SEK	13,740,717	EUR	(1,591,178)	02/20/2013	6,531
SEK	6,555,746	EUR	(756,364)	02/20/2013	5,909
SEK	10,208,829	EUR	(1,181,131)	02/20/2013	5,906
SEK	9,592,071	EUR	(1,109,490)	02/20/2013	5,833
SEK	7,764,220	EUR	(897,128)	02/20/2013	5,660
SEK	6,333,715	EUR	(731,303)	02/20/2013	5,153
SEK	6,559,046	EUR	(757,508)	02/20/2013	5,148
SEK	7,132,499	EUR	(824,420)	02/20/2013	4,915
SEK	4,911,078	EUR	(566,369)	02/20/2013	4,669
SEK	8,622,039	EUR	(997,958)	02/20/2013	4,575
SEK	4,200,299	EUR	(484,169)	02/20/2013	4,223
SEK	4,476,319	EUR	(516,348)	02/20/2013	4,138
SEK	5,967,106	EUR	(690,520)	02/20/2013	3,309
SEK	3,138,126	EUR	(361,682)	02/20/2013	3,205
SEK	7,604,707	EUR	(881,643)	02/20/2013	2,598
SEK	3,424,606	EUR	(395,745)	02/20/2013	2,453
SEK	3,971,499	EUR	(460,746)	02/20/2013	1,042
SEK	2,885,713	EUR	(334,708)	02/20/2013	830
SEK	628,847	EUR	(72,485)	02/20/2013	634
SEK	236,222	EUR	(27,292)	02/20/2013	175
SEK	3,268	EUR	(376)	02/20/2013	4
EUR	58	SEK	(500)	02/20/2013	-
EUR	115	SEK	(992)	02/20/2013	-
EUR	35	SEK	(300)	02/20/2013	-
EUR	587	SEK	(5,049)	02/20/2013	-
EUR	23	SEK	(201)	02/20/2013	-
EUR	44,822	AUD	(55,590)	02/25/2013	1,375
EUR	48,846	AUD	(61,482)	02/25/2013	793
AUD	71,866	EUR	(55,846)	02/25/2013	323
EUR	153,053,137	GBP	(124,204,457)	03/05/2013	963,578
EUR	2,299,096	USD	(2,987,392)	03/05/2013	39,593
EUR	1,504,758	USD	(1,955,249)	03/05/2013	25,914
EUR	1,765,370	GBP	(1,432,619)	03/05/2013	11,114
EUR	310,347	GBP	(250,000)	03/05/2013	4,220
EUR	233,706	GBP	(188,723)	03/05/2013	2,613
EUR	203,979	GBP	(164,756)	03/05/2013	2,233
EUR	392,669	GBP	(319,437)	03/05/2013	1,515
EUR	23,983,698	USD	(31,031,475)	03/06/2013	513,383
EUR	23,710,339	USD	(30,634,019)	03/11/2013	541,740
EUR	11,521,258	USD	(14,985,770)	03/11/2013	187,476
EUR	7,704,720	USD	(9,970,562)	03/11/2013	163,954
EUR	15,297,242	USD	(20,023,432)	03/11/2013	153,461
EUR	2,070,397	USD	(2,702,895)	03/11/2013	26,190

EUR	1,047,903	USD	(1,367,035)	03/11/2013	14,010
EUR	318,899	USD	(416,024)	03/11/2013	4,259
EUR	2,854,223	JPY	(303,024,044)	03/12/2013	200,669
EUR	5,404,790	AUD	(6,706,653)	03/12/2013	169,373
EUR	5,251,477	AUD	(6,540,488)	03/12/2013	145,773
EUR	2,013,894	JPY	(215,588,344)	03/12/2013	126,006
EUR	4,571,915	HKD	(45,782,126)	03/12/2013	103,327
EUR	1,781,791	JPY	(192,352,404)	03/12/2013	97,379
EUR	3,749,708	HKD	(37,806,274)	03/12/2013	59,608
EUR	3,195,593	HKD	(32,293,472)	03/12/2013	43,573
EUR	1,484,333	AUD	(1,846,959)	03/12/2013	42,541
EUR	1,280,117	JPY	(142,420,051)	03/12/2013	32,957
EUR	2,815,790	GBP	(2,275,006)	03/12/2013	30,283
EUR	619,930	JPY	(67,486,070)	03/12/2013	28,961
EUR	1,500,902	AUD	(1,887,235)	03/12/2013	27,670
EUR	1,643,098	SGD	(2,610,330)	03/12/2013	26,407
EUR	1,098,986	AUD	(1,375,188)	03/12/2013	25,473
EUR	1,614,085	GBP	(1,299,678)	03/12/2013	22,766
EUR	1,544,960	HKD	(15,633,804)	03/12/2013	19,014
EUR	1,961,393	AUD	(2,489,237)	03/12/2013	18,219
EUR	716,554	SGD	(1,131,840)	03/12/2013	15,556
EUR	1,745,528	GBP	(1,414,080)	03/12/2013	14,135
EUR	501,396	AUD	(624,942)	03/12/2013	13,547
EUR	1,607,194	AUD	(2,041,787)	03/12/2013	13,313
EUR	661,400	AUD	(832,518)	03/12/2013	11,511
EUR	1,208,683	HKD	(12,265,949)	03/12/2013	11,458
EUR	977,164	GBP	(789,397)	03/12/2013	10,630
EUR	2,739,799	AUD	(3,497,320)	03/12/2013	9,684
EUR	539,238	SGD	(858,794)	03/12/2013	7,350
EUR	1,942,582	USD	(2,561,287)	03/12/2013	5,492
EUR	319,757	USD	(416,024)	03/12/2013	5,120
EUR	1,082,822	USD	(1,425,301)	03/12/2013	4,873
EUR	799,821	HKD	(8,156,586)	03/12/2013	3,693
EUR	605,732	GBP	(491,932)	03/12/2013	3,413
EUR	2,784,731	GBP	(2,271,639)	03/12/2013	3,347
EUR	1,256,848	HKD	(12,842,554)	03/12/2013	3,344
EUR	692,646	GBP	(563,043)	03/12/2013	3,259
EUR	246,238	SGD	(392,592)	03/12/2013	3,088
EUR	280,984	SGD	(449,431)	03/12/2013	2,632
EUR	347,997	GBP	(283,431)	03/12/2013	966
EUR	586,070	HKD	(5,995,234)	03/12/2013	902
EUR	134,172	SGD	(215,635)	03/12/2013	620
EUR	110,117	USD	(144,977)	03/12/2013	471
EUR	528,010	SGD	(852,404)	03/12/2013	79
USD	27,872,640	AUD	(27,000,000)	03/26/2013	24,084
MXN	350,000,000	USD	(26,086,114)	04/18/2013	449,073
MXN	100,000,000	USD	(7,546,828)	04/18/2013	57,503
MXN	350,000,000	USD	(26,113,946)	04/19/2013	426,072
MXN	100,000,000	USD	(7,546,259)	04/19/2013	57,375
MXN	300,000,000	USD	(22,500,563)	04/22/2013	271,579
MXN	70,000,000	USD	(5,272,474)	04/22/2013	46,477
MXN	350,000,000	USD	(26,122,717)	04/23/2013	411,603
MXN	100,000,000	USD	(7,543,697)	04/23/2013	57,074
MXN	350,000,000	USD	(26,159,423)	04/24/2013	381,895
MXN	100,000,000	USD	(7,543,128)	04/24/2013	56,945
USD	85,175,915	CAD	(82,653,856)	05/21/2013	1,835,943
USD	32,941,221	CAD	(32,249,455)	05/22/2013	496,038
USD	32,937,974	CAD	(32,329,280)	05/23/2013	433,786
USD	90,000,000	CAD	(89,526,420)	05/23/2013	285,257
USD	27,500,000	JPY	(2,259,606,250)	08/30/2013	975,244
USD	21,000,000	CNY	(132,630,750)	08/30/2013	17,222
USD	5,900,000	CNY	(37,271,480)	08/30/2013	3,817

34,399,128

EUR	1,425	USD	(1,892)	01/02/2013	(7)
EUR	2,030	USD	(2,696)	01/02/2013	(10)
EUR	2,120	USD	(2,816)	01/02/2013	(11)
EUR	5,987	USD	(7,951)	01/02/2013	(30)
EUR	17,563	USD	(23,324)	01/02/2013	(88)
EUR	22,050	USD	(29,282)	01/02/2013	(110)
EUR	58,382	USD	(77,531)	01/02/2013	(292)
EUR	89,500	GBP	(73,295)	01/02/2013	(320)
EUR	883,055	SEK	(7,604,707)	01/02/2013	(2,660)
EUR	2,354	CAD	(3,102)	01/03/2013	(4)
EUR	3,962	USD	(5,250)	01/03/2013	(11)
EUR	3,966	GBP	(3,260)	01/03/2013	(29)
EUR	179,545	GBP	(146,545)	01/03/2013	(32)
EUR	6,251	USD	(8,303)	01/03/2013	(32)
HKD	223,531	EUR	(21,860)	01/03/2013	(34)
EUR	6,932	GBP	(5,698)	01/03/2013	(50)
EUR	7,216	GBP	(5,932)	01/03/2013	(53)
EUR	9,182	GBP	(7,548)	01/03/2013	(67)
EUR	11,731	GBP	(9,643)	01/03/2013	(85)
EUR	12,264	GBP	(10,081)	01/03/2013	(89)
EUR	15,816	GBP	(13,000)	01/03/2013	(115)
EUR	17,101	GBP	(14,057)	01/03/2013	(125)
EUR	26,158	GBP	(21,502)	01/03/2013	(191)
USD	145,532	EUR	(110,341)	01/03/2013	(209)
HKD	5,995,234	EUR	(586,317)	01/03/2013	(924)
EUR	461,440	SEK	(3,971,499)	01/03/2013	(1,070)
EUR	429,532	GBP	(353,006)	01/03/2013	(3,043)
JPY	1,000,000	EUR	(8,765)	01/04/2013	(8)
JPY	280,000	EUR	(2,501)	01/04/2013	(48)
JPY	2,480,000	EUR	(21,815)	01/04/2013	(97)
EUR	45,585	GBP	(37,328)	01/04/2013	(157)
EUR	60,103	SEK	(527,719)	01/09/2013	(1,341)
AUD	140,245	EUR	(112,583)	01/09/2013	(2,544)
AUD	147,235	EUR	(118,196)	01/09/2013	(2,673)
EUR	499,618	SEK	(4,315,796)	01/09/2013	(2,885)
SEK	5,034,452	EUR	(589,253)	01/09/2013	(3,074)
CAD	205,698	EUR	(160,055)	01/09/2013	(3,760)
GBP	917,169	EUR	(1,128,755)	01/09/2013	(4,933)
USD	183,062	EUR	(143,647)	01/09/2013	(5,121)
AUD	1,061,829	EUR	(840,252)	01/09/2013	(7,123)
GBP	1,082,881	EUR	(1,340,151)	01/09/2013	(13,279)
SEK	26,796,077	EUR	(3,149,496)	01/09/2013	(29,534)
USD	3,761,202	EUR	(2,879,848)	01/09/2013	(33,691)
EUR	5,032,433	SEK	(44,017,688)	01/09/2013	(92,702)
EUR	7,029,069	CHF	(8,500,000)	01/10/2013	(11,991)
EUR	3,102,253	NOK	(23,000,000)	01/10/2013	(25,751)
EUR	15,878,267	CHF	(19,200,000)	01/10/2013	(26,245)
EUR	2,876,642	SEK	(25,000,000)	01/10/2013	(34,097)
EUR	2,679,313	NOK	(20,000,000)	01/10/2013	(40,691)
EUR	230,915	USD	(305,185)	01/14/2013	(12)
GBP	103,629	EUR	(127,085)	01/14/2013	(114)
EUR	79,486	USD	(105,501)	01/14/2013	(344)
USD	151,360	EUR	(115,043)	01/14/2013	(512)
USD	99,157	EUR	(75,772)	01/14/2013	(742)
USD	57,680	EUR	(44,775)	01/14/2013	(1,129)
USD	105,737	EUR	(81,584)	01/14/2013	(1,575)
USD	639,466	EUR	(487,236)	01/14/2013	(3,365)
USD	621,017	EUR	(474,680)	01/14/2013	(4,770)
USD	270,693	EUR	(209,616)	01/14/2013	(4,788)
USD	331,413	EUR	(255,724)	01/14/2013	(4,950)
USD	456,851	EUR	(351,035)	01/14/2013	(5,345)
USD	353,184	EUR	(272,819)	01/14/2013	(5,572)
USD	1,269,345	EUR	(966,355)	01/14/2013	(5,866)
USD	374,376	EUR	(289,876)	01/14/2013	(6,593)

USD	366,159	EUR	(283,666)	01/14/2013	(6,601)
USD	337,053	EUR	(262,187)	01/14/2013	(7,145)
USD	307,448	EUR	(240,165)	01/14/2013	(7,525)
USD	437,976	EUR	(339,993)	01/14/2013	(8,585)
USD	647,348	EUR	(500,211)	01/14/2013	(10,376)
USD	558,352	EUR	(436,373)	01/14/2013	(13,880)
USD	681,329	EUR	(529,438)	01/14/2013	(13,890)
USD	1,288,046	EUR	(989,182)	01/14/2013	(14,543)
USD	1,824,731	EUR	(1,395,691)	01/14/2013	(14,954)
USD	641,911	EUR	(502,875)	01/14/2013	(17,154)
USD	732,883	EUR	(575,068)	01/14/2013	(20,510)
USD	40,000,000	EUR	(30,896,763)	01/18/2013	(630,685)
USD	10,393	EUR	(7,868)	02/05/2013	(5)
USD	2,291	EUR	(1,740)	02/05/2013	(7)
EUR	1,946	USD	(2,588)	02/05/2013	(12)
USD	1,100	EUR	(846)	02/05/2013	(14)
USD	9,973	EUR	(7,565)	02/05/2013	(20)
USD	6,001	EUR	(4,585)	02/05/2013	(45)
EUR	8,810	USD	(11,706)	02/05/2013	(46)
EUR	10,291	USD	(13,681)	02/05/2013	(60)
USD	13,480	EUR	(10,308)	02/05/2013	(110)
USD	217,769	EUR	(164,860)	02/05/2013	(111)
USD	8,760	EUR	(6,768)	02/05/2013	(141)
USD	8,000	EUR	(6,237)	02/05/2013	(184)
USD	7,971	EUR	(6,214)	02/05/2013	(184)
USD	22,717	EUR	(17,372)	02/05/2013	(186)
USD	21,530	EUR	(16,511)	02/05/2013	(223)
USD	13,663	EUR	(10,580)	02/05/2013	(244)
USD	12,250	EUR	(9,526)	02/05/2013	(258)
USD	9,846	EUR	(7,710)	02/05/2013	(261)
USD	11,455	EUR	(8,935)	02/05/2013	(269)
EUR	74,034	USD	(98,368)	02/05/2013	(385)
USD	40,029	EUR	(30,682)	02/05/2013	(398)
USD	1,958,345	EUR	(1,481,949)	02/05/2013	(403)
USD	26,753	EUR	(20,647)	02/05/2013	(408)
USD	217,653	EUR	(165,096)	02/05/2013	(435)
USD	29,193	EUR	(22,554)	02/05/2013	(469)
USD	19,112	EUR	(14,952)	02/05/2013	(493)
USD	16,948	EUR	(13,332)	02/05/2013	(511)
USD	45,705	EUR	(35,187)	02/05/2013	(609)
USD	50,000	EUR	(38,462)	02/05/2013	(635)
USD	46,997	EUR	(36,198)	02/05/2013	(644)
USD	102,241	EUR	(78,010)	02/05/2013	(662)
USD	83,757	EUR	(64,047)	02/05/2013	(683)
USD	290,251	EUR	(220,465)	02/05/2013	(882)
USD	98,039	EUR	(75,057)	02/05/2013	(887)
USD	104,409	EUR	(80,028)	02/05/2013	(1,039)
USD	52,656	EUR	(41,087)	02/05/2013	(1,252)
USD	127,034	EUR	(97,423)	02/05/2013	(1,318)
USD	111,467	EUR	(85,814)	02/05/2013	(1,486)
USD	201,452	EUR	(154,937)	02/05/2013	(2,533)
USD	282,913	EUR	(216,593)	02/05/2013	(2,561)
USD	358,327	EUR	(273,796)	02/05/2013	(2,711)
USD	116,065	EUR	(90,566)	02/05/2013	(2,759)
USD	108,072	EUR	(84,765)	02/05/2013	(3,005)
USD	107,130	EUR	(84,128)	02/05/2013	(3,081)
USD	141,440	EUR	(110,484)	02/05/2013	(3,481)
USD	243,207	EUR	(187,921)	02/05/2013	(3,928)
USD	210,000	EUR	(163,295)	02/05/2013	(4,424)
USD	337,520	EUR	(259,943)	02/05/2013	(4,599)
USD	723,233	EUR	(551,828)	02/05/2013	(4,680)
USD	187,990	EUR	(147,253)	02/05/2013	(5,033)
USD	285,520	EUR	(221,055)	02/05/2013	(5,051)
USD	200,000	EUR	(156,886)	02/05/2013	(5,580)

USD	766,145	EUR	(589,626)	02/05/2013	(10,014)
USD	600,000	EUR	(464,631)	02/05/2013	(10,714)
USD	358,948	EUR	(282,695)	02/05/2013	(11,140)
USD	958,400	EUR	(737,585)	02/05/2013	(12,527)
USD	2,060,000	EUR	(1,597,499)	02/05/2013	(39,048)
USD	40,711,421	EUR	(31,535,382)	02/05/2013	(735,988)
USD	138,812,126	EUR	(107,524,947)	02/05/2013	(2,509,468)
AUD	169,551	EUR	(132,744)	02/07/2013	(42)
GBP	15,316	EUR	(18,832)	02/07/2013	(71)
AUD	115,910	EUR	(92,355)	02/07/2013	(1,636)
EUR	936,941	GBP	(768,330)	02/07/2013	(4,179)
GBP	585,446	EUR	(721,309)	02/07/2013	(4,202)
AUD	833,970	EUR	(660,099)	02/07/2013	(7,377)
GBP	829,155	EUR	(1,026,506)	02/07/2013	(10,883)
GBP	4,147,097	EUR	(5,109,766)	02/07/2013	(30,028)
USD	1,080,423	EUR	(849,070)	02/07/2013	(31,712)
USD	3,760,255	EUR	(2,919,389)	02/07/2013	(74,693)
GBP	3,841,723	EUR	(4,781,271)	02/07/2013	(75,582)
EUR	13,980,828	SEK	(121,155,944)	02/08/2013	(111,795)
CAD	42,012	EUR	(31,966)	02/11/2013	(76)
CAD	18,446	EUR	(14,135)	02/11/2013	(133)
CAD	10,165	EUR	(7,865)	02/11/2013	(148)
CAD	9,016	EUR	(7,055)	02/11/2013	(211)
CAD	9,361	EUR	(7,367)	02/11/2013	(261)
CAD	10,986	EUR	(8,618)	02/11/2013	(279)
CAD	20,720	EUR	(16,027)	02/11/2013	(299)
CAD	15,866	EUR	(12,358)	02/11/2013	(314)
CAD	12,900	EUR	(10,127)	02/11/2013	(335)
CAD	24,434	EUR	(18,935)	02/11/2013	(388)
CAD	24,445	EUR	(18,983)	02/11/2013	(428)
CAD	24,522	EUR	(19,061)	02/11/2013	(447)
CAD	60,976	EUR	(46,918)	02/11/2013	(634)
CAD	31,355	EUR	(24,492)	02/11/2013	(691)
CAD	34,803	EUR	(27,181)	02/11/2013	(763)
CAD	53,532	EUR	(41,778)	02/11/2013	(1,144)
CAD	47,675	EUR	(37,347)	02/11/2013	(1,159)
CAD	135,960	EUR	(105,620)	02/11/2013	(2,417)
CAD	285,000	EUR	(219,238)	02/11/2013	(2,904)
CAD	381,015	EUR	(294,346)	02/11/2013	(5,130)
CAD	327,359	EUR	(255,813)	02/11/2013	(7,325)
CAD	3,078,916	EUR	(2,346,129)	02/11/2013	(9,026)
CAD	543,225	EUR	(425,553)	02/11/2013	(13,210)
CAD	2,673,303	EUR	(2,069,436)	02/11/2013	(40,220)
CAD	36,604,998	EUR	(28,185,616)	02/11/2013	(399,982)
CAD	25,068,831	EUR	(19,665,129)	02/11/2013	(636,214)
CAD	113,931,954	EUR	(89,364,002)	02/11/2013	(2,882,052)
CHF	5,077	EUR	(4,209)	02/15/2013	(2)
CHF	5,065	EUR	(4,199)	02/15/2013	(2)
JPY	460,000	EUR	(4,031)	02/15/2013	(3)
EUR	6,046	GBP	(4,953)	02/15/2013	(20)
GBP	6,276	EUR	(7,709)	02/15/2013	(22)
GBP	1,556	EUR	(1,930)	02/15/2013	(24)
JPY	50,000	EUR	(469)	02/15/2013	(31)
GBP	5,467	EUR	(6,730)	02/15/2013	(35)
EUR	351,113	GBP	(286,723)	02/15/2013	(58)
GBP	9,715	EUR	(11,984)	02/15/2013	(85)
SGD	30,440	EUR	(18,958)	02/15/2013	(101)
GBP	602,440	EUR	(737,956)	02/15/2013	(102)
SGD	5,123	EUR	(3,277)	02/15/2013	(104)
JPY	220,000	EUR	(2,052)	02/15/2013	(126)
GBP	29,389	EUR	(36,148)	02/15/2013	(153)
JPY	152,399	EUR	(1,503)	02/15/2013	(168)
GBP	38,174	EUR	(46,925)	02/15/2013	(170)
JPY	162,885	EUR	(1,606)	02/15/2013	(180)

JPY	720,000	EUR	(6,531)	02/15/2013	(226)
GBP	49,180	EUR	(60,493)	02/15/2013	(259)
GBP	52,395	EUR	(64,499)	02/15/2013	(327)
EUR	49,241	GBP	(40,487)	02/15/2013	(347)
GBP	54,097	EUR	(66,653)	02/15/2013	(396)
GBP	25,112	EUR	(31,195)	02/15/2013	(439)
GBP	22,818	EUR	(28,400)	02/15/2013	(453)
GBP	90,833	EUR	(111,735)	02/15/2013	(484)
GBP	77,517	EUR	(95,431)	02/15/2013	(490)
GBP	22,169	EUR	(27,722)	02/15/2013	(569)
GBP	88,431	EUR	(108,920)	02/15/2013	(611)
GBP	57,462	EUR	(71,111)	02/15/2013	(733)
JPY	1,520,000	EUR	(14,150)	02/15/2013	(840)
GBP	58,486	EUR	(72,612)	02/15/2013	(980)
GBP	54,142	EUR	(67,298)	02/15/2013	(986)
JPY	27,880,000	EUR	(245,258)	02/15/2013	(1,109)
JPY	1,990,000	EUR	(18,550)	02/15/2013	(1,123)
GBP	77,670	EUR	(96,269)	02/15/2013	(1,141)
GBP	127,665	EUR	(157,519)	02/15/2013	(1,158)
JPY	1,970,000	EUR	(18,667)	02/15/2013	(1,416)
GBP	75,728	EUR	(94,371)	02/15/2013	(1,621)
GBP	86,414	EUR	(107,469)	02/15/2013	(1,631)
JPY	3,340,000	EUR	(31,343)	02/15/2013	(2,094)
JPY	3,510,000	EUR	(32,972)	02/15/2013	(2,235)
GBP	287,979	EUR	(355,500)	02/15/2013	(2,791)
GBP	119,926	EUR	(150,028)	02/15/2013	(3,145)
GBP	155,575	EUR	(193,876)	02/15/2013	(3,331)
GBP	311,559	EUR	(385,197)	02/15/2013	(3,607)
GBP	172,453	EUR	(216,014)	02/15/2013	(4,797)
GBP	379,218	EUR	(469,334)	02/15/2013	(4,877)
GBP	275,000	EUR	(341,823)	02/15/2013	(5,009)
GBP	371,826	EUR	(460,418)	02/15/2013	(5,015)
GBP	368,025	EUR	(456,153)	02/15/2013	(5,406)
GBP	613,454	EUR	(758,920)	02/15/2013	(7,577)
SGD	700,000	EUR	(442,177)	02/15/2013	(8,539)
JPY	24,000,000	EUR	(224,906)	02/15/2013	(14,735)
JPY	29,340,000	EUR	(273,366)	02/15/2013	(16,432)
JPY	30,570,000	EUR	(287,455)	02/15/2013	(19,750)
JPY	52,680,000	EUR	(481,633)	02/15/2013	(20,308)
JPY	41,250,000	EUR	(385,486)	02/15/2013	(24,254)
GBP	1,179,025	EUR	(1,474,694)	02/15/2013	(30,653)
JPY	147,970,000	EUR	(1,333,930)	02/15/2013	(38,139)
JPY	299,928,603	EUR	(2,796,302)	02/15/2013	(169,792)
JPY	429,990,000	EUR	(4,065,776)	02/15/2013	(300,303)
JPY	404,960,000	EUR	(3,905,544)	02/15/2013	(359,262)
JPY	430,000,000	EUR	(4,205,449)	02/15/2013	(439,888)
GBP	26,897,498	EUR	(33,463,507)	02/15/2013	(520,105)
JPY	1,900,000,000	EUR	(17,416,588)	02/15/2013	(778,065)
JPY	2,555,760,000	EUR	(23,651,852)	02/15/2013	(1,270,761)
GBP	114,696,979	EUR	(143,459,990)	02/15/2013	(2,981,921)
JPY	14,349,058,407	EUR	(141,512,382)	02/15/2013	(15,855,990)
USD	130,818,697	EUR	(102,853,620)	02/19/2013	(3,897,199)
EUR	317	SEK	(2,735)	02/20/2013	(1)
EUR	139	SEK	(1,206)	02/20/2013	(1)
EUR	239	SEK	(2,068)	02/20/2013	(2)
EUR	333	SEK	(2,893)	02/20/2013	(3)
EUR	355	SEK	(3,080)	02/20/2013	(3)
EUR	867	SEK	(7,513)	02/20/2013	(6)
EUR	1,509	SEK	(13,063)	02/20/2013	(10)
EUR	1,516	SEK	(13,136)	02/20/2013	(12)
EUR	3,002	SEK	(25,996)	02/20/2013	(20)
EUR	1,977	SEK	(17,316)	02/20/2013	(36)
EUR	2,074	SEK	(18,247)	02/20/2013	(48)
EUR	9,515	SEK	(82,240)	02/20/2013	(48)

