

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年4月20日提出
【計算期間】	第2期(自 平成26年1月21日至 平成27年1月20日)
【ファンド名】	世界経済インデックスファンド（債券シフト型）
【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3番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0521
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。



DR(預託証券)とは

ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ－バ ル (日本を 含む)	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益追求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマ－ジ ング				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))	その他 ()					
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信... 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信... 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外... 目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産... 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合... 目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)... 「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)... 「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF... 投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型... 目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型... 目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊

型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株... 目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株... 目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債... 目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債... 目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券... 目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性... 目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合... 以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型... 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型... 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1) 年1回... 目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回... 目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回... 目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)... 目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5) 年12回(毎月)... 目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

(1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

(1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1)日経225

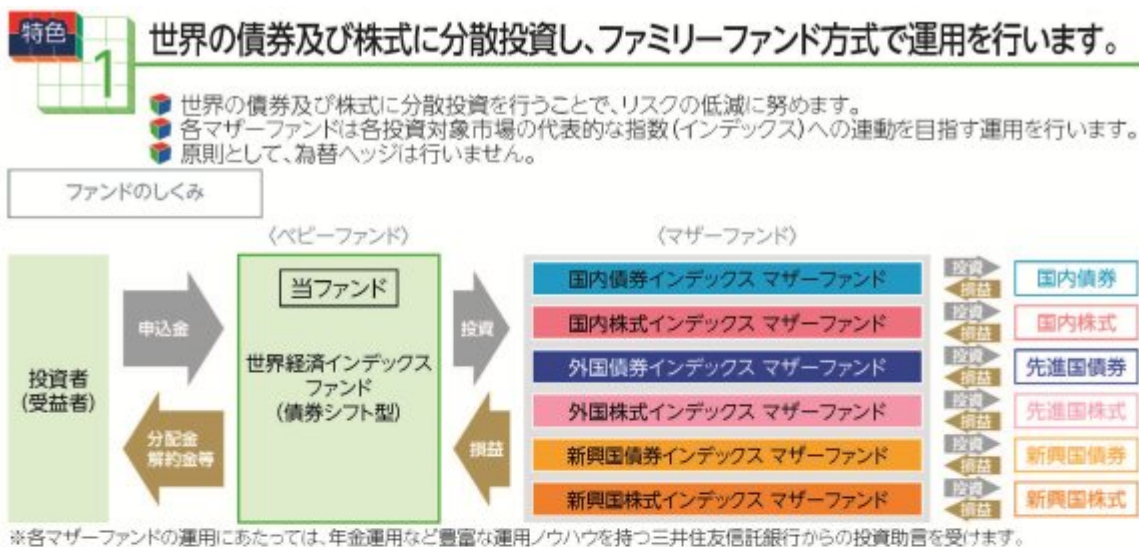
(2)TOPIX

(3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

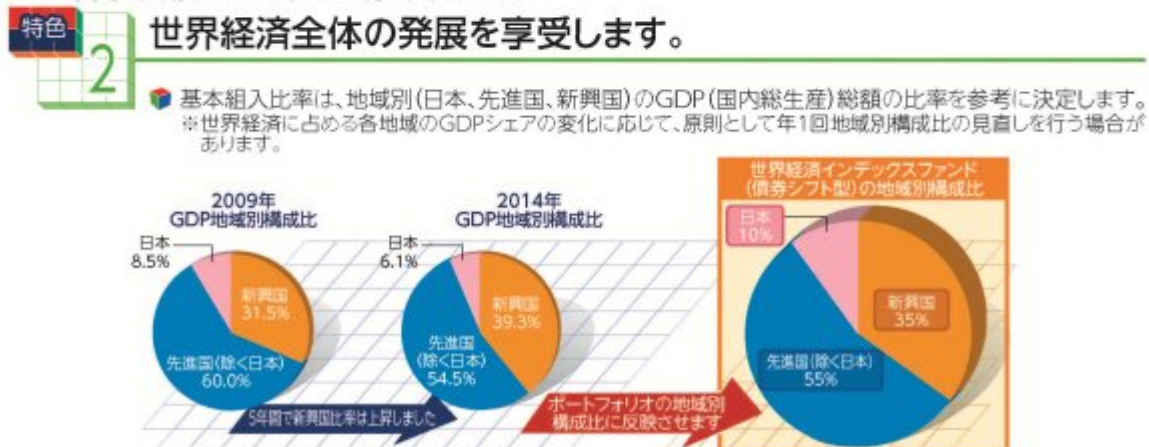
[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

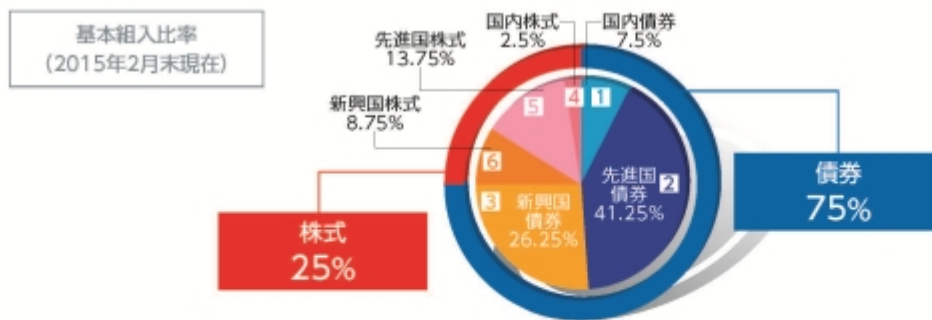
< ファンドの特色 >



? ファミリーファンド方式とは
投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



(出所)IMF「世界経済見通し2014年10月データ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※上記のファンドの地域別構成比は、2015年2月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合があります。

資産	インデックス
① 国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI 総合） ¹
② 先進国債券	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース） ²
③ 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） ³
④ 国内株式	東証株価指数（TOPIX） ⁴
⑤ 先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース） ⁵
⑥ 新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース） ⁶

* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

1「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI 総合）」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

2「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商

標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

4「東証株価指数（TOPIX）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

5「MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

6「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色 3 信託報酬を抑えたファンドです。

● 運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対して年率**0.486%（税抜0.45%）**です。

（注）ご換金時には信託財産留保額として換金申込受付日の翌営業日の基準価額の**0.1%**がかかります。

なお、一部のマザーファンドの換金に伴う信託財産留保額をファンドが負担します。詳しくは後記「4手数料等及び税金（2）換金（解約）手数料」をご覧ください。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

〈ご参考情報〉

新興国は世界経済における存在感を増しています。



- 世界人口が増加し人々が生活水準の向上を目指し生産と消費を拡大することで、世界経済は長期にわたり持続的な成長を実現しました。世界経済における新興国の人口やGDPの割合は年々増加しています。

世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects(The 2012 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2014年10月データ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

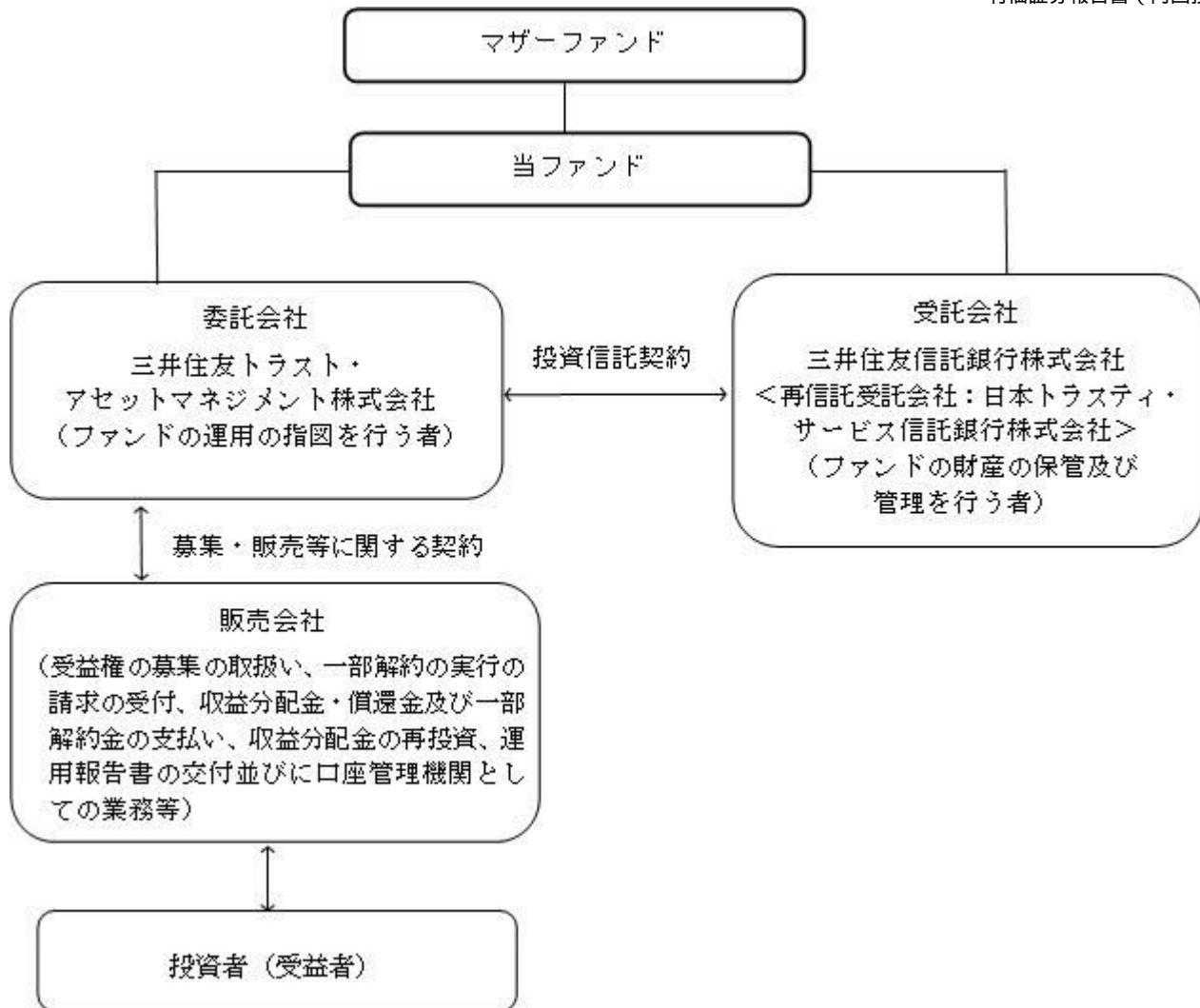
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成25年11月8日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年 2月27日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年2月20日：	投資顧問業の登録
昭和62年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
平成2年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
平成19年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
平成24年4月1日：	中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外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」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。
- ロ．株式（DR（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式25%、債券75%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。
- ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
- ト．ただし、資金動向及び市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約

款第21条、第22条及び第23条に定めるものに限ります。）

3. 金銭債権

4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに7.から28.までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

2. 国内株式インデックス マザーファンド

3. 外国債券インデックス マザーファンド

4. 外国株式インデックス マザーファンド

5. 新興国債券インデックス マザーファンド

6. 新興国株式インデックス マザーファンド

7. 株券又は新株引受権証券

8. 国債証券

9. 地方債証券

10. 特別の法律により法人の発行する債券

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

12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

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

15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

16. コマーシャル・ペーパー

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

18. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの

19. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

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

21. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

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

23. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

25. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証

券に限ります。）

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

27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28. 外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ. 当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行

うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

原則として、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総

額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

(2)投資態度

主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

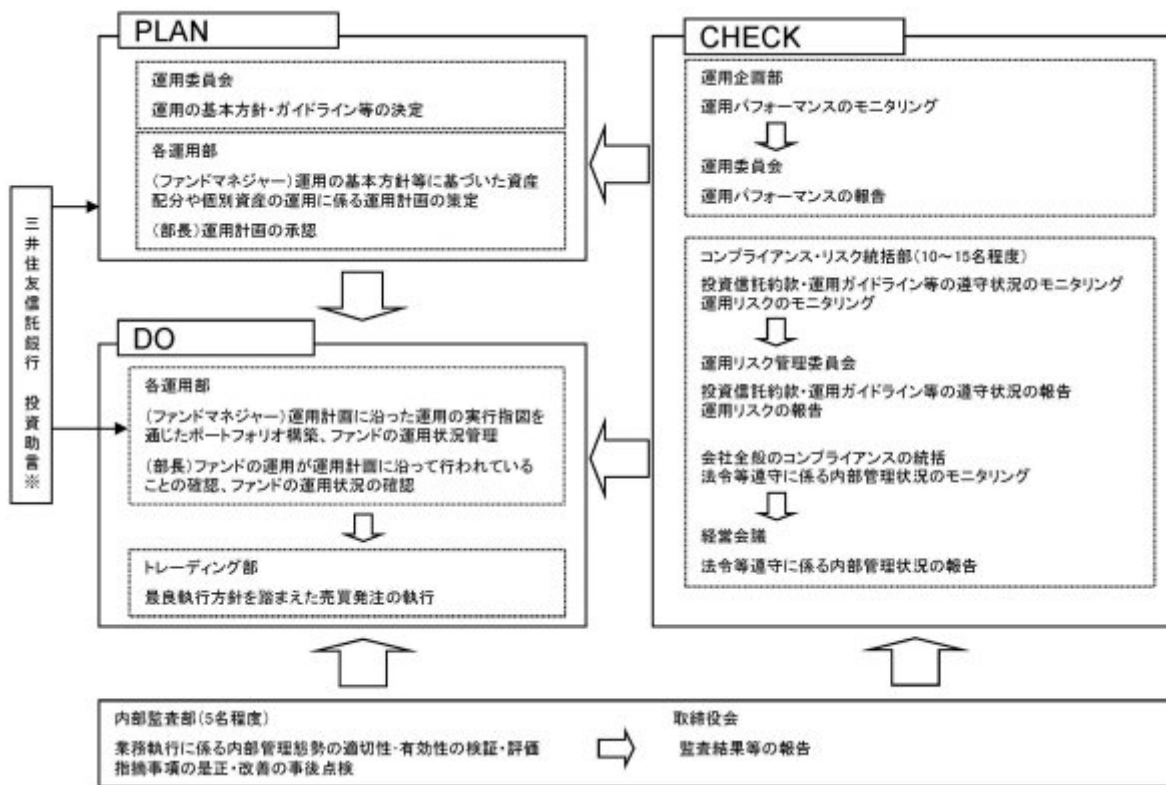
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）に

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

（３）【運用体制】

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、今後変更されることがあります。



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

- イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
 6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ヘ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引