EUR	6,361	SEK	(55,225)	02/20/2013	(61)
EUR	3,969	SEK	(34,730)	02/20/2013	(69)
EUR	13,550	SEK	(117,227)	02/20/2013	(81)
EUR	17,295	SEK	(149,451)	02/20/2013	(83)
SEK	2,827,444	EUR	(328,875)	02/20/2013	(112)
SEK	7,517,074	EUR	(874,890)	02/20/2013	(838)
EUR	2,557,782	SEK	(22,130,033)	02/20/2013	(15,399)
USD	123,800,210	CAD	(124,170,125)	02/20/2013	(582,724)
USD	178,141,053	CAD	(178,736,400)	02/22/2013	(880,941)
AUD	12,870	EUR	(10,215)	02/25/2013	(157)
AUD	25,869	EUR	(20,689)	02/25/2013	(471)
AUD	33,308	EUR	(26,677)	02/25/2013	(644)
EUR	229,311	AUD	(295,093)	02/25/2013	(1,325)
AUD	150,975	EUR	(121,683)	02/25/2013	(3,686)
AUD	1,936,275	EUR	(1,560,298)	02/25/2013	(46,961)
AUD	16,000,000	EUR	(12,725,712)	02/25/2013	(220,569)
AUD	27,941,500	EUR	(22,208,948)	02/25/2013	(370,669)
AUD	139,064,247	EUR	(112,083,505)	02/25/2013	(3,394,858)
GBP	171,652	EUR	(211,276)	03/05/2013	(1,087)
GBP	205,597	EUR	(253,113)	03/05/2013	(1,358)
EUR	354,186	USD	(468,526)	03/12/2013	(159)
EUR	455,586	HKD	(4,670,444)	03/12/2013	(275)
EUR	1,435,828	HKD	(14,718,636)	03/12/2013	(792)
EUR	727,873	SGD	(1,177,089)	03/12/2013	(1,149)
EUR	421,961	HKD	(4,343,068)	03/12/2013	(1,947)
EUR	1,013,472	HKD	(10,426,490)	03/12/2013	(4,211)
EUR	1,368,782	HKD	(14,077,671)	03/12/2013	(5,276)
EUR	2,146,118	USD	(2,849,965)	03/12/2013	(9,299)
EUR	5,713,075	USD	(7,583,495)	03/12/2013	(22,291)
USD	3,084,609	AUD	(3,000,000)	03/18/2013	(8,007)
USD	27,505,980	AUD	(27,000,000)	03/18/2013	(265,285)
USD	3,084,528	AUD	(3,000,000)	03/19/2013	(7,900)
USD	27,563,625	AUD	(27,000,000)	03/19/2013	(220,178)
USD	3,084,165	AUD	(3,000,000)	03/20/2013	(8,007)
USD	27,746,550	AUD	(27,000,000)	03/20/2013	(80,331)
USD	15,413,625	AUD	(15,000,000)	03/21/2013	(44,640)
USD	29,811,420	AUD	(29,000,000)	03/21/2013	(77,421)
USD	81,174,354	EUR	(62,332,681)	03/22/2013	(946,713)
USD	81,000,000	EUR	(62,294,994)	03/25/2013	(1,042,628)
USD	78,000,000	EUR	(60,808,851)	03/25/2013	(1,825,092)
USD	115,225,000	SGD	(140,879,846)	04/19/2013	(111,517)
INR	6,331,095,238	USD	(115,225,000)	04/19/2013	(1,368,748)
USD	80,550,000	SGD	(98,511,039)	05/21/2013	(96,994)
INR	4,507,175,250	USD	(80,550,000)	05/21/2013	(202,270)
					(47,607,773)
				純額（ユーロ）	(13,208,645)

7. スワップ契約

2012年12月31日現在、当会社は以下のスワップ契約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^

期限	契約	カウンターパーティー	通貨	想定元本	未実現評価（損）益 （ユーロ相当額）
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	25,000	193,904
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	25,000	202,968
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	44,000	225,364
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	30,000	229,662
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	45,000	245,101

12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	33,000	246,637
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	50,000	268,600
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	55,000	300,445
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	40,000	335,946
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	66,000	337,364
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	50,000	386,943
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	88,000	399,512
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	91,000	527,783
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	136,000	541,034
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	91,000	545,867
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	88,000	550,283
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Deutsche Bank	USD	91,000	554,058
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Deutsche Bank	USD	91,000	565,111
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	133,000	726,490
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	300,000	748,325
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	178,000	762,004
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	150,000	765,150
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	92,652	849,290
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	200,000	907,320
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	165,000	931,450
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	200,000	939,171
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	250,000	1,142,640
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	247,678	1,194,827
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	150,000	1,334,535
12/20/2013	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Barclays	GBP	141,872	1,348,870
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	250,000	1,482,239
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	500,000	1,521,700
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	USD	300,000	1,801,440
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	320,000	1,802,263
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	USD	200,000	1,952,059
12/20/2013	S&P500変動率支払、固定金利受取	Deutsche Bank	USD	200,000	1,992,703
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	19,700,000	110,542
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	23,000,000	140,854
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	7,950,000	153,482
12/12/2014	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,980,000	339,829
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	100,000	54,905
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	200,000	69,201
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	50,000	134,981
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	GBP	56,488	373,720
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	250,000	383,626
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	97,000	424,067
12/19/2014	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	300,000	447,375
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	GBP	170,000	447,503

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

期限	契約	カウンターパーティー	通貨	想定元本	未実現評価（損）益 （ユーロ相当額）
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	BNP Paribas	GBP	79,667	505,291
12/19/2014	FTSE100変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	GBP	188,000	861,180
12/11/2015	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,900,000	398,997
12/18/2015	S&P500変動率支払、固定金利受取	Societe Generale	USD	200,000	20,098
06/20/2016	EDF SA 5.625% 02/21/2033変動金利支払、 1.000%固定金利受取	UBSAG	EUR	(700,000)	6,030

11/24/2017	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.765%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	2,100,000	31
12/17/2017	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.815%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	13,051,636	10,077
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Barclays	USD	(950,000)	2,695
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Deutsche Bank	USD	(10,000,000)	28,365
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	BNP Paribas	EUR	10,000,000	75,781
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	JP Morgan	EUR	12,000,000	90,937
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Credit Suisse International	USD	(40,000,000)	113,461
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Credit Suisse International	USD	(46,000,000)	130,480
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	BNP Paribas	EUR	22,000,000	166,719
12/20/2017	CDX 北米ハイイールド19 5 Y 変動金利支払、 5.000%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	(61,168,000)	173,505
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Credit Suisse International	EUR	25,000,000	189,453
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	25,000,000	189,453
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Barclays	EUR	25,000,000	189,453
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Barclays	EUR	35,000,000	265,234
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Barclays	EUR	36,556,400	277,029
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Deutsche Bank	EUR	42,000,000	318,281
12/20/2017	1.000%固定金利支払、 iTraxx 欧州メイン・シリーズ18 5 Y 受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	47,443,600	359,533
12/18/2018	EURIBOR変動金利支払、1.520%固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	9,700,000	27,892
12/18/2018	EURIBOR変動金利支払、1.526%固定金利受取	JP Morgan	EUR	9,700,000	29,571
12/21/2018	EURIBOR変動金利支払、1.550%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	EUR	10,200,000	37,131
09/19/2022	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.848%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	3,352,381	20,609
05/24/2042	1.880%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	EUR	73,610,000	2,383,023
05/25/2042	1.794%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	Barclays	EUR	46,480,000	1,731,277
05/28/2042	1.695%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	Barclays	EUR	10,215,000	437,859
05/31/2042	1.805%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	HSBC Bank plc	EUR	56,695,000	2,070,999
07/05/2042	2.394%固定金利支払、ユーロ - EURIBOR受取	UBS AG	EUR	40,000,000	119,909
09/20/2042	3.205%固定金利支払、 英ポンド修正前RPI連動金利受取	HSBC Bank plc	GBP	1,400,000	56,555
10/04/2042	3.190%固定金利支払、 英ポンド修正前RPI連動金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	950,000	44,558
					43,270,609
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	30,000,000	(1,927,113)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	40,295,000	(1,873,687)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	27,000,000	(1,564,926)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	15,330,000	(1,359,002)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	23,655,000	(949,789)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	20,000,000	(948,188)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	20,000,000	(930,228)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,000,000	(921,924)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	10,000,000	(897,673)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	13,636,000	(809,488)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	9,000,000	(785,813)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	15,000,000	(759,729)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	12,573,000	(738,309)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	15,980,000	(706,755)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	15,000,000	(694,536)

12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	10,641,000	(606,192)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	10,400,000	(571,409)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Societe Generale	JPY	6,805,532	(555,662)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	6,759,000	(495,138)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	6,762,000	(469,430)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Deutsche Bank	JPY	6,768,000	(468,982)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	BNP Paribas	JPY	6,506,000	(463,522)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	6,834,000	(430,344)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	7,071,000	(397,138)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	5,183,000	(278,254)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	3,812,500	(215,373)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	3,395,000	(212,907)
12/13/2013	固定金利支払、日経225変動率受取	Morgan Stanley & Co. International plc	JPY	3,471,000	(186,886)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	1,700,000	(1,656,233)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Barclays	HKD	1,410,991	(1,392,059)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	700,000	(646,262)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Morgan Stanley & Co. International plc	HKD	618,400	(532,824)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Morgan Stanley & Co. International plc	HKD	342,500	(304,790)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	700,000	(304,728)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Morgan Stanley & Co. International plc	HKD	260,000	(244,550)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Morgan Stanley & Co. International plc	HKD	260,000	(231,695)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	250,000	(216,322)
12/30/2013	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	100,000	(87,037)
12/12/2014	固定金利支払、日経225受取	Societe Generale	JPY	10,000,000	(97,021)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	2,080,000	(789,489)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	Societe Generale	HKD	1,020,000	(404,607)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	BNP Paribas	HKD	1,100,000	(338,056)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	BNP Paribas	HKD	708,434	(262,001)
12/30/2014	固定金利支払、ハンセン中国企業株指数受取	BNP Paribas	HKD	564,855	(222,159)
12/08/2017	米ドル修正前CPI連動金利支払 2.755%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	7,428,364	(3,409)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Barclays	EUR	(143,614,000)	(2,789,332)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	(128,772,800)	(2,501,080)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	(50,000,000)	(971,121)
12/20/2017	iTrax x欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Deutsche Bank	EUR	(50,000,000)	(971,121)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Deutsche Bank	EUR	(45,000,000)	(874,009)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	BNP Paribas	EUR	(31,834,800)	(618,309)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Credit Suisse International	EUR	(31,778,400)	(617,214)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	BNP Paribas	EUR	(30,000,000)	(582,673)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	Credit Suisse International	EUR	(25,000,000)	(485,561)
12/20/2017	iTraxx 欧州シニア・フィナンシャル・シリーズ 18 5 Y 変動金利支払、1.000%固定金利受取	JP Morgan	EUR	(24,000,000)	(466,138)
09/19-2022	2.165%固定金利支払、 ユーロ修正前CPI(除くタバコ)連動金利受取	Royal Bank of Scotland plc	EUR	2,556,948	(42,727)
09/24/2022	2.115%固定金利支払、 ユーロ修正前CPI(除くタバコ)連動金利P	Royal Bank of Scotland plc	EUR	2,543,052	(29,250)
09/24/2022	米ドル修正前CPI連動金利支払、 2.763%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	USD	3,047,619	(4,171)
05/24/2042	英ポンド-LIBOR-BBA変動金利支払、 3.460%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	GBP	68,170,000	(1,565,192)

05/24/2042	英債券-LIBOR-BBA変動金利支払、 3.394%固定金利受取	Barclays	GBP	39,695,000	(1,062,274)
05/24/2042	英債券-LIBOR-BBA変動金利支払、 3.330%固定金利受取	Barclays	GBP	8,720,000	(265,632)
05/25/2042	英債券-LIBOR-BBA変動金利支払、 3.385%固定金利受取	HSBC Bank plc	GBP	48,415,000	(1,320,206)
07/05/2042	英債券-LIBOR-BBA変動金利支払、 3.573%固定金利受取	UBS AG	GBP	13,000,000	(206,580)
09/27/2042	英債券-LIBOR-BBA変動金利支払 、3.700%固定金利受取	Morgan Stanley & Co. International plc	GBP	43,000,000	(318,103)
09/28/2042	2.498%固定金利支払、ユーロ-EURIBOR受取	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR	56,000,000	(170,787)
					(44,813,119)
				純額(ユーロ)	(1,542,510)

8. 先物契約

2012年12月31日現在、当社は以下の先物契約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^						
種類	満期日	通貨	購入(売却) 契約数	想定元本 (先物契約の通貨)	未実現評価(損)益 (ユーロ相当額)	
ハンセン指数先物	1/30/2013	HKD	235	26,014,333	177,122	
スイス市場IX 先物	03/15/2013	CHF	(328)	(18,337,645)	278,460	
ラッセル2000ミニ先物	03/15/2013	USD	(7,160)	(446,865,983)	812,076	
FTSE 100指数先物	03/15/2013	GBP	(1,922)	(137,609,273)	896,997	
ユーロ債先物	03/07/2013	EUR	1,029	149,863,560	1,420,700	
米国超長期債(CBT)先物	03/19/2013	USD	(1,767)	(219,137,920)	2,232,917	
					5,818,272	
ナスダック100指数ミニ先物	03/15/2013	USD	7,126	278,915,477	(8,091,938)	
S&P指数ミニ先物	03/15/2013	USD	2,961	155,064,642	(3,112,129)	
ユーロストックス銀行先物	03/15/2013	EUR	(13,701)	(76,246,065)	(2,116,805)	
米国10年債(CBT)先物	03/19/2013	USD	5,849	588,502,688	(1,927,797)	
Euro OAT先物	03/07/2013	EUR	(1,048)	(142,695,680)	(1,002,660)	
FTSE MID 250 指数先物	03/15/2013	GBP	(147)	(22,294,269)	(344,070)	
ユーロストックス50先物	03/15/2013	EUR	(1,661)	(43,435,150)	(271,468)	
MSCI 台湾指数先物	01/30/2013	USD	(4,630)	(96,356,710)	(190,261)	
OMXS30指数先物	01/18/2013	SEK	(1,097)	(14,153,379)	(83,564)	
					(17,140,692)	
				純額(ユーロ)	(11,322,420)	

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

9. オプション契約

2012年12月31日現在、当社は以下のオプション契約を保有していました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^								
期限	通貨	契約	カウンターパーティー	プット/ コール	行使 価格	想定元本	未実現評価(損)益 (ユーロ相当額)	時価 (ユーロ)
01/16/2013	USD	01/2013限月VIXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	21.00	15,400	707,536	3,379,770
01/19/2013	USD	01/2013限月AAPL USプット	Royal Bank of Scotland plc	プット	560.00	113	(155,972)	455,115
01/19/2013	USD	01/2013限月AAPL USプット	Royal Bank of Scotland plc	プット	555.00	350	(594,346)	1,298,403
02/13/2013	USD	02/2013限月VIXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	22.00	13,100	(181,662)	2,280,171
02/19/2013	USD	米ドル/日本円コール	HSBC Bank plc	コール	95.00	2,200,000	(10,460)	495
02/26/2013	USD	米ドル/日本円コール	HSBC Bank plc	コール	94.00	1,000,000	(5,197)	496
05/31/2013	USD	日本円/米ドルコール	Barclays Bank plc	コール	97.00	78,944,000	(1,199,942)	145,071
05/31/2013	USD	米ドル/日本円プット	Barclays Bank plc	プット	79.00	78,944,000	(2,111,700)	155,144
08/28/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.45	18,477,559	(118,227)	33,459
08/28/2013	USD	人民元/米ドルコール	UBS AG	コール	6.45	21,117,210	(131,022)	38,239
08/28/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.45	26,396,513	(157,897)	47,798

08/28/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.45	18,477,559	165,856	306,497
08/28/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.45	21,117,210	179,515	350,282
08/28/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.45	26,396,513	231,947	437,853
09/20/2013	GBP	09/2013限月UKXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	5,800.00	1,700	(722,406)	6,103,967
09/21/2013	USD	09/2013限月SPXコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	1,425.00	3,160	(1,853,728)	17,505,175
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	8,864,337	17,812	53,994
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	11,819,116	14,208	71,992
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	8,864,337	(38,360)	72,855
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	11,819,116	(57,405)	97,140
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	17,728,674	21,651	107,988
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	23,638,232	24,367	143,984
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	17,728,674	(86,787)	145,710
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	29,547,790	35,519	179,980
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	29,547,791	29,765	179,980
12/11/2013	USD	米ドル/人民元コール	UBS AG	コール	6.38	29,547,791	37,785	179,980
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	23,638,232	(93,618)	194,280
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	29,547,790	(137,847)	242,850
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	29,547,791	(154,147)	242,850

△本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

期限	通貨	契約	カウンターパーティー	ブット/コール	行使価格	想定元本	未実現評価(損)益 (ユーロ相当額)	時価 (ユーロ)
12/11/2013	USD	米ドル/人民元ブット	UBS AG	ブット	6.38	29,547,791	(132,181)	242,850
12/12/2013	KRW	韓国証券取引所コール	UBS AG	コール	249.32	3,146,132	1,336,037	6,633,757
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	995.83	15,000	(2,092,409)	383,572
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	982.72	18,500	(2,545,836)	470,958
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	140.43	18,000	(2,362,240)	483,544
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	199.60	18,000	(2,363,559)	493,371
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	3.08	30,500	(4,328,539)	781,864
12/30/2013	HKD	ハンセン指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	304.39	30,000	(3,926,445)	852,046
05/12/2014	EUR	EURIBOR支払、2.600%受取	Barclays Bank plc	ブット	2.60	82,000,000	4,950,443	5,631,043
05/16/2014	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	88.00	55,000,000	(503,183)	1,560,244
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	UBS AG	コール	267.94	1,598,549	(366,041)	2,713,382
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	BNP Paribas	コール	266.78	1,632,315	(323,372)	2,835,250
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	Deutsche Bank	コール	267.10	1,716,981	(327,541)	2,963,271
06/12/2014	KRW	韓国証券取引所コール	BNP Paribas	コール	252.24	1,707,599	511,304	3,907,685
07/21/2014	EUR	EURIBOR支払、1.500%受取	Royal Bank of Scotland plc	コール	1.50	34,579,000	221,460	753,312
07/23/2014	EUR	EURIBOR支払、1.500%受取	HSBC Bank plc	コール	1.50	315,421,000	1,293,216	6,863,216
10/24/2014	USD	米ドル/日本円ブット	Barclays Bank plc	ブット	67.00	21,000,000	(372,119)	75,590
10/24/2014	USD	米ドル/日本円コール	Barclays Bank plc	コール	81.00	21,000,000	515,543	1,335,566
12/08/2014	EUR	EURIBOR支払、1.500%受取	JP Morgan Chase Bank	コール	1.50	206,000,000	441,016	4,126,016
01/19/2015	EUR	EURIBOR支払、2.600%固定金利受取	Royal Bank of Scotland plc	ブット	2.60	88,370,000	2,856,502	5,256,674
01/13/2016	USD	米ドル/日本円コール	Royal Bank of Scotland plc	コール	82.00	2,000,000	51,808	134,763
01/13/2016	USD	米ドル/日本円コール	Royal Bank of Scotland plc	コール	82.00	18,784,000	(8,550)	1,265,696 84,215,188
01/19/2013	USD	01/2013満期AAPL USコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	555.00	(350)	1,782,827	(109,922)
01/19/2013	USD	01/2013満期AAPL USコール	Royal Bank of Scotland plc	コール	560.00	(113)	580,729	(30,358)
02/19/2013	USD	米ドル/日本円ブット	HSBC Bank plc	ブット	77.00	(2,200,000)	104,088	(34)
02/26/2013	USD	米ドル/日本円ブット	HSBC Bank plc	ブット	77.00	(1,000,000)	47,652	(37)

04/05/2013	USD	2.800%固定金利支払、米ドルLIBOR受取	HSBC Bank plc	コール	2.80	(50,523,000)	169,573	(1,460,040)
04/10/2013	USD	2.800%固定金利支払、米ドルLIBOR受取	Barclays Bank plc	コール	2.80	(41,795,000)	518,135	(1,231,094)
04/10/2013	USD	2.800%支払、米ドルLIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	コール	2.80	(33,682,000)	525,949	(992,121)
05/14/2013	USD	2.800%支払、米ドルLIBOR受取	HSBC Bank plc	コール	2.80	(14,700,000)	467,784	(478,644)
05/31/2013	USD	米ドル/日本円コール	Barclays Bank plc	コール	79.00	(78,944,000)	3,911,391	(155,144)
05/31/2013	USD	米ドル/日本円コール	Barclays Bank plc	コール	97.00	(78,944,000)	364,318	(145,071)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	81.00	(26,396,513)	(851,283)	(1,349,116)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	81.00	(21,117,210)	(698,749)	(1,079,292)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	81.00	(18,477,559)	(597,565)	(944,381)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	76.00	(26,396,513)	473,090	(56,922)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	76.00	(21,117,210)	383,893	(45,537)
08/28/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	76.00	(18,477,559)	330,534	(39,845)
09/26/2013	USD	2.40%支払、米ドルLIBOR受取	Morgan Stanley & Co. International	ブット	2.40	(25,000,000)	444,389	(409,263)
12/10/2013	USD	2.40%支払、米ドルLIBOR受取	JP Morgan Chase Bank	コール	2.40	(48,000,000)	501,059	(947,923)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(29,547,791)	(289,916)	(1,024,614)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(29,547,791)	(408,249)	(1,024,614)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(29,547,790)	(398,051)	(1,024,614)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(23,638,232)	(358,053)	(819,691)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(17,728,674)	(232,033)	(614,769)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	コール	84.50	(11,819,116)	(154,688)	(409,846)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(29,547,791)	261,218	(260,540)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(29,547,791)	180,505	(260,540)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(29,547,790)	257,819	(260,540)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(23,638,232)	242,290	(208,432)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(17,728,674)	150,612	(156,324)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(11,819,116)	100,408	(104,216)
12/11/2013	USD	米ドル/日本円ブット	UBS AG	ブット	79.50	(8,864,337)	26,216	(78,162)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	150.92	(55,000)	2,682,282	(1,612,227)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	161.39	(36,000)	1,806,690	(1,106,462)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	144.08	(34,000)	1,827,529	(966,174)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	158.51	(30,000)	1,556,506	(910,148)
12/20/2013	USD	SPX指数OTCブットオプション	UBS AG	ブット	137.31	(33,000)	1,786,099	(909,290)
05/12/2014	EUR	2.700%固定金利支払、EURIBOR受取	Barclays Bank plc	ブット	2.70	(42,000,000)	(2,797,545)	(3,338,505)
05/16/2014	USD	米ドル/日本円コール	UBS AG	ブット	71.00	(55,000,000)	1,877,869	(207,778)
07/21/2014	EUR	1.70%固定金利支払、EURIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	ブット	1.70	(18,193,000)	25,042	(364,746)
07/23/2014	EUR	1.700%固定金利支払、EURIBOR受取	HSBC Bank plc	ブット	1.70	(161,807,000)	1,055,075	(3,244,925)
10/24/2014	USD	日本円/米ドルコール	Barclays Bank plc	コール	81.00	(21,000,000)	(126,979)	(1,335,566)
10/24/2014	USD	米ドル/日本円ブット	Barclays Bank plc	ブット	67.00	(21,000,000)	792,927	(75,590)
12/08/2014	EUR	1.700%固定金利支払、EURIBOR受取	JP Morgan Chase Bank	コール	1.70	(110,000,000)	(232,444)	(2,232,444)
01/19/2015	EUR	2.800%固定金利支払、EURIBOR受取	Royal Bank of Scotland plc	コール	2.80	(47,000,000)	(1,517,361)	(3,693,725)
01/13/2016	USD	米ドル/日本円コール	Royal Bank of Scotland plc	ブット	68.00	(18,784,000)	1,066,469	(237,436)
01/13/2016	USD	米ドル/日本円ブット	Royal Bank of Scotland plc	ブット	68.00	(2,000,000)	94,167	(25,281)
								(36,289,327)
純額(ユーロ)								47,925,861

10. 交渉型証券売買手数料

投資顧問会社は、当会社に関して交渉型証券売買手数料を導入しません。投資顧問会社及びその関連当事者はいずれも、サブファンドのために取引を指示する謝礼として証券ブローカー又はディーラーから現金リポートを得る権利を有していません。受領した現金リポートは、当該サブファンドの勘定に計上されます。

11. 関連当事者取引

投資顧問会社及び販売会社以外に関連当事者は存在しません。

2012年12月31日現在、Global Absolute Return Strategies Fundは、関連ファンドのスタンダード・ライフ・インベストメント欧州株式インカム・ファンドに評価額で1億5,500万ユーロを保有していました。この金額はこのサブファンドの純資産の4.71%に相当します。すべての関連取引は通常の市場状況のもとで行われました。