並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

- ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。
- リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ル．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をことができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ヲ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信

託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- ワ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- カ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヨ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

ロ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益率を示すものではありません。

投資者の当ファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

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

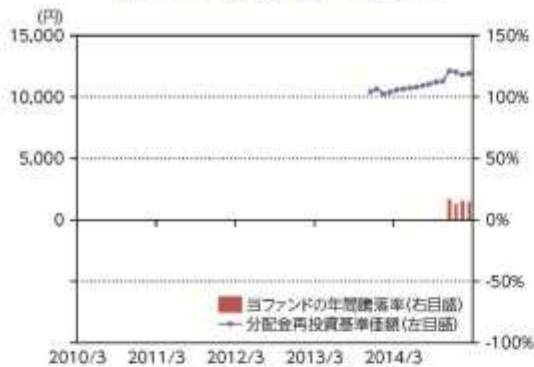
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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経営会議に報告します。

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。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

- ※当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

- ※当ファンドについては2014年11月～2015年2月の4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2010年3月～2015年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ※当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。
- ※各資産クラスの指数
 日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}
 先進国株…… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}
 新興国株…… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{※3}
 日本国債…… NOMURA-BPI国債^{※4}
 先進国債…… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}
 新興国債…… JPモルガン・ガバナメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバイン・シフアイト(円ベース)^{※6}
 (注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

※2 MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜 3.0%）（1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同じ。）。

「分配金再投資コース」（2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコー

ス)と「分配金再投資コース」(税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース)の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額()として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.486%(税抜0.45%)を乗じて得た額とします(信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率)。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1944% (税抜 0.18%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.2376% (税抜 0.22%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率 （ 所得 税 の み ）
平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

上記は、平成27年 2月27日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成27年 2月27日現在の状況について記載してあります。

【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	391,309,168	98.30
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		6,749,815	1.70
合計（純資産総額）		398,058,983	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】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
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	56,471,195	2.8376	160,243,133	2.8340	160,039,366	40.20
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	57,689,735	1.7418	100,486,016	1.7394	100,345,525	25.21
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	27,956,872	1.9593	54,778,474	2.0876	58,362,765	14.66
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	13,372,746	2.4733	33,076,088	2.6092	34,892,168	8.77
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	20,422,285	1.3399	27,364,899	1.3227	27,012,556	6.79
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	8,364,826	1.1700	9,787,637	1.2740	10,656,788	2.68

(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。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.30
合計	98.30

(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。

【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26年 1月20日）	83,358,017	83,358,017	10,486	10,486
第2期計算期間末 （平成27年 1月20日）	377,394,493	377,394,493	11,741	11,741
平成26年 2月末日	121,683,511		10,394	
3月末日	123,442,687		10,580	
4月末日	141,490,864		10,646	
5月末日	156,571,519		10,730	
6月末日	172,644,035		10,795	
7月末日	188,494,427		10,932	
8月末日	200,474,478		11,054	
9月末日	231,567,572		11,219	
10月末日	271,558,335		11,279	
11月末日	310,906,861		12,137	
12月末日	365,171,465		12,034	
平成27年 1月末日	385,682,693		11,791	
2月末日	398,058,983		11,907	

【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11月 8日～平成26年 1月20日	0
第2期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成25年11月 8日～平成26年 1月20日	4.9
第2期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	12.0

(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11月 8日～平成26年 1月20日	82,565,042	3,071,810	79,493,232
第2期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	351,798,094	109,869,385	321,421,941

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)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）

国内債券インデックス マザーファンド

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	242,492,094,950	79.51
	ポーランド	201,578,000	0.07
	メキシコ	100,865,000	0.03
	小計	242,794,537,950	79.61
地方債証券	日本	18,739,399,369	6.14
特殊債券	日本	25,460,745,887	8.35
	アメリカ	209,996,000	0.07
	スウェーデン	100,678,000	0.03
	韓国	100,480,000	0.03
小計	25,871,899,887	8.48	
社債券	日本	14,582,845,650	4.78
	アメリカ	506,583,000	0.17
	オランダ	305,541,000	0.10
	オーストラリア	302,958,000	0.10
	スウェーデン	302,630,000	0.10
	イギリス	100,871,000	0.03
	フランス	100,236,000	0.03
小計	16,201,664,650	5.31	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,390,839,655	0.46
合計(純資産総額)		304,998,341,511	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	4,600,000,000	100.27	4,612,457,300	100.14	4,606,578,000	0.100	2019/12/20	1.51
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	100.34	4,254,745,100	100.61	4,265,948,800	0.200	2019/9/20	1.40
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	4,170,000,000	100.17	4,177,287,400	100.62	4,196,104,200	0.200	2019/3/20	1.38
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,150,000,000	100.62	4,176,085,200	100.92	4,188,304,500	0.300	2018/6/20	1.37
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	4,020,000,000	100.26	4,030,520,000	100.62	4,045,165,200	0.200	2018/12/20	1.33
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	3,650,000,000	100.20	3,657,300,000	100.62	3,672,666,500	0.200	2019/6/20	1.20
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	100.29	3,510,321,500	100.43	3,515,260,000	0.200	2017/6/20	1.15
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	3,010,000,000	103.06	3,102,167,300	104.73	3,152,523,500	0.800	2022/9/20	1.03
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	100.68	2,970,090,300	102.76	3,031,420,000	0.600	2024/6/20	0.99
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	3,000,000,000	100.63	3,019,155,000	100.50	3,015,180,000	0.400	2016/6/20	0.99
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,900,000,000	100.49	2,914,210,000	102.96	2,986,101,000	0.600	2023/12/20	0.98
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,860,000,000	100.38	2,870,914,300	101.71	2,909,049,000	0.500	2024/9/20	0.95
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	100.30	2,758,288,400	102.86	2,828,870,000	0.600	2024/3/20	0.93
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	2,680,000,000	100.30	2,688,049,200	100.48	2,692,971,200	0.200	2017/9/20	0.88
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,660,000,000	100.29	2,667,907,200	100.62	2,676,492,000	0.200	2018/9/20	0.88
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.70	2,618,458,000	100.60	2,615,704,000	0.400	2016/9/20	0.86
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,490,000,000	104.87	2,611,263,000	104.17	2,593,833,000	1.500	2017/12/20	0.85
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	100.56	2,514,180,500	100.60	2,515,075,000	0.300	2017/3/20	0.82
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	102.48	2,295,641,600	104.73	2,346,064,000	0.800	2023/9/20	0.77
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	106.08	2,302,076,200	106.55	2,312,308,600	1.200	2020/12/20	0.76
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	100.52	2,291,878,800	100.52	2,291,878,800	0.300	2016/12/20	0.75
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	106.03	2,290,296,800	105.88	2,287,094,400	1.300	2019/12/20	0.75
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	105.76	2,221,149,000	105.23	2,209,872,000	1.500	2018/9/20	0.72
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	105.23	2,199,307,000	104.30	2,180,058,100	1.700	2017/9/20	0.71
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,040,000,000	102.55	2,092,020,000	104.72	2,136,410,400	0.800	2023/6/20	0.70
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,950,000,000	106.46	2,076,114,000	107.05	2,087,514,000	1.200	2021/6/20	0.68
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,010,000,000	100.92	2,028,492,000	103.12	2,072,832,600	0.600	2023/3/20	0.68
日本	国債証券	第345回利付国債(2年)	2,060,000,000	100.16	2,063,392,200	100.15	2,063,151,800	0.100	2016/10/15	0.68
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1,990,000,000	104.47	2,079,092,300	103.45	2,058,814,200	1.700	2017/3/20	0.68
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,930,000,000	104.62	2,019,304,400	106.18	2,049,389,800	1.000	2022/3/20	0.67

(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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	79.61
地方債証券	6.14
特殊債券	8.48
社債券	5.31
合計	99.54

(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。

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。

国内株式インデックス マザーファンド

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	151,748,598,600	98.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,783,850,370	1.80
合計(純資産総額)		154,532,448,970	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。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	1,601,775,000	1.04

(注1)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。

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	940,200	5,680.13	5,340,458,226	8,063.00	7,580,832,600	4.91
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,396,500	579.11	3,125,167,115	777.70	4,196,858,050	2.72
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	355,700	7,264.40	2,583,947,080	7,367.00	2,620,441,900	1.70
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	613,300	3,533.15	2,166,880,895	3,949.50	2,422,228,350	1.57
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	508,700	4,103.22	2,087,308,014	4,759.50	2,421,157,650	1.57
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,320,600	197.77	1,843,335,062	220.50	2,055,192,300	1.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	263,200	5,992.23	1,577,154,936	7,420.00	1,952,944,000	1.26
日本	株式	KDDI	情報・通信業	227,800	6,017.01	1,370,674,878	8,290.00	1,888,462,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	267,400	4,624.34	1,236,548,516	6,123.00	1,637,290,200	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	70,900	17,504.18	1,241,046,362	22,945.00	1,626,800,500	1.05
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	423,200	3,440.23	1,455,905,336	3,772.00	1,596,310,400	1.03
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	812,900	1,300.11	1,056,859,419	1,901.00	1,545,322,900	1.00
日本	株式	キヤノン	電気機器	395,100	3,330.09	1,315,718,559	3,889.00	1,536,543,900	0.99
日本	株式	ソニー	電気機器	445,400	1,720.69	766,395,326	3,414.50	1,520,818,300	0.98
日本	株式	三菱地所	不動産業	500,000	2,484.39	1,242,195,000	2,793.50	1,396,750,000	0.90
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	61,000	13,520.22	824,733,420	22,250.00	1,357,250,000	0.88
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,636,000	682.78	1,117,028,080	818.00	1,338,248,000	0.87
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	281,400	4,083.93	1,149,217,902	4,573.50	1,286,982,900	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	124,900	7,706.85	962,585,565	10,035.00	1,253,371,500	0.81
日本	株式	パナソニック	電気機器	830,500	1,108.71	920,783,655	1,495.00	1,241,597,500	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	515,500	2,014.73	1,038,593,315	2,390.50	1,232,302,750	0.80
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	956,600	928.57	888,270,062	1,264.00	1,209,142,400	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	276,800	3,173.09	878,311,312	4,350.50	1,204,218,400	0.78
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	554,200	1,692.17	937,800,614	2,124.50	1,177,397,900	0.76
日本	株式	三井不動産	不動産業	357,000	3,201.51	1,142,939,070	3,286.50	1,173,280,500	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	71,500	8,651.09	618,552,935	14,745.00	1,054,267,500	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	128,000	6,083.83	778,730,240	8,203.00	1,049,984,000	0.68
日本	株式	花王	化学	192,000	4,124.54	791,911,680	5,350.00	1,027,200,000	0.66
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	223,700	3,617.22	809,172,114	4,584.00	1,025,440,800	0.66
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,375,200	679.37	934,269,624	735.00	1,010,772,000	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。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.42
		建設業	2.52
		食料品	4.00
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.04
		医薬品	4.69
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.91
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.66
		機械	4.90
		電気機器	12.56
		輸送用機器	11.58
		精密機器	1.43
		その他製品	1.30
		電気・ガス業	1.94
		陸運業	4.20
		海運業	0.33
		空運業	0.59
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	6.71
		卸売業	4.02
		小売業	4.16
		銀行業	9.17
		証券、商品先物取引業	1.36
		保険業	2.43
		その他金融業	1.24
		不動産業	2.91
		サービス業	3.01
	小計	98.20	
合計		98.20	

(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または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	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	105円		1,582,457,000	1,601,775,000	1.04

(注1)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。

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

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	90,260,898,764	40.20
	イタリア	21,687,658,515	9.66
	フランス	21,588,550,546	9.61
	イギリス	18,388,498,710	8.19
	ドイツ	17,299,859,748	7.70
	スペイン	11,967,032,392	5.33
	ベルギー	5,792,238,106	2.58
	オランダ	5,711,207,458	2.54
	カナダ	4,996,020,946	2.22
	オーストラリア	3,691,946,663	1.64
	オーストリア	3,546,688,926	1.58
	メキシコ	2,341,313,133	1.04
	アイルランド	1,807,359,407	0.80
	デンマーク	1,612,243,849	0.72
	フィンランド	1,371,069,382	0.61
	ポーランド	1,273,204,207	0.57
	南アフリカ	1,223,836,422	0.55
	マレーシア	1,122,607,951	0.50
	スウェーデン	1,053,059,958	0.47
	シンガポール	830,427,711	0.37
スイス	788,554,439	0.35	
ノルウェー	607,471,369	0.27	
	小計	218,961,748,602	97.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,595,232,324	2.49
合計(純資産総額)		224,556,980,926	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。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	961,469,026	0.43
	買建	ドイツ	1,681,647,115	0.75

(注1)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。

(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。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		3,653,729,000	1.62

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/16	18,000,000	12,206.21	2,197,117,993	12,131.76	2,183,717,228	1.750	2016/5/31	0.97
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/16	17,300,000	11,957.41	2,068,632,596	11,954.95	2,068,207,025	0.625	2016/8/15	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	11,981.74	1,593,571,822	11,959.14	1,590,566,546	0.625	2016/7/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/15/16	13,000,000	11,929.86	1,550,882,123	11,940.74	1,552,296,715	0.625	2016/11/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	11,500,000	11,171.90	1,284,769,076	12,487.24	1,436,032,935	2.875	2043/5/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	11,970.56	1,436,467,375	11,958.44	1,435,013,779	0.750	2017/1/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	9,900,000	12,017.22	1,189,705,368	13,729.56	1,359,226,540	3.375	2044/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/16	11,000,000	11,945.55	1,314,010,710	11,937.48	1,313,123,104	0.375	2016/3/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	13,239.43	1,297,464,714	12,907.94	1,264,979,013	4.500	2017/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	10,000,000	11,976.15	1,197,615,224	11,992.92	1,199,292,458	1.500	2019/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	10,000,000	11,966.83	1,196,683,427	11,986.16	1,198,616,913	1.500	2019/2/28	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	12,004.33	1,200,433,920	11,984.53	1,198,453,847	0.875	2017/1/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	10,000,000	11,939.52	1,193,952,932	11,937.71	1,193,771,569	0.625	2016/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	12,688.51	1,205,408,549	12,481.41	1,185,734,824	3.000	2017/2/28	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	12,607.91	1,147,320,031	12,510.30	1,138,437,740	2.750	2017/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	11,871.55	1,115,926,457	11,903.23	1,118,904,480	1.250	2018/11/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 3% 08/31/16	8,700,000	12,611.87	1,097,232,756	12,380.08	1,077,067,500	3.000	2016/8/31	0.48

アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,611.35	1,045,021,847	11,702.43	1,053,219,331	1.000	2019/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	11,947.51	1,051,381,271	11,929.56	1,049,801,491	0.875	2017/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	11,877.49	1,009,587,035	12,275.72	1,043,436,622	2.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	11,934.22	1,002,475,203	12,406.17	1,042,118,828	2.500	2024/5/15	0.46
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	15,734.41	1,038,471,326	15,755.19	1,039,842,976	4.250	2019/4/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	8,600,000	11,640.75	1,001,104,672	11,995.95	1,031,651,955	2.000	2023/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	8,100,000	12,275.25	994,295,985	12,666.14	1,025,957,980	2.750	2024/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	8,000,000	12,467.90	997,432,645	12,523.58	1,001,886,635	2.625	2020/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	12,630.04	1,010,403,257	12,455.32	996,426,311	2.750	2017/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	12,308.57	972,377,097	12,223.77	965,678,404	1.875	2017/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	7,900,000	12,070.72	953,587,643	12,022.27	949,759,821	1.000	2016/9/30	0.42
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 10/25/21	5,800,000	15,331.23	889,211,340	16,110.37	934,401,546	3.250	2021/10/25	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,000,000	13,214.74	925,032,029	13,205.19	924,363,466	3.625	2021/2/15	0.41

(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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.51
合計	97.51

(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。

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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	34	アメリカ ドル	4,060,776.71	484,328,838	4,051,312.5	483,200,042	0.22
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	20	アメリカ ドル	2,559,283.12	305,245,697	2,552,812.6	304,473,958	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカ ドル	1,458,942.25	174,008,042	1,457,156.25	173,795,026	0.08
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	23	ユーロ	2,559,572	342,086,797	2,560,590	342,222,853	0.15
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	24	ユーロ	3,143,576	420,138,933	3,150,480	421,061,652	0.19
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	43	ユーロ	6,834,702	913,457,922	6,871,400	918,362,610	0.41

(注1)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。

(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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	13,430,000.00	1,595,989,380	1,601,258,900	0.71
	カナダドル	買建	1,490,000.00	141,742,570	142,101,300	0.06
	ユーロ	買建	11,900,000.00	1,601,726,990	1,590,435,000	0.70
	イギリスポンド	買建	1,740,000.00	317,105,350	319,933,800	0.14

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

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	139,594,611,338	56.33
	イギリス	19,906,494,094	8.03
	スイス	9,903,437,720	4.00
	カナダ	9,692,534,711	3.91
	ドイツ	9,385,210,166	3.79
	フランス	9,003,315,277	3.63
	オーストラリア	6,715,041,153	2.71
	オランダ	3,759,350,818	1.52
	アイルランド	3,715,767,893	1.50
	スペイン	3,483,262,163	1.41
	スウェーデン	3,138,615,137	1.27
	香港	2,641,398,944	1.07
	イタリア	2,113,849,277	0.85
	デンマーク	1,575,144,098	0.64
	シンガポール	1,570,558,454	0.63
	ベルギー	1,357,370,142	0.55
	ジャージー	1,354,182,172	0.55
	フィンランド	902,779,233	0.36
	バミューダ	880,282,840	0.36
	キュラソー	824,037,935	0.33
ノルウェー	619,131,446	0.25	
イスラエル	556,918,540	0.22	

	ルクセンブルク	367,409,080	0.15
	オーストリア	208,441,292	0.08
	ケイマン	168,231,208	0.07
	ニュージーランド	162,248,112	0.07
	ポルトガル	158,560,390	0.06
	パナマ	125,311,631	0.05
	英ヴァージン諸島	104,017,149	0.04
	リベリア	96,225,128	0.04
	ガンジー	71,157,551	0.03
	マン島	36,589,525	0.01
	モーリシャス	15,091,751	0.01
	小計	234,206,576,368	94.51
投資信託受益証券	オーストラリア	149,696,711	0.06
	香港	29,393,333	0.01
	シンガポール	27,271,681	0.01
	小計	206,361,725	0.08
投資証券	アメリカ	4,052,385,317	1.64
	オーストラリア	562,793,760	0.23
	フランス	356,434,877	0.14
	イギリス	347,878,539	0.14
	香港	111,757,232	0.05
	シンガポール	108,364,819	0.04
	カナダ	50,816,983	0.02
	小計	5,590,431,527	2.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,816,183,450	3.15
合計(純資産総額)		247,819,553,070	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。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,529,659,914	1.83
	買建	カナダ	340,305,888	0.14
	買建	ドイツ	1,255,125,420	0.51
	買建	イギリス	826,869,046	0.33
	買建	オーストラリア	410,739,945	0.17

(注1)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。

(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。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		133,458,900	0.05
	売建		443,990,000	0.17

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
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	376,044	10,966.87	4,124,028,106	15,554.59	5,849,212,893	2.36
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	270,893	11,898.08	3,223,107,347	10,573.28	2,864,229,029	1.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	502,547	4,880.79	2,452,830,439	5,254.43	2,640,602,983	1.07
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	179,122	12,034.68	2,155,677,206	12,260.95	2,196,206,961	0.89
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	316,138	6,041.10	1,909,821,554	6,577.74	2,079,473,726	0.84
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	643,887	3,143.67	2,024,171,341	3,087.90	1,988,258,860	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	206,923	8,759.38	1,812,518,028	9,332.46	1,931,100,621	0.78
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	147,614	10,290.54	1,519,027,800	12,278.56	1,812,488,094	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	173,313	9,672.78	1,676,418,828	10,158.22	1,760,552,605	0.71
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	238,860	6,672.03	1,593,681,357	7,344.64	1,754,342,287	0.71
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	402,676	3,544.91	1,427,452,288	4,125.54	1,661,259,690	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	266,171	5,907.67	1,572,452,249	5,888.35	1,567,310,643	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	121,309	14,445.62	1,752,384,543	12,769.04	1,549,000,226	0.63
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	45,108	33,374.38	1,505,451,849	32,400.89	1,461,539,797	0.59
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	332,829	4,188.99	1,394,217,562	4,114.81	1,369,529,762	0.55

イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,257,681	1,153.66	1,450,948,178	1,069.85	1,345,534,041	0.54
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	74,104	15,511.47	1,149,462,030	17,692.51	1,311,085,894	0.53
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	674,856	1,830.88	1,235,584,712	1,913.09	1,291,060,805	0.52
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	103,102	10,099.78	1,041,307,888	12,470.87	1,285,771,762	0.52
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	182,464	6,769.76	1,235,238,437	7,032.15	1,283,115,896	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	253,021	4,868.35	1,231,796,588	5,064.20	1,281,350,011	0.52
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	309,737	3,358.64	1,040,296,068	4,013.43	1,243,109,471	0.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	128,534	7,932.87	1,019,644,229	9,590.50	1,232,705,417	0.50
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	18,533	66,562.72	1,233,606,922	66,252.09	1,227,850,162	0.50
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	18,299	67,590.48	1,236,838,350	66,706.51	1,220,662,578	0.49
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	194,468	5,725.06	1,113,342,099	6,250.94	1,215,607,936	0.49
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	96,851	10,276.93	995,331,432	12,426.74	1,203,542,322	0.49
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	226,640	4,927.11	1,116,682,013	5,234.76	1,186,406,074	0.48
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	329,083	2,976.69	979,578,640	3,567.36	1,173,959,407	0.47
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	84,309	9,830.23	828,777,148	13,761.37	1,160,207,563	0.47

(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。

□. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.94
		素材	5.07
		資本財	6.92
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	2.00
		自動車・自動車部品	1.75
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.64
		メディア	3.00
		小売	3.36
		食品・生活必需品小売り	2.16
		食品・飲料・タバコ	6.04

	家庭用品・パーソナル用品	1.70
	ヘルスケア機器・サービス	3.40
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.87
	銀行	8.98
	各種金融	3.88
	保険	4.09
	不動産	0.72
	ソフトウェア・サービス	6.90
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.57
	電気通信サービス	3.08
	公益事業	3.13
	半導体・半導体製造装置	1.79
	小計	94.51
投資信託受益証券		0.08
投資証券		2.26
合計		96.85

(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または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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	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	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	72	アメリカドル	36,672,774	4,373,961,755	37,978,200	4,529,659,914	1.83
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	20	カナダドル	3,423,330	326,654,149	3,566,400	340,305,888	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	34	スイスフラン	2,792,728	349,370,273	3,049,460	381,487,446	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	183	ユーロ	6,105,273.5	815,969,803	6,536,760	873,637,974	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	30	オーストラリアドル	4,093,285	381,371,363	4,408,500	410,739,945	0.17
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	65	イギリスポンド	4,359,548.75	801,938,992	4,495,075	826,869,046	0.33

(注1)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。

(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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	720,000.00	85,705,992	85,867,200	0.03
	ユーロ	買建	170,000.00	22,996,070	22,720,500	0.00
	イギリスポンド	買建	40,000.00	7,394,380	7,357,200	0.00
	スイスフラン	買建	140,000.00	17,559,080	17,514,000	0.00
	アメリカドル	売建	2,250,000.00	268,343,100	268,335,000	0.10
	カナダドル	売建	200,000.00	19,081,440	19,080,000	0.00
	ユーロ	売建	500,000.00	66,823,650	66,825,000	0.02
	イギリスポンド	売建	200,000.00	36,786,760	36,786,000	0.01
	スイスフラン	売建	200,000.00	25,022,320	25,022,000	0.01
	オーストラリアドル	売建	300,000.00	27,943,200	27,942,000	0.01

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

新興国債券インデックス マザーファンド

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	マレーシア	1,442,559,781	10.30
	ポーランド	1,434,848,008	10.24
	南アフリカ	1,399,522,329	9.99
	メキシコ	1,389,922,472	9.92
	トルコ	1,321,192,360	9.43
	ブラジル	1,306,944,147	9.33
	インドネシア	1,289,478,015	9.20
	タイ	1,097,030,951	7.83
	コロンビア	1,017,075,956	7.26
	ハンガリー	716,457,279	5.11
	ロシア	578,969,929	4.13
	ペルー	265,440,725	1.89
	ナイジェリア	222,967,131	1.59
	フィリピン	64,489,036	0.46
チリ	10,287,382	0.07	
	小計	13,557,185,501	96.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		451,826,208	3.23
合計(純資産総額)		14,009,011,709	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。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,027,991	0.01
	売建		2,031,180	0.01

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	7,900,000,000	5.28	417,265,097	5.34	422,629,101	7.750	2021/4/14	3.02
コロンビア	国債証券	COLOM 4.375% 03/21/23	6,950,000,000	4.28	297,910,335	4.42	307,219,715	4.375	2023/3/21	2.19
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	22,350,000	1,231.38	275,213,934	1,271.29	284,134,583	10.500	2026/12/21	2.03
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	56,500,000	389.69	220,179,786	391.62	221,268,464	3.875	2019/6/13	1.58
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	3,800,000,000	5.08	193,378,048	5.00	190,129,901	12.000	2015/10/22	1.36
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	4,800,000	3,913.81	187,863,246	3,913.88	187,866,590	10.000	2017/1/1	1.34
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.375% 03/15/24	17,800,000,000	0.96	171,044,484	1.02	182,259,540	8.375	2024/3/15	1.30
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	19,500,000,000	0.77	151,517,460	0.86	168,659,127	6.625	2033/5/15	1.20
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	3,750,000	4,441.17	166,543,897	4,462.49	167,343,524	7.100	2023/3/8	1.19
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 12/17/21	42,000,000	389.06	163,407,308	393.71	165,362,198	3.650	2021/12/17	1.18
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 10/01/16	4,800,000	3,330.09	159,844,735	3,374.67	161,984,354	0.000	2016/10/1	1.16
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	40,500,000	377.16	152,750,248	377.65	152,950,064	3.250	2017/6/16	1.09
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	3,550,000	3,992.80	141,744,478	4,068.66	144,437,467	5.750	2022/9/23	1.03
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	85,000,000	182.26	154,926,525	168.39	143,134,241	7.850	2018/3/10	1.02
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/17	4,350,000	3,178.40	138,260,618	3,274.42	142,437,336	0.000	2017/1/1	1.02
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	13,100,000	1,067.76	139,877,256	1,076.12	140,972,470	8.000	2018/12/21	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	13,400,000	1,033.12	138,439,358	1,047.45	140,358,441	7.250	2020/1/15	1.00
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	13,200,000	1,041.15	137,431,813	1,059.85	139,901,267	10.000	2024/12/5	1.00
トルコ	国債証券	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000	5,088.06	137,377,809	5,161.28	139,354,593	10.400	2019/3/27	0.99

ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/16	4,000,000	3,378.45	135,138,308	3,477.95	139,118,213	0.000	2016/7/1	0.99
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	4,100,000	3,399.67	139,386,717	3,389.44	138,967,341	4.750	2016/10/25	0.99
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.25% 03/31/36	16,400,000	800.47	131,278,347	842.79	138,218,434	6.250	2036/3/31	0.99
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	326,000,000	46.97	153,127,154	42.24	137,703,207	7.000	2019/10/23	0.98
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.75% 03/31/21	13,500,000	997.66	134,685,351	1,018.50	137,498,482	6.750	2021/3/31	0.98
ポーランド	国債証券	POLGB 5.25% 10/25/17	3,900,000	3,530.91	137,705,702	3,522.11	137,362,414	5.250	2017/10/25	0.98
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/19	3,900,000	3,401.20	132,647,050	3,421.71	133,446,911	3.250	2019/7/25	0.95
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	12,100,000	1,073.58	129,904,279	1,075.09	130,086,603	8.250	2017/9/15	0.93
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/19	3,400,000	3,782.86	128,617,298	3,784.63	128,677,482	10.000	2019/1/1	0.92
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	31,900,000	386.53	123,304,744	395.92	126,300,879	3.625	2023/6/16	0.90
インドネシア	国債証券	INDOGB 9% 03/15/29	11,400,000,000	0.98	112,057,933	1.09	124,279,825	9.000	2029/3/15	0.89

(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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.77
合計	96.77

(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。

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	17,004.79	2,031,180	2,027,991	0.01
	ロシアルーブル	売建	1,047,000.00	2,031,180	2,031,180	0.01