12. 価格変動修正

評価日における各サブファンド内の各々のクラス及びカテゴリーの1投資証券当たりの純資産価値は、当該クラス及びカテゴリーに適切に配分可能なサブファンドの総資産評価額から当該クラス及びカテゴリーに適切に配分可能な当該サブファンドの負債を減じた金額を、当該評価日において発行済みの当該クラス及びカテゴリーの投資証券総数で除することにより決定されます。

しかしながら、評価日にサブファンドの全てのクラス及びカテゴリーの投資証券の累計取引が、そのサブファンドに関する販売会社により随時定められた基準を超える投資証券数の純増加又は減少をもたらした場合（サブファンドの募集、償還、転換及び関連費用に基づき）、当該サブファンドの1投資証券当たりの純資産価値は、サブファンドに発生する可能性のある推定の財務及びディーリング費用を反映する金額に修正されます。この修正は、純変動がサブファンドの全投資証券の増加をもたらす場合は増額となり、減少をもたらす場合は減額となります。同様に、かかる修正が行われた場合、当該サブファンドが保有する有価証券の評価は、予想される呼び値スプレッドを反映して修正される可能性があります。この修正は純資産計算書の「その他の資産」又は「その他の負債」に計上されます。

13. 担保

以下の表は、2012年12月31日現在保有するデリバティブ契約に関してブローカーに供されている現金担保を示しています：

Global Absolute Return Strategies Fund ^	BNP Paribas	EUR	(16,367,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Deutsche Bank AG	EUR	(2,392,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	HSBC Bank plc	EUR	(5,354,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	HSBC Bank plc	GBP	(240,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Royal Bank of Canada	GBP	(320,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Royal Bank of Scotland plc	EUR	(3,875,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	Societe Generale	EUR	(3,201,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	UBS AG	EUR	(11,194,000)
Global Absolute Return Strategies Fund ^	State Street	GBP	(30,000)

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

14. 重要なイベント

以下の投資証券クラス（ヘッジあり）を当年度中にローンチしました：

Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスA 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスD 累積型投資証券（豪ドル、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスD 累積型投資証券（スイスフラン、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスD 累積型投資証券（シンガポールドル、ヘッジあり）
 Global Absolute Return Strategies Fund ^ クラスZ 累積型投資証券（日本円、ヘッジあり）

当年度中に当会社に影響を与えるその他の重要なイベントはありませんでした。

^本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

15. その後のイベント

当年度末以降に当会社に影響を与えるその他の重要なイベントはありませんでした。

Standard Life Investments Global SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable

Global Absolute Return Strategies Fund

サブファンドの目的

本サブファンドは、あらゆる市場条件において中・長期にわたって資本増加の形でプラスの絶対収益をもたらすことを目的としています。

運用方針

認められたデリバティブ契約（先物、オプション、スワップ、先物為替予約及びその他のデリバティブなど）、確定利付証券、株式、及び現金によるポートフォリオでの運用によりこの目標を達成する予定です。さらに本サブファンドは、適格な譲渡可能証券、預金、短期金融商品、及び集合投資事業などの形態で投資する場合があります。

パフォーマンス・レビュー

Global Absolute Return Strategies Fundは、6か月EURIBORの0.85%に対して、レビューを行った12か月間において7.48%^{*}の収益をもたらしました。

2012年の初めに金融市場が上昇したため、本サブファンドは株式及びクレジットの収益により恩恵を受けるポジションを構築しました。グローバル株式ポジションが収益に寄与し、投資適格債及びハイイールド債ポジションも収益に寄与しました。レバティブ・バリュエーション戦略の中では、米国のテクノロジー株が小型株をアウトパフォームするという見通しが功を奏しました。その後市場は、ユーロ圏をめぐる懸念が強まったため、2012年第2四半期に下落しました。その結果、クレジット市場は引き続き小幅な上昇を示しましたが、本サブファンドの主要な株式ポジションは収益にマイナス寄与となりました。これは、株式ボラティリティ戦略にとっても厳しい環境となり、ロング・ボラティリティ及びレバティブ・バリュエーションの両戦略が収益にマイナス寄与となりました。

中央銀行の刺激策を受け、同年下半年に入り市場は再び上昇しました。本サブファンドの主要な株式ポジションは収益にプラス寄与となった一方、ハイイールド債及び社債の保有も収益をもたらしました。最近導入したフランスに対するドイツのデレギュレーション戦略など、金利及びデレギュレーション戦略は概してプラスの収益をもたらしました。同年の第4四半期に入り、株式市場が更に上昇した結果、欧州及びロシアの株式により大きな収益を生み出しました。米国市場の中では、小型株が大型株をアウトパフォームし、本ファンドにとってはマイナスとなりました。しかし、グローバル上場不動産株の新たなポジションが収益を上げました。

* パフォーマンスは、機関投資家向け投資証券クラス及び報酬控除後を基準に、株価パフォーマンスに基づき本報告期間について計算されています。

見通し

グローバル市場の回復は不安定であり、長期化すると引き続き考えられ、金融機関の追加規制により金融機関のクレジット・リスクは低下し、その高い相対スプレッドを活用することが可能となります。したがって、ロング及びレティフ・バリューの戦略によるクレジット・ポジションは引き続き、本サブファンドのポートフォリオの一部を形成します。欧州の銀行株についてリストラ圧力を活用するポジションも構築します。新興市場の成長可能性も継続的な投資テーマであり、本ファンドはそれに関して多くの戦略を有しています。

投資有価証券明細表 地理的分類

2012年12月31日現在（純資産総額に対する割合で表示）

オーストラリア	1.28%
オーストリア	0.11%
バルバドス	0.00%
ベルギー	0.19%
バミューダ	0.20%
ブラジル	0.02%
カナダ	0.58%
ケイマン諸島	0.36%
クロアチア	0.00%
キプロス	0.00%
チェコ共和国	0.04%
デンマーク	0.41%
欧州連合	26.81%
フィンランド	0.12%
フランス	3.25%
ドイツ	2.06%
ガンジー島	0.01%
香港	0.60%
インド	0.02%
インドネシア	0.01%
アイルランド	0.54%
イタリア	0.57%
日本	0.61%
ジャージー島	0.67%
ルクセンブルグ	0.72%
マレーシア	0.02%
マーシャル諸島	0.01%
メキシコ	3.30%
オランダ	2.08%
ニュージーランド	0.07%
ノルウェー	0.21%
ポルトガル	0.08%
ロシア	2.82%
シンガポール	0.14%
超国家	0.35%
南アフリカ	0.02%
韓国	0.02%
スペイン	0.55%
スウェーデン	0.93%
スイス	0.42%
トルコ	0.01%
アラブ首長国連邦	0.02%
英国	15.81%
米国	14.99%

保有上位10銘柄

2012年12月31日現在

（純資産総額に対する割合で表示）

スタンダード・ライフ・インベストメント欧州株式インカム・ファンド	4.71%
ICAP 0.300% 01/17/2013満期	1.86%
Barclays 0.000% 01/09/2013満期	1.83%
KBC Bank NV 0.160% 02/28/2013満期	1.52%
Societe Generale 0.090% 01/31/2013満期	1.52%
Sumi 0.090% 02/06/2013満期	1.52%
Deutsche Bank 0.0175% 06/06/2013満期	1.52%
ING Bank 0.320% 05/02/2013満期	1.37%

Societe Generale 0.740% 01/01/2013満期	1.22%
Svenska 0.200% 02/15/2013満期	1.22%

本サブファンドのグローバル・エクスポージャーのリスク測定及び計算について、絶対バリュー・アット・リスク（以下、「VaR」）が用いられています。

絶対VaRは、サブファンドのNAVの20%未満に制限されています。以下の数値は、本サブファンドのこの20%のVaRリミットに対する2012年12月31日における99%信頼水準のVaRを示しています。使用したモデルは、3.5年（180週）の期間についての週単位の価格リターンに基づくリスク・プロファイルを計算する中期ボラティリティ・モデルのAPTモデルです。この計算において各々の週間リターンは均等な重要性を有しています。このモデルにより算出されたボラティリティの数値は、3か月から2年までの中期的な予測のためのものです。使用された保有期間は1か月（20日）であり、計算のための観測期間は2012年1月1日から2012年12月31日までの間です。

最大：15.40%
最低：23.50%
平均：18.85%

レバレッジは、デリバティブの用いられた国の合計として計算されています。該当期間に用いられたレバレッジの水準は320%でした。

本サブファンドは香港で認可されておらず、香港居住者は利用できません。

投資有価証券明細表（ユーロ表示）
2012年12月31日現在

数量/想定元本	通貨	有価証券の銘柄	時価 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
取引所上場を認められた譲渡可能証券及び短期金融商品				
オーストラリア				
150,000	GBP	APT Pipelines Ltd 4.250% 26 November 2024	184,096	0.01%
1,207,000	AUD	Australia Government Bond 4.000% 20 August 2015	1,717,392	0.05%
1,811,000	AUD	Australia Government Bond 3.000% 20 September 2025	1,946,692	0.06%
3,445,000	AUD	Australia Government Bond 2.500% 20 September 2030	3,506,134	0.11%
550,000	EUR	BHP Billiton Finance Ltd 2.125% 29 November 2018	573,518	0.02%
216,030	AUD	Brambles Ltd	1,273,966	0.04%
1,258,418	AUD	Centro Retail Australia	2,243,132	0.07%
1,582,000	GBP	Commonwealth Bank of Australia 3.875% 14 December 2015	2,079,112	0.06%
4,171,093	AUD	Dexus Property Group	3,324,451	0.10%
1,683,435	AUD	GPT Group	4,864,612	0.15%
3,049,312	AUD	Mirvac Group	3,555,759	0.11%
162,000	EUR	National Australia Bank Ltd 3.500% 23 January 2015	171,434	0.01%
300,000	GBP	National Australia Bank Ltd 3.625% 08 November 2017	396,734	0.01%
187,147	AUD	Oil Search Ltd	1,030,160	0.03%
400,000	EUR	Origin Energy Finance Ltd FRN 16 June 2071	422,196	0.01%
783,000	GBP	QBE Insurance Group Ltd 6.125% 28 September 2015	1,058,490	0.03%
1,106,000	EUR	Santos Finance Ltd FRN 22 September 2070	1,170,978	0.04%
108,167	AUD	Santos Ltd	942,805	0.03%
92,000	EUR	Wesfarmers Ltd 3.875% 10 July 2015	98,969	0.00%
300,000	EUR	Wesfarmers Ltd 2.750% 02 August 2022	307,778	0.01%
935,612	AUD	Westfield Group	7,758,248	0.24%
308,000	EUR	Westpac Banking Corp 4.250% 22 September 2016	345,640	0.01%
		オーストラリア合計	38,972,296	1.20%
オーストリア				
59,883	EUR	Oesterreichische Post AG	1,868,350	0.06%
300,000	EUR	Wienerberger AG FRN 09 February 2017	258,750	0.01%
		オーストリア合計	2,127,100	0.07%
バルバドス				
51,000	USD	Barbados Government International Bond 7.250% 15 December 2021	40,139	0.00%
		バルバドス合計	40,139	0.00%
ベルギー				
18,007	EUR	Anheuser-Busch InBev NV	1,183,780	0.04%
44,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 6.570% 27 February 2014	47,025	0.00%
90,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 8.625% 30 January 2017	117,556	0.00%
470,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 1.250% 24 March 2017	476,221	0.01%
365,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 4.000% 26 April 2018	416,522	0.01%

91,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 4.000% 02 June 2021	105,237	0.00%
440,000	EUR	Anheuser-Busch InBev NV 2.875% 25 September 2024	458,800	0.01%
8,142	EUR	Anheuser-Busch InBev NV strip VVPR	8	0.00%
208,000	EUR	Barry Callebaut Services NV 6.000% 13 July 2017	233,496	0.01%
80,000	EUR	Fortis Bank SA/NV 4.500% 30 May 2014	84,163	0.00%
15,279	EUR	KBC Groep NV	399,546	0.01%
27,863	EUR	UCB SA	1,204,239	0.04%
46,865	EUR	Umicore SA	1,953,802	0.06%
		ベルギー合計	6,680,395	0.19%
		バミューダ		
450,000	EUR	Central European Media Enterprises Ltd 11.625% 15 September 2016	474,750	0.01%
349,000	USD	Hongkong Land Holdings Ltd	1,846,166	0.06%
12,265	USD	Invesco Ltd	239,287	0.01%
406,500	HKD	Kerry Properties Ltd	1,597,619	0.05%
40,967	GBP	Lancashire Holdings Ltd	389,324	0.01%
47,861	USD	Lazard Ltd	1,078,636	0.03%
		バミューダ合計	5,625,782	0.17%
		ブラジル		
100,000	EUR	Vale SA 4.375% 24 March 2018	110,788	0.00%
500,000	EUR	Vale SA 3.750% 10 January 2023	525,781	0.02%
		ブラジル合計	636,569	0.02%
		カナダ		
1,856,000	USD	Air Canada 9.250% 01 August 2015	1,474,808	0.05%
300,000	EUR	Bombardier Inc 6.125% 15 May 2021	321,348	0.01%
18,802	CAD	Cenovus Energy Inc	471,150	0.01%
1,205,000	USD	Novelis Inc/GA 8.750% 15 December 2020	1,021,347	0.03%
34,538	CAD	Suncor Energy Inc	845,783	0.03%
500,000	USD	Teck Resources Ltd 3.750% 01 February 2023	390,062	0.01%
		カナダ合計	4,524,498	0.14%
		ケイマン諸島		
18,155	USD	51 Job Inc	637,916	0.02%
8,679	USD	Baidu Inc	650,239	0.02%
277,000	HKD	China Mengniu Dairy Co Ltd	595,044	0.02%
532,200	HKD	China Metal Recycling Holdings Ltd	416,769	0.01%
1,200,000	HKD	China Resources Land Ltd	2,472,353	0.07%
800,000	EUR	Hutchison Whampoa Finance 09 Ltd 4.750% 14 November 2016	908,907	0.03%
200,000	EUR	IPIC GMTN Ltd 4.875% 14 May 2016	222,666	0.01%
200,000	USD	IPIC GMTN Ltd 3.750% 01 March 2017	162,140	0.01%
321,981	GBP	Punch Taverns Finance B Ltd 7.369% 30 June 2022	367,938	0.01%
508,000	GBP	Punch Taverns Finance B Ltd 5.943% 30 December 2024	552,525	0.02%
400,000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd 3.706% 31 March 2034	860,045	0.03%
68,000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd FRN 31 March 2038	87,470	0.00%
301,460	GBP	Sutton Bridge Financing Ltd 8.625% 30 June 2022	427,878	0.01%
290,000	EUR	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd 3.250% 09 November 2016	314,275	0.01%
450,000	GBP	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd FRN 21 July 2025	605,546	0.02%
644,000	GBP	Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd FRN 13 September 2030	897,646	0.03%
356,000	EUR	UPCB Finance Ltd 7.625% 15 January 2020	393,380	0.01%
200,000	EUR	Viridian Group FundCo II 11.125% 01 April 2017	209,994	0.01%
		ケイマン諸島合計	10,782,731	0.34%
		クロアチア		
100,000	EUR	Agrokor DD 9.125% 01 February 2020	109,000	0.00%
		クロアチア合計	109,000	0.00%

キプロス				
23,157	NOK	ProSafe SE	149,099	0.00%
		キプロス合計	149,099	0.00%
チェコ共和国				
270,000	EUR	CET 21 spol sro 9.000% 01 November 2017	294,300	0.01%
200,000	EUR	CEZ AS 6.000% 18 July 2014	216,250	0.01%
250,000	EUR	CEZ AS 5.750% 26 May 2015	279,265	0.01%
214,000	EUR	CEZ AS 3.625% 27 May 2016	233,746	0.01%
66,000	EUR	CEZ AS 4.500% 29 June 2020	77,441	0.00%
54,000	EUR	CEZ AS 5.000% 19 October 2021	66,092	0.00%
67,000	EUR	CEZ AS 4.875% 16 April 2025	81,496	0.00%
		チェコ共和国合計	1,248,590	0.04%
デンマーク				
99	DKK	AP Moeller - Maersk A/S	565,305	0.02%
734,000	EUR	AP Moeller - Maersk A/S 4.875% 30 October 2014	780,602	0.02%
430,000	EUR	AP Moeller - Maersk A/S 3.375% 28 August 2019	451,764	0.01%
422,000	EUR	Carlsberg Breweries A/S 6.000% 28 May 2014	453,437	0.01%
553,000	GBP	Carlsberg Breweries A/S 7.250% 28 November 2016	812,347	0.02%
87,690	DKK	Danske Bank A/S	1,124,276	0.03%
412,000	EUR	Danske Bank A/S 4.750% 04 June 2014	434,422	0.01%
405,000	GBP	Danske Bank A/S 4.000% 09 December 2015	526,506	0.02%
250,000	EUR	Danske Bank A/S 3.875% 18 May 2016	271,942	0.01%
396,000	GBP	Danske Bank A/S FRN 15 February 2017	452,308	0.01%
190,000	EUR	Danske Bank A/S 3.875% 28 February 2017	208,779	0.01%
188,000	EUR	Danske Bank A/S FRN 16 March 2018	190,268	0.01%
121,000	EUR	DONG Energy A/S 4.000% 16 December 2016	134,909	0.00%
400,000	EUR	DONG Energy A/S 6.500% 07 May 2019	508,292	0.02%
58,000	EUR	DONG Energy A/S 4.875% 16 December 2021	69,477	0.00%
1,550,000	GBP	DONG Energy A/S 4.875% 12 January 2032	2,045,745	0.06%
435,000	EUR	DONG Energy A/S FRN 01 June 3010	486,741	0.02%
574,000	EUR	ISS A/S 8.875% 15 May 2016	598,303	0.02%
17,474	DKK	Novo Nordisk A/S	2,146,656	0.07%
400,000	EUR	TDC A/S 3.500% 23 February 2015	422,447	0.01%
15,158	DKK	Tryg A/S	866,560	0.03%
		デンマーク合計	13,551,086	0.41%
フィンランド				
400,000	EUR	Fortum OYJ 4.000% 24 May 2021	457,085	0.01%
580,000	EUR	Fortum OYJ 2.250% 06 September 2022	575,809	0.02%
235,000	EUR	Nokia OYJ 5.500% 04 February 2014	243,011	0.01%
340,000	EUR	Pohjola Bank Plc 5.750% 28 February 2022	400,512	0.01%
32,849	EUR	Sampo	799,545	0.02%
48,321	EUR	Wartsila OYJ Abp	1,581,063	0.05%
		フィンランド合計	4,057,025	0.12%
フランス				
350,000	EUR	Air Liquide Finance SA 3.889% 09 June 2020	405,303	0.01%
400,000	EUR	Alstom SA 4.000% 23 September 2014	420,749	0.01%
100,000	EUR	Alstom SA 3.875% 02 March 2016	107,590	0.00%
100,000	EUR	Areva SA 3.875% 23 September 2016	106,004	0.00%
600,000	EUR	Areva SA 4.625% 05 October 2017	656,059	0.02%
200,000	EUR	Areva SA 4.875% 23 September 2024	218,677	0.01%
150,000	EUR	Autoroutes du Sud de la France SA 4.125% 13 April 2020	169,600	0.01%
51,000	EUR	AXA SA FRN 06 July 2016	50,416	0.00%
669,000	GBP	AXA SA FRN 16 October 2019	791,968	0.02%
639,000	GBP	AXA SA 7.125% 15 December 2020	905,850	0.03%
600,000	EUR	AXA SA FRN 16 April 2040	628,274	0.02%
100,000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.000% 22 October 2020	105,007	0.00%
200,000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.250% 23 August 2022	215,211	0.01%

50,000	EUR	Banque PSA Finance SA 3.500% 17 January 2014	50,622	0.00%
350,000	EUR	Banque PSA Finance SA 6.000% 16 July 2014	368,952	0.01%
61,597	EUR	BNP Paribas SA	2,623,108	0.08%
600,000	EUR	BNP Paribas SA 3.500% 07 March 2016	645,618	0.02%
400,000	EUR	BNP Paribas SA 3.000% 24 February 2017	428,326	0.01%
450,000	EUR	BNP Paribas SA 5.431% 07 September 2017	514,703	0.02%
1,000,000	EUR	BNP Paribas SA 2.500% 23 August 2019	1,041,336	0.03%
280,000	EUR	BNP Paribas SA 2.875% 24 October 2022	292,947	0.01%
21,042	EUR	Bouygues SA	471,341	0.01%
200,000	EUR	Bouygues SA 4.000% 12 February 2018	224,171	0.01%
155,000	EUR	BPCE SA 9.250% 22 April 2015	164,494	0.01%
300,000	EUR	BPCE SA 4.250% 06 February 2023	345,889	0.01%
100,000	EUR	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA 3.750% 22 January 2015	101,951	0.00%
150,000	EUR	Carrefour Banque SA 2.875% 25 September 2015	156,241	0.01%
100,000	EUR	Carrefour SA 5.125% 10 October 2014	107,424	0.00%
100,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 5.500% 30 January 2015	108,893	0.00%
250,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 4.379% 08 February 2017	276,048	0.01%
450,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 4.481% 12 November 2018	509,639	0.02%
400,000	EUR	Casino Guichard Perrachon SA 4.726% 26 May 2021	458,050	0.01%
250,000	EUR	Christian Dior SA 3.750% 23 September 2014	259,993	0.01%
400,000	EUR	Christian Dior SA 4.000% 12 May 2016	426,592	0.01%
66,000	EUR	Cie de St-Gobain 7.250% 16 September 2013	68,982	0.00%
420,000	EUR	Cie de St-Gobain 3.500% 30 September 2015	445,540	0.01%
750,000	GBP	Cie de St-Gobain 5.625% 15 December 2016	1,022,903	0.03%
100,000	EUR	Cie de St-Gobain 4.750% 11 April 2017	112,778	0.00%
100,000	EUR	Cie de St-Gobain 4.500% 30 September 2019	111,851	0.00%
340,000	EUR	Cie de St-Gobain 3.625% 28 March 2022	351,878	0.01%
400,000	GBP	Cie de St-Gobain 5.625% 15 November 2024	558,458	0.02%
650,000	EUR	Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA 5.000% 24 May 2021	778,036	0.02%
19,959	EUR	Cie Generale de Geophysique- Veritas	450,874	0.01%
402,000	USD	Cie Generale de Geophysique- Veritas 9.500% 15 May 2016	327,802	0.01%
100,000	EUR	CMA CGM SA 8.875% 15 April 2019	80,530	0.00%
100,000	EUR	CNP Assurances FRN 30 September 2041	103,553	0.00%
200,000	GBP	CNP Assurances FRN 30 September 2041	256,492	0.01%
1,050,000	EUR	Credit Agricole SA 5.971% 01 February 2018	1,193,137	0.04%
700,000	GBP	Credit Agricole SA FRN 30 January 2020	806,398	0.02%
550,000	EUR	Credit Agricole SA 3.900% 19 April 2021	557,357	0.02%
800,000	EUR	Credit Agricole SA/London 3.000% 20 July 2015	840,788	0.03%
200,000	EUR	Credit Agricole SA/London 1.875% 18 October 2017	202,926	0.01%
300,000	EUR	Credit Logement SA 5.454% 16 February 2021	335,214	0.01%
40,000	EUR	Dexia Credit Local SA 5.375% 21 July 2014	40,997	0.00%
23,016	EUR	Edenred	536,273	0.02%
100,000	EUR	Electricite de France SA 6.250% 25 January 2021	130,264	0.00%
400,000	EUR	Electricite de France SA 3.875% 18 January 2022	450,332	0.01%
150,000	EUR	Electricite de France SA 4.625% 11 September 2024	176,903	0.01%
1,500,000	GBP	Electricite de France SA 5.875% 18 July 2031	2,143,532	0.07%
55,000	EUR	Electricite de France SA 5.625% 21 February 2033	71,429	0.00%
400,000	EUR	Europcar Groupe SA 11.500% 15 May 2017	425,000	0.01%
225,000	EUR	Europcar Groupe SA 9.375% 15 April 2018	203,063	0.01%
300,000	EUR	Eutelsat SA 4.125% 27 March 2017	333,864	0.01%
200,000	EUR	Eutelsat SA 5.000% 14 January 2019	235,192	0.01%
200,000	EUR	Faurecia 9.375% 15 December 2016	232,441	0.01%
400,000	EUR	Faurecia 8.750% 15 June 2019	422,000	0.01%
1,000	EUR	France Government Bond OAT 2.500% 25 July 2013	1,211	0.00%
4,800,000	EUR	France Government Bond OAT 1.600% 25 July 2015	6,131,349	0.19%
8,879,000	EUR	France Government Bond OAT 1.100% 25 July 2022	10,490,750	0.32%
4,623,000	EUR	France Government Bond OAT 2.100% 25 July 2023	6,104,200	0.19%
1,854,000	EUR	France Government Bond OAT 3.400% 25 July 2029	3,427,191	0.10%
613,000	EUR	France Government Bond OAT 3.150% 25 July 2032	1,108,551	0.03%
1,360,000	EUR	France Government Bond OAT 1.800% 25 July 2040	1,979,754	0.06%