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

新興国株式インデックス マザーファンド

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	3,466,736,989	14.34
	台湾	2,974,326,651	12.30
	中国	2,906,010,141	12.02
	南アフリカ	1,854,570,342	7.67
	ブラジル	1,844,000,641	7.63
	インド	1,812,147,560	7.49
	香港	1,114,175,506	4.61
	メキシコ	1,085,550,003	4.49
	ケイマン	1,057,843,082	4.37
	ロシア	885,830,042	3.66
	マレーシア	832,053,053	3.44
	インドネシア	639,728,355	2.65
	タイ	569,452,002	2.36
	トルコ	364,310,617	1.51
	ポーランド	352,869,831	1.46
	チリ	330,884,682	1.37
	フィリピン	320,644,926	1.33
	バミューダ	276,292,416	1.14
	カタール	208,909,429	0.86
	アラブ首長国連邦	166,586,923	0.69
	コロンビア	155,007,590	0.64
	ギリシャ	102,508,141	0.42
	チェコ	51,462,054	0.21
	エジプト	48,162,273	0.20
	ハンガリー	45,251,699	0.19
	アメリカ	24,814,596	0.10
	ペルー	21,949,151	0.09
マルタ共和国	16,641,589	0.07	
スペイン	4,669,046	0.02	
	小計	23,533,389,330	97.33
投資信託受益証券	ブラジル	51,964,995	0.21
	メキシコ	6,513,843	0.03
	小計	58,478,838	0.24
投資証券	南アフリカ	70,344,792	0.29
	メキシコ	38,696,202	0.16
	トルコ	20,810,117	0.09
	小計	129,851,111	0.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		458,220,914	1.90
合計(純資産総額)		24,179,940,193	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。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	521,009,526	2.15

(注1)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。

(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。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		112,104,400	0.46

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,485	131,822.82	723,048,195	149,600.00	820,556,000	3.39
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,219,389	500.51	610,317,073	571.89	697,368,569	2.88
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	255,600	1,907.23	487,490,162	2,085.52	533,060,957	2.20
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	302,500	1,488.82	450,369,070	1,645.66	497,812,150	2.06
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,599,620	87.60	315,360,157	99.81	359,300,390	1.49
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	19,904	14,652.41	291,641,749	17,548.63	349,287,971	1.44
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,596,515	77.25	277,831,253	87.81	315,845,228	1.31
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,046,200	57.34	232,035,154	68.74	278,170,585	1.15
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,704,540	129.67	221,036,734	129.03	219,939,523	0.91
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	631,314	364.06	229,837,696	330.98	208,952,308	0.86
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	45,777	4,085.16	187,006,806	4,403.29	201,569,635	0.83

ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	132,609	1,480.89	196,379,435	1,513.96	200,765,464	0.83
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	74,891	2,173.64	162,786,310	2,624.11	196,522,597	0.81
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	383,000	358.67	137,373,243	509.07	194,976,874	0.81
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	81,887	2,335.24	191,226,271	2,176.91	178,261,080	0.74
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	299,365	737.94	220,913,789	593.48	177,669,391	0.73
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	234,500	673.50	157,937,239	751.03	176,117,004	0.73
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	128,000	991.25	126,880,693	1,330.37	170,287,360	0.70
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	103,000	1,480.60	152,501,921	1,562.39	160,926,458	0.67
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	916,000	180.58	165,420,313	171.64	157,222,973	0.65
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	26,842	5,463.14	146,641,685	5,730.32	153,813,441	0.64
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,096,000	140.42	153,901,310	138.72	152,045,450	0.63
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	28,610	5,178.64	148,160,974	5,124.48	146,611,373	0.61
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	7,976	17,765.10	141,694,441	17,788.80	141,883,469	0.59
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	68,804	1,631.78	112,273,033	1,797.40	123,668,310	0.51
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	28,083	5,529.16	155,275,445	4,392.64	123,358,607	0.51
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,227,400	98.81	121,282,320	100.43	123,269,500	0.51
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	23,616	5,012.01	118,363,704	5,180.07	122,332,710	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,027	101,534.11	104,275,532	116,198.40	119,335,757	0.49
メキシコ	株式	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO-UBD	食品・飲料・タバコ	101,440	1,043.08	105,810,449	1,138.12	115,450,974	0.48

(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。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.06
		素材	7.15
		資本財	4.72
		商業・専門サービス	0.15
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	3.32
		耐久消費財・アパレル	1.33
		消費者サービス	0.74
		メディア	2.23
		小売	1.46
		食品・生活必需品小売り	1.81

	食品・飲料・タバコ	4.75
	家庭用品・パーソナル用品	1.27
	ヘルスケア機器・サービス	0.75
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.48
	銀行	18.54
	各種金融	2.77
	保険	4.21
	不動産	1.93
	ソフトウェア・サービス	5.19
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
	電気通信サービス	7.49
	公益事業	3.16
	半導体・半導体製造装置	5.25
	小計	97.33
投資信託受益証券		0.24
投資証券		0.54
合計		98.10

(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または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	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	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	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	88	アメリカドル	4,331,871	516,662,254	4,368,320	521,009,526	2.15

(注1)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。

(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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	940,000.00	112,055,325	112,104,400	0.46

(注1)評価にあたっては、計算日また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。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。

(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。

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11月8日
作成基準日：2015年2月27日

基準価額・純資産の推移



基準価額 11,907円
純資産総額 3.98億円

※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

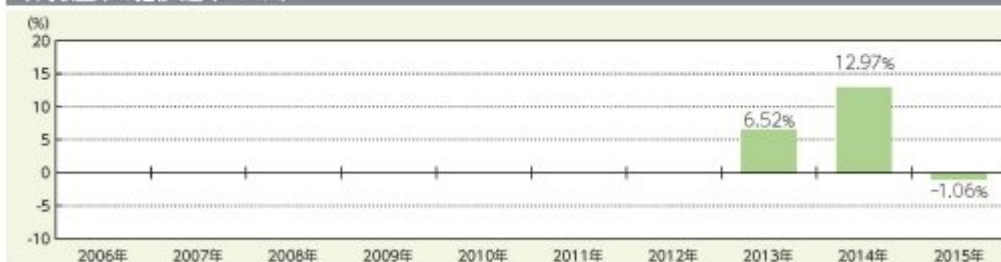
決算期	2014年1月	2015年1月	-	-	-
分配金	0円	0円	-	-	-

※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

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	40.2%	T 1.75% 05/31/16	アメリカ	国債	-	1.750%	2016/05/31	0.4%
		T 0.625% 08/15/16	アメリカ	国債	-	0.625%	2016/08/15	0.4%
新興国債券 インデックス マザーファンド	25.2%	COLOM 7.75% 04/14/21	コロンビア	国債	-	7.750%	2021/04/14	0.8%
		COLOM 4.375% 03/21/23	コロンビア	国債	-	4.375%	2023/03/21	0.6%
外国株式 インデックス マザーファンド	14.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	-	-	0.3%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.2%
新興国株式 インデックス マザーファンド	8.8%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	-	-	0.3%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体-半導体製造装置	-	-	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	6.8%	第122回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2019/12/20	0.1%
		第120回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.2%	2019/09/20	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	2.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2015年は年初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。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」()の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします(「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

(注) 分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするた

め社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

（ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

（ハ）公社債等

計算日（ ）における次のa. からc. までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成25年11月 8日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は平成25年11月8日から平成26年1月20日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・ 受益権の口数が5億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

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

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当するものを除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則とし

て取得申込者とします。)に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金(解約)手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成26年 1月21日から平成27年 1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。

1【財務諸表】

【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成26年 1月20日現在）	第2期 （平成27年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,061,875	7,811,068
親投資信託受益証券	81,996,309	370,453,768
未収利息	2	11
流動資産合計	84,058,186	378,264,847
資産合計	84,058,186	378,264,847
負債の部		
流動負債		
未払解約金	664,371	211,207
未払受託者報酬	3,941	72,442
未払委託者報酬	31,484	579,522
その他未払費用	373	7,183
流動負債合計	700,169	870,354
負債合計	700,169	870,354
純資産の部		
元本等		
元本	79,493,232	321,421,941
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,864,785	55,972,552
（分配準備積立金）	274,817	17,210,837
元本等合計	83,358,017	377,394,493
純資産合計	83,358,017	377,394,493
負債純資産合計	84,058,186	378,264,847

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成25年11月8日 至 平成26年1月20日	自	平成26年1月21日 至 平成27年1月20日
営業収益				
受取利息		107		2,285
有価証券売買等損益		345,502		24,200,733
営業収益合計		345,609		24,203,018
営業費用				
受託者報酬		3,941		109,332
委託者報酬		31,484		874,592
その他費用		373		10,812
営業費用合計		35,798		994,736
営業利益又は営業損失（ ）		309,811		23,208,282
経常利益又は経常損失（ ）		309,811		23,208,282
当期純利益又は当期純損失（ ）		309,811		23,208,282
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（ ）		47,606		6,153,762
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		3,864,785
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,713,730		43,539,834
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,713,730		43,539,834
剰余金減少額又は欠損金増加額		111,150		8,486,587
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		111,150		8,486,587
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,864,785		55,972,552

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (平成26年 1月20日現在)	第2期 (平成27年 1月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,493,232口	321,421,941口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0486円 (10,486円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1741円 (11,741円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成25年11月 8日 至 平成26年 1月20日			第2期 自 平成26年 1月21日 至 平成27年 1月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	274,817円	費用控除後の配当等収益額	A	6,973,595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	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	10,073,684円
収益調整金額	C	3,589,968円	収益調整金額	C	38,761,715円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	163,558円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,864,785円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	55,972,552円
当ファンドの期末残存口数	F	79,493,232口	当ファンドの期末残存口数	F	321,421,941口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	486円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,741円
1万口当たり分配金額	H	- 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	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 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

	第2期 自 平成26年 1月21日 至 平成27年 1月20日
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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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経営会議に報告します。 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

	第2期 (平成27年 1月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(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についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第1期	第2期
	自 平成25年11月 8日 至 平成26年 1月20日	自 平成26年 1月21日 至 平成27年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	79,493,232円
期中追加設定元本額	82,065,042円	351,798,094円
期中一部解約元本額	3,071,810円	109,869,385円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期	第2期
	(平成26年 1月20日現在)	(平成27年 1月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	334,351	21,618,549
合計	334,351	21,618,549

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

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	12,889,983	31,806,033
	国内株式インデックス マザーファンド	8,060,172	9,414,280
	外国株式インデックス マザーファンド	26,980,236	52,759,851
	国内債券インデックス マザーファンド	19,654,429	26,368,381
	外国債券インデックス マザーファンド	54,223,491	153,913,379
	新興国債券インデックス マザーファンド	55,235,053	96,191,844
合計		177,043,364	370,453,768

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「世界経済インデックスファンド(債券シフト型)」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外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」、「新興国株式インデックス 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、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27年1月20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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,584,988,701
国債証券	244,437,690,000
地方債証券	18,887,253,916
特殊債券	25,561,737,885
社債券	16,294,537,640
派生商品評価勘定	1,048,056
未収利息	739,941,550
前払費用	31,784,621
流動資産合計	307,538,982,369
資産合計	307,538,982,369
負債の部	
流動負債	

	平成27年 1月20日現在
項目	金額（円）
前受金	1,050,000
未払金	900,000
未払解約金	291,226,371
流動負債合計	293,176,371
負債合計	293,176,371
純資産の部	
元本等	
元本	229,010,770,480
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	78,235,035,518
元本等合計	307,245,805,998
純資産合計	307,245,805,998
負債純資産合計	307,538,982,369

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 1月20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、社債券</p> <p>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。</p> <p>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>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</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)

	平成27年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	229,010,770,480口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 107,091,000円</p>
3.	1口当たり純資産額 1.3416円

平成27年 1月20日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (13,416円)

(注) 担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27年 1月20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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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経営会議に報告します。 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

平成27年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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) 有価証券 売買目的有価証券 「(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。

	平成27年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)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> <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>

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 1月21日
期首元本額	189,844,804,670円
期中追加設定元本額	59,756,466,155円
期中一部解約元本額	20,590,500,345円
期末元本額	229,010,770,480円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,705,082,542円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,610,785円
S M T 国内債券インデックス・オープン	6,673,753,063円
世界経済インデックスファンド	283,533,568円
マイセレクション25	87,121,216円

区分	平成27年 1月20日現在
マイセレクション50	88,535,414円
マイセレクション75	23,597,458円
DCマイセレクション25	12,993,852,571円
DCマイセレクション50	16,367,495,273円
DCマイセレクション75	4,403,460,269円
DC日本債券インデックス・オープン	403,562,047円
DC日本債券インデックス・オープンS	53,194,258,164円
DC日本債券インデックス・オープンP	19,230,898,530円
DCマイセレクションS25	5,052,771,039円
DCマイセレクションS50	5,840,095,713円
DCマイセレクションS75	1,106,482,485円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	21,212,909円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,071,895,727円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	572,210,032円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	140,473,224円
DC世界経済インデックスファンド	259,932,325円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,259,448,276円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	26,118,752円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	237,073,175円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,886,060円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	915,018円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,034,683,346円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,408,570,290円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	2,444,686,330円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	409,723,573円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	15,314,941,521円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,739,609,545円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,346,334,426円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,800,796,715円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	3,070,134,961円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,355,751,787円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,207,168,725円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,471,321,253円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,586,327,225円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	260,263,100円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,671,768,696円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,473,286,903円
コア投資戦略ファンド（安定型）	6,089,805,707円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,535,529,330円
分散投資コア戦略ファンドA	1,102,388,390円
分散投資コア戦略ファンドS	457,769,650円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	4,643,825円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	82,661,698円

区分	平成27年 1月20日現在
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	26,447,320,507円
コア投資戦略ファンド（切替型）	548,832,137円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	21,221,181円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	19,654,429円
SMT インデックスバランス・オープン	13,072,355円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,046,955,200
地方債証券	372,228,703
特殊債券	431,398,294
社債券	116,084,610
合計	8,966,666,807

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成27年 1月20日現在）

区分	種類	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	889,771,944	-	890,820,000	1,048,056
	合計	889,771,944	-	890,820,000	1,048,056

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第337回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,051,449,000	
	第338回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,602,368,000	
	第339回利付国債(2年)	680,000,000	681,081,200	
	第340回利付国債(2年)	640,000,000	641,088,000	
	第341回利付国債(2年)	630,000,000	631,140,300	
	第342回利付国債(2年)	1,170,000,000	1,172,246,400	
	第343回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,302,639,000	
	第344回利付国債(2年)	1,560,000,000	1,563,338,400	
	第345回利付国債(2年)	2,060,000,000	2,064,614,400	
	第346回利付国債(2年)	590,000,000	591,386,500	
	第95回利付国債(5年)	840,000,000	846,115,200	
	第96回利付国債(5年)	1,770,000,000	1,780,832,400	
	第97回利付国債(5年)	3,000,000,000	3,018,150,000	
	第98回利付国債(5年)	630,000,000	632,923,200	
	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,618,564,000	
	第100回利付国債(5年)	490,000,000	492,685,200	
	第101回利付国債(5年)	950,000,000	957,799,500	
	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,294,364,000	
	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,517,775,000	
	第104回利付国債(5年)	810,000,000	814,017,600	
	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	3,518,970,000	
	第106回利付国債(5年)	2,680,000,000	2,696,026,400	
	第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,127,168,000	
	第108回利付国債(5年)	590,000,000	592,059,100	
	第109回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,194,498,200	
	第110回利付国債(5年)	700,000,000	707,070,000	
	第111回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,611,083,400	
	第112回利付国債(5年)	740,000,000	750,596,800	
	第113回利付国債(5年)	4,150,000,000	4,195,276,500	
	第114回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,123,009,200	
	第115回利付国債(5年)	1,960,000,000	1,975,778,000	
	第116回利付国債(5年)	3,620,000,000	3,651,132,000	
	第117回利付国債(5年)	3,670,000,000	3,703,580,500	
第118回利付国債(5年)	3,810,000,000	3,846,118,800		
第119回利付国債(5年)	700,000,000	703,549,000		
第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	4,280,492,000		
第121回利付国債(5年)	780,000,000	783,814,200		
第122回利付国債(5年)	2,690,000,000	2,703,181,000		

第1回利付国債(40年)	150,000,000	202,542,000	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	389,670,000	
第3回利付国債(40年)	340,000,000	442,669,800	
第4回利付国債(40年)	530,000,000	690,632,400	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	611,152,500	
第6回利付国債(40年)	690,000,000	840,613,200	
第7回利付国債(40年)	850,000,000	981,512,000	
第277回利付国債(10年)	410,000,000	417,728,500	
第278回利付国債(10年)	720,000,000	735,235,200	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	450,326,800	
第280回利付国債(10年)	600,000,000	616,314,000	
第281回利付国債(10年)	700,000,000	720,013,000	
第282回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,296,199,800	
第283回利付国債(10年)	280,000,000	288,509,200	
第284回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,249,990,500	
第285回利付国債(10年)	1,990,000,000	2,064,266,800	
第286回利付国債(10年)	870,000,000	908,471,400	
第287回利付国債(10年)	540,000,000	565,180,200	
第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,186,244,500	
第289回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,642,711,500	
第290回利付国債(10年)	470,000,000	491,154,700	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	875,154,000	
第292回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,170,472,800	
第293回利付国債(10年)	370,000,000	393,032,500	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	190,591,200	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	105,201,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,216,907,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	591,108,000	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,745,722,400	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,381,630,800	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	882,290,000	
第301回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,322,571,600	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	212,436,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,481,031,100	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	509,198,400	
第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,297,851,200	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,468,886,600	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	746,921,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,059,597,000	
第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,885,892,200	
第310回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,679,994,000	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	637,620,800	

第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	2,323,874,700	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,780,944,000	
第314回利付国債(10年)	760,000,000	810,965,600	
第315回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,506,680,000	
第316回利付国債(10年)	720,000,000	770,256,000	
第317回利付国債(10年)	480,000,000	514,478,400	
第318回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,927,975,800	
第319回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,234,410,000	
第320回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,834,397,200	
第321回利付国債(10年)	1,930,000,000	2,060,004,800	
第322回利付国債(10年)	1,030,000,000	1,092,036,900	
第323回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,230,957,200	
第324回利付国債(10年)	1,860,000,000	1,960,068,000	
第325回利付国債(10年)	2,910,000,000	3,068,333,100	
第326回利付国債(10年)	530,000,000	554,952,400	
第327回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,624,592,200	
第328回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,088,751,800	
第329回利付国債(10年)	2,040,000,000	2,153,668,800	
第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	2,365,484,800	
第331回利付国債(10年)	450,000,000	467,509,500	
第332回利付国債(10年)	3,000,000,000	3,117,300,000	
第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	2,856,590,000	
第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	3,063,191,500	
第335回利付国債(10年)	2,860,000,000	2,941,309,800	
第336回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,161,244,500	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	52,891,200	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	202,912,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	150,528,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	148,393,300	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	62,124,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	242,457,100	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	226,771,200	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	58,812,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	266,311,200	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	169,083,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	104,166,000	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	232,940,000	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	350,322,900	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	382,590,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	439,688,000	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	478,887,300	
第17回利付国債(30年)	330,000,000	420,677,400	

第18回利付国債(30年)	495,000,000	622,254,600	
第19回利付国債(30年)	210,000,000	264,335,400	
第20回利付国債(30年)	340,000,000	441,303,000	
第21回利付国債(30年)	280,000,000	353,021,200	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	520,212,000	
第23回利付国債(30年)	350,000,000	455,423,500	
第24回利付国債(30年)	330,000,000	429,600,600	
第25回利付国債(30年)	320,000,000	404,204,800	
第26回利付国債(30年)	610,000,000	782,636,100	
第27回利付国債(30年)	710,000,000	927,302,600	
第28回利付国債(30年)	510,000,000	668,283,600	
第29回利付国債(30年)	890,000,000	1,150,405,100	
第30回利付国債(30年)	660,000,000	840,840,000	
第31回利付国債(30年)	770,000,000	966,157,500	
第32回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,356,047,400	
第33回利付国債(30年)	970,000,000	1,177,696,400	
第34回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,514,244,000	
第35回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,303,441,900	
第36回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,317,675,600	
第37回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,281,421,300	
第38回利付国債(30年)	640,000,000	752,486,400	
第39回利付国債(30年)	700,000,000	840,301,000	
第40回利付国債(30年)	720,000,000	846,417,600	
第41回利付国債(30年)	580,000,000	667,307,400	
第42回利付国債(30年)	590,000,000	678,635,700	
第43回利付国債(30年)	940,000,000	1,080,924,800	
第44回利付国債(30年)	680,000,000	780,844,000	
第45回利付国債(30年)	150,000,000	164,800,500	
第31回利付国債(20年)	80,000,000	83,268,800	
第32回利付国債(20年)	50,000,000	52,159,000	
第33回利付国債(20年)	140,000,000	148,894,200	
第34回利付国債(20年)	50,000,000	53,808,000	
第35回利付国債(20年)	10,000,000	10,718,400	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	75,646,900	
第37回利付国債(20年)	70,000,000	75,833,100	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	21,721,400	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	541,455,000	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	108,517,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	350,790,000	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	88,718,400	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	158,957,400	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	192,011,600	

第45回利付国債(20年)	290,000,000	325,968,700
第46回利付国債(20年)	170,000,000	190,298,000
第47回利付国債(20年)	90,000,000	101,212,200
第48回利付国債(20年)	130,000,000	149,214,000
第49回利付国債(20年)	140,000,000	158,114,600
第50回利付国債(20年)	220,000,000	245,755,400
第51回利付国債(20年)	100,000,000	112,821,000
第52回利付国債(20年)	110,000,000	125,265,800
第53回利付国債(20年)	80,000,000	91,418,400
第54回利付国債(20年)	200,000,000	229,924,000
第55回利付国債(20年)	140,000,000	159,474,000
第56回利付国債(20年)	150,000,000	171,399,000
第57回利付国債(20年)	240,000,000	272,467,200
第58回利付国債(20年)	300,000,000	341,568,000
第59回利付国債(20年)	200,000,000	225,200,000
第60回利付国債(20年)	350,000,000	385,857,500
第61回利付国債(20年)	240,000,000	257,265,600
第62回利付国債(20年)	320,000,000	337,830,400
第63回利付国債(20年)	200,000,000	227,968,000
第64回利付国債(20年)	320,000,000	368,345,600
第65回利付国債(20年)	220,000,000	254,071,400
第66回利付国債(20年)	330,000,000	378,203,100
第67回利付国債(20年)	130,000,000	150,411,300
第68回利付国債(20年)	190,000,000	225,077,800
第69回利付国債(20年)	390,000,000	458,480,100
第70回利付国債(20年)	400,000,000	483,044,000
第71回利付国債(20年)	200,000,000	237,706,000
第72回利付国債(20年)	630,000,000	744,496,200
第73回利付国債(20年)	360,000,000	423,169,200
第74回利付国債(20年)	200,000,000	237,038,000
第75回利付国債(20年)	130,000,000	154,508,900
第76回利付国債(20年)	270,000,000	315,530,100
第77回利付国債(20年)	290,000,000	341,788,200
第78回利付国債(20年)	170,000,000	199,059,800
第79回利付国債(20年)	270,000,000	318,899,700
第80回利付国債(20年)	220,000,000	262,083,800
第81回利付国債(20年)	390,000,000	461,584,500
第82回利付国債(20年)	600,000,000	716,370,000
第83回利付国債(20年)	290,000,000	347,159,000
第84回利付国債(20年)	670,000,000	794,934,900
第85回利付国債(20年)	290,000,000	348,037,700
第86回利付国債(20年)	210,000,000	256,722,900
第87回利付国債(20年)	550,000,000	666,402,000

第 8 8 回利付国債(20年)	550,000,000	673,937,000	
第 8 9 回利付国債(20年)	320,000,000	388,566,400	
第 9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	767,012,400	
第 9 1 回利付国債(20年)	320,000,000	393,209,600	
第 9 2 回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,317,112,400	
第 9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	491,458,800	
第 9 4 回利付国債(20年)	670,000,000	810,968,000	
第 9 5 回利付国債(20年)	570,000,000	705,107,100	
第 9 6 回利付国債(20年)	420,000,000	509,220,600	
第 9 7 回利付国債(20年)	640,000,000	784,960,000	
第 9 8 回利付国債(20年)	380,000,000	461,738,000	
第 9 9 回利付国債(20年)	970,000,000	1,179,665,500	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	550,000,000	676,269,000	
第 1 0 1 回利付国債(20年)	435,000,000	546,125,100	
第 1 0 2 回利付国債(20年)	500,000,000	628,855,000	
第 1 0 3 回利付国債(20年)	270,000,000	336,136,500	
第 1 0 4 回利付国債(20年)	360,000,000	438,717,600	
第 1 0 5 回利付国債(20年)	730,000,000	890,738,700	
第 1 0 6 回利付国債(20年)	330,000,000	406,936,200	
第 1 0 7 回利付国債(20年)	370,000,000	451,984,600	
第 1 0 8 回利付国債(20年)	680,000,000	812,253,200	
第 1 0 9 回利付国債(20年)	280,000,000	334,476,800	
第 1 1 0 回利付国債(20年)	850,000,000	1,038,717,000	
第 1 1 1 回利付国債(20年)	300,000,000	370,785,000	
第 1 1 2 回利付国債(20年)	800,000,000	977,944,000	
第 1 1 3 回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,468,260,000	
第 1 1 4 回利付国債(20年)	630,000,000	771,466,500	
第 1 1 5 回利付国債(20年)	670,000,000	829,761,500	
第 1 1 6 回利付国債(20年)	490,000,000	607,355,000	
第 1 1 7 回利付国債(20年)	910,000,000	1,114,340,500	
第 1 1 8 回利付国債(20年)	850,000,000	1,029,452,000	
第 1 1 9 回利付国債(20年)	380,000,000	448,745,800	
第 1 2 0 回利付国債(20年)	300,000,000	345,234,000	
第 1 2 1 回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,244,224,800	
第 1 2 2 回利付国債(20年)	280,000,000	330,702,400	
第 1 2 3 回利付国債(20年)	700,000,000	858,725,000	
第 1 2 4 回利付国債(20年)	400,000,000	484,496,000	
第 1 2 5 回利付国債(20年)	430,000,000	534,081,500	
第 1 2 6 回利付国債(20年)	390,000,000	472,504,500	
第 1 2 7 回利付国債(20年)	460,000,000	550,100,200	
第 1 2 8 回利付国債(20年)	560,000,000	669,244,800	
第 1 2 9 回利付国債(20年)	620,000,000	731,680,600	

	第130回利付国債(20年)	440,000,000	519,182,400
	第131回利付国債(20年)	580,000,000	674,586,400
	第132回利付国債(20年)	530,000,000	616,660,300
	第133回利付国債(20年)	810,000,000	955,548,900
	第134回利付国債(20年)	420,000,000	494,932,200
	第135回利付国債(20年)	380,000,000	441,924,800
	第136回利付国債(20年)	710,000,000	814,107,300
	第137回利付国債(20年)	290,000,000	337,090,200
	第138回利付国債(20年)	630,000,000	710,961,300
	第139回利付国債(20年)	470,000,000	538,558,900
	第140回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,543,890,600
	第141回利付国債(20年)	310,000,000	359,333,400
	第142回利付国債(20年)	780,000,000	917,272,200
	第143回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,198,365,000
	第144回利付国債(20年)	440,000,000	494,709,600
	第145回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,711,560,800
	第146回利付国債(20年)	1,460,000,000	1,687,030,000
	第147回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,671,390,000
	第148回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,575,252,000
	第149回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,517,379,200
	第150回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,916,967,500
	第151回利付国債(20年)	160,000,000	169,102,400
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	101,051,000
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,934,000
	国債証券合計	224,300,000,000	244,437,690,000
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,528,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,108,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,953,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	121,694,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,000,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,669,000
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,817,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	231,378,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	228,832,000
	第633回東京都公募公債	129,000,000	131,856,060
	第639回東京都公募公債	50,000,000	51,473,000
	第649回東京都公募公債	102,000,000	106,549,200
	第650回東京都公募公債	140,000,000	146,692,000
	第695回東京都公募公債	100,000,000	107,095,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	107,284,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	104,929,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	103,821,000

第720回東京都公募公債	100,000,000	105,809,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	103,988,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,135,000	
平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	103,460,000	
平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	114,988,500	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	106,678,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	107,438,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,739,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	129,489,000	
第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	121,146,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,897,000	
第144回神奈川県公募公債	100,000,000	103,376,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	104,671,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	213,228,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	233,014,000	
第72回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,652,000	
第91回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,228,000	
第290回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,581,000	
第291回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,737,000	
第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,832,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,908,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,933,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	108,073,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,702,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,084,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,240,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	103,137,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	106,254,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	116,507,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	105,201,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,643,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	203,764,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	104,789,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	107,195,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	105,184,000	
平成18年度第1回静岡県公募公債	162,310,000	166,567,391	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	104,525,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	105,694,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	106,916,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	110,685,564	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	106,376,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	104,127,000	