83,000	EUR	France Telecom SA 4.750% 21 February 2017	94,635	0.00%
482,000	GBP	France Telecom SA 8.000% 20 December 2017	740,391	0.02%
200,000	EUR	France Telecom SA 4.125% 23 January 2019	226,553	0.01%
200,000	GBP	France Telecom SA 7.250% 10 November 2020	314,829	0.01%
300,000	EUR	France Telecom SA 3.375% 16 September 2022	324,255	0.01%
899,000	GBP	France Telecom SA 5.250% 05 December 2025	1,256,180	0.04%
25,000	EUR	France Telecom SA 8.125% 28 January 2033	39,523	0.00%
880,000	EUR	GDF Suez 1.500% 20 July 2017	895,853	0.03%
88,000	EUR	GDF Suez 6.375% 18 January 2021	116,344	0.00%
766,000	EUR	GDF Suez 2.625% 20 July 2022	787,584	0.02%
42,000	EUR	GDF Suez 3.500% 18 October 2022	46,476	0.00%
1,000,000	GBP	GDF Suez 7.000% 30 October 2028	1,699,028	0.05%
3,474	EUR	Gecina SA	294,943	0.01%
500,000	EUR	Groupe Auchan SA 3.625% 19 October 2018	562,128	0.02%
15,596	EUR	Ingenico	670,628	0.02%
19,387	EUR	Klepierre	581,998	0.02%
170,000	EUR	Labco SAS 8.500% 15 January 2018	176,375	0.01%
22,489	EUR	Lafarge SA	1,084,644	0.03%
400,000	GBP	Lafarge SA 10.000% 30 May 2017	589,182	0.02%
2,100,000	EUR	Lafarge SA 6.625% 29 November 2018	2,380,097	0.07%
830,000	EUR	Lafarge SA 5.875% 09 July 2019	908,526	0.03%
200,000	EUR	Lagardere SCA 4.875% 06 October 2014	209,960	0.01%
300,000	EUR	Lagardere SCA 4.125% 31 October 2017	313,517	0.01%
300,000	EUR	Legrand SA 4.375% 21 March 2018	343,496	0.01%
19,667	EUR	L'Oreal SA	2,063,068	0.06%
14,699	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SA	2,040,221	0.06%
100,000	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SA 4.000% 06 April 2018	114,657	0.00%
200,000	EUR	Mercialys SA 4.125% 26 March 2019	220,515	0.01%
150,000	EUR	Pernod-Ricard SA 7.000% 15 January 2015	167,980	0.01%
450,000	EUR	Pernod-Ricard SA 4.875% 18 March 2016	500,572	0.02%
500,000	EUR	Pernod-Ricard SA 5.000% 15 March 2017	573,331	0.02%
200,000	EUR	Peugeot SA 6.875% 30 March 2016	213,556	0.01%
90,000	EUR	Peugeot SA 5.000% 28 October 2016	91,632	0.00%
4,463	EUR	PPR	628,614	0.02%
111,000	EUR	PPR 8.625% 03 April 2014	121,661	0.00%
845,000	EUR	PPR 3.750% 08 April 2015	897,893	0.03%
762,000	EUR	PPR 3.125% 23 April 2019	826,361	0.03%
859,000	EUR	RCI Banque SA 4.000% 11 July 2013	868,569	0.03%
333,000	EUR	RCI Banque SA 3.250% 17 January 2014	339,816	0.01%
440,000	EUR	RCI Banque SA 2.125% 24 November 2014	446,240	0.01%
179,000	EUR	RCI Banque SA 5.625% 13 March 2015	194,561	0.01%
44,590	EUR	Renault SA	1,814,144	0.05%
200,000	EUR	Renault SA 4.625% 25 May 2016	210,204	0.01%
500,000	EUR	Renault SA 5.625% 22 March 2017	545,193	0.02%
250,000	EUR	Renault SA 4.625% 18 September 2017	261,135	0.01%
250,000	EUR	RTE Reseau de transport d'electricite 5.125% 12 September 2018	298,597	0.01%
200,000	EUR	RTE Reseau de transport d'electricite 3.875% 28 June 2022	224,766	0.01%
14,761	EUR	Safran SA	481,135	0.01%
57,585	EUR	Sanofi	4,110,993	0.12%
26,983	EUR	Schneider Electric SA	1,479,478	0.04%
32,868	EUR	SCOR SE	670,836	0.02%
450,000	EUR	Societe Des Autoroutes Paris-Rhin-Rhone 7.500% 12 January 2015	505,882	0.02%
300,000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA 4.625% 25 May 2016	321,882	0.01%
200,000	EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA 3.500% 28 November 2017	206,942	0.01%
92,827	EUR	Societe Generale SA	2,630,717	0.08%
100,000	EUR	Societe Generale SA FRN 22 May 2013	96,623	0.00%
160,000	USD	Societe Generale SA 2.500% 15 January 2014	122,925	0.00%
50,000	EUR	Societe Generale SA 3.750% 21 August 2014	52,389	0.00%
400,000	EUR	Societe Generale SA 3.000% 31 March 2015	417,497	0.01%

200,000	EUR	Societe Generale SA 2.375% 13 July 2015	206,625	0.01%
400,000	EUR	Societe Generale SA 4.000% 20 April 2016	436,351	0.01%
525,000	GBP	Societe Generale SA 5.400% 30 January 2018	673,829	0.02%
300,000	GBP	Societe Generale SA 5.000% 20 December 2018	409,473	0.01%
350,000	EUR	Societe Generale SA FRN 04 September 2019	391,589	0.01%
600,000	EUR	Societe Generale SA 4.750% 02 March 2021	708,993	0.02%
400,000	EUR	SPCM SA 5.500% 15 June 2020	425,000	0.01%
200,000	EUR	Suez Environnement Co 4.078% 17 May 2021	229,909	0.01%
12,491	EUR	Unibaii-Rodamco SE	2,272,737	0.07%
282,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 3.375% 11 March 2015	297,252	0.01%
200,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 3.500% 06 April 2016	215,484	0.01%
450,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 4.625% 23 September 2016	505,170	0.02%
130,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 3.875% 13 December 2017	145,004	0.00%
428,000	EUR	Unibaii-Rodamco SE 2.250% 01 August 2018	442,026	0.01%
300,000	EUR	Valeo SA 5.750% 19 January 2017	339,399	0.01%
100,000	EUR	Valeo SA 4.875% 11 May 2018	111,501	0.00%
125,000	EUR	Veolia Environnement SA 5.250% 24 April 2014	132,412	0.00%
104,000	EUR	Veolia Environnement SA 5.375% 28 May 2018	122,936	0.00%
53,000	EUR	Veolia Environnement SA 5.125% 24 May 2022	63,393	0.00%
600,000	EUR	Veolia Environnement SA 4.625% 30 March 2027	679,351	0.02%
300,000	GBP	Veolia Environnement SA 6.125% 29 October 2037	431,170	0.01%
300,000	EUR	Vinci SA 3.375% 30 March 2020	323,587	0.01%
200,000	EUR	Vivendi SA 7.750% 23 January 2014	214,340	0.01%
100,000	EUR	Vivendi SA 4.250% 01 December 2016	109,855	0.00%
100,000	EUR	Vivendi SA 4.125% 18 July 2017	109,847	0.00%
100,000	EUR	Vivendi SA 4.875% 02 December 2019	116,357	0.00%
500,000	EUR	Vivendi SA 4.750% 13 July 2021	576,201	0.02%
100,000	EUR	Wendel SA 5.875% 17 September 2019	107,780	0.00%
		フランス合計	107,822,140	3.25%
		ドイツ		
300,000	EUR	ALBA Group Plc & Co KG 8.000% 15 May 2018	325,515	0.01%
400,000	EUR	Allianz Se Var 5.625% 17 October 2042	453,890	0.01%
24,723	EUR	BASF SE	1,759,042	0.05%
1,410,000	EUR	BASF SE 2.000% 05 December 2022	1,410,232	0.04%
9,107	EUR	Bayerische Motoren Werke AG	664,174	0.02%
2,000,000	EUR	Bundesobligation 2.750% 08 April 2016	2,174,742	0.07%
1,350,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 4.000% 04 January 2018	1,593,129	0.05%
150,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 3.500% 04 July 2019	176,981	0.01%
3,800,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 1.500% 04 September 2022	3,852,871	0.12%
300,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland 4.750% 04 July 2028	416,323	0.01%
5,188,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesobligation Inflation Linked Bond 2.250% 15 April 2013	5,866,201	0.18%
830,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesobligation Inflation Linked Bond 0.750% 15 April 2018	954,878	0.03%
56,000	EUR	Commerzbank AG 5.000% 06 February 2014	58,648	0.00%
530,000	EUR	Commerzbank AG 3.875% 22 March 2017	585,098	0.02%
14,583	EUR	Continental AG	1,277,324	0.04%
378,000	EUR	Daimler AG 4.625% 02 September 2014	402,769	0.01%
354,000	EUR	Daimler AG 2.000% 05 May 2017	367,634	0.01%
970,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 2.000% 20 February 2023	965,659	0.03%
45,332	EUR	Deutsche Bank AG	1,493,689	0.05%
4,541,000	EUR	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1.500% 15 April 2016	5,686,550	0.17%
5,162,000	EUR	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1.750% 15 April 2020	6,659,435	0.20%
4,135,000	EUR	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.100% 15 April 2023	4,466,537	0.14%
49,501	EUR	Deutsche Post AG	821,717	0.02%
500,000	EUR	Deutsche Telekom International 2.000% 30 October 2019	511,115	0.02%
113,239	EUR	Deutsche Wohnen AG	1,585,346	0.05%
600,000	EUR	German Treasury Bill 0.000% 26 June 2013	600,078	0.02%
400,000	EUR	Heckler & Koch GmbH 9.500% 15 May 2018	348,000	0.01%

250,000	EUR	Heidelberger Druckmaschinen AG 9.250% 15 April 2018	221,250	0.01%
521,000	EUR	Henkel AG & Co KGaA FRN 25 November 2104	561,914	0.02%
7,469	EUR	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	464,572	0.01%
400,000	EUR	IKB Deutsche Industriebank AG 4.500% 09 July 2013	396,500	0.01%
136,881	EUR	Infineon Technologies AG	838,944	0.03%
36,519	EUR	Kabel Deutschland Holding AG	2,065,880	0.06%
300,000	EUR	Kabel Deutschland Holding AG 6.500% 31 July 2017	328,401	0.01%
200,000	EUR	Kabel Deutschland Vertrieb und Service GmbH 6.500% 29 June 2018	216,814	0.01%
741,000	GBP	KFW 5.750% 07 June 2032	1,281,677	0.04%
840,000	GBP	KFW 5.000% 09 June 2036	1,343,474	0.04%
715,000	EUR	KM Germany Holdings GmbH 8.750% 15 December 2020	750,414	0.02%
6,190	EUR	Linde AG	817,080	0.02%
340,000	EUR	Linde AG 1.750% 17 September 2020	342,572	0.01%
200,000	EUR	Mondi Consumer Packaging International AG 9.750% 15 July 2017	233,000	0.01%
400,000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs AG FRN 26 May 2042	485,464	0.02%
369,000	EUR	RWE AG FRN 28 September 2015	376,320	0.01%
30,317	EUR	SAP AG	1,839,938	0.06%
29,709	EUR	Symrise AG	805,708	0.02%
300,000	EUR	Techem Energy Metering Service GmbH & Co KG 7.875% 01 October 2020	331,896	0.01%
215,000	EUR	Techem GmbH 6.125% 01 October 2019	231,663	0.01%
466,000	EUR	ThyssenKrupp AG 8.000% 18 June 2014	509,110	0.02%
831,000	EUR	UniCredit Bank AG 6.000% 05 February 2014	867,225	0.03%
220,000	EUR	UniCredit Bank AG 3.250% 15 July 2014	226,652	0.01%
418,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 8.125% 01 December 2017	454,575	0.01%
590,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 7.500% 15 March 2019	651,437	0.02%
200,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.500% 15 September 2022	206,000	0.01%
460,000	EUR	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.750% 15 January 2023	481,925	0.01%
636,000	EUR	Unitymedia KabelBW GmbH 9.625% 01 December 2019	719,609	0.02%
945,000	EUR	Unitymedia KabelBW GmbH 9.500% 15 March 2021	1,099,743	0.03%
13,000	EUR	Volkswagen Financial Services AG 6.875% 15 January 2014	13,839	0.00%
530,000	EUR	Volkswagen International Finance NV 2.125% 19 January 2015	544,438	0.02%
200,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 2.250% 10 November 2014	205,679	0.01%
350,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 2.750% 13 July 2015	367,201	0.01%
300,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 1.500% 15 September 2015	305,356	0.01%
300,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 3.375% 03 June 2016	323,819	0.01%
200,000	EUR	Volkswagen Leasing GmbH 3.250% 10 May 2018	218,484	0.01%
16,530	EUR	Wirecard AG	307,458	0.01%
		ドイツ合計	66,913,608	2.06%
		ガンジー島		
72,107	GBP	Resolution Ltd	218,700	0.01%
		ガンジー島合計	218,700	0.01%
		香港		
583,000	HKD	BOC Hong Kong Holdings Ltd	1,371,931	0.04%
1,460,000	HKD	China Overseas Land & Investment Ltd	3,293,150	0.10%
1,099,000	HKD	Henderson Land Development Co Ltd	5,869,913	0.18%
512,000	HKD	Sun Hung Kai Properties Ltd	5,809,286	0.18%
1,342,800	HKD	Swire Properties Ltd	3,389,367	0.10%
		香港合計	19,733,647	0.60%
		インド		
33,551	USD	Tata Motors Ltd	719,571	0.02%
		インド合計	719,571	0.02%
		インドネシア		
3,485,232	IDR	Lippo Karawaci Tbk PT	273,674	0.01%

		インドネシア合計	273,674	0.01%
		アイルランド		
47,000	EUR	Allied Irish Banks Plc 5.625% 12 November 2014	47,388	0.00%
445,000	EUR	Ardagh Glass Finance Plc 9.250% 01 July 2016	484,494	0.02%
83,000	EUR	Ardagh Glass Finance Plc 7.125% 15 June 2017	86,113	0.00%
400,000	EUR	Ardagh Glass Finance Plc 8.750% 01 February 2020	422,500	0.01%
180,000	EUR	Ardagh Packaging Finance Plc 7.375% 15 October 2017	198,900	0.01%
150,000	EUR	Ardagh Packaging Finance Plc 9.250% 15 October 2020	164,813	0.01%
395,000	EUR	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh MP Holdings USA Inc 7.375% 15 October 2017	436,475	0.01%
450,000	EUR	Bank of Ireland Mortgage Bank 3.125% 20 November 2015	457,147	0.01%
260,000	EUR	Bord Gais Eireann 3.625% 04 December 2017	270,901	0.01%
157,088	EUR	C&C Group Plc	714,750	0.02%
100,000	EUR	Caterpillar International Finance Ltd 1.375% 18 May 2015	101,658	0.00%
270,000	EUR	Cloverie Plc for Swiss Reinsurance Co Ltd FRN 01 September 2042	328,785	0.01%
350,000	EUR	Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd FRN 24 July 2039	429,741	0.01%
417,000	EUR	CRH Finance Ltd 7.375% 28 May 2014	454,607	0.01%
91,265	EUR	Dragon Oil Plc	621,150	0.02%
510,000	EUR	ESB Finance Ltd 6.250% 11 September 2017	585,723	0.02%
290,000	EUR	ESB Finance Ltd 4.375% 21 November 2019	306,412	0.01%
100,000	EUR	FGA Capital Ireland Plc 4.000% 28 March 2013	100,725	0.00%
350,000	EUR	FGA Capital Ireland Plc 5.250% 28 February 2014	359,722	0.01%
180,000	EUR	FGA Capital Ireland Plc 4.375% 18 September 2014	185,624	0.01%
108,000	EUR	GE Capital European Funding 4.750% 30 July 2014	114,833	0.00%
474,000	EUR	GE Capital European Funding 2.000% 27 February 2015	486,147	0.02%
131,000	EUR	GE Capital European Funding 5.250% 18 May 2015	144,458	0.00%
97,000	EUR	GE Capital European Funding 2.875% 17 September 2015	102,047	0.00%
1,678,000	EUR	GE Capital European Funding 4.250% 01 March 2017	1,881,275	0.06%
315,000	EUR	GE Capital European Funding 3.625% 15 June 2017	343,593	0.01%
200,000	EUR	GE Capital European Funding 6.000% 15 January 2019	249,201	0.01%
189,000	EUR	GE Capital European Funding 2.875% 18 June 2019	202,213	0.01%
297,000	EUR	GE Capital European Funding 5.375% 23 January 2020	363,943	0.01%
100,000	EUR	GE Capital European Funding 4.625% 22 February 2027	120,622	0.00%
295,000	EUR	Governor & Co of the Bank of Ireland 4.625% 08 April 2013	295,040	0.01%
200,000	EUR	Nara Cable Funding Ltd 8.875% 01 December 2018	202,584	0.01%
500,000	EUR	Ono Finance II Plc 11.125% 15 July 2019	482,500	0.01%
19,905	EUR	Paddy Power Plc	1,244,063	0.04%
800,000	EUR	Rottapharm Ltd 6.125% 15 November 2019	832,000	0.03%
338,404	EUR	Ryanair Holdings Plc	1,599,635	0.05%
114,000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions 7.250% 15 November 2017	123,120	0.00%
225,000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions 5.125% 15 September 2018	237,375	0.01%
647,000	EUR	Smurfit Kappa Acquisitions 7.750% 15 November 2019	719,788	0.02%
200,000	EUR	Willow No.2 Ireland Plc for Zurich Insurance Co Ltd 3.375% 27 June 2022	216,729	0.01%
		アイルランド合計	16,718,794	0.51%
		イタリア		
412,000	EUR	Assicurazioni Generali SpA 5.125% 16 September 2024	441,204	0.01%
229,000	EUR	Atlantia SpA 5.625% 06 May 2016	254,866	0.01%
111,000	EUR	Atlantia SpA 3.375% 18 September 2017	115,242	0.00%
290,000	EUR	Atlantia SpA 4.375% 16 March 2020	310,284	0.01%
609,000	GBP	Atlantia SpA 6.250% 09 June 2022	814,362	0.03%
141,000	EUR	Atlantia SpA 4.375% 16 September 2025	146,517	0.00%
1,015,000	EUR	Banco Popolare SC 4.000% 06 April 2013	1,018,456	0.03%
156,000	EUR	Edison SpA 4.250% 22 July 2014	162,814	0.01%
259,000	EUR	Edison SpA 3.250% 17 March 2015	269,026	0.01%
420,000	EUR	Edison SpA 3.875% 10 November 2017	456,000	0.01%
97,000	EUR	Enel SpA 5.250% 14 January 2015	103,158	0.00%
44,000	EUR	Enel SpA 3.500% 26 February 2016	45,045	0.00%

350,000	EUR	Enel SpA 5.250% 20 June 2017	386,411	0.01%
49,000	EUR	Enel SpA 4.750% 12 June 2018	53,060	0.00%
95,000	GBP	Enel SpA 6.250% 20 June 2019	127,084	0.00%
81,201	EUR	Eni SpA	1,489,226	0.05%
150,000	EUR	Eni SpA 4.125% 16 September 2019	169,572	0.01%
200,000	EUR	Guala Closures SpA 5.568% 15 November 2019	203,500	0.01%
150,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 3.375% 19 January 2015	153,537	0.00%
500,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 3.875% 01 April 2015	516,059	0.02%
1,200,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.875% 10 July 2015	1,269,239	0.04%
200,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.375% 16 August 2016	217,785	0.01%
300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.125% 19 September 2016	313,695	0.01%
150,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 3.750% 23 November 2016	155,139	0.00%
300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 5.000% 28 February 2017	323,968	0.01%
200,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.750% 15 June 2017	215,306	0.01%
141,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.000% 09 November 2017	145,964	0.00%
50,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 08 May 2018	52,318	0.00%
50,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA FRN 28 May 2018	46,174	0.00%
300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA 4.000% 08 November 2018	307,628	0.01%
50,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA FRN 02 March 2020	42,172	0.00%
149,000	GBP	Intesa Sanpaolo SpA FRN 18 March 2024	144,970	0.00%
300,000	EUR	Lottomatica Group SpA 3.500% 05 March 2020	308,889	0.01%
57,878	EUR	Prysmian SpA	868,749	0.03%
28,085	EUR	Saipem SpA	822,891	0.02%
251,790	EUR	Snam SpA	884,790	0.03%
510,000	EUR	Snam SpA 3.875% 19 March 2018	546,872	0.02%
180,000	EUR	Snam SpA 3.500% 13 February 2020	183,787	0.01%
320,000	EUR	Telecom Italia SpA 4.625% 15 June 2015	341,978	0.01%
200,000	EUR	Telecom Italia SpA 5.125% 25 January 2016	217,644	0.01%
320,000	EUR	Telecom Italia SpA 4.500% 20 September 2017	342,133	0.01%
450,000	GBP	Telecom Italia SpA 7.375% 15 December 2017	625,982	0.02%
900,000	EUR	Telecom Italia SpA 4.750% 25 May 2018	969,723	0.03%
600,000	GBP	Telecom Italia SpA 6.375% 24 June 2019	793,709	0.02%
100,000	EUR	Telecom Italia SpA 5.250% 10 February 2022	107,193	0.00%
480,000	EUR	UniCredit SpA 4.875% 07 March 2017	515,394	0.02%
370,000	EUR	UniCredit SpA 3.375% 11 January 2018	369,769	0.01%
175,000	EUR	UniCredit SpA 4.250% 31 July 2018	192,088	0.01%
		イタリア合計	18,561,372	0.57%
		日本		
23,600	JPY	Japan Tobacco Inc	504,291	0.02%
278,000	JPY	Mitsubishi Estate Co Ltd	4,988,453	0.15%
303,000	JPY	Mitsui Fudosan Co Ltd	5,545,849	0.17%
8,640	JPY	ORIX Corp	733,190	0.02%
88,000	JPY	Sekisui House Ltd	725,960	0.02%
41,200	JPY	Seven & I Holdings Co Ltd	879,290	0.03%
81,500	JPY	Yokogawa Electric Corp	671,624	0.02%
		日本合計	14,048,657	0.43%
		ジャージー島		
915,000	EUR	ASIF III Jersey Ltd 4.750% 11 September 2013	947,444	0.03%
100,000	GBP	Aston Martin Capital Ltd 9.250% 15 July 2018	121,932	0.00%
160,000	GBP	CPUK Finance Ltd 11.625% 28 February 2018	218,130	0.01%
100,000	GBP	Gatwick Funding Ltd 6.125% 02 March 2026	150,648	0.00%
312,430	GBP	Glencore International Plc	1,345,013	0.04%
776,000	EUR	Heathrow Funding Ltd FRN 30 September 2014	827,207	0.03%
250,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 3.000% 08 June 2015	317,050	0.01%
102,000	EUR	Heathrow Funding Ltd 4.125% 12 October 2016	112,861	0.00%
136,000	EUR	Heathrow Funding Ltd 4.375% 25 January 2017	151,902	0.00%
117,000	EUR	Heathrow Funding Ltd FRN 15 February 2018	133,105	0.00%
1,687,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 6.250% 10 September 2018	2,348,792	0.07%
350,000	GBP	Heathrow Funding Ltd FRN 15 February 2023	495,085	0.02%
1,061,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 6.750% 03 December 2026	1,709,122	0.05%

202,000	GBP	Heathrow Funding Ltd FRN 10 December 2031	313,057	0.01%
420,000	GBP	Heathrow Funding Ltd 3.334% 09 December 2039 HSBC Bank Capital Funding Sterling LP FRN 05	738,393	0.02%
1,736,000	GBP	November 2031	2,081,426	0.06%
73,000	GBP	HSBC Capital Funding LP/Jersey FRN 30 June 2015	99,189	0.00%
250,720	GBP	Informa Plc	1,379,529	0.04%
125,353	GBP	Petrofac Ltd	2,493,153	0.08%
719,000	GBP	QBE Capital Funding IV Ltd FRN 24 May 2041	918,737	0.03%
26,781	GBP	Shire Plc	619,290	0.02%
505,000	GBP	UBM Plc 6.500% 23 November 2016	706,646	0.02%
62,843	GBP	Wolseley Plc	2,233,318	0.07%
174,067	GBP	WPP Plc	1,894,196	0.06%
		ジャージー島合計	22,355,225	0.67%
		ルクセンブルグ		
100,000	EUR	Albea Beauty Holdings SA 8.750% 01 November 2019	106,250	0.00%
172,000	EUR	ArcelorMittal 8.250% 03 June 2013	176,560	0.01%
100,000	EUR	ArcelorMittal 4.500% 29 March 2018	106,890	0.00%
1,970,000	USD	ArcelorMittal 6.000% 01 March 2021	1,498,583	0.05%
1,452,000	USD	ArcelorMittal 7.250% 01 March 2041	1,029,705	0.03%
547,285	EUR	ARD Finance SA 11.125% 01 June 2018	571,913	0.02%
100,000	EUR	Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA 8.000% 15 December 2016	102,500	0.00%
108,000	EUR	Beverage Packaging Holdings Luxembourg II SA 9.500% 15 June 2017	112,860	0.00%
750,000	GBP	Cabot Financial Luxembourg SA 10.375% 01 October 2019	1,015,592	0.03%
100,000	EUR	Capsugel FinanceCo SCA 9.875% 01 August 2019	112,875	0.00%
375,000	EUR	Cirsa Funding Luxembourg SA 8.750% 15 May 2018	371,719	0.01%
445,000	EUR	Codere Finance Luxembourg SA 8.250% 15 June 2015	369,600	0.01%
241,000	EUR	ConvaTec Healthcare E SA 7.375% 15 December 2017	261,702	0.01%
200,000	EUR	Fiat Finance & Trade SA 6.375% 01 April 2016	206,000	0.01%
100,000	EUR	Fiat Finance & Trade SA 7.750% 17 October 2016	106,620	0.00%
210,000	EUR	Fiat Industrial Finance Europe SA 5.250% 11 March 2015	223,020	0.01%
1,795,000	EUR	Fiat Industrial Finance Europe SA 6.250% 09 March 2018	2,013,990	0.06%
62,000	EUR	Finmeccanica Finance SA/Old 8.125% 03 December 2013	65,894	0.00%
200,000	EUR	FMC Finance VIII SA 6.500% 15 September 2018	235,000	0.01%
150,000	EUR	Gategroup Finance Luxembourg SA 6.750% 01 March 2019	160,376	0.01%
404,000	EUR	Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 8.125% 04 February 2015	457,917	0.01%
390,000	EUR	Gazprom OAO Via Gaz Capital SA 3.755% 15 March 2017	414,814	0.01%
300,000	EUR	GCL Holdings SCA 9.375% 15 April 2018	323,250	0.01%
725,000	EUR	Geo Travel Finance SCA 10.375% 01 May 2019	746,750	0.02%
600,000	EUR	Hannover Finance Luxembourg SA FRN 26 February 2024	628,095	0.02%
291,000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 7.500% 31 October 2014	320,941	0.01%
200,000	EUR	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 9.500% 15 December 2018	257,714	0.01%
175,000	USD	Holcim US Finance Sari & Cie SCS 6.000% 30 December 2019	150,742	0.00%
840,000	EUR	INEOS Group Holdings SA 7.875% 15 February 2016	837,900	0.03%
589,000	USD	Intelsat Jackson Holdings SA 7.250% 15 October 2020	486,416	0.02%
3,459,000	USD	Intelsat Luxembourg SA 11.250% 04 February 2017	2,778,027	0.08%
100,000	EUR	KION Finance SA 7.875% 15 April 2018	108,500	0.00%
575,000	EUR	Matterhorn Mobile Holdings SA 8.250% 15 February 2020	629,625	0.02%
193,000	EUR	Michelin Luxembourg SCS 8.625% 24 April 2014	213,291	0.01%
180,000	EUR	Michelin Luxembourg SCS 2.750% 20 June 2019	188,647	0.01%
200,000	EUR	Numericable Finance & Co SCA 8.750% 15 February 2019	214,000	0.01%
200,000	EUR	Spie BondCo 3 SCA 11.000% 15 August 2019	219,000	0.01%
23,826	NOK	Subsea 7 SA	428,253	0.01%
586,000	EUR	Sunrise Communications Holdings SA 8.500% 31 December 2018	645,778	0.02%
200,000	EUR	Sunrise Communications International SA 7.000% 31 December 2017	218,204	0.01%
100,000	EUR	Talanx Finanz Luxembourg SA FRN 15 June 2042	122,346	0.00%
80,000	USD	Telecom Italia Capital SA 5.250% 15 November 2013	62,328	0.00%