平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,327,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	123,516,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	213,968,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	108,245,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,287,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,779,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,945,000	
平成19年度第2回広島県公募公債	200,000,000	209,644,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	123,937,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	106,955,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	105,080,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	102,623,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	105,640,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	107,234,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	207,372,710	
平成23年度第11回埼玉県公募公債（5年）	100,000,000	100,599,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	106,776,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,419,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	103,906,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	120,243,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	119,879,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	214,364,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	120,737,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	114,616,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	135,000,000	139,221,450	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	107,049,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	126,609,600	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	105,499,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,681,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,596,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	123,684,000	
第46回共同発行市場公募地方債	236,500,000	244,727,835	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,591,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	166,196,448	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,684,000	

第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,571,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	174,626,259	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	117,470,100	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,233,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,261,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,682,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	158,525,919	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,849,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,063,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,104,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	268,617,500	
第97回共同発行市場公募地方債	200,000,000	216,522,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,078,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	159,568,500	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,447,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,773,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,645,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,318,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,459,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,220,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,329,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,179,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,998,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,863,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,847,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	210,048,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	105,524,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	241,210,000	
平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	205,416,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	104,602,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	106,340,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	127,501,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	120,582,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	112,067,000	
第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	101,876,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	104,644,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	107,986,380	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	105,023,000	
平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	105,456,000	
平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,196,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	101,662,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	119,120,000	

	第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	121,140,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	213,180,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	107,241,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	106,388,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	102,879,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	105,041,000	
	第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	117,245,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,270,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	106,818,000	
	平成23年度第1回北九州市公募公債(5年)	100,000,000	100,472,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	107,219,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	155,938,500	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	106,607,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	103,241,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	123,171,000	
	地方債証券合計	17,537,500,000	18,887,253,916	
特殊債券	第42回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	100,478,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,262,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	109,286,000	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,509,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,601,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,121,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	116,891,000	
	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	101,696,000	
	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	111,290,000	
	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	101,811,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,356,000	
	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	222,862,000	
	第14回道路債券	100,000,000	113,193,000	
	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	103,132,000	
	第17回道路債券	100,000,000	110,312,000	
	第21回道路債券	100,000,000	130,772,000	
	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,173,000	
	第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,588,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	303,000,000	314,641,260	

第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,478,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	328,973,400	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,371,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,057,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,339,000	
第42回道路債券	100,000,000	118,533,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,052,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,868,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,464,000	
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,220,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,327,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,630,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,920,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,277,100	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	115,820,730	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,974,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	191,463,610	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,054,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,403,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,676,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,120,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,876,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,858,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,920,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,510,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	147,250,140	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	124,149,000	

第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,809,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,323,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,140,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,848,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,996,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,680,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,727,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,941,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,820,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,794,000	
第140回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,524,000	
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	105,694,000	
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	211,552,000	
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	105,756,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,092,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,857,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,387,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,423,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,963,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,248,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,063,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,752,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,927,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,866,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	220,990,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,760,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	213,643,280	

第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,383,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,066,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,033,000	
第2回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,782,000	
第3回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	340,722,000	
第3回公営企業債券(20年)	110,000,000	117,188,500	
第6回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	100,478,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,317,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	129,408,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	121,804,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	47,106,000	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,749,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,797,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	214,252,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,022,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,017,680	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,796,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	108,762,860	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	108,849,720	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	108,178,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	113,800,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	104,888,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	106,292,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,680,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,685,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,055,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,608,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,571,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,096,000	
第862回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,168,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,901,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,511,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,270,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,676,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	220,106,880	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	127,397,280	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	106,691,520	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	83,414,400	
第11回首都高速道路株式会社債券	300,000,000	301,428,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,890,320	
第18回株式会社日本政策金融公庫債券	100,000,000	121,226,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	106,670,000	

第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	118,200,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	111,549,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,468,600	
第190回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,077,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,081,000	
第197回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,070,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,608,000	38,626,134	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,601,000	29,899,335	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,401,000	31,052,517	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	108,246,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,172,000	39,517,186	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,170,000	32,610,753	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,470,000	26,135,183	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,878,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,440,000	54,944,292	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,844,000	32,048,874	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,381,000	28,665,066	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,832,000	34,107,033	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,293,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,176,000	28,481,843	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,277,000	35,494,912	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,345,000	42,539,768	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,747,000	42,883,772	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,412,000	51,991,525	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,211,000	53,034,992	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,137,000	52,816,879	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,822,000	59,470,357	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,180,000	61,961,391	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,610,000	64,368,070	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,998,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,040,000	133,697,754	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,603,000	38,331,613	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,757,000	74,005,221	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,404,000	38,039,119	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,821,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,552,000	37,967,119	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,589,000	85,052,945	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,350,000	34,367,437	

第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,430,000	85,165,568	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,132,000	84,977,144	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,419,000	38,893,603	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,896,000	168,548,665	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,851,000	87,888,329	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,752,000	38,953,949	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,754,000	91,058,742	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,873,000	90,166,529	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,642,000	91,153,062	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,262,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,468,000	183,678,326	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,196,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,360,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,040,000	188,039,177	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,924,000	94,762,811	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,425,000	96,386,634	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,447,000	96,563,459	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,155,000	96,021,765	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,603,000	95,403,608	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,813,000	98,185,944	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	179,473,500	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,124,000	99,008,864	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,003,000	100,608,601	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,604,000	101,290,503	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,299,000	101,542,867	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,456,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,318,000	204,715,738	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,492,000	102,130,527	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	202,940,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,849,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,442,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	121,054,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	149,469,600	
い第729号商工債	100,000,000	100,594,000	
い第731号商工債	100,000,000	100,689,000	
い第736号商工債	100,000,000	100,496,000	
い第738号商工債	100,000,000	100,534,000	
い第741号商工債	100,000,000	100,618,000	
い第750号商工債	100,000,000	100,411,000	
い第752号商工債	200,000,000	200,852,000	
い第756号商工債	100,000,000	100,432,000	
い第758号商工債	100,000,000	100,810,000	

	い第761号商工債	100,000,000	100,504,000	
	い第740号農林債	100,000,000	100,633,000	
	い第743号農林債	100,000,000	100,586,000	
	い第746号農林債	100,000,000	100,405,000	
	い第748号農林債	100,000,000	100,440,000	
	い第752号農林債	100,000,000	100,335,000	
	い第761号農林債	200,000,000	200,784,000	
	い第762号農林債	100,000,000	100,401,000	
	い第766号農林債	100,000,000	100,417,000	
	第258回信金中金債（5年）	100,000,000	100,545,000	
	第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,579,000	
	第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,684,000	
	第267回信金中金債（5年）	200,000,000	201,278,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,414,000	
	第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,555,000	
	第290回信金中金債（5年）	100,000,000	100,586,000	
	第5回S B A B銀行A B（p u b l）円貨債券	100,000,000	100,761,000	
	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,624,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,069,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	106,228,000	
	第43回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,656,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	209,508,000	
	特殊債券合計	23,970,595,000	25,561,737,885	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	102,403,000	
	第4回スウェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	100,457,000	
	第26回G Eキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,602,000	
	第9回J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,195,000	
	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	103,584,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,701,000	
	第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,467,000	
	第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,999,000	
	第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	100,285,000	
	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	102,182,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	204,046,000	
	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	100,889,000	
	第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,084,000	

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	100,616,000	
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	104,881,000	
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	107,005,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	104,005,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,173,000	
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	106,175,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,462,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	103,697,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,413,000	
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	103,717,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,673,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	100,737,000	
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	101,835,000	
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	100,621,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,656,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,804,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,432,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,420,000	
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,619,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,177,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	102,177,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,035,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,563,000	
第59回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,283,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	204,052,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,903,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,317,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,482,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,426,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,417,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,998,000	
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	101,425,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,395,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,618,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,510,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	101,413,000	

第 2 1 回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	104,082,000	
第 5 3 回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,371,000	
第 7 8 回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,692,000	
第 8 9 回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,862,000	
第 7 0 回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,285,000	
第 6 9 回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,146,000	
第 7 4 回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,767,000	
第 5 0 回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	103,929,000	
第 2 5 回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,748,000	
第 2 6 回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	301,725,000	
第 2 9 回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,668,000	
第 3 0 回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,444,000	
第 2 3 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	128,664,000	
第 2 5 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	106,072,000	
第 3 2 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	108,576,000	
第 1 5 1 回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,445,000	
第 1 回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,580,000	
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	108,959,000	
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	108,296,000	
第 2 0 回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,833,000	
第 2 2 回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,604,000	
第 5 3 回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,711,000	
第 5 6 回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,696,000	
第 3 回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,450,000	
第 1 0 回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	210,692,000	
第 3 6 回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,424,000	
第 2 0 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	100,884,000	
第 1 7 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,725,000	
第 2 7 回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,708,000	
第 4 7 回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,776,000	
	100,000,000	102,056,000	

第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債			
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,691,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,888,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,933,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,962,000	
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	101,861,000	
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	104,657,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,729,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,086,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	108,114,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,715,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,648,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,654,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,260,000	
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	105,739,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,178,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,079,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,983,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,117,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,065,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,325,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,097,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,812,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,827,580	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	123,859,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,921,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,018,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,820,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,412,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,279,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,642,000	
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	102,232,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,466,000	
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	100,789,000	

第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,636,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	104,357,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	121,995,600	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,401,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,136,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,779,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,040,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,313,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,097,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,336,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	106,340,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,578,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,295,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,560,000	
第489回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,637,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,422,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,491,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,028,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,904,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	107,669,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,360,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,155,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,304,600	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,738,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,800,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,058,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,083,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,718,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,904,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,965,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,629,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,876,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,173,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,140,860	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,023,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	205,406,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,730,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,347,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	105,358,000	
社債券合計	15,720,000,000	16,294,537,640	
合計		305,181,219,441	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,838,382,585
株式	144,709,271,060
派生商品評価勘定	42,421,420
未収入金	124,749
未収配当金	163,792,482
未収利息	2,764
差入委託証拠金	104,660,000
流動資産合計	146,858,655,060
資産合計	146,858,655,060
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,775,940
前受金	40,720,000
未払解約金	91,540,017
流動負債合計	134,035,957
負債合計	134,035,957
純資産の部	
元本等	
元本	125,624,543,166
剰余金	
剰余金又は欠損金()	21,100,075,937
元本等合計	146,724,619,103
純資産合計	146,724,619,103
負債純資産合計	146,858,655,060

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	平成27年 1月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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>先物取引 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、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 株式は、原則として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> <p>(2)派生商品取引等損益 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27年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	125,624,543,166口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.1680円 (1万口当たり純資産額) (11,680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27年 1月20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。

平成27年 1月20日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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、株価の変動による価格変動リスクであります。</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経営会議に報告します。</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27年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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>

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 1月21日
期首元本額	138,521,834,689円
期中追加設定元本額	25,322,062,780円
期中一部解約元本額	38,219,354,303円
期末元本額	125,624,543,166円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,545,497,892円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,419,121,471円
SBI資産設計オープン（分配型）	22,433,475円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,911,239,576円
世界経済インデックスファンド	473,919,455円
マイセクション25	33,276,220円
マイセクション50	86,155,140円
マイセクション75	83,977,874円
日本株式インデックス・オープン	12,917,823,046円
DCマイセクション25	5,038,823,687円
DCマイセクション50	16,026,724,968円
DCマイセクション75	15,442,038,624円
DC日本株式インデックス・オープン	4,117,631,133円
DCマイセクションS25	1,912,399,713円
DCマイセクションS50	5,754,193,698円
DCマイセクションS75	3,842,053,767円
DC日本株式インデックス・オープンS	2,316,125,785円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,597,840円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	468,899,199円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	496,373,868円

区分	平成27年 1月20日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	245,788,494円
DC世界経済インデックスファンド	430,375,397円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	415,692,359円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	90,399,399円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	235,741,615円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	115,297,542円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	1,189,794,143円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	3,105,139円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	568,502,896円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,914,501,222円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	2,839,483,886円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,632,485,382円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	7,310,695,260円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,532,790,293円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	8,677,434,470円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,673,797,510円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,556,579,475円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,764,769,325円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	3,518,400,759円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	914,544,119円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,284,675,170円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	105,451,574円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,713,956,807円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,310,685,695円
日本株式ファンド・シリーズ2	507,351,596円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	17,133,689円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,345,409円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	82,170,362円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	8,060,172円
SMT インデックスバランス・オープン	15,227,576円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	19,924,219,902
合計	19,924,219,902

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 1月20日現在）

区分	種類	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	1,888,594,520	-	1,929,240,000	40,645,480
合計		1,888,594,520	-	1,929,240,000	40,645,480

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	34,000	276.00	9,384,000	
日本水産	97,600	395.00	38,552,000	
マルハニチロ	15,300	1,715.00	26,239,500	
サカタのタネ	11,700	1,990.00	23,283,000	
ホクト	8,800	2,057.00	18,101,600	
住石ホールディングス	22,000	118.00	2,596,000	
日鉄鉱業	22,000	418.00	9,196,000	
三井松島産業	52,000	128.00	6,656,000	
国際石油開発帝石	418,400	1,297.50	542,874,000	
日本海洋掘削	2,400	4,250.00	10,200,000	
石油資源開発	11,300	3,465.00	39,154,500	
K&Oエナジーグループ	5,300	1,477.00	7,828,100	
ショーボンドホールディングス	7,000	4,745.00	33,215,000	
ミライト・ホールディングス	24,400	1,325.00	32,330,000	
タマホーム	6,000	538.00	3,228,000	
サンヨーホームズ	1,300	639.00	830,700	
ダイセキ環境ソリューション	1,200	1,615.00	1,938,000	
安藤・間	53,200	770.00	40,964,000	
東急建設	28,600	577.00	16,502,200	
コムシスホールディングス	35,300	1,583.00	55,879,900	
ミサワホーム	10,100	1,058.00	10,685,800	
高松コンストラクショングループ	6,000	2,528.00	15,168,000	

東建コーポレーション	3,000	4,705.00	14,115,000	
ヤマウラ	4,900	389.00	1,906,100	
大成建設	402,000	702.00	282,204,000	
大林組	238,000	791.00	188,258,000	
清水建設	243,000	815.00	198,045,000	
飛島建設	51,700	262.00	13,545,400	
長谷工コーポレーション	99,600	955.00	95,118,000	
松井建設	10,000	641.00	6,410,000	
銭高組	11,000	372.00	4,092,000	
鹿島建設	349,000	476.00	166,124,000	
不動テトラ	60,900	245.00	14,920,500	
鉄建建設	48,000	458.00	21,984,000	
日鉄住金テックスエンジ	15,000	512.00	7,680,000	
西松建設	86,000	468.00	40,248,000	
三井住友建設	320,300	181.00	57,974,300	
大豊建設	22,000	528.00	11,616,000	
前田建設工業	53,000	921.00	48,813,000	
佐田建設	27,000	138.00	3,726,000	
ナカノフドー建設	7,700	399.00	3,072,300	
奥村組	75,000	522.00	39,150,000	
大和小田急建設	4,900	767.00	3,758,300	
東鉄工業	9,500	2,773.00	26,343,500	
イチケン	10,000	320.00	3,200,000	
戸田建設	99,000	440.00	43,560,000	
熊谷組	100,000	367.00	36,700,000	
青木あすなる建設	5,100	813.00	4,146,300	
北野建設	18,000	367.00	6,606,000	
植木組	12,000	266.00	3,192,000	
三井ホーム	11,000	500.00	5,500,000	
矢作建設工業	10,300	883.00	9,094,900	
ピーエス三菱	9,000	473.00	4,257,000	
東日本ハウス	11,200	514.00	5,756,800	
大東建託	30,200	13,940.00	420,988,000	
新日本建設	10,700	436.00	4,665,200	
N I P P O	18,000	1,854.00	33,372,000	
東亜道路工業	15,000	444.00	6,660,000	
前田道路	25,000	1,762.00	44,050,000	
日本道路	24,000	565.00	13,560,000	
東亜建設工業	60,000	207.00	12,420,000	
若築建設	49,000	198.00	9,702,000	
東洋建設	22,300	559.00	12,465,700	
五洋建設	88,200	440.00	38,808,000	

大林道路	10,000	745.00	7,450,000	
世紀東急工業	11,600	585.00	6,786,000	
福田組	12,000	954.00	11,448,000	
住友林業	58,600	1,146.00	67,155,600	
日本基礎技術	10,100	383.00	3,868,300	
日成ビルド工業	23,000	289.00	6,647,000	
巴コーポレーション	9,900	435.00	4,306,500	
パナホーム	30,000	737.00	22,110,000	
大和ハウス工業	232,600	2,245.50	522,303,300	
ライト工業	12,900	1,120.00	14,448,000	
積水ハウス	244,300	1,558.50	380,741,550	
日特建設	11,400	551.00	6,281,400	
北陸電気工事	5,000	649.00	3,245,000	
ユアテック	13,000	657.00	8,541,000	
西部電気工業	7,000	480.00	3,360,000	
四電工	7,000	428.00	2,996,000	
中電工	11,500	1,862.00	21,413,000	
関電工	36,000	689.00	24,804,000	
きんでん	53,000	1,336.00	70,808,000	
東京エネシス	9,000	821.00	7,389,000	
トーエネック	12,000	575.00	6,900,000	
住友電設	6,400	1,425.00	9,120,000	
日本電設工業	13,000	1,655.00	21,515,000	
協和エクシオ	33,700	1,239.00	41,754,300	
新日本空調	6,900	941.00	6,492,900	
N D S	13,000	303.00	3,939,000	
九電工	15,000	1,308.00	19,620,000	
三機工業	16,400	759.00	12,447,600	
日揮	80,000	2,393.50	191,480,000	
中外炉工業	25,000	275.00	6,875,000	
ヤマト	8,000	419.00	3,352,000	
太平電業	11,000	891.00	9,801,000	
高砂熱学工業	22,100	1,447.00	31,978,700	
三晃金属工業	10,000	240.00	2,400,000	
朝日工業社	9,000	409.00	3,681,000	
明星工業	14,000	688.00	9,632,000	
大気社	11,300	2,660.00	30,058,000	
ダイダン	11,000	681.00	7,491,000	
日比谷総合設備	10,200	1,547.00	15,779,400	
東芝プラントシステム	12,900	1,847.00	23,826,300	
O S J Bホールディングス	13,300	279.00	3,710,700	
東洋エンジニアリング	39,000	405.00	15,795,000	

千代田化工建設	57,000	977.00	55,689,000
新興プランテック	16,300	849.00	13,838,700
日本製粉	49,000	528.00	25,872,000
日清製粉グループ本社	87,100	1,253.00	109,136,300
日東富士製粉	6,000	318.00	1,908,000
昭和産業	33,000	477.00	15,741,000
鳥越製粉	6,300	716.00	4,510,800
中部飼料	7,600	660.00	5,016,000
フィード・ワンホールディングス	48,000	110.00	5,280,000
東洋精糖	12,000	101.00	1,212,000
日本甜菜製糖	41,000	205.00	8,405,000
三井製糖	31,000	395.00	12,245,000
塩水港精糖	8,600	266.00	2,287,600
森永製菓	72,000	345.00	24,840,000
中村屋	18,000	465.00	8,370,000
江崎グリコ	18,300	4,680.00	85,644,000
名糖産業	3,500	1,180.00	4,130,000
不二家	46,000	199.00	9,154,000
山崎製パン	58,000	1,582.00	91,756,000
第一屋製パン	11,000	134.00	1,474,000
モロゾフ	12,000	371.00	4,452,000
亀田製菓	4,400	3,700.00	16,280,000
寿スピリッツ	1,900	2,396.00	4,552,400
カルビー	29,400	4,280.00	125,832,000
森永乳業	71,000	418.00	29,678,000
六甲バター	3,600	1,058.00	3,808,800
ヤクルト本社	42,600	6,710.00	285,846,000
明治ホールディングス	23,500	12,010.00	282,235,000
雪印メグミルク	18,700	1,515.00	28,330,500
プリマハム	45,000	278.00	12,510,000
日本ハム	58,000	2,911.00	168,838,000
伊藤ハム	44,000	659.00	28,996,000
丸大食品	41,000	419.00	17,179,000
米久	2,600	1,822.00	4,737,200
S Foods	5,000	2,202.00	11,010,000
サッポロホールディングス	130,000	478.00	62,140,000
アサヒグループホールディングス	159,600	3,686.50	588,365,400
キリンホールディングス	339,800	1,515.50	514,966,900
宝ホールディングス	62,300	747.00	46,538,100
オエノンホールディングス	20,000	216.00	4,320,000
養命酒製造	5,000	912.00	4,560,000
コカ・コーラウエスト	26,900	1,665.00	44,788,500

コカ・コーラーストジャパン	24,200	1,979.00	47,891,800
サントリー食品インターナショナル	47,600	4,215.00	200,634,000
ダイドードリンコ	4,000	4,945.00	19,780,000
伊藤園	21,600	2,194.00	47,390,400
キーコーヒー	7,000	1,676.00	11,732,000
ユニカフェ	2,200	782.00	1,720,400
ジャパンフーズ	1,000	1,125.00	1,125,000
日清オイリオグループ	38,000	419.00	15,922,000
不二製油	21,200	1,522.00	32,266,400
かどや製油	800	2,627.00	2,101,600
J・オイルミルズ	33,000	398.00	13,134,000
キッコーマン	65,000	3,175.00	206,375,000
味の素	183,000	2,342.50	428,677,500
キューピー	40,400	2,481.00	100,232,400
ハウス食品グループ本社	29,400	2,152.00	63,268,800
カゴメ	30,700	1,814.00	55,689,800
焼津水産化学工業	3,800	1,011.00	3,841,800
アリアケジャパン	7,200	3,030.00	21,816,000
ニチレイ	85,000	570.00	48,450,000
東洋水産	41,500	4,010.00	166,415,000
イトアンド	900	1,798.00	1,618,200
日清食品ホールディングス	33,600	6,310.00	212,016,000
永谷園	8,000	1,120.00	8,960,000
一正蒲鉾	1,200	1,804.00	2,164,800
フジッコ	8,000	2,061.00	16,488,000
ロック・フィールド	4,100	2,009.00	8,236,900
日本たばこ産業	440,200	3,266.00	1,437,693,200
ケンコーマヨネーズ	2,600	1,440.00	3,744,000
わらべや日洋	4,700	1,935.00	9,094,500
なとり	3,700	1,321.00	4,887,700
ミヨシ油脂	27,000	134.00	3,618,000
片倉工業	9,300	1,261.00	11,727,300
ゲンゼ	60,000	305.00	18,300,000
東洋紡	295,000	160.00	47,200,000
ユニチカ	216,000	57.00	12,312,000
富士紡ホールディングス	36,000	325.00	11,700,000
日清紡ホールディングス	47,000	1,214.00	57,058,000
倉敷紡績	77,000	187.00	14,399,000
シキボウ	43,000	118.00	5,074,000
日本毛織	23,000	762.00	17,526,000
トーア紡コーポレーション	33,000	74.00	2,442,000
ダイドーリミテッド	8,600	507.00	4,360,200

帝国繊維	7,800	2,469.00	19,258,200
帝人	303,000	320.00	96,960,000
東レ	575,000	972.90	559,417,500
サカイオーベックス	20,000	170.00	3,400,000
住江織物	24,000	293.00	7,032,000
日本フェルト	4,400	529.00	2,327,600
イチカワ	5,000	277.00	1,385,000
日本バイリーン	11,000	597.00	6,567,000
芦森工業	21,000	161.00	3,381,000
アツギ	62,000	113.00	7,006,000
ダイニック	14,000	177.00	2,478,000
セーレン	18,500	946.00	17,501,000
東海染工	10,000	122.00	1,220,000
小松精練	13,500	527.00	7,114,500
ワコールホールディングス	44,000	1,159.00	50,996,000
ホギメディカル	4,700	5,800.00	27,260,000
レナウン	17,800	112.00	1,993,600
クラウディア	1,500	1,343.00	2,014,500
T S Iホールディングス	33,500	654.00	21,909,000
三陽商会	42,000	284.00	11,928,000
オンワードホールディングス	53,000	704.00	37,312,000
ルック	15,000	235.00	3,525,000
ゴールドウイン	18,000	634.00	11,412,000
デサント	17,000	1,103.00	18,751,000
キング	3,900	430.00	1,677,000
ヤマトインターナショナル	5,000	425.00	2,125,000
特種東海製紙	43,000	270.00	11,610,000
王子ホールディングス	305,000	414.00	126,270,000
日本製紙	35,800	1,666.00	59,642,800
三菱製紙	113,000	87.00	9,831,000
北越紀州製紙	46,100	499.00	23,003,900
中越パルプ工業	28,000	176.00	4,928,000
巴川製紙所	11,000	193.00	2,123,000
大王製紙	33,000	943.00	31,119,000
レンゴー	66,000	471.00	31,086,000
トモク	23,000	274.00	6,302,000
ザ・パック	5,300	2,170.00	11,501,000
クラレ	126,400	1,398.00	176,707,200
旭化成	463,000	1,125.00	520,875,000
共和レザー	4,900	766.00	3,753,400
コープケミカル	11,000	108.00	1,188,000
昭和電工	494,000	144.00	71,136,000

住友化学	546,000	459.00	250,614,000	
日本化成	14,000	138.00	1,932,000	
住友精化	15,000	777.00	11,655,000	
日産化学工業	49,600	2,157.00	106,987,200	
ラサ工業	28,000	131.00	3,668,000	
クレハ	52,000	495.00	25,740,000	
多木化学	5,000	711.00	3,555,000	
テイカ	12,000	416.00	4,992,000	
石原産業	124,000	102.00	12,648,000	
片倉チッカリン	5,000	277.00	1,385,000	
日本曹達	48,000	637.00	30,576,000	
東ソー	185,000	624.00	115,440,000	
トクヤマ	115,000	238.00	27,370,000	
セントラル硝子	76,000	480.00	36,480,000	
東亜合成	93,000	473.00	43,989,000	
ダイソー	30,000	396.00	11,880,000	
関東電化工業	18,000	573.00	10,314,000	
電気化学工業	154,000	437.00	67,298,000	
信越化学工業	133,100	7,786.00	1,036,316,600	
日本カーバイド工業	25,000	226.00	5,650,000	
堺化学工業	30,000	396.00	11,880,000	
エア・ウォーター	66,000	1,952.00	128,832,000	
大陽日酸	95,000	1,364.00	129,580,000	
日本化学工業	27,000	313.00	8,451,000	
日本パーカライズン	17,500	2,763.00	48,352,500	
高压ガス工業	11,000	578.00	6,358,000	
チタン工業	9,000	235.00	2,115,000	
四国化成工業	11,000	829.00	9,119,000	
戸田工業	15,000	442.00	6,630,000	
ステラ ケミファ	3,800	1,292.00	4,909,600	
保土谷化学工業	22,000	192.00	4,224,000	
日本触媒	58,000	1,574.00	91,292,000	
大日精化工業	31,000	648.00	20,088,000	
カネカ	100,000	702.00	70,200,000	
三菱瓦斯化学	128,000	565.00	72,320,000	
三井化学	337,000	333.00	112,221,000	
J S R	73,300	1,949.00	142,861,700	
東京応化工業	15,400	3,900.00	60,060,000	
大阪有機化学工業	5,400	494.00	2,667,600	
三菱ケミカルホールディングス	464,100	575.20	266,950,320	
日本合成化学工業	17,000	696.00	11,832,000	
ダイセル	104,000	1,465.00	152,360,000	

住友ベークライト	69,000	468.00	32,292,000	
積水化学工業	176,000	1,396.00	245,696,000	
日本ゼオン	64,000	1,150.00	73,600,000	
アイカ工業	22,300	2,620.00	58,426,000	
宇部興産	374,000	179.00	66,946,000	
積水樹脂	11,500	1,554.00	17,871,000	
タキロン	16,000	526.00	8,416,000	
旭有機材工業	26,000	281.00	7,306,000	
日立化成	36,700	2,143.00	78,648,100	
ニチバン	8,000	429.00	3,432,000	
リケンテクノス	12,000	431.00	5,172,000	
大倉工業	18,000	337.00	6,066,000	
積水化成成品工業	21,000	476.00	9,996,000	
群栄化学工業	20,000	340.00	6,800,000	
タイガースポリマー	3,700	764.00	2,826,800	
ミライアル	2,700	1,479.00	3,993,300	
ダイキョーニシカワ	1,800	3,755.00	6,759,000	
日本化薬	48,000	1,548.00	74,304,000	
カーリットホールディングス	6,400	680.00	4,352,000	
日本精化	6,100	847.00	5,166,700	
A D E K A	34,200	1,345.00	45,999,000	
日油	62,000	751.00	46,562,000	
ハリマ化成グループ	7,000	466.00	3,262,000	
花王	204,400	5,011.00	1,024,248,400	
第一工業製薬	16,000	365.00	5,840,000	
三洋化成工業	23,000	872.00	20,056,000	
大日本塗料	43,000	153.00	6,579,000	
日本ペイントホールディングス	64,000	3,790.00	242,560,000	
関西ペイント	90,000	1,947.00	175,230,000	
神東塗料	8,000	213.00	1,704,000	
中国塗料	21,000	915.00	19,215,000	
日本特殊塗料	5,700	754.00	4,297,800	
藤倉化成	10,100	580.00	5,858,000	
太陽ホールディングス	6,000	4,125.00	24,750,000	
D I C	297,000	278.00	82,566,000	
サカタインクス	15,200	1,297.00	19,714,400	
東洋インキＳＣホールディングス	73,000	563.00	41,099,000	
T & K T O K A	2,500	2,202.00	5,505,000	
富士フイルムホールディングス	169,900	3,814.50	648,083,550	
資生堂	132,100	1,735.50	229,259,550	
ライオン	86,000	624.00	53,664,000	
高砂香料工業	24,000	556.00	13,344,000	