21,000	EUR	Telecom Italia Finance SA 7.750% 24 January 2033	24,335	0.00%
730,000	EUR	Wind Acquisition Finance SA 7.375% 15 February 2018	744,600	0.02%
100,000	EUR	Xefin Lux SCA 8.000% 01 June 2018	107,500	0.00%
620,000	EUR	Zinc Capital SA 8.875% 15 May 2018	663,399	0.02%
		ルクセンブルグ合計	20,840,021	0.63%
		マレーシア		
1,018,900	MYR	UEM Land Holdings Bhd	529,516	0.02%
		マレーシア合計	529,516	0.02%
		マーシャル諸島		
276,000	USD	Navios Maritime Holdings Inc / Navios Maritime Finance US Inc 8.875% 01 November 2017	209,393	0.01%
		マーシャル諸島合計	209,393	0.01%
		メキシコ		
232,000	EUR	America Movil SAB de CV 3.750% 28 June 2017	257,284	0.01%
150,000	EUR	America Movil SAB de CV 4.125% 25 October 2019	172,185	0.01%
440,000	EUR	America Movil SAB de CV 3.000% 12 July 2021	462,667	0.01%
170,000	EUR	America Movil SAB de CV 4.750% 28 June 2022	202,549	0.01%
750,000	GBP	America Movil SAB de CV 5.750% 28 June 2030	1,134,206	0.03%
132,000	USD	Kansas City Southern de Mexico SA de CV 8.000% 01 February 2018	111,133	0.00%
130,000	USD	Kansas City Southern de Mexico SA de CV 6.125% 15 June 2021	111,170	0.00%
433,500,000	MXN	Mexican Bonos 6.500% 10 June 2021	27,376,898	0.83%
334,736,300	MXN	Mexican Bonos 10.000% 05 December 2024	27,349,707	0.83%
369,950,500	MXN	Mexican Bonos 7.500% 03 June 2027	25,091,688	0.76%
339,033,500	MXN	Mexican Bonos 8.500% 31 May 2029	25,003,512	0.76%
62,000	USD	Mexico Government International Bond 3.625% 15 March 2022	51,378	0.00%
347,000	EUR	Petroleos Mexicanos 5.500% 09 January 2017	395,198	0.01%
849,000	GBP	Petroleos Mexicanos 8.250% 02 June 2022	1,345,018	0.04%
		メキシコ合計	109,064,593	3.30%
		オランダ		
460,000	EUR	ABB Finance BV 2.625% 26 March 2019	488,205	0.02%
925,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 4.250% 11 April 2016	1,020,946	0.03%
200,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 3.625% 06 October 2017	221,116	0.01%
613,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 6.375% 27 April 2021	703,107	0.02%
360,000	EUR	ABN AMRO Bank NV 7.125% 06 July 2022	424,859	0.01%
112,000	EUR	Achmea BV 7.375% 16 June 2014	122,377	0.00%
500,000	EUR	Aegon NV 4.125% 08 December 2014	531,227	0.02%
180,000	EUR	Aegon NV 3.000% 18 July 2017	192,688	0.01%
243,000	EUR	Allianz Finance II BV FRN 17 February 2017	244,246	0.01%
250,000	EUR	Allianz Finance II BV 4.750% 22 July 2019	299,450	0.01%
400,000	EUR	Allianz Finance II BV FRN 08 July 2041	459,791	0.01%
30,877	EUR	ASML Holding NV	1,482,096	0.04%
734,000	EUR	BMW Finance NV 4.000% 17 September 2014	776,189	0.02%
109,000	EUR	BMW Finance NV 3.875% 18 January 2017	121,256	0.00%
200,000	EUR	BMW Finance NV 3.625% 29 January 2018	223,168	0.01%
950,000	GBP	BMW Finance NV 3.375% 14 December 2018	1,239,009	0.04%
143,000	EUR	British American Tobacco Holdings The Netherlands BV 4.000% 07 July 2020	163,970	0.01%
400,000	EUR	British American Tobacco Holdings The Netherlands BV 2.375% 19 January 2023	400,586	0.01%
250,000	EUR	Carlson Wagonlit BV 7.500% 15 June 2019	268,125	0.01%
100,000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV 7.875% 15 January 2014	106,139	0.00%
214,000	EUR	Coca-Cola HBC Finance BV 4.250% 16 November 2016	230,453	0.01%
188,000	EUR	Conti-Gummi Finance BV 8.500% 15 July 2015	203,980	0.01%
200,000	EUR	Conti-Gummi Finance BV 6.500% 15 January 2016	215,000	0.01%
1,353,000	EUR	Conti-Gummi Finance BV 7.500% 15 September 2017	1,456,546	0.04%
600,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 4.375% 05 May 2016	667,303	0.02%

519,000	USD	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands FRN 26 July 2016	426,310	0.01%
875,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 4.750% 15 January 2018	1,020,517	0.03%
272,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 3.500% 17 October 2018	302,176	0.01%
700,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 4.125% 14 January 2020	805,135	0.02%
100,000	EUR	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 6.875% 19 March 2020	112,142	0.00%
280,000	GBP	Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA/Netherlands 2.250% 22 November 2022	459,288	0.01%
700,000	EUR	CRH Finance BV 5.000% 25 January 2019	810,090	0.02%
260,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 4.750% 14 March 2018	308,451	0.01%
250,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 3.000% 08 March 2024	270,115	0.01%
200,000	EUR	Deutsche Bahn Finance BV 3.750% 09 July 2025	232,188	0.01%
777,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 6.000% 20 January 2017	922,563	0.03%
22,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 6.625% 29 March 2018	27,747	0.00%
500,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 4.250% 16 March 2020	579,518	0.02%
79,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 5.375% 27 July 2021	96,935	0.00%
582,000	GBP	Deutsche Telekom International Finance BV 6.500% 08 April 2022	895,843	0.03%
109,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 4.250% 13 July 2022	127,718	0.00%
310,000	EUR	Deutsche Telekom International Finance BV 2.750% 24 October 2024	313,706	0.01%
493,000	EUR	E.ON International Finance BV 5.500% 19 January 2016	560,920	0.02%
577,000	EUR	E.ON International Finance BV 6.375% 29 May 2017	706,921	0.02%
1,200,000	GBP	E.ON International Finance BV 6.000% 30 October 2019	1,801,370	0.06%
550,000	GBP	E.ON International Finance BV 6.375% 07 June 2032	884,419	0.03%
1,085,000	EUR	EDP Finance BV 5.750% 21 September 2017	1,166,103	0.04%
200,000	EUR	En Germany Holdings BV 10.750% 15 November 2015	190,000	0.01%
320,000	EUR	Enel Finance International NV 4.125% 12 July 2017	338,751	0.01%
610,000	EUR	Enel Finance International NV 3.625% 17 April 2018	629,371	0.02%
1,100,000	EUR	Enel Finance International NV 5.750% 24 October 2018	1,250,062	0.04%
160,000	EUR	Enel Finance International NV 4.875% 11 March 2020	172,802	0.01%
158,000	EUR	Enel Finance International NV 5.000% 14 September 2022	169,097	0.01%
1,019,000	GBP	Enel Finance International NV 5.625% 14 August 2024	1,268,299	0.04%
1,207,000	GBP	Enel Finance International NV 5.750% 14 September 2040	1,361,051	0.04%
260,000	EUR	Enexis Holding NV 1.875% 13 November 2020	260,805	0.01%
31,282	EUR	European Aeronautic Defence and Space Co NV	922,819	0.03%
24,390	EUR	Gemalto NV	1,658,520	0.05%
1,365,000	EUR	HeidelbergCement Finance BV 8.000% 31 January 2017	1,596,983	0.05%
100,000	EUR	HIT Finance BV 5.750% 09 March 2018	111,556	0.00%
300,000	EUR	Iberdrola International BV 4.875% 18 February 2013	302,070	0.01%
300,000	EUR	Iberdrola International BV 4.250% 11 October 2018	325,563	0.01%
596,000	EUR	ING Bank NV 3.375% 03 March 2015	627,420	0.02%
300,000	EUR	ING Bank NV 2.125% 10 July 2015	308,894	0.01%
150,000	EUR	ING Bank NV 3.875% 24 May 2016	163,710	0.01%
192,000	GBP	ING Bank NV 3.875% 23 December 2016	250,884	0.01%
718,000	EUR	ING Bank NV FRN 15 March 2019	712,175	0.02%
280,000	EUR	ING Bank NV 4.875% 18 January 2021	332,833	0.01%
1,300,000	GBP	ING Bank NV 5.375% 15 April 2021	1,875,719	0.06%
430,000	EUR	ING Bank NV 4.500% 21 February 2022	501,062	0.02%
307,948	EUR	ING Groep NV	2,174,421	0.07%
71,000	EUR	ING Groep NV 4.125% 23 March 2015	75,713	0.00%
203,000	GBP	InterGen NV 9.500% 30 June 2017	222,646	0.01%
132,000	EUR	InterGen NV 8.500% 30 June 2017	118,140	0.00%
150,000	EUR	International Endesa BV 5.375% 21 February 2013	150,674	0.00%
454,000	EUR	InterXion Holding NV 9.500% 12 February 2017	507,913	0.02%
650,000	EUR	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 3.875% 31 March 2015	687,089	0.02%

400,000	EUR	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 4.375% 26 October 2015	432,591	0.01%
261,000	EUR	KBC Internationale Financieringsmaatschappij NV 3.000% 29 August 2016	274,892	0.01%
12,066	EUR	Koninklijke Boskalis Westminster NV	410,244	0.01%
61,000	EUR	Koninklijke KPN NV 6.500% 15 January 2016	69,744	0.00%
487,000	EUR	Koninklijke KPN NV 7.500% 04 February 2019	620,628	0.02%
220,000	EUR	Koninklijke KPN NV 3.250% 01 February 2021	220,849	0.01%
120,000	EUR	Koninklijke KPN NV 4.500% 04 October 2021	130,633	0.00%
320,000	GBP	Koninklijke KPN NV 5.750% 17 September 2029	437,819	0.01%
350,000	EUR	LeasePlan Corp NV 4.125% 13 January 2015	368,941	0.01%
54,000	EUR	LeasePlan Corp NV 3.875% 16 September 2015	57,421	0.00%
140,000	EUR	LeasePlan Corp NV 2.500% 19 September 2016	144,378	0.00%
163,000	EUR	LeasePlan Finance NV 3.750% 18 March 2013	163,929	0.01%
58,000	EUR	Linde Finance BV 1.750% 11 June 2019	59,493	0.00%
137,000	EUR	Linde Finance BV 3.875% 01 June 2021	158,979	0.01%
1,270,000	EUR	Linde Finance BV FRN 29 July 2049	1,313,955	0.04%
274,000	EUR	Linde Finance BV FRN 14 July 2066	321,615	0.01%
31,951	USD	LyondellBasell Industries NV	1,342,221	0.04%
575,000	USD	LyondellBasell Industries NV 5.000% 15 April 2019	483,013	0.01%
1,495,000	USD	LyondellBasell Industries NV 5.750% 15 April 2024	1,340,688	0.04%
88,000	EUR	Magyar Telecom BV 9.500% 15 December 2016	48,400	0.00%
398,000	EUR	O1 European Group BV 6.750% 15 September 2020	455,710	0.01%
160,000	EUR	PACCAR Financial Europe BV 1.375% 08 June 2015	162,479	0.01%
100,000	EUR	Polish Television Holding BV 11.250% 15 May 2017	109,500	0.00%
200,000	EUR	Portugal Telecom International Finance BV 5.625% 08 February 2016	211,331	0.01%
105,000	GBP	Roche Finance Europe BV 5.375% 29 August 2023	162,889	0.01%
154,000	EUR	RWE Finance BV 4.625% 23 July 2014	163,514	0.01%
367,000	EUR	RWE Finance BV 5.000% 10 February 2015	399,636	0.01%
62,000	EUR	RWE Finance BV 5.125% 23 July 2018	74,269	0.00%
800,000	EUR	RWE Finance BV 6.625% 31 January 2019	1,033,586	0.03%
200,000	EUR	RWE Finance BV 6.500% 10 August 2021	270,242	0.01%
1,500,000	GBP	RWE Finance BV 5.625% 06 December 2023	2,224,559	0.07%
1,100,000	GBP	RWE Finance BV 6.125% 06 July 2039	1,679,214	0.05%
200,000	EUR	Schaeffler Finance BV 7.750% 15 February 2017	224,000	0.01%
230,000	EUR	Schaeffler Finance BV 6.750% 01 July 2017	250,413	0.01%
325,000	EUR	Schaeffler Finance BV 8.750% 15 February 2019	377,000	0.01%
950,000	EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV 1.500% 10 March 2020	946,040	0.03%
124,000	EUR	SNS Bank NV 3.625% 18 July 2013	125,278	0.00%
210,000	EUR	SNS Bank NV 2.125% 30 August 2017	214,890	0.01%
400,000	EUR	Swiss Reinsurance Co via ELM BV FRN 25 May 2016	411,677	0.01%
85,000	EUR	TenneT Holding BV 3.250% 09 February 2015	89,262	0.00%
265,000	EUR	TenneT Holding BV FRN 01 June 2017	286,304	0.01%
100,000	EUR	TenneT Holding BV 4.625% 21 February 2023	118,894	0.00%
56,412	EUR	Unilever NV	1,626,640	0.05%
200,000	EUR	UPC Holding BV 9.750% 15 April 2018	214,762	0.01%
362,000	EUR	UPC Holding BV 8.375% 15 August 2020	406,939	0.01%
280,000	EUR	UPC Holding BV 6.375% 15 September 2022	285,950	0.01%
340,000	EUR	Volkswagen International Finance NV 3.250% 21 January 2019	371,468	0.01%
506,000	EUR	Ziggo Bond Co BV 8.000% 15 May 2018	557,157	0.02%
486,000	EUR	Ziggo Finance BV 6.125% 15 November 2017	521,284	0.02%
		オランダ合計	66,734,369	2.07%
		ニュージーランド		
521,000	EUR	Westpac Securities NZ Ltd 3.875% 20 March 2017	579,997	0.02%
		ニュージーランド合計	579,997	0.02%
		ノルウェー		
136,036	NOK	DNB ASA	1,303,087	0.04%
473,000	EUR	DNB Bank ASA 4.500% 29 May 2014	499,662	0.02%
500,000	GBP	DNB Bank ASA FRN 29 January 2018	618,851	0.02%

400,000	EUR	DNB Bank ASA 4.375% 24 February 2021	470,363	0.01%
500,000	EUR	DNB Bank ASA FRN 08 March 2022	546,152	0.02%
121,000	EUR	SpareBank 1 SR Bank ASA 3.625% 24 March 2015	127,631	0.00%
480,000	EUR	SpareBank 1 SR Bank ASA 2.000% 14 May 2018	488,825	0.02%
480,000	EUR	Statkraft AS 2.500% 28 November 2022	482,261	0.01%
60,585	NOK	Statoil ASA	1,145,847	0.03%
80,197	NOK	Telenor ASA	1,224,328	0.04%
		ノルウェー合計	6,907,007	0.21%
		ポルトガル		
156,349	EUR	Galp Energia SGPS SA	1,838,664	0.06%
36,888	EUR	Jeronimo Martins SGPS SA	538,565	0.02%
		ポルトガル合計	2,377,229	0.08%
		ロシア		
3,176,843	USD	Gazprom OAO	22,743,388	0.69%
355,454	USD	Lukoil OAO	17,915,376	0.54%
247,498	USD	Magnit OJSC	7,510,768	0.23%
449,787	USD	MMC Norilsk Nickel OJSC	6,273,365	0.19%
63,875	USD	NovaTek OAO	5,791,033	0.18%
1,876,955	USD	Rosneft OAO	12,656,098	0.38%
1,462,320	USD	Sberbank of Russia	13,611,808	0.41%
128,638	USD	Uralkali OJSC	3,719,757	0.11%
1,159,799	USD	VTB Bank OJSC	3,036,876	0.09%
		ロシア合計	93,258,469	2.82%
		シンガポール		
1,115,000	SGD	Ascendas Real Estate Investment Trust	1,637,786	0.05%
1,359,000	SGD	CapitalLand Ltd	3,116,415	0.09%
		シンガポール合計	4,754,201	0.14%
		超国家		
1,800,000	GBP	European Investment Bank 5.500% 15 April 2025	2,814,866	0.09%
1,475,000	GBP	European Investment Bank 5.625% 07 June 2032	2,417,105	0.07%
688,000	GBP	European Investment Bank 3.875% 08 June 2037	889,088	0.03%
1,605,000	GBP	European Investment Bank 5.000% 15 April 2039	2,481,169	0.08%
1,744,000	GBP	European Investment Bank 4.500% 07 March 2044	2,497,389	0.08%
		超国家合計	11,099,617	0.35%
		南アフリカ		
223,000	EUR	Edcon Pty Ltd 3.433% 15 June 2014	215,753	0.01%
250,000	EUR	Peermont Global Pty Ltd 7.750% 30 April 2014	246,875	0.01%
		南アフリカ合計	462,628	0.02%
		韓国		
501	KRW	Samsung Electronics Co Ltd	539,018	0.02%
		韓国合計	539,018	0.02%
		スペイン		
500,000	EUR	Altadis Emisiones Financieras SAU 4.000% 11 December 2015	541,691	0.02%
900,000	EUR	Amadeus Capital Markets SA 4.875% 15 July 2016	986,376	0.03%
68,023	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	473,440	0.01%
50,000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.250% 30 March 2015	51,820	0.00%
600,000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 3.500% 05 December 2017	601,611	0.02%
121,000	EUR	Banco de Sabadell SA	238,975	0.01%
296,000	EUR	Banco Popular Espanol SA	173,456	0.01%
400,000	EUR	Bankia SA 3.500% 13 November 2014	389,826	0.01%
800,000	EUR	BBVA Senior Finance SAU 3.250% 23 April 2015	800,137	0.02%
85,000	EUR	Campofrio Food Group SA 8.250% 31 October 2016	91,378	0.00%
400,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 5.625% 09 February 2017	449,222	0.01%
250,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 4.125% 26 January 2018	265,459	0.01%

100,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 5.000% 13 February 2018	110,224	0.00%
500,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 5.375% 24 May 2019	557,764	0.02%
300,000	EUR	Gas Natural Capital Markets SA 6.000% 27 January 2020	343,082	0.01%
73,843	EUR	Grifols SA	1,920,061	0.06%
3,692	EUR	Grifols S.A. Eur0.10	70,517	0.00%
3	EUR	Grifols S.A. - Rights 03 January 2013	3	0.00%
100,000	EUR	Iberdrola Finanzas SAU 7.500% 25 November 2015	115,412	0.00%
100,000	EUR	Iberdrola Finanzas SAU 4.625% 07 April 2017	109,148	0.00%
300,000	EUR	Iberdrola Finanzas SAU 4.125% 23 March 2020	323,868	0.01%
1,000,000	GBP	Iberdrola Finanzas SAU 6.000% 01 July 2022	1,302,438	0.04%
13,332	EUR	Inditex SA	1,406,526	0.04%
200,000	EUR	Obrascon Huarte Lain SA 7.375% 28 April 2015	215,214	0.01%
1,000,000	EUR	Santander International Debt SAU 3.500% 12 August 2014	1,012,279	0.03%
500,000	EUR	Santander International Debt SAU 4.500% 18 May 2015	517,115	0.02%
650,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.431% 03 February 2014	676,832	0.02%
300,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.967% 03 February 2016	324,308	0.01%
200,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.496% 01 April 2016	219,764	0.01%
400,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 5.811% 05 September 2017	454,482	0.01%
150,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 3.661% 18 September 2017	156,696	0.01%
1,092,000	GBP	Telefonica Emisiones SAU 5.375% 02 February 2018	1,411,176	0.04%
100,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.797% 21 February 2018	109,527	0.00%
250,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.693% 11 November 2019	273,162	0.01%
400,000	EUR	Telefonica Emisiones SAU 4.710% 20 January 2020	433,533	0.01%
200,000	GBP	Telefonica Emisiones SAU 5.289% 09 December 2022	247,455	0.01%
		スペイン合計	17,373,977	0.52%
		スウェーデン		
42,493	SEK	Africa Oil Corp	226,175	0.01%
400,000	EUR	Akzo Nobel Sweden Finance AB 7.750% 31 January 2014	429,343	0.01%
141,480	SEK	Elekta AB	1,670,878	0.05%
570,000	EUR	Investor AB 4.875% 18 November 2021	699,256	0.02%
41,709	SEK	Investment AB Kinnevik	659,206	0.02%
49,982	SEK	Lundin Petroleum AB	870,296	0.03%
400,000	EUR	Norcell Sweden Holding 2 AB 10.750% 29 September 2019	434,000	0.01%
259,000	EUR	Nordea Bank AB 2.750% 11 August 2015	272,648	0.01%
200,000	EUR	Nordea Bank AB 3.625% 11 February 2016	216,962	0.01%
440,000	EUR	Nordea Bank AB FRN 10 September 2018	452,175	0.01%
181,000	EUR	Nordea Bank AB 4.000% 29 June 2020	208,321	0.01%
259,000	EUR	Nordea Bank AB 4.000% 29 March 2021	280,238	0.01%
320,000	EUR	Nordea Bank AB FRN 15 February 2022	346,584	0.01%
440,000	EUR	Nordea Bank AB 3.250% 05 July 2022	478,288	0.01%
47,485	SEK	Sandvik AB	572,412	0.02%
420,000	EUR	Sandvik AB 6.875% 25 February 2014	449,957	0.01%
1,000,000	GBP	Skandinaviska Enskilda Banken AB 6.625% 09 July 2014	1,319,999	0.04%
242,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB 2.500% 01 September 2015	252,867	0.01%
350,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB 3.750% 19 May 2016	381,840	0.01%
490,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.875% 14 November 2019	494,121	0.02%
280,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 12 September 2022	296,853	0.01%
59,765	SEK	Svenska Cellulosa AB	981,472	0.03%
28,932	SEK	Svenska Handelsbanken AB	783,116	0.02%
500,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 1.500% 06 July 2015	509,699	0.02%
250,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 3.625% 16 February 2016	271,858	0.01%
460,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 2.250% 14 June 2018	482,966	0.01%
200,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB 4.375% 20 October 2021	236,683	0.01%
100,269	SEK	Swedbank AB	1,483,140	0.04%
183,000	EUR	Swedbank AB 3.375% 09 February 2017	199,061	0.01%
1,760,000	SEK	Sweden Government Bond 3.500% 01 December 2015	278,652	0.01%
43,460,000	SEK	Sweden Government Bond 0.250% 01 June 2022	5,232,694	0.16%
13,480,000	SEK	Sweden Government Bond 3.500% 01 December 2028	2,923,856	0.09%
27,412	SEK	Swedish Match AB	696,638	0.02%
64,828	SEK	Tele2 AB	884,161	0.03%

580,000	EUR	TeliaSonera AB 3.625% 14 February 2024	643,576	0.02%
106,000	EUR	TeliaSonera AB 3.875% 01 October 2025	121,061	0.00%
220,000	EUR	TeliaSonera AB 3.000% 07 September 2027	226,533	0.01%
61,000	EUR	Vattenfall AB 4.250% 19 May 2014	64,126	0.00%
61,000	EUR	Vattenfall AB 6.250% 17 March 2021	81,448	0.00%
1,014,000	GBP	Vattenfall AB 6.875% 15 April 2039	1,781,935	0.05%
146,961	SEK	Volvo AB	1,519,941	0.05%
103,000	EUR	Volvo Treasury AB 9.875% 27 February 2014	113,705	0.00%
		スウェーデン合計	30,528,740	0.93%
		スイス		
16,226	USD	ACE Ltd	969,710	0.03%
6,531	EUR	Aryzta AG	254,709	0.01%
542,000	EUR	Credit Suisse AG/Guernsey 2.875% 24 September 2015	571,670	0.02%
163,000	EUR	Credit Suisse AG/London 3.875% 25 January 2017	181,083	0.01%
59,141	CHF	Nestle SA	2,919,449	0.09%
52,986	CHF	Novartis AG	2,521,257	0.08%
14,939	CHF	Swiss Re AG	815,404	0.02%
9,577	CHF	Syngenta AG	2,907,956	0.09%
55,096	CHF	UBS AG	651,193	0.02%
458,000	EUR	UBS AG/Jersey FRN 25 September 2018	459,211	0.01%
109,000	EUR	UBS AG/Jersey FRN 16 September 2019	111,813	0.00%
7,015	CHF	Zurich Insurance Group AG	1,414,212	0.04%
		スイス合計	13,777,667	0.42%
		トルコ		
23,098	TRY	Koza Altin Isletmeleri AS	422,009	0.01%
		トルコ合計	422,009	0.01%
		アラブ首長国連邦		
320,000	EUR	IPIC GMTN Ltd 2.375% 30 May 2018	328,838	0.01%
460,000	EUR	Xstrata Finance Dubai Ltd 1.500% 19 May 2016	459,235	0.01%
		アラブ首長国連邦合計	788,073	0.02%
		英国		
218,000	GBP	Abbey National Treasury Services Plc/London 5.500% 18 June 2014	280,851	0.01%
440,000	EUR	Abbey National Treasury Services Plc/London 3.375% 20 October 2015	467,762	0.01%
358,276	GBP	Aberdeen Asset Management Plc	1,611,750	0.05%
350,000	GBP	ABP Finance Plc 6.250% 14 December 2026	478,848	0.01%
557,557	GBP	Afren Plc	895,752	0.03%
123,000	GBP	Anglian Water Osprey Financing Plc 7.000% 31 January 2018	164,729	0.01%
180,000	GBP	Anglian Water Services Financing Plc 5.250% 30 October 2015	243,117	0.01%
143,000	EUR	Anglian Water Services Financing Plc 6.250% 27 June 2016	169,586	0.01%
27,680	GBP	Anglo American Plc	642,453	0.02%
400,000	GBP	Arkle Master Issuer Plc 4.681% 17 February 2017	547,617	0.02%
163,579	GBP	ARM Holdings Plc	1,539,517	0.05%
124,686	GBP	Ashtead Group Plc	651,371	0.02%
43,494	GBP	ASOS Plc	1,434,296	0.04%
95,047	GBP	Associated British Foods Plc	1,821,674	0.06%
77,869	GBP	AstraZeneca Plc	2,776,378	0.08%
20,375	GBP	Aveva Group Plc	544,814	0.02%
448,207	GBP	Aviva Plc	2,048,722	0.06%
37,000	EUR	Aviva Plc FRN 28 November 2014	36,068	0.00%
380,000	EUR	Aviva Plc FRN 29 September 2015	377,156	0.01%
200,000	EUR	Aviva Plc FRN 02 October 2023	201,399	0.01%
850,000	GBP	Aviva Plc FRN 14 November 2036	1,082,673	0.03%
850,000	GBP	Aviva Plc FRN 03 June 2041	1,097,869	0.03%
260,000	GBP	Aviva Plc FRN 2022/29/29	301,780	0.01%
150,000	GBP	AWG Parent Co Ltd/UK 6.625% 15 January 2029	249,378	0.01%

203,634	GBP	Babcock International Group Plc	2,409,340	0.07%
250,000	GBP	Bank of Scotland Plc 1.835% 24 March 2016	394,641	0.01%
224,000	EUR	Barclays Bank Plc 5.250% 27 May 2014	238,130	0.01%
130,000	EUR	Barclays Bank Plc 4.125% 15 March 2016	142,859	0.00%
380,000	EUR	Barclays Bank Plc 4.000% 20 January 2017	422,991	0.01%
350,000	GBP	Barclays Bank Plc FRN 15 December 2017	368,466	0.01%
175,000	EUR	Barclays Bank Plc FRN 04 March 2019	177,215	0.01%
463,000	GBP	Barclays Bank Plc FRN 15 June 2019	759,096	0.02%
109,000	EUR	Barclays Bank Plc 6.000% 14 January 2021	123,704	0.00%
550,000	GBP	Barclays Bank Plc 10.000% 21 May 2021	908,358	0.03%
1,377,000	GBP	Barclays Bank Plc 5.750% 17 August 2021	2,049,822	0.06%
150,000	EUR	Barclays Bank Plc 6.625% 30 March 2022	177,516	0.01%
2,490,000	USD	Barclays Bank Plc 7.625% 21 November 2022	1,891,443	0.06%
1,089,812	GBP	Barclays Plc	3,504,379	0.11%
55,000	EUR	BAT International Finance Plc 5.875% 12 March 2015	61,035	0.00%
250,000	EUR	BAT International Finance Plc 3.625% 09 November 2021	279,126	0.01%
1,050,000	GBP	BAT International Finance Plc 6.000% 29 June 2022	1,602,054	0.05%
331,000	GBP	BAT International Finance Plc 5.750% 05 July 2040	496,206	0.02%
83,798	GBP	Bellway Plc	1,061,817	0.03%
117,292	GBP	Berkeley Group Holdings Plc	2,525,432	0.08%
240,000	EUR	BG Energy Capital Plc 3.000% 16 November 2018	261,087	0.01%
338,657	GBP	BG Group Plc	4,201,948	0.13%
188,655	GBP	BHP Billiton Plc	4,923,133	0.15%
600,000	GBP	BMW UK Capital Plc 5.000% 02 October 2017	834,141	0.03%
628,300	GBP	Booker Group Plc	751,856	0.02%
200,000	EUR	Boparan Finance Plc 9.750% 30 April 2018	227,500	0.01%
109,000	EUR	BP Capital Markets Plc 3.100% 07 October 2014	113,935	0.00%
1,594,012	GBP	BP Plc	8,297,967	0.25%
450,000	EUR	Brambles Finance Plc 4.625% 20 April 2018	520,096	0.02%
135,341	GBP	British American Tobacco Plc	5,176,292	0.16%
376,848	GBP	British Land Co Plc	2,595,363	0.08%
783,000	EUR	British Telecommunications Plc 6.125% 11 July 2014	845,393	0.03%
1,150,000	GBP	British Telecommunications Plc 8.500% 07 December 2016	1,751,461	0.05%
63,858	GBP	Britvic Plc	318,419	0.01%
990,351	GBP	BT Group Plc	2,804,689	0.09%
80,370	GBP	Burberry Group Plc	1,207,480	0.04%
279,156	GBP	Capital & Counties Properties Plc	827,862	0.02%
385,201	GBP	Centrica Plc	1,574,741	0.05%
363,000	GBP	Centrica Plc 4.375% 13 March 2029	479,463	0.01%
97,208	GBP	Close Brothers Group Plc	1,028,036	0.03%
292,842	GBP	Compass Group Plc	2,601,758	0.08%
363,000	GBP	Compass Group Plc 7.000% 08 December 2014	493,643	0.02%
700,000	EUR	Coventry Building Society 2.250% 04 December 2017	714,665	0.02%
51,872	GBP	Croda International Plc	1,510,341	0.05%
90,000	GBP	Delamare Finance Plc 5.546% 19 February 2029	126,305	0.00%
64,532	GBP	Derwent London Plc	1,665,440	0.05%
226,483	GBP	Diageo Plc	4,959,704	0.15%
80,000	GBP	Dignity Finance Plc 8.151% 31 December 2030	139,687	0.00%
310,000	GBP	Direct Line Insurance Group Pl Var 9.250% 27 April 2042	447,730	0.01%
1,267,320	GBP	DS Smith Plc	3,177,514	0.10%
235,177	GBP	easyJet Plc	2,206,153	0.07%
169,000	EUR	EC Finance Plc 9.750% 01 August 2017	185,689	0.01%
399,000	GBP	Enterprise Inns Plc 6.500% 06 December 2018	477,992	0.01%
601,000	GBP	Eversholt Funding Plc 6.359% 02 December 2025	913,405	0.03%
100,000	GBP	Experian Finance Plc 5.625% 12 December 2013	127,508	0.00%
238,000	GBP	Experian Finance Plc 4.750% 23 November 2018	327,018	0.01%
470,000	EUR	Experian Finance Plc 4.750% 04 February 2020	557,442	0.02%
350,000	EUR	FCE Bank Plc 7.125% 15 January 2013	352,373	0.01%
250,000	EUR	FCE Bank Plc 7.250% 15 July 2013	257,531	0.01%
100,000	EUR	FCE Bank Plc 9.375% 17 January 2014	108,328	0.00%
300,000	EUR	FCE Bank Plc 4.750% 19 January 2015	319,375	0.01%
150,000	GBP	FCE Bank Plc 5.125% 16 November 2015	197,962	0.01%

400,000	EUR	FCE Bank Plc 2.875% 03 October 2017	414,322	0.01%
99,888	GBP	Fenner Plc	485,102	0.01%
40,000	GBP	First Hydro Finance Plc 9.000% 31 July 2021	61,027	0.00%
380,000	EUR	G4S International Finance Plc 2.875% 02 May 2017	392,857	0.01%
200,000	EUR	G4S International Finance Plc 2.625% 06 December 2018	200,041	0.01%
200,000	EUR	G4S International Finance Plc 2.625% 06 December 2018	200,041	0.01%
149,000	GBP	G4S Plc 7.750% 13 May 2019	224,953	0.01%
270,000	GBP	Gala Electric Casinos Plc 11.500% 01 June 2019	324,264	0.01%
101,711	GBP	Galliford Try Plc	927,335	0.03%
1,025,906	GBP	GKN Plc	2,876,467	0.09%
100,000	GBP	GKN Holdings Plc 5.375% 19 September 2022	127,651	0.00%
200,000	EUR	GlaxoSmithKline Capital Inc 4.000% 16 June 2025	234,917	0.01%
378,159	GBP	GlaxoSmithKline Plc	6,186,590	0.19%
703,000	GBP	Go-Ahead Group Plc 5.375% 29 September 2017	943,931	0.03%
268,412	GBP	Grainger Plc	390,106	0.01%
371,714	GBP	Great Portland Estates Plc	2,227,933	0.07%
200,000	GBP	Great Rolling Stock Co Plc 6.500% 05 April 2031	306,918	0.01%
150,027	GBP	Greene King Plc	1,149,985	0.03%
307,283	GBP	Hammerson Plc	1,838,742	0.06%
758,000	EUR	Hammerson Plc 4.875% 19 June 2015	830,093	0.03%
400,000	EUR	Hammerson Plc 2.750% 26 September 2019	412,899	0.01%
750,000	GBP	Hammerson Plc 6.000% 23 February 2026	1,112,692	0.03%
770,000	GBP	Heathrow Finance Plc 5.375% 02 September 2019	957,750	0.03%
200,000	GBP	House of Fraser Funding Plc 8.875% 15 August 2018	257,180	0.01%
1,105,994	GBP	Howden Joinery Group Plc	2,343,383	0.07%
419,000	EUR	HSBC Bank Plc 3.875% 24 October 2018	476,977	0.01%
1,629,406	GBP	HSBC Holdings Plc	12,917,012	0.39%
283,000	EUR	HSBC Holdings Plc 6.000% 10 June 2019	342,910	0.01%
500,000	GBP	HSBC Holdings Plc FRN 18 October 2022	682,060	0.02%
1,400,000	GBP	HSBC Holdings Plc 7.000% 07 April 2038	2,234,915	0.07%
937,000	GBP	HSBC Holdings Plc 6.000% 29 March 2040	1,365,696	0.04%
192,431	GBP	IMI Plc	2,586,886	0.08%
323,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 7.250% 15 September 2014	357,175	0.01%
616,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 8.375% 17 February 2016	748,253	0.02%
300,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 5.500% 22 November 2016	414,403	0.01%
280,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 4.500% 05 July 2018	320,452	0.01%
177,000	EUR	Imperial Tobacco Finance Plc 5.000% 02 December 2019	210,790	0.01%
185,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 9.000% 17 February 2022	322,264	0.01%
463,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 8.125% 15 March 2024	781,469	0.02%
340,000	GBP	Imperial Tobacco Finance Plc 5.500% 28 September 2026	487,442	0.02%
125,214	GBP	Imperial Tobacco Group Plc	3,641,214	0.11%
299,747	GBP	Inchcape Plc	1,582,803	0.05%
200,000	EUR	Ineos Finance Plc 9.250% 15 May 2015	215,000	0.01%
241,000	GBP	Infinis Plc 9.125% 15 December 2014	305,667	0.01%
123,669	GBP	Inmarsat Plc	885,811	0.03%
1,125,909	GBP	ITV Plc	1,451,492	0.04%
124,531	GBP	J Sainsbury Plc	526,645	0.02%
400,000	GBP	Jaguar Land Rover Plc 8.125% 15 May 2018	542,820	0.02%
220,000	GBP	Jaguar Land Rover Plc 8.250% 15 March 2020	299,727	0.01%
34,703	GBP	Johnson Matthey Plc	1,010,437	0.03%
310,000	EUR	Kerling Plc 10.625% 01 February 2017	299,925	0.01%
24,173	GBP	Kier Group Plc	392,798	0.01%
441,969	GBP	Kingfisher Plc	1,538,717	0.05%
292,000	GBP	Land Securities Capital Markets Plc FRN 07 November 2019	406,289	0.01%
335,612	GBP	Land Securities Group Plc	3,345,728	0.10%
940,000	GBP	LBG Capital No.1 Plc 11.040% 19 March 2020	1,350,630	0.04%
363,000	GBP	LBG Capital No.1 Plc 7.869% 25 August 2020	474,309	0.01%
370,000	GBP	LBG Capital No.2 Plc 15.000% 21 December 2019	607,118	0.02%
1,469,479	GBP	Legal & General Group Plc	2,621,926	0.08%
76,000	GBP	Legal & General Group Plc FRN 01 April 2019	97,130	0.00%
307,000	EUR	Legal & General Group Plc FRN 08 June 2025	304,383	0.01%

7,394,865	GBP	Lloyds Banking Group Plc	4,342,075	0.13%
16,000	EUR	Lloyds Banking Group Plc 5.875% 08 July 2014	16,965	0.00%
270,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 4.500% 15 September 2014	287,140	0.01%
206,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 3.750% 07 September 2015	220,956	0.01%
319,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 6.375% 17 June 2016	374,371	0.01%
645,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc FRN 05 March 2018	625,334	0.02%
363,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc 6.750% 24 October 2018	544,117	0.02%
270,000	EUR	Lloyds TSB Bank Plc 6.500% 24 March 2020	309,147	0.01%
617,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc FRN 16 December 2021	898,694	0.03%
1,200,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc 7.500% 15 April 2024	1,961,405	0.06%
278,000	GBP	Lloyds TSB Bank Plc FRN 09 July 2025	329,956	0.01%
490,000	GBP	London Stock Exchange Group Plc 9.125% 18 October 2019	787,358	0.02%
323,030	GBP	Marks & Spencer Group Plc	1,513,362	0.05%
573,000	GBP	Marks & Spencer Plc 5.625% 24 March 2014	733,038	0.02%
417,000	GBP	Marks & Spencer Plc 6.125% 02 December 2019	585,267	0.02%
190,000	GBP	Marks & Spencer Plc 4.750% 12 June 2025	236,836	0.01%
275,000	GBP	Matalan Finance Plc 8.875% 29 April 2016	351,742	0.01%
385,000	GBP	Matalan Finance Plc 9.625% 31 March 2017	467,080	0.01%
208,565	GBP	Melrose Industries Plc	571,235	0.02%
100,019	GBP	Micro Focus International Plc	713,347	0.02%
53,947	GBP	Mitchells & Butlers Finance Plc 5.965% 15 December 2023	71,459	0.00%
73,000	GBP	Mitchells & Butlers Finance Plc 6.469% 15 September 2030	86,024	0.00%
492,000	EUR	Mondi Finance Plc 5.750% 03 April 2017	565,766	0.02%
530,000	EUR	Mondi Finance Plc 3.375% 28 September 2020	549,160	0.02%
149,000	GBP	Motability Operations Group Plc 5.250% 28 September 2016	206,273	0.01%
390,000	EUR	Motability Operations Group Plc 3.250% 30 November 2018	426,242	0.01%
149,000	GBP	Motability Operations Group Plc 6.625% 10 December 2019	231,055	0.01%
104,589	GBP	National Express Group Plc	261,592	0.01%
241,000	GBP	National Express Group Plc 6.250% 13 January 2017	328,770	0.01%
900,000	GBP	National Express Group Plc 6.625% 17 June 2020	1,283,894	0.04%
153,000	GBP	National Grid Electricity Transmission Plc 7.375% 13 January 2031	266,794	0.01%
93,000	GBP	National Grid Gas Plc 4.188% 14 December 2022	226,287	0.01%
1,000,000	GBP	National Grid Gas Plc 7.000% 16 December 2024	1,651,488	0.05%
650,000	EUR	National Grid Plc 6.500% 22 April 2014	698,103	0.02%
97,000	EUR	National Grid Plc 5.000% 02 July 2018	115,418	0.00%
300,000	EUR	National Grid Plc 4.375% 10 March 2020	351,358	0.01%
70,000	GBP	National Westminster Bank Plc 7.875% 09 September 2015	94,505	0.00%
426,000	EUR	Nationwide Building Society 3.750% 20 January 2015	450,825	0.01%
742,000	EUR	Nationwide Building Society 3.125% 03 April 2017	800,696	0.02%
807,000	GBP	Nationwide Building Society 5.625% 09 September 2019	1,165,169	0.04%
822,000	EUR	Nationwide Building Society 6.750% 22 July 2020	965,044	0.03%
520,000	GBP	Nationwide Building Society FRN 06 February 2026	558,980	0.02%
313,000	GBP	Network Rail Infrastructure Finance Plc 1.750% 22 November 2027	579,723	0.02%
879,000	GBP	Network Rail Infrastructure Finance Plc 1.375% 22 November 2037	1,611,743	0.05%
690,000	USD	Nord Anglia Education UK Holdings Plc 10.250% 01 April 2017	582,227	0.02%
73,000	GBP	Northern Gas Networks Finance Plc 5.875% 08 July 2019	106,694	0.00%
198,000	GBP	Northumbrian Water Finance Plc 5.625% 29 April 2033	293,135	0.01%
300,000	GBP	Old Mutual Plc 8.000% 03 June 2021	401,020	0.01%
111,719	GBP	Persimmon Plc	1,095,248	0.03%
200,000	GBP	Phones4u Finance Plc 9.500% 01 April 2018	256,580	0.01%
239,074	GBP	Prudential Plc	2,535,683	0.08%
216,480	GBP	Punch Taverns Finance Plc 6.820% 15 July 2020	260,477	0.01%
80,000	GBP	Punch Taverns Finance Plc 7.567% 15 April 2026	46,077	0.00%
24,966	GBP	Reckitt Benckiser Group Plc	1,186,764	0.04%
190,433	GBP	Restaurant Group Plc	902,894	0.03%
365,000	EUR	Rexam Plc 4.375% 15 March 2013	367,091	0.01%
616,000	EUR	Rexam Plc FRN 29 June 2067	646,800	0.02%
35,017	GBP	Rightmove Plc	616,210	0.02%

156,764	GBP	Rio Tinto Plc	6,745,818	0.21%
400,000	EUR	Rio Tinto Finance Plc 2.000% 11 May 2020	406,436	0.01%
320,000	GBP	Rio Tinto Finance Plc 4.000% 11 December 2029	395,921	0.01%
300,000	GBP	RL Finance Bonds Plc FRN 15 December 2015	325,789	0.01%
17,162,548	GBP	Rolls-Royce Holdings Plc - C Shares	21,032	0.00%
225,823	GBP	Rolls-Royce Holdings Plc	2,417,278	0.07%
538,000	EUR	Royal Bank of Scotland Group Plc 5.250% 15 May 2013	546,923	0.02%
79,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 6.000% 10 May 2013	80,312	0.00%
600,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 4.750% 18 May 2016	667,845	0.02%
667,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 4.875% 20 January 2017	755,642	0.02%
337,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 5.375% 30 September 2019	403,166	0.01%
121,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc 5.500% 23 March 2020	146,304	0.00%
369,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc FRN 22 September 2021	352,365	0.01%
300,000	GBP	Royal Bank of Scotland Plc/The 6.375% 29 April 2014	390,851	0.01%
85,000	EUR	Royal Bank of Scotland Plc/The 5.750% 21 May 2014	90,561	0.00%
1,245,000	GBP	Royal Bank of Scotland Plc/The 6.625% 17 September 2018	1,847,799	0.06%
240,000	GBP	Royal Bank of Scotland Plc/The 7.500% 29 April 2024	390,925	0.01%
517,345	GBP	Royal Dutch Shell Plc	13,578,291	0.41%
1,016,593	GBP	RSA Insurance Group Plc	1,565,950	0.05%
500,000	GBP	RSA Insurance Group Plc FRN 20 May 2039	785,941	0.02%
24,117	GBP	SABMiller Plc	834,906	0.03%
518,000	EUR	SABMiller Plc 4.500% 20 January 2015	557,424	0.02%
677,000	GBP	Scottish Widows Plc FRN 24 September 2015	752,903	0.02%
173,000	GBP	Segro Plc 6.250% 30 September 2015	234,784	0.01%
200,000	GBP	Segro Plc 5.500% 20 June 2018	274,493	0.01%
280,000	GBP	Segro Plc 6.000% 30 September 2019	401,286	0.01%
841,000	GBP	Segro Plc 6.750% 23 November 2021	1,261,674	0.04%
419,000	GBP	Segro Plc 6.750% 23 February 2024	629,016	0.02%
203,000	GBP	Severn River Crossing Plc 6.125% 30 June 2013	458,193	0.01%
249,000	GBP	Severn Trent Utilities Finance Plc 6.125% 26 February 2024	379,071	0.01%
945,000	GBP	Silverstone Master Issuer Plc 5.063% 21 October 2016	1,304,751	0.04%
1,000,000	GBP	South Eastern Power Networks Plc 5.500% 05 June 2026	1,456,166	0.04%
1,200,000	GBP	Southern Electric Power Distribution Plc 5.500% 07 June 2032	1,789,214	0.05%
350,000	GBP	Southern Gas Networks Plc 4.875% 05 October 2023	489,831	0.02%
56,530	GBP	Spectris Plc	1,419,438	0.04%
1,381,000	EUR	SSE Plc FRN 01 October 2015	1,433,518	0.04%
323,000	GBP	SSE Plc 5.000% 01 October 2018	453,919	0.01%
500,000	GBP	SSE Plc 6.250% 27 August 2038	799,788	0.02%
350,000	EUR	SSE Plc FRN 29 September 2049	371,967	0.01%
318,269	GBP	Stagecoach Group Plc	1,198,150	0.04%
200,000	GBP	Standard Chartered Bank FRN 11 May 2016	274,110	0.01%
186,695	GBP	Standard Chartered Plc	3,599,938	0.11%
204,000	EUR	Standard Chartered Plc 5.750% 30 April 2014	217,641	0.01%
409,493	GBP	SVG Capital Plc	1,444,720	0.04%
165,630	GBP	Telecity Group Plc	1,596,369	0.05%
48,957	GBP	Telereal Securitisation Plc 5.565% 10 December 2031	71,478	0.00%
125,000	GBP	Tesco Plc FRN 24 March 2036	193,754	0.01%
150,000	EUR	Thomas Cook Group Plc 6.750% 22 June 2015	128,303	0.00%
241,426	GBP	Tullow Oil Plc	3,730,738	0.11%
53,935	GBP	Unilever Plc	1,563,799	0.05%
730,000	GBP	Unilever Plc 4.750% 16 June 2017	1,022,580	0.03%
600,000	GBP	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30 March 2021	705,859	0.02%
300,000	GBP	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28 March 2024	302,398	0.01%
115,933	GBP	United Kingdom Gilt 5.000% 07 March 2018	171,337	0.00%
20,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.500% 16 August 2013	68,704	0.00%
894,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2017	1,587,373	0.05%
1,374,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.500% 16 April 2020	6,267,491	0.19%
1,906,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.875% 22 November 2022	3,575,008	0.11%

965,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22 March 2024	1,295,474	0.04%
859,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.500% 17 July 2024	3,574,312	0.11%
577,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2027	1,111,373	0.03%
4,044,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22 March 2029	5,365,889	0.16%
1,134,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 4.125% 22 July 2030	4,417,730	0.13%
2,153,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2032	3,795,342	0.12%
3,195,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.750% 22 March 2034	4,803,197	0.15%
1,470,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 2.000% 26 January 2035	3,639,392	0.11%
2,230,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.125% 22 November 2037	4,218,505	0.13%
1,876,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 22 March 2040	2,979,754	0.09%
1,224,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.625% 22 November 2042	2,008,165	0.06%
179,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22 March 2044	219,879	0.01%
1,961,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.750% 22 November 2047	3,437,475	0.10%
2,892,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.500% 22 March 2050	4,593,880	0.14%
498,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.250% 22 March 2052	636,632	0.02%
3,451,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 1.250% 22 November 2055	7,897,574	0.24%
2,436,000	GBP	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.375% 22 March 2062	3,462,963	0.11%
234,749	GBP	United Utilities Group Plc	1,937,478	0.06%
113,000	EUR	United Utilities Water Plc 4.250% 24 January 2020	130,105	0.00%
1,200,000	GBP	United Utilities Water Plc 5.625% 20 December 2027	1,781,184	0.05%
139,000	GBP	Virgin Media Finance Plc 8.875% 15 October 2019	194,549	0.01%
70,000	GBP	Virgin Media Secured Finance Plc 7.000% 15 January 2018	92,991	0.00%
4,204,844	GBP	Vodafone Group Plc	7,958,539	0.24%
116,000	EUR	Vodafone Group Plc 6.250% 15 January 2016	135,059	0.00%
743,000	GBP	Vodafone Group Plc 5.375% 05 December 2017	1,059,535	0.03%
47,301	GBP	Weir Group Plc	1,089,163	0.03%
909,000	GBP	Western Power Distribution West Midlands Plc 5.750% 16 April 2032	1,323,920	0.04%
73,306	GBP	Whitbread Plc	2,198,210	0.07%
229,000	GBP	William Hill Plc 7.125% 11 November 2016	312,900	0.01%
266,732	GBP	Xstrata Plc	3,461,519	0.11%
		英国合計	364,226,689	11.09%
		米国		
1,195,000	USD	Accellent Inc 8.375% 01 February 2017	954,088	0.03%
480,000	USD	Access Midstream Partners LP / ACMP Finance Corp 4.875% 15 May 2023	370,518	0.01%
944,000	USD	Accuride Corp 9.500% 01 August 2018	692,966	0.02%
24,357	USD	Acuity Brands Inc	1,220,069	0.04%
1,182,000	USD	Aleris International Inc 7.625% 15 February 2018	912,401	0.03%
480,000	USD	Alliance Data Systems Corp 6.375% 01 April 2020	383,232	0.01%
2,030,000	USD	Alliance One International Inc 10.000% 15 July 2016	1,632,275	0.05%
74,817	USD	Altria Group Inc	1,760,312	0.05%
164,000	USD	Altria Group Inc 4.125% 11 September 2015	134,797	0.00%
49,000	USD	Altria Group Inc 9.700% 10 November 2018	51,983	0.00%
77,000	USD	Altria Group Inc 9.250% 06 August 2019	81,330	0.00%
250,000	USD	Altria Group Inc 4.750% 05 May 2021	215,317	0.01%
433,000	USD	Altria Group Inc 2.850% 09 August 2022	325,880	0.01%
224,000	USD	Altria Group Inc 10.200% 06 February 2039	286,310	0.01%
534,000	USD	AMC Entertainment Inc 8.750% 01 June 2019	449,583	0.01%
2,200,000	USD	AMC Entertainment Inc 9.750% 01 December 2020	1,931,296	0.06%

463,000	USD	American Axle & Manufacturing Inc 7.750% 15 November 2019	381,923	0.01%
1,442,000	USD	American Axle & Manufacturing Inc 6.625% 15 October 2022	1,113,099	0.03%
12,889	USD	Amgen Inc	831,440	0.03%
210,000	EUR	Amgen Inc 4.375% 05 December 2018	244,715	0.01%
390,000	EUR	Amgen Inc 2.125% 13 September 2019	399,354	0.01%
7,038	USD	Anadarko Petroleum Corp 15 July 2016	385,138	0.01%
7,866	USD	Apple Inc	3,032,422	0.09%
696,000	USD	Apria Healthcare Group Inc 11.250% 01 November 2014	545,811	0.02%
37,418	USD	Arthur J Gallagher & Co	976,091	0.03%
20,994	USD	AT&T Inc	529,381	0.02%
950,000	GBP	AT&T Inc 5.875% 28 April 2017	1,353,386	0.04%
440,000	EUR	AT&T Inc 3.550% 17 December 2032	460,788	0.01%
315,000	USD	Atlas Pipeline Partners LP / Atlas Pipeline Finance Corp 8.750% 15 June 2018	255,072	0.01%
734,000	USD	Atwood Oceanics Inc 6.500% 01 February 2020	599,913	0.02%
64,824	USD	AvalonBay Communities Inc	6,572,704	0.20%
540,000	USD	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc 9.625% 15 March 2018	457,699	0.01%
860,000	USD	B/E Aerospace Inc 5.250% 01 April 2022	693,133	0.02%
250,000	EUR	Bank of America Corp 5.125% 26 September 2014	267,140	0.01%
1,150,000	EUR	Bank of America Corp 7.000% 15 June 2016	1,362,878	0.04%
750,000	EUR	Bank of America Corp 4.750% 03 April 2017	845,711	0.03%
150,000	EUR	Bank of America Corp 4.625% 07 August 2017	169,271	0.01%
400,000	EUR	Bank of America Corp FRN 28 March 2018	374,042	0.01%
650,000	GBP	Bank of America Corp 6.125% 15 September 2021	938,849	0.03%
23,873	USD	Baxter International Inc	1,184,985	0.04%
29,530	USD	Beam Inc	1,341,976	0.04%
450,000	USD	Beazer Homes USA Inc 8.125% 15 June 2016	364,388	0.01%
1,180,000	USD	Beazer Homes USA Inc 6.625% 15 April 2018	953,275	0.03%
1,122,000	USD	Beazer Homes USA Inc 9.125% 15 June 2018	891,560	0.03%
196,000	USD	Berry Plastics Corp 8.250% 15 November 2015	155,374	0.00%
585,000	USD	BI-LO LLC / BI-LO Finance Corp 9.250% 15 February 2019	475,919	0.01%
720,000	USD	Biomet Inc 6.500% 01 August 2020	580,978	0.02%
450,000	EUR	BMW US Capital LLC 1.250% 20 July 2016	455,502	0.01%
1,909,000	USD	Boise Paper Holdings LLC / Boise Co-Issuer Co 8.000% 01 April 2020	1,603,605	0.05%
30,524	USD	BorgWarner Inc 15 February 2020	1,618,146	0.05%
85,517	USD	Boston Properties Inc	6,791,439	0.21%
2,130,000	USD	Boyd Gaming Corp 9.000% 01 July 2020	1,595,817	0.05%
49,414	USD	Brookdale Senior Living Inc	908,708	0.03%
3,159,000	USD	Cablevision Systems Corp 8.625% 15 September 2017	2,800,060	0.09%
893,000	USD	Caesars Entertainment Operating Co Inc 11.250% 01 June 2017	727,332	0.02%
2,880,000	USD	Caesars Entertainment Operating Co Inc 9.000% 15 February 2020	2,195,866	0.07%
121,490	USD	Calpine Corp	1,631,950	0.05%
2,484,000	USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 7.875% 30 April 2018	2,032,572	0.06%
1,015,000	USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 7.375% 01 June 2020	856,464	0.03%
2,070,000	USD	CDW LLC / CDW Finance Corp 8.500% 01 April 2019	1,703,601	0.05%
383,000	GBP	Cellco Partnership / Verizon Wireless Capital LLC 8.875% 18 December 2018	642,139	0.02%
133,000	EUR	Cemex Finance LLC 9.625% 14 December 2017	143,973	0.00%
8,322	USD	Centurylink Inc	242,847	0.01%
200,000	USD	Centurylink Inc 6.875% 15 January 2028	156,789	0.01%
300,000	USD	CF Industries Inc 7.125% 01 May 2020	286,769	0.01%
2,189,000	USD	Chaparral Energy Inc 8.250% 01 September 2021	1,813,961	0.06%
94,007	USD	Charles Schwab Corp	1,005,953	0.03%
1,504,000	USD	Chesapeake Energy Corp 7.250% 15 December 2018	1,246,322	0.04%
385,000	USD	Chesapeake Energy Corp 6.875% 15 November 2020	317,218	0.01%
7,623	USD	Chevron Corp	614,101	0.02%

2,500,000	USD	Chrysler Group LLC / CG Co-Issuer Inc 8.250% 15 June 2021	2,097,693	0.06%
90,481	USD	Citigroup Inc	2,671,171	0.08%
494,000	EUR	Citigroup Inc 6.400% 27 March 2013	500,654	0.02%
652,000	EUR	Citigroup Inc 4.000% 26 November 2015	706,274	0.02%
500,000	EUR	Citigroup Inc 4.375% 30 January 2017	561,692	0.02%
200,000	EUR	Citigroup Inc FRN 31 May 2017	185,681	0.01%
200,000	EUR	Citigroup Inc FRN 30 November 2017	189,998	0.01%
400,000	GBP	Citigroup Inc 7.625% 03 April 2018	602,797	0.02%
675,000	GBP	Citigroup Inc 5.125% 12 December 2018	882,347	0.03%
317,000	EUR	Citigroup Inc FRN 10 February 2019	307,363	0.01%
820,000	EUR	Citigroup Inc 7.375% 04 September 2019	1,078,383	0.03%
729,000	GBP	Citigroup Inc 5.875% 01 July 2024	977,965	0.03%
1,200,000	GBP	Citigroup Inc 6.500% 16 August 2030	1,817,073	0.06%
321,000	GBP	Citigroup Inc 7.375% 01 September 2039	537,946	0.02%
2,294,816	USD	CityCenter Holdings LLC / CityCenter Finance Corp 10.750% 15 January 2017	1,901,649	0.06%
925,000	USD	Clear Channel Communications Inc 9.000% 01 March 2021	628,267	0.02%
1,692,000	USD	Clear Channel Worldwide Holdings Inc 7.625% 15 March 2020	1,296,080	0.04%
17,664	USD	CMS Energy Corp	321,494	0.01%
33,530	USD	Cobalt International Energy Inc	609,248	0.02%
120,000	USD	Concho Resources Inc 7.000% 15 January 2021	101,711	0.00%
950,000	USD	Concho Resources Inc 6.500% 15 January 2022	794,427	0.02%
735,000	USD	Concho Resources Inc 5.500% 01 October 2022	589,605	0.02%
1,613,000	USD	Continental Resources Inc/OK 5.000% 15 September 2022	1,321,389	0.04%
2,559,000	USD	Cricket Communications Inc 7.750% 15 October 2020	1,985,009	0.06%
116,000	USD	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp II 7.625% 15 May 2017	93,273	0.00%
225,000	USD	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp III 6.250% 01 February 2021	187,515	0.01%
4,460	USD	Cummins Inc	357,167	0.01%
600,000	USD	CVS Pass-Through Trust 9.350% 10 January 2023	524,499	0.02%
460,000	USD	DaVita HealthCare Partners Inc 5.750% 15 August 2022	368,134	0.01%
378,652	USD	DDR Corp	4,421,549	0.13%
2,585,000	USD	DeI Monte Corp 7.625% 15 February 2019	2,051,638	0.06%
603,000	USD	DineEquity Inc 9.500% 30 October 2018	520,794	0.02%
370,000	GBP	DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co Inc 4.375% 14 September 2029	455,801	0.01%
772,000	USD	DISH DBS Corp 7.875% 01 September 2019	695,967	0.02%
2,260,000	USD	DISH DBS Corp 6.750% 01 June 2021	1,962,589	0.06%
985,000	USD	DISH DBS Corp 5.875% 15 July 2022	807,855	0.02%
940,000	USD	DJO Finance LLC / DJO Finance Corp 7.750% 15 April 2018	686,473	0.02%
1,260,000	USD	DJO Finance LLC / DJO Finance Corp 9.875% 15 April 2018	989,298	0.03%
8,902	USD	Dominion Resources Inc	344,118	0.01%
194,000	USD	DR Horton Inc 6.500% 15 April 2016	164,433	0.01%
990,000	USD	DR Horton Inc 4.375% 15 September 2022	770,750	0.02%
42,103	USD	Dr Pepper Snapple Group Inc	1,398,131	0.04%
47,149	USD	eBay Inc	1,777,286	0.05%
1,460,000	USD	EI Paso LLC 7.000% 15 June 2017	1,267,830	0.04%
270,000	USD	EI Paso LLC 7.750% 15 January 2032	242,439	0.01%
504,000	USD	EI Paso Pipeline Partners Operating Co LLC 6.500% 01 April 2020	467,978	0.01%
25,284	USD	EMC Corp	475,106	0.01%
500,000	USD	Endo Health Solutions Inc 7.000% 15 December 2020	405,349	0.01%
520,000	USD	Endo Health Solutions Inc 7.250% 15 January 2022	424,023	0.01%
1,362,000	USD	Energy Future Intermediate Holding Co LLC / EFIH Finance Inc 10.000% 01 December 2020	1,169,880	0.04%
1,876,000	USD	Energy XXI Gulf Coast Inc 7.750% 15 June 2019	1,558,137	0.05%
5,479	USD	EOG Resources Inc	491,803	0.01%
1,485,000	USD	EP Energy LLC / EP Energy Finance Inc 9.375% 01 May 2020	1,269,911	0.04%
21,421	USD	Essex Property Trust Inc	2,367,931	0.07%
30,908	USD	Estee Lauder Cos Inc	1,355,011	0.04%
40,242	USD	Express Scripts Holding Co	1,611,943	0.05%

109,894	USD	Extra Space Storage Inc	2,979,813	0.09%
9,040	USD	Exxon Mobil Corp	582,192	0.02%
3,970	USD	Facebook Inc	77,844	0.00%
100,000	USD	FAGE Dairy Industry SA / FAGE USA Dairy Industry Inc 9.875% 01 February 2020	81,921	0.00%
41,513	USD	Federal Realty Investment Trust	3,254,081	0.10%
700,000	USD	First Data Corp 10.550% 24 September 2015	544,974	0.02%
142,633	USD	Ford Motor Co	1,389,207	0.04%
552,000	USD	Ford Motor Co 7.450% 16 July 2031	532,620	0.02%
360,000	USD	Ford Motor Co 8.900% 15 January 2032	361,664	0.01%
168,000	USD	Ford Motor Credit Co LLC 8.125% 15 January 2020	163,721	0.01%
32,985	USD	Freeport-McMoRan Copper & Gold Inc	827,251	0.02%
2,133,000	USD	Freescale Semiconductor Inc 10.750% 01 August 2020	1,739,308	0.05%
1,446,000	USD	Frontier Communications Corp 8.250% 15 April 2017	1,272,124	0.04%
1,470,000	USD	Frontier Communications Corp 8.125% 01 October 2018	1,282,114	0.04%
85,000	EUR	GE Capital Trust II FRN 15 September 2067	84,421	0.00%
365,000	EUR	GE Capital Trust IV FRN 15 September 2066	360,401	0.01%
8,143	USD	General Dynamics Corp	418,306	0.01%
230,000	GBP	General Electric Capital Corp 5.250% 07 December 2028	320,047	0.01%
383,000	GBP	General Electric Capital Corp 5.375% 18 December 2040	529,849	0.02%
27,594	USD	General Electric Co	426,839	0.01%
396,465	USD	General Growth Properties Inc	5,904,705	0.18%
482,000	USD	GenOn Americas Generation LLC 8.500% 01 October 2021	417,658	0.01%
2,790,000	USD	GenOn Energy Inc 9.500% 15 October 2018	2,507,298	0.08%
5,767	USD	Gilead Sciences Inc	315,847	0.01%
1,256,000	USD	Goodrich Petroleum Corp 8.875% 15 March 2019	912,492	0.03%
4,229	USD	Google Inc	2,240,321	0.07%
408,000	USD	GWR Operating Partnership LLP 10.875% 01 April 2017	352,764	0.01%
53,268	USD	Hanesbrands Inc	1,410,115	0.04%
1,362,000	USD	HCA Inc 7.875% 15 February 2020	1,151,842	0.04%
1,288,000	USD	HCA Inc 7.250% 15 September 2020	1,086,823	0.03%
1,800,000	USD	HCA Inc 5.875% 01 May 2023	1,413,282	0.04%
1,774,000	USD	HCA Inc 7.500% 15 November 2095	1,201,559	0.04%
2,255,000	USD	HDTFS Inc 5.875% 15 October 2020	1,791,860	0.05%
130,000	USD	HDTFS Inc 6.250% 15 October 2022	105,268	0.00%
95,084	USD	Health Care REIT Inc	4,377,171	0.13%
817,000	USD	Health Management Associates Inc 7.375% 15 January 2020	670,842	0.02%
308,000	USD	HealthSouth Corp 7.250% 01 October 2018	255,231	0.01%
200,000	USD	HealthSouth Corp 5.750% 01 November 2024	155,707	0.00%
1,768,000	USD	Hexion US Finance Corp 6.625% 15 April 2020	1,364,743	0.04%
1,414,000	USD	Hexion US Finance Corp / Hexion Nova Scotia Finance ULC 8.875% 01 February 2018	1,104,861	0.03%
26,424	USD	Home Depot Inc	1,212,824	0.04%
442,860	USD	Host Hotels & Resorts Inc	5,154,554	0.16%
545,000	EUR	HSBC Finance Corp 3.750% 04 November 2015	585,684	0.02%
1,328,000	USD	IASIS Healthcare LLC / IASIS Capital Corp 8.375% 15 May 2019	954,751	0.03%
1,007,000	USD	Infor US Inc 11.500% 15 July 2018	895,438	0.03%
95,000	USD	Infor US Inc 9.375% 01 April 2019	81,060	0.00%
1,110,000	USD	Innovation Ventures LLC / Innovation Ventures Finance Corp 9.500% 15 August 2019	804,322	0.02%
3,903	USD	Intercontinental Exchange Inc	365,255	0.01%
1,565,000	USD	Jabil Circuit Inc 4.700% 15 September 2022	1,250,977	0.04%
1,230,000	USD	Jarden Corp 7.500% 01 May 2017	1,051,845	0.03%
495,000	USD	Jarden Corp 6.125% 15 November 2022	406,446	0.01%
25,680	USD	JB Hunt Transport Services Inc	1,136,503	0.03%
72,520	USD	JPMorgan Chase & Co	2,373,077	0.07%
250,000	EUR	JPMorgan Chase & Co 6.125% 01 April 2014	266,799	0.01%
365,000	EUR	JPMorgan Chase & Co 3.750% 15 June 2016	399,867	0.01%
200,000	GBP	JPMorgan Chase & Co 4.250% 25 January 2017	266,157	0.01%
150,000	EUR	JPMorgan Chase & Co FRN 31 March 2018	144,177	0.00%
1,150,000	GBP	JPMorgan Chase Bank NA 5.375% 28 September 2016	1,562,336	0.05%
100,000	EUR	JPMorgan Chase Bank NA FRN 30 November 2021	106,292	0.00%

13,864	USD	Kansas City Southern	860,971	0.03%
174,337	USD	Kimco Realty Corp	2,513,349	0.08%
1,167,000	USD	Kinetic Concepts Inc / KCI USA Inc 10.500% 01 November 2018	930,629	0.03%
41,603	USD	Kraft Foods Group Inc	1,398,214	0.04%
780,000	USD	Laredo Petroleum Inc 9.500% 15 February 2019	662,597	0.02%
495,000	USD	Laredo Petroleum Inc 7.375% 01 May 2022	408,319	0.01%
3,420,000	USD	Laureate Education Inc 9.250% 01 September 2019	2,717,587	0.08%
250,000	USD	Level 3 Financing Inc 9.375% 01 April 2019	212,844	0.01%
1,775,000	USD	Level 3 Financing Inc 8.125% 01 July 2019	1,467,534	0.04%
410,000	USD	Level 3 Financing Inc 8.625% 15 July 2020	345,573	0.01%
1,215,000	USD	Libbey Glass Inc 6.875% 15 May 2020	993,044	0.03%
670,000	USD	Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp 6.500% 15 May 2019	514,647	0.02%
34,000	USD	Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp 8.625% 15 April 2020	28,175	0.00%
3,498	USD	Lockheed Martin Corp	241,796	0.01%
205,000	USD	Ltd Brands Inc 6.625% 01 April 2021	178,410	0.01%
1,350,000	USD	Ltd Brands Inc 5.625% 15 February 2022	1,116,152	0.03%
190,000	USD	Ltd Brands Inc 6.950% 01 March 2033	147,023	0.00%
14,160	USD	Macy's Inc	400,349	0.01%
999	USD	Mastercard Inc	365,219	0.01%
3,289	USD	McKesson Corp	238,674	0.01%
15,736	USD	Mead Johnson Nutrition Co	775,372	0.02%
10,896	USD	Merck & Co Inc	335,111	0.01%
100,000	EUR	Merrill Lynch & Co Inc 6.000% 11 February 2013	100,554	0.00%
46,000	EUR	Merrill Lynch & Co Inc 4.450% 31 January 2014	47,650	0.00%
500,000	EUR	Merrill Lynch & Co Inc 4.875% 30 May 2014	526,245	0.02%
700,000	GBP	Merrill Lynch & Co Inc 7.750% 30 April 2018	1,045,513	0.03%
765,000	GBP	Merrill Lynch & Co Inc 5.500% 22 November 2021	1,004,093	0.03%
1,496,000	USD	MetroPCS Wireless Inc 6.625% 15 November 2020	1,207,144	0.04%
100,000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I 4.625% 16 May 2017	114,949	0.00%
440,000	EUR	Metropolitan Life Global Funding I 2.375% 30 September 2019	462,120	0.01%
1,740,000	USD	MGM Resorts International 7.500% 01 June 2016	1,418,845	0.04%
1,850,000	USD	MGM Resorts International 7.625% 15 January 2017	1,508,542	0.05%
900,000	USD	Michael Foods Group Inc 9.750% 15 July 2018	759,426	0.02%
250,000	USD	Michael Foods Holding Inc 8.500% 15 July 2018	193,924	0.01%
219,379	USD	Micron Technology Inc	1,017,709	0.03%
21,654	USD	Microsoft Corp	435,082	0.01%
55,000	USD	Mobile Mini Inc 7.875% 01 December 2020	45,889	0.00%
15,270	USD	Mondelez International Inc	291,904	0.01%
163,000	EUR	Mondelez International Inc 6.250% 20 March 2015	181,802	0.01%
23,827	USD	Monster Beverage Corp	935,487	0.03%
200,000	EUR	Morgan Stanley 4.500% 29 October 2014	211,304	0.01%
73,000	EUR	Morgan Stanley 4.000% 17 November 2015	77,621	0.00%
900,000	EUR	Morgan Stanley 4.500% 23 February 2016	968,922	0.03%
400,000	GBP	Morgan Stanley 5.750% 14 February 2017	541,107	0.02%
128,000	EUR	Morgan Stanley 3.750% 21 September 2017	136,581	0.00%
437,000	EUR	Morgan Stanley 5.500% 02 October 2017	498,272	0.02%
200,000	EUR	Morgan Stanley 5.375% 10 August 2020	227,856	0.01%
27,566	USD	National Oilwell Varco Inc	1,374,344	0.04%
1,180,000	USD	Newfield Exploration Co 5.625% 01 July 2024	966,670	0.03%
1,755,000	USD	NPC International Inc 10.500% 15 January 2020	1,547,289	0.05%
955,000	USD	NRG Energy Inc 8.250% 01 September 2020	813,063	0.02%
6,013	USD	Occidental Petroleum Corp	343,017	0.01%
231,337	USD	ON Semiconductor Corp	1,199,234	0.04%
23,417	USD	Oracle Corp	585,163	0.02%
7,805	USD	Orbital Sciences Corp	78,322	0.00%
30,997	USD	Pall Corp	1,399,729	0.04%
1,170,000	USD	Peabody Energy Corp 6.250% 15 November 2021	945,196	0.03%
526,000	GBP	Pemex Project Funding Master Trust 7.500% 18 December 2013	683,097	0.02%

385,000	EUR	Pemex Project Funding Master Trust 6.375% 05 August 2016	447,613	0.01%
49,000	EUR	Pemex Project Funding Master Trust 5.500% 24 February 2025	56,228	0.00%
8,380	USD	Penn National Gaming Inc	307,260	0.01%
5,677	USD	PepsiCo Inc	292,229	0.01%
55,165	USD	Pfizer Inc	1,039,099	0.03%
200,000	EUR	Pfizer Inc 5.750% 03 June 2021	261,668	0.01%
16,888	USD	Philip Morris International Inc	1,056,305	0.03%
190,000	EUR	Philip Morris International Inc 2.125% 30 May 2019	196,797	0.01%
408,000	USD	Pinnacle Entertainment Inc 8.750% 15 May 2020	335,010	0.01%
321,000	USD	Pioneer Natural Resources Co 7.500% 15 January 2020	308,864	0.01%
708,000	USD	Plains Exploration & Production Co 7.625% 01 April 2020	600,094	0.02%
85,554	USD	Polycom Inc	676,589	0.02%
11,479	USD	Precision Castparts Corp	1,614,054	0.05%
1,524	USD	priceline.com Inc	702,239	0.02%
6,417	USD	Procter & Gamble Co	326,097	0.01%
130,000	EUR	Procter & Gamble Co/The 2.000% 16 August 2022	130,579	0.00%
1,160,000	USD	Production Resource Group Inc 8.875% 01 May 2019	645,229	0.02%
137,588	USD	Prologis Inc	3,724,498	0.11%
30,582	USD	Public Storage	3,320,206	0.10%
12,637	USD	Qualcomm Inc	579,638	0.02%
214,000	USD	Quicksilver Resources Inc 9.125% 15 August 2019	144,946	0.00%
253,000	GBP	Rabobank Capital Funding Trust IV FRN 31 December 2019	311,723	0.01%
1,725,000	USD	Regions Bank 7.500% 15 May 2018	1,577,952	0.05%
576,000	USD	Reynolds Group Issuer Inc 8.500% 15 May 2018	450,071	0.01%
2,065,000	USD	Reynolds Group Issuer Inc 7.875% 15 August 2019	1,750,275	0.05%
2,298,000	USD	Rite Aid Corp 7.500% 01 March 2017	1,791,247	0.05%
1,465,000	USD	Rite Aid Corp 9.250% 15 March 2020	1,180,743	0.04%
45,000	GBP	Roche Holdings Inc 5.500% 04 March 2015	60,341	0.00%
2,755	USD	Salesforce.com Inc	342,303	0.01%
1,683,000	USD	SandRidge Energy Inc 8.750% 15 January 2020	1,401,022	0.04%
9,914	USD	Schlumberger Ltd	509,883	0.02%
100,000	USD	Service Corp International/US 7.625% 01 October 2018	90,435	0.00%
481,000	USD	Service Corp International/US 7.000% 15 May 2019	399,501	0.01%
175,000	USD	Service Corp International/US 4.500% 15 November 2020	134,754	0.00%
1,130,000	USD	Service Corp International/US 8.000% 15 November 2021	1,060,397	0.03%
620,000	USD	ServiceMaster Co/TN 7.000% 15 August 2020	472,721	0.01%
77,407	USD	Simon Property Group Inc	9,139,633	0.28%
700,000	USD	Sky Growth Acquisition Corp 7.375% 15 October 2020	529,744	0.02%
104,598	USD	SL Green Realty Corp	5,986,676	0.18%
4,285	USD	SolarWinds Inc	166,744	0.00%
1,850,000	USD	Sprint Capital Corp 6.875% 15 November 2028	1,466,540	0.04%
115,817	USD	Sprint Nextel Corp	490,827	0.01%
225,000	USD	Sprint Nextel Corp 9.125% 01 March 2017	201,350	0.01%
1,602,000	USD	Sprint Nextel Corp 8.375% 15 August 2017	1,415,428	0.04%
1,600,000	USD	Sprint Nextel Corp 7.000% 15 August 2020	1,328,902	0.04%
2,100,000	USD	Sprint Nextel Corp 6.000% 15 November 2022	1,640,883	0.05%
35,495	USD	Starbucks Corp	1,414,006	0.04%
101,477	USD	Starwood Hotels & Resorts Worldwide Inc	4,311,300	0.13%
10,019	USD	Stryker Corp	412,848	0.01%
1,853,000	USD	SunGard Data Systems Inc 7.625% 15 November 2020	1,542,540	0.05%
12,803	USD	SunTrust Banks Inc	269,258	0.01%
760,000	USD	SUPERVALU Inc 7.500% 15 November 2014	560,772	0.02%
660,000	USD	SUPERVALU Inc 8.000% 01 May 2016	478,246	0.01%
333,000	EUR	Swiss Re Treasury US Corp 7.000% 19 May 2014	361,704	0.01%
6,157	USD	Target Corp	272,906	0.01%
501,000	USD	Tenet Healthcare Corp 10.000% 01 May 2018	433,174	0.01%
11,739	USD	Time Warner Cable Inc	845,561	0.03%
626,000	GBP	Time Warner Cable Inc 5.750% 02 June 2031	909,795	0.03%
40,286	USD	TJX Cos Inc	1,268,892	0.04%
9,629	USD	TransDigm Group Inc	969,537	0.03%

775,000	USD	TransUnion Holding Co Inc 9.625% 15 June 2018	623,159	0.02%
445,000	USD	TransUnion Holding Co Inc 8.125% 15 June 2018	349,395	0.01%
600,000	USD	Triumph Group Inc 8.625% 15 July 2018	506,284	0.02%
1,491,912	USD	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02 July 2022	1,213,724	0.04%
5,571	USD	Union Pacific Corp	520,846	0.02%
1,380,000	USD	United Rentals North America Inc 5.750% 15 July 2018	1,130,512	0.03%
620,000	USD	United Rentals North America Inc 7.625% 15 April 2022	526,679	0.02%
854,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.375% 15 April 2032	1,399,976	0.04%
1,993,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15 April 2013	1,648,832	0.05%
1,815,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15 July 2013	1,758,464	0.05%
990,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.000% 15 January 2014	968,426	0.03%
25,910,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15 April 2015	21,848,850	0.66%
10,965,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15 July 2015	10,765,120	0.33%
3,000,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15 April 2016	2,506,033	0.08%
13,196,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15 January 2017	13,319,052	0.40%
238,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.625% 15 January 2018	230,913	0.01%
22,198,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15 July 2018	20,999,399	0.64%
2,076,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.875% 15 July 2019	2,075,439	0.06%
2,622,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.375% 15 January 2020	2,521,244	0.08%
9,423,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.250% 15 July 2020	8,993,953	0.27%
7,250,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.125% 15 January 2021	6,833,486	0.21%
4,136,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15 July 2021	3,662,476	0.11%
11,870,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15 January 2022	10,002,820	0.30%
7,537,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15 January 2025	9,501,448	0.29%
3,828,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15 January 2027	4,611,618	0.14%
4,608,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.750% 15 January 2028	5,020,687	0.15%
5,465,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.875% 15 April 2029	9,717,219	0.30%
5,471,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15 February 2040	6,573,962	0.20%
2,561,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15 February 2041	3,059,798	0.09%
1,460,000	USD	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15 February 2042	1,256,232	0.04%
576,992	USD	US Airways 2001-1G Pass Through Trust 7.076% 20 March 2021	454,121	0.01%
551,941	USD	US Airways 2011-1 Class A Pass Through Trust 7.125% 22 October 2023	469,908	0.01%
845,000	USD	Valeant Pharmaceuticals International 6.750% 01 October 2017	693,833	0.02%
1,112,000	USD	Valeant Pharmaceuticals International 6.750% 15 August 2021	904,652	0.03%
234,000	USD	Vector Group Ltd 11.000% 15 August 2015	185,277	0.01%
171,000	USD	Verso Paper Holdings LLC / Verso Paper Inc 8.750% 01 February 2019	50,470	0.00%
17,197	USD	Virgin Media Inc	473,851	0.01%
2,159,000	USD	Visant Corp 10.000% 01 October 2017	1,470,495	0.04%
200,000	EUR	Wachovia Corp 4.375% 01 August 2016	224,782	0.01%
100,000	EUR	Wachovia Corp 4.375% 27 November 2018	111,342	0.00%
1,017,000	GBP	Wal-Mart Stores Inc 5.625% 27 March 2034	1,600,024	0.05%
55,776	USD	Walt Disney Co	2,074,623	0.06%
13,007	USD	Wells Fargo & Co	333,790	0.01%

760,000	EUR	Wells Fargo & Co 2.625% 16 August 2022	787,849	0.02%
500,000	GBP	Wells Fargo & Co 4.875% 29 November 2035	621,446	0.02%
600,000	GBP	Wells Fargo Bank NA 5.250% 01 August 2023	844,914	0.03%
24,128	USD	Wesco Aircraft Holdings Inc	240,478	0.01%
150,000	USD	West Corp 7.875% 15 January 2019	118,057	0.00%
517,000	USD	Westvaco Corp 8.200% 15 January 2030	520,321	0.02%
464,000	USD	Windstream Corp 7.875% 01 November 2017	397,672	0.01%
3,870,000	USD	Windstream Corp 7.750% 01 October 2021	3,184,992	0.10%
		米国合計	466,239,956	14.13%

取引所上場を認められた譲渡可能証券及び短期金融商品合計

1,566,582,867	47.64%
---------------	--------

オープンエンド型投資信託

157,812,546	英ポンド	Standard Life Investments European Equity Income Fund	154,732,446	4.71%
-------------	------	---	-------------	-------

オープンエンド型投資信託合計

154,732,446	4.71%
-------------	-------

取引所上場を認められたもの以外の譲渡可能証券及び短期金融商品

オーストラリア				
1,740,000	USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd 8.250% 01 November 2019	1,408,969	0.04%
290,000	USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd 6.875% 01 April 2022	225,775	0.01%
923,000	AUD	New South Wales Treasury Corp 2.750% 20 November 2025	945,130	0.03%
		オーストラリア合計	2,579,874	0.08%
オーストリア				
1,550,000	USD	OGX Austria GmbH 8.500% 01 June 2018	1,064,502	0.03%
600,000	USD	Sappi Papier Holding GmbH 6.625% 15 April 2021	449,526	0.01%
		オーストリア合計	1,514,028	0.04%
バミューダ				
1,260,000	USD	Digicel Group Ltd 8.250% 30 September 2020	1,053,661	0.03%
		バミューダ合計	1,053,661	0.03%
カナダ				
480,000	USD	Ainsworth Lumber Co Ltd 7.500% 15 December 2017	381,870	0.01%
2,920,000	CAD	Canadian Government Bond 4.250% 01 December 2021	4,609,100	0.14%
626,000	CAD	Canadian Government Bond 4.250% 01 December 2026	1,063,440	0.03%
2,935,000	CAD	Canadian Government Bond 4.000% 01 December 2031	5,176,493	0.16%
881,000	CAD	Canadian Government Bond 2.000% 01 December 2041	1,066,395	0.03%
200,000	USD	First Quantum Minerals Ltd 7.250% 15 October 2019	153,815	0.00%
1,370,000	USD	HudBay Minerals Inc 9.500% 01 October 2020	1,102,880	0.03%
1,410,000	USD	Inmet Mining Corp 8.750% 01 June 2020	1,168,428	0.04%
		カナダ合計	14,722,421	0.44%
ケイマン諸島				
700,000	USD	Shelf Drilling Holdings Ltd 8.625% 01 November 2018	545,637	0.02%
		ケイマン諸島合計	545,637	0.02%
欧州連合				
25,000,000	EUR	Abbey 0.070% 11 February 2013	24,999,980	0.76%
25,000,000	EUR	Abbey 0.100% 11 January 2013	25,000,498	0.76%
25,000,000	EUR	Abbey 0.100% 16 January 2013	25,000,681	0.76%
60,000,000	EUR	Barclays 0.000% 09 January 2013	59,999,656	1.83%
40,000,000	EUR	Barclays 0.190% 12 April 2013	40,005,634	1.22%
30,000,000	EUR	Barclays 0.200% 16 May 2013	30,002,923	0.91%
30,000,000	EUR	Barclays 0.380% 25 February 2013	30,013,175	0.91%
30,000,000	EUR	BNP Paribas 0.430% 06 March 2013	30,017,399	0.91%
25,000,000	EUR	Caylon 0.435% 04 March 2013	25,014,347	0.76%
15,000,000	EUR	Caylon 0.440% 27 March 2013	15,011,163	0.46%

40,000,000	EUR	Caylon 0.850% 07 January 2013	40,005,511	1.22%
25,000,000	EUR	Danske Bank 0.150% 12 February 2013	25,002,267	0.76%
35,000,000	EUR	Deutsche Bank 0.0170% 02 April 2013	34,988,465	1.06%
50,000,000	EUR	Deutsche Bank 0.0175% 06 June 2013	49,957,399	1.52%
10,100,000	EUR	ICAP 0.200% 28 February 2013	10,101,675	0.31%
61,000,000	EUR	ICAP 0.300% 17 January 2013	61,007,162	1.86%
45,000,000	EUR	ING Bank 0.320% 02 May 2013	45,024,383	1.37%
25,000,000	EUR	ING Bank 0.770% 04 September 2013	25,079,633	0.76%
20,000,000	EUR	ING Bank 0.920% 02 August 2013	20,077,833	0.61%
50,000,000	EUR	KBC Bank NV 0.160% 28 February 2013	50,005,071	1.52%
10,000,000	EUR	SLIF 0.620% 24 September 2013	10,021,741	0.30%
50,000,000	EUR	Societe Generale 0.090% 31 January 2013	50,001,513	1.52%
40,000,000	EUR	Societe Generale 0.740% 01 January 2013	40,023,579	1.22%
50,000,000	EUR	Sumi 0.090% 06 Feb 2013	50,001,351	1.52%
25,000,000	EUR	Svenska 0.170% 20 May 2013	24,999,192	0.76%
40,000,000	EUR	Svenska 0.200% 15 February 2013	40,006,151	1.22%
		欧州連合合計	881,368,382	26.81%
		アイルランド		
1,095,000	USD	Ardagh Packaging Finance Plc 9.125% 15 October 2020	907,394	0.03%
		アイルランド合計	907,394	0.03%
		日本		
13,000,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.100% 10 June 2014	116,194	0.00%
97,700,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 0.800% 10 September 2015	887,412	0.03%
30,100,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.100% 10 December 2016	282,096	0.01%
126,800,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.400% 10 March 2018	1,210,620	0.04%
328,600,000	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 1.400% 10 June 2018	3,147,141	0.10%
		日本合計	5,643,463	0.18%
		ルクセンブルグ		
100,000	EUR	Boardriders SA 8.875% 15 December 2017	105,500	0.00%
1,033,000	USD	Expro Finance Luxembourg SCA 8.500% 15 December 2016	820,839	0.03%
1,068,325	USD	Wind Acquisition Holdings Finance SA 12.250% 15 July 2017	953,219	0.03%
989,000	USD	Wind Acquisition Finance SA 11.750% 15 July 2017	946,206	0.03%
		ルクセンブルグ合計	2,825,764	0.09%
		オランダ		
581,026	EUR	Boats Investments Netherlands BV 11.000% 31 March 2017	320,662	0.01%
106,000	USD	NXP BV / NXP Funding LLC 9.750% 01 August 2018	93,354	0.00%
		オランダ合計	414,016	0.01%
		ニュージーランド		
2,260,000	NZD	New Zealand Government Bond 2.000% 20 September 2025	1,516,352	0.05%
		ニュージーランド合計	1,516,352	0.05%
		スペイン		
1,235,000	USD	Cemex Espana Luxembourg 9.250% 12 May 2020	1,021,073	0.03%
		スペイン合計	1,021,073	0.03%
		英国		
108,000	GBP	Bg Energy Capital Plc 6.500% 30 November 2072	143,045	0.00%
46,106	GBP	Prestbury Investments Limited	-	-
300,000	USD	Standard Chartered Plc 3.200% 12 May 2016	238,936	0.01%
		英国合計	381,981	0.01%
		米国		
1,150,000	USD	313 Group Inc 6.375% 01 December 2019	867,031	0.03%
790,000	USD	313 Group Inc 8.750% 01 December 2020	590,381	0.02%
115,000	USD	Aleris International Inc 7.875% 01 November 2020	87,356	0.00%

556,000	USD	Ashland Inc 4.750% 15 August 2022	437,599	0.01%
1,450,000	USD	Atlas Pipeline Partners LP / Atlas Pipeline Finance Corp 6.625% 01 October 2020	1,146,707	0.04%
1,985,000	USD	BOE Merger Corp 9.500% 01 November 2017	1,509,714	0.05%
2,466,000	USD	Calpine Corp 7.875% 31 July 2020	2,104,156	0.06%
3,635,000	USD	Casella Waste Systems Inc 7.750% 15 February 2019	2,627,097	0.08%
930,000	USD	Cequel Communications Holdings I LLC / Cequel Capital Corp 6.375% 15 September 2020	733,715	0.02%
176,000	USD	Chesapeake Oilfield Operating LLC / Chesapeake Oilfield Finance Inc 6.625% 15 November 2019	126,200	0.00%
1,095,000	USD	EP Energy LLC / Everest Acquisition Finance Inc 7.750% 01 September 2022	882,535	0.03%
800,000	USD	First Data Corp 8.250% 15 January 2021	608,449	0.02%
1,130,000	USD	First Data Corp 8.750% 15 January 2022	878,676	0.03%
250,000	USD	Halcon Resources Corp 8.875% 15 May 2021	201,965	0.01%
1,405,000	USD	Halcon Resources Corp 9.750% 15 July 2020	1,153,651	0.04%
780,000	USD	Hiland Partners LP / Hiland Partners Finance Corp 7.250% 01 October 2020	634,558	0.02%
1,425,000	EUR	Infor US Inc 10.000% 01 April 2019	1,596,000	0.05%
350,000	USD	Level 3 Communications Inc 8.875% 01 June 2019	283,744	0.01%
1,300,000	USD	Linn Energy LLC / Linn Energy Finance Corp 6.250% 01 November 2019	993,649	0.03%
330,000	USD	Longview Fibre Paper & Packaging Inc 8.000% 01 June 2016	263,784	0.01%
1,118,000	USD	Midstates Petroleum Co Inc / Midstates Petroleum Co LLC 10.750% 01 October 2020	903,188	0.03%
97,000	EUR	Millipore Corp 5.875% 30 June 2016	112,911	0.00%
890,000	USD	NRG Energy Inc 6.625% 15 March 2023	724,047	0.02%
1,000,000	USD	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp 8.250% 15 January 2021	777,589	0.02%
815,000	EUR	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp 8.500% 15 January 2021	846,581	0.03%
510,000	USD	Sealed Air Corp 6.500% 01 December 2020	418,763	0.01%
1,010,000	USD	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 10.500% 31 January 2020	829,315	0.03%
250,000	USD	Taminco Global Chemical Corp 9.750% 31 March 2020	207,641	0.01%
730,000	USD	Tekni-Piex Inc 9.750% 01 June 2019	606,311	0.02%
1,415,000	USD	Tronox Finance LLC 6.375% 15 August 2020	1,085,564	0.03%
2,546,000	USD	Univision Communications Inc 7.875% 01 November 2020	2,095,347	0.06%
1,021,000	GBP	Wells Fargo & Co 4.625% 02 November 2035	1,366,272	0.04%
		米国合計	27,700,496	0.86%

取引所上場を認められたもの以外の譲渡可能証券及び短期金融商品合計

942,194,542	28.68%
-------------	--------

投資有価証券合計

2,663,509,855	81.03%
---------------	--------

現金及び現金同等物

607,116,540	18.47%
-------------	--------

当座貸越及びその他の純資産

16,488,291	0.50%
------------	-------

純資産総額

3,287,114,686	100.00%
---------------	---------

純資産に占める割合（％）による投資有価証券の分析

取引所上場を認められた譲渡可能証券及び短期金融商品	49.50%
取引所上場を認められたもの以外の譲渡可能証券及び短期金融商品	27.10%
その他の資産	23.40%
純資産総額	100.00%

[次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書(平成25年7月31日現在)

分散投資コア戦略ファンドA

資産総額	582,632,642 円
負債総額	13,939,911 円
純資産総額(-)	568,692,731 円
発行済口数	581,886,267 口
1口当たり純資産額(/)	0.9773 円
1万口当たり純資産額	9,773 円

分散投資コア戦略ファンドS

資産総額	137,260,015 円
負債総額	1,226,943 円
純資産総額(-)	136,033,072 円
発行済口数	138,474,090 口
1口当たり純資産額(/)	0.9824 円
1万口当たり純資産額	9,824 円

(参考情報)

ART テクニカル運用日本株式 マザーファンド

資産総額	28,798,595,202 円
負債総額	2,257,269,059 円
純資産総額(-)	26,541,326,143 円
発行済口数	19,335,016,028 口
1口当たり純資産額(/)	1.3727 円
1万口当たり純資産額	13,727 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	251,488,299,867 円
負債総額	2,410,876,981 円
純資産総額(-)	249,077,422,886 円
発行済口数	197,468,416,277 口
1口当たり純資産額(/)	1.2614 円
1万口当たり純資産額	12,614 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	160,317,045,236 円
負債総額	381,401,392 円
純資産総額(-)	159,935,643,844 円
発行済口数	114,082,822,233 口
1口当たり純資産額(/)	1.4019 円
1万口当たり純資産額	14,019 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	229,511,137,980 円
負債総額	934,627,598 円
純資産総額(-)	228,576,510,382 円
発行済口数	100,720,389,697 口
1口当たり純資産額(/)	2.2694 円
1万口当たり純資産額	22,694 円

新興国株式インデックス マザーファンド

資産総額	18,944,841,137 円
負債総額	5,618,300 円
純資産総額(-)	18,939,222,837 円
発行済口数	9,500,382,831 口
1口当たり純資産額(/)	1.9935 円
1万口当たり純資産額	19,935 円

新興国債券インデックス マザーファンド

資産総額	22,021,326,212 円
負債総額	295,963,754 円
純資産総額(-)	21,725,362,458 円
発行済口数	13,838,269,671 口
1口当たり純資産額(/)	1.5699 円
1万口当たり純資産額	15,699 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	15,541,063,625 円
負債総額	539,468,548 円
純資産総額(-)	15,001,595,077 円
発行済口数	14,666,454,182 口

1口当たり純資産額(/)	1.0229 円
1万口当たり純資産額	10,229 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	20,457,015,523 円
負債総額	137,314,173 円
純資産総額(-)	20,319,701,350 円
発行済口数	18,051,424,769 口
1口当たり純資産額(/)	1.1257 円
1万口当たり純資産額	11,257 円

グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド

資産総額	7,458,218,967 円
負債総額	176,481,296 円
純資産総額(-)	7,281,737,671 円
発行済口数	16,879,502,882 口
1口当たり純資産額(/)	0.4314 円
1万口当たり純資産額	4,314 円

FRM シグマ リンク マザーファンド

資産総額	4,010,600,451 円
負債総額	99,639,450 円
純資産総額(-)	3,910,961,001 円
発行済口数	4,498,526,223 口
1口当たり純資産額(/)	0.8694 円
1万口当たり純資産額	8,694 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「1 委託会社等の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

(1)資本金の額（平成25年2月28日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成25年5月2日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(1)資本金の額（平成25年7月31日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成25年9月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

平成25年2月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>299</u>	<u>4,042,545</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>5</u>	<u>778</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>304</u>	<u>4,043,323</u>

< 訂正後 >

（前略）

平成25年7月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	<u>320</u>	<u>4,361,531</u>
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>1</u>	<u>64</u>
単位型公社債投資信託	0	0
合計	<u>321</u>	<u>4,361,595</u>

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）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、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

[次へ](#)

(1)貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	4,826,115	8,192,444
前払費用	30,184	81,751
未収委託者報酬	944,716	2,210,605
未収運用受託報酬	26,998	31,051
未収入金	75,514	676
一年以内返還予定保証金	187,128	-
繰延税金資産	69,857	61,743
その他	31,325	19,263
流動資産合計	6,191,840	10,597,535
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 3,525	1 79,281
器具備品	1 14,970	1 103,209
建設仮勘定	62,454	-
有形固定資産合計	80,949	182,491
無形固定資産		
ソフトウェア	60,130	168,561
ソフトウェア仮勘定	12,151	-
その他無形固定資産	928	1,770
無形固定資産合計	73,209	170,332
投資その他の資産		
投資有価証券	43,194	47,112
長期前払費用	357	-
長期貸付金	-	31,838
会員権	-	25,000
その他の投資	165	633
貸倒引当金	-	31,838
投資その他の資産合計	43,717	72,746
固定資産合計	197,876	425,570
資産合計	6,389,717	11,023,105

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	-	350,000
資本剰余金合計	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計

6,389,717

11,023,105

(2)損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	7,821,113	19,128,296
運用受託報酬	98,179	94,659
営業収益合計	7,919,292	19,222,955
営業費用		
支払手数料	3,715,816	9,030,246
広告宣伝費	61,165	73,287
公告費	2,451	2,244
調査費	1,023,870	4,132,154
調査費	86,225	207,030
委託調査費	936,024	3,922,394
図書費	1,620	2,729
営業雑経費	610,455	1,294,879
通信費	10,764	21,905
印刷費	121,287	330,735
協会費	10,136	21,939
諸会費	803	757
情報機器関連費	436,328	874,151
その他営業雑経費	31,135	45,391
営業費用合計	5,413,759	14,532,812
一般管理費		
給料	1,276,685	2,259,238
役員報酬	35,160	78,205
給料・手当	1,048,061	1,967,177
賞与	193,464	213,855
退職給付費用	66,790	64,787
福利費	152,149	190,716
交際費	1,012	879
旅費交通費	25,687	45,160
租税公課	16,148	25,420
不動産賃借料	238,033	129,096
寄付金	2,832	-
減価償却費	55,540	129,966
敷金償却	2,804	-
諸経費	81,858	1 257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213
営業利益	585,991	1,586,929

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3)株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344

その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当期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。

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
	建 物	84,592	千円	23,594
器具備品	127,549	〃	235,212	〃
計	212,142	〃	258,807	〃

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)		当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
	諸経費		千円	97,199

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

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	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	-	3,000	3,000	-

(注) (1)普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2)普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

3. 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（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

4. 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翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 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	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 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（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

4. 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翌事業年度となるもの

平成25年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

（リ・ス取引関係）

該当事項はありません。

（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、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください。

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
(2)未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4)未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	37,315	45,159	7,843
小計	37,315	45,159	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,030	1,952	77
小計	2,030	1,952	77
合計	39,345	47,112	7,766

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
114,040	30,924	14,182

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付債務	199,976	268,531
（2）退職給付引当金	199,976	268,531

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付費用	66,790	64,787

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

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差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.69 %	- %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

当事業年度は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が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分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．地域ごとの情報

(1)営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客から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)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．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

（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)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職 業	議決権等 の被所有 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)
親会社	三井住友 トラスト・ホールディングス㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職 業	議決権等 の被所有 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)
親会社	三井住友 トラスト・ホールディングス㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	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)
兄弟会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、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。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	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)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

(注) 1. 上記金額のうち、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。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

前事業年度（平成24年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成25年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（企業結合等関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31銭

(注) 1 . 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。

2 . 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

[次へ](#)

5 その他

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「5 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部 _____ は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成25年5月2日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

<訂正後>

（前略）

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成25年9月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1)受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（平成24年9月末日現在）

（中略）

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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に基づき信託業務を営んでいます。

（中略）

3 資本関係

（中略）

（参考）再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成24年9月末日現在）

（後略）

<訂正後>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1)受託会社

（中略）

資本金の額：342,037百万円（平成25年3月末日現在）

（中略）

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	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に基づき信託業務を営んでいます。

（中略）

3 資本関係

（中略）

（参考）再信託受託会社

（中略）

資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

（後略）

第3【その他】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第3 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部_____は訂正部分を示します。

<訂正前>

（前略）

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

<訂正後>

（前略）

(6)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(7)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(8)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(9)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成25年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 佐藤 智治 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの平成25年3月29日から平成25年7月10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、分散投資コア戦略ファンドAの平成25年7月10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

三井住友トラスト・アセットマネジメント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

-
- 1．上記は、当社が、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。
 - 2．財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 佐藤智治 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの平成25年3月29日から平成25年7月10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、分散投資コア戦略ファンドSの平成25年7月10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

三井住友トラスト・アセットマネジメント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

-
- 1．上記は、当社が、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。
 - 2．財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤浩之	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」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

上記は、当社が、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。