マンダム	7,400	3,840.00	28,416,000
ミルボン	4,400	3,090.00	13,596,000
ファンケル	17,200	1,792.00	30,822,400
コーセー	12,000	5,020.00	60,240,000
コタ	2,100	1,539.00	3,231,900
ドクターシーラボ	5,000	4,170.00	20,850,000
シーボン	900	2,627.00	2,364,300
ポーラ・オルビスホールディングス	8,800	5,010.00	44,088,000
ノエビアホールディングス	4,900	2,126.00	10,417,400
アジュバンコスメジャパン	1,400	923.00	1,292,200
エステー	5,200	1,018.00	5,293,600
アグロ カネショウ	2,000	1,082.00	2,164,000
コニシ	5,800	1,955.00	11,339,000
長谷川香料	9,400	1,684.00	15,829,600
星光PMC	4,100	930.00	3,813,000
小林製薬	12,200	7,240.00	88,328,000
荒川化学工業	6,300	1,207.00	7,604,100
メック	5,700	860.00	4,902,000
日本高純度化学	2,100	2,381.00	5,000,100
JCU	2,000	5,390.00	10,780,000
新田ゼラチン	4,600	720.00	3,312,000
アース製薬	5,300	3,870.00	20,511,000
イハラケミカル工業	11,400	1,230.00	14,022,000
北興化学工業	8,000	405.00	3,240,000
大成ラミック	2,100	2,775.00	5,827,500
クミアイ化学工業	15,000	907.00	13,605,000
日本農薬	17,000	1,393.00	23,681,000
アキレス	63,000	150.00	9,450,000
有沢製作所	12,400	851.00	10,552,400
日東電工	57,400	6,982.00	400,766,800
レック	2,700	1,283.00	3,464,100
きもと	13,300	297.00	3,950,100
藤森工業	6,400	3,155.00	20,192,000
前澤化成工業	5,200	1,225.00	6,370,000
JSP	5,500	2,303.00	12,666,500
エフピコ	6,600	4,110.00	27,126,000
天馬	5,900	1,556.00	9,180,400
信越ポリマー	14,500	501.00	7,264,500
東リ	20,000	244.00	4,880,000
ニフコ	16,600	4,180.00	69,388,000
日本バルカー工業	31,000	311.00	9,641,000
ユニ・チャーム	150,300	3,072.00	461,721,600

協和発酵キリン	89,000	1,200.00	106,800,000	
武田薬品工業	278,100	5,502.00	1,530,106,200	
アステラス製薬	845,500	1,804.50	1,525,704,750	
大日本住友製薬	52,500	1,192.00	62,580,000	
塩野義製薬	115,900	3,515.00	407,388,500	
田辺三菱製薬	86,500	1,881.00	162,706,500	
わかもと製薬	8,000	274.00	2,192,000	
あすか製薬	8,700	1,218.00	10,596,600	
日本新薬	17,000	3,950.00	67,150,000	
ピオフェルミン製薬	1,200	2,929.00	3,514,800	
中外製薬	73,900	3,215.00	237,588,500	
科研製薬	26,000	2,500.00	65,000,000	
エーザイ	97,900	5,200.00	509,080,000	
ロート製薬	33,700	1,526.00	51,426,200	
小野薬品工業	33,700	12,550.00	422,935,000	
久光製薬	20,900	3,745.00	78,270,500	
有機合成薬品工業	5,000	270.00	1,350,000	
持田製薬	5,300	6,410.00	33,973,000	
参天製薬	27,300	7,360.00	200,928,000	
扶桑薬品工業	25,000	299.00	7,475,000	
日本ケミファ	9,000	538.00	4,842,000	
ツムラ	23,400	2,695.00	63,063,000	
日医工	17,400	1,983.00	34,504,200	
キッセイ薬品工業	13,800	3,375.00	46,575,000	
生化学工業	14,200	2,060.00	29,252,000	
栄研化学	6,200	1,951.00	12,096,200	
日水製薬	3,000	1,262.00	3,786,000	
鳥居薬品	5,100	2,881.00	14,693,100	
JCRファーマ	5,700	2,292.00	13,064,400	
東和薬品	3,800	5,310.00	20,178,000	
富士製薬工業	2,100	2,023.00	4,248,300	
沢井製薬	11,700	7,140.00	83,538,000	
ゼリア新薬工業	15,200	1,940.00	29,488,000	
第一三共	249,700	1,625.00	405,762,500	
キョーリン製薬ホールディングス	19,800	2,294.00	45,421,200	
大幸薬品	3,300	1,918.00	6,329,400	
ダイト	2,800	2,106.00	5,896,800	
大塚ホールディングス	147,300	3,775.50	556,131,150	
大正製薬ホールディングス	17,900	7,390.00	132,281,000	
日本コークス工業	66,500	110.00	7,315,000	
昭和シェル石油	66,300	1,173.00	77,769,900	
コスモ石油	205,000	160.00	32,800,000	

ニチレキ	9,000	863.00	7,767,000
東燃ゼネラル石油	112,000	1,014.00	113,568,000
ユシロ化学工業	4,300	1,775.00	7,632,500
ピーピー・カストロール	3,000	1,087.00	3,261,000
富士石油	17,200	351.00	6,037,200
MORESCO	1,900	2,119.00	4,026,100
出光興産	35,200	1,944.00	68,428,800
JXホールディングス	823,800	438.90	361,565,820
横浜ゴム	83,000	1,141.00	94,703,000
東洋ゴム工業	33,600	2,727.00	91,627,200
ブリヂストン	232,600	4,614.50	1,073,332,700
住友ゴム工業	57,900	1,860.00	107,694,000
藤倉ゴム工業	6,200	800.00	4,960,000
オカモト	25,000	424.00	10,600,000
フコク	3,100	1,271.00	3,940,100
ニッタ	7,300	2,772.00	20,235,600
住友理工	13,700	890.00	12,193,000
三ツ星ベルト	19,000	928.00	17,632,000
バンドー化学	27,000	426.00	11,502,000
日東紡績	55,000	400.00	22,000,000
旭硝子	366,000	610.00	223,260,000
日本板硝子	358,000	108.00	38,664,000
石塚硝子	10,000	255.00	2,550,000
日本山村硝子	30,000	172.00	5,160,000
日本電気硝子	142,000	540.00	76,680,000
オハラ	2,800	563.00	1,576,400
住友大阪セメント	138,000	341.00	47,058,000
太平洋セメント	463,000	348.00	161,124,000
デイ・シイ	8,600	473.00	4,067,800
日本ヒューム	7,800	875.00	6,825,000
日本コンクリート工業	13,500	549.00	7,411,500
三谷セキサン	3,700	1,972.00	7,296,400
ジャパンパイル	10,300	728.00	7,498,400
東海カーボン	64,000	350.00	22,400,000
日本カーボン	39,000	239.00	9,321,000
東洋炭素	4,100	1,935.00	7,933,500
ノリタケカンパニーリミテド	42,000	282.00	11,844,000
TOTO	109,000	1,335.00	145,515,000
日本碍子	94,000	2,371.00	222,874,000
日本特殊陶業	64,000	3,640.00	232,960,000
MARUWA	2,200	3,155.00	6,941,000
品川リフラクトリーズ	20,000	256.00	5,120,000

黒崎播磨	17,000	240.00	4,080,000
ヨータイ	4,000	377.00	1,508,000
イソライト工業	5,900	207.00	1,221,300
東京窯業	9,000	211.00	1,899,000
ニッカトー	2,700	402.00	1,085,400
フジインコーポレーテッド	7,400	1,795.00	13,283,000
ニチアス	33,000	643.00	21,219,000
ニチハ	10,200	1,340.00	13,668,000
新日鐵住金	3,137,000	293.10	919,454,700
神戸製鋼所	1,283,000	203.00	260,449,000
合同製鐵	39,000	184.00	7,176,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	189,300	2,461.50	465,961,950
日新製鋼	31,800	1,156.00	36,760,800
東京製鐵	37,600	833.00	31,320,800
共英製鋼	7,900	2,055.00	16,234,500
大和工業	16,900	3,265.00	55,178,500
東京鐵鋼	15,000	576.00	8,640,000
大阪製鐵	4,700	2,001.00	9,404,700
淀川製鋼所	53,000	442.00	23,426,000
東洋鋼鋳	18,000	622.00	11,196,000
丸一鋼管	22,800	2,662.00	60,693,600
モリ工業	13,000	422.00	5,486,000
大同特殊鋼	125,000	468.00	58,500,000
日本高周波鋼業	33,000	108.00	3,564,000
日本冶金工業	60,000	242.00	14,520,000
山陽特殊製鋼	44,000	383.00	16,852,000
愛知製鋼	44,000	485.00	21,340,000
日立金属	76,000	1,855.00	140,980,000
日本金属	19,000	143.00	2,717,000
大平洋金属	47,000	343.00	16,121,000
新日本電工	45,600	297.00	13,543,200
栗本鐵工所	39,000	225.00	8,775,000
虹技	10,000	209.00	2,090,000
日本鑄鉄管	9,000	235.00	2,115,000
三菱製鋼	50,000	240.00	12,000,000
日亜鋼業	11,000	346.00	3,806,000
日本精線	6,000	680.00	4,080,000
シンニッタン	8,100	527.00	4,268,700
新家工業	16,000	177.00	2,832,000
大紀アルミニウム工業所	12,000	306.00	3,672,000
日本輕金属ホールディングス	180,000	167.00	30,060,000
三井金属鋳業	202,000	258.00	52,116,000

東邦亜鉛	42,000	359.00	15,078,000
三菱マテリアル	463,000	378.00	175,014,000
住友金属鉱山	205,000	1,721.50	352,907,500
DOWAホールディングス	89,000	940.00	83,660,000
古河機械金属	116,000	194.00	22,504,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,300	2,294.00	16,746,200
東邦チタニウム	12,500	796.00	9,950,000
UACJ	85,000	293.00	24,905,000
古河電気工業	218,000	191.00	41,638,000
住友電気工業	279,600	1,502.50	420,099,000
フジクラ	103,000	494.00	50,882,000
昭和電線ホールディングス	81,000	100.00	8,100,000
東京特殊電線	1,000	1,344.00	1,344,000
タツタ電線	14,800	491.00	7,266,800
沖電線	10,000	316.00	3,160,000
カナレ電気	1,400	2,090.00	2,926,000
平河ヒューテック	2,100	1,092.00	2,293,200
リョービ	41,000	307.00	12,587,000
アーレスティ	6,400	645.00	4,128,000
アサヒホールディングス	11,200	1,836.00	20,563,200
稲葉製作所	3,200	1,317.00	4,214,400
宮地エンジニアリンググループ	21,000	184.00	3,864,000
トーカロ	5,100	1,978.00	10,087,800
アルファC o	3,100	1,187.00	3,679,700
SUMCO	51,600	1,720.00	88,752,000
川田テクノロジーズ	1,700	3,885.00	6,604,500
東洋製罐グループホールディングス	53,100	1,393.00	73,968,300
ホッカンホールディングス	21,000	287.00	6,027,000
コロナ	3,900	1,150.00	4,485,000
横河ブリッジホールディングス	14,300	1,277.00	18,261,100
駒井ハルテック	16,000	283.00	4,528,000
高田機工	9,000	258.00	2,322,000
三和ホールディングス	72,000	813.00	58,536,000
文化シャッター	21,000	922.00	19,362,000
三協立山	9,300	1,833.00	17,046,900
東洋シャッター	2,700	776.00	2,095,200
LIXILグループ	110,300	2,391.00	263,727,300
日本フィルコン	6,600	462.00	3,049,200
ノーリツ	14,600	1,856.00	27,097,600
長府製作所	7,900	2,931.00	23,154,900
リンナイ	13,800	7,940.00	109,572,000
ダイニチ工業	3,900	795.00	3,100,500

日東精工	11,000	361.00	3,971,000	
三洋工業	11,000	208.00	2,288,000	
岡部	15,000	1,011.00	15,165,000	
東ブレ	14,400	1,623.00	23,371,200	
高周波熱錬	13,300	824.00	10,959,200	
サンコール	5,000	659.00	3,295,000	
モリテック スチール	5,000	318.00	1,590,000	
パイオラックス	3,800	5,150.00	19,570,000	
日本発條	64,500	1,041.00	67,144,500	
中央発條	11,000	329.00	3,619,000	
アドバネクス	19,000	178.00	3,382,000	
三益半導体工業	6,300	1,164.00	7,333,200	
日本ドライケミカル	1,100	2,281.00	2,509,100	
日本製鋼所	106,000	424.00	44,944,000	
三浦工業	33,100	1,259.00	41,672,900	
タクマ	25,000	858.00	21,450,000	
ツガミ	21,000	661.00	13,881,000	
オークマ	48,000	976.00	46,848,000	
東芝機械	40,000	466.00	18,640,000	
アマダ	110,600	1,068.00	118,120,800	
アイダエンジニアリング	16,200	1,113.00	18,030,600	
滝澤鉄工所	29,000	210.00	6,090,000	
富士機械製造	24,300	1,090.00	26,487,000	
牧野フライス製作所	37,000	1,015.00	37,555,000	
オーエスジー	33,800	2,120.00	71,656,000	
ダイジェット工業	11,000	219.00	2,409,000	
旭ダイヤモンド工業	20,300	1,219.00	24,745,700	
D M G 森精機	46,800	1,417.00	66,315,600	
ディスコ	8,600	10,750.00	92,450,000	
日東工器	4,400	2,219.00	9,763,600	
パンチ工業	2,600	1,406.00	3,655,600	
豊和工業	4,800	741.00	3,556,800	
大阪機工	29,000	160.00	4,640,000	
東洋機械金属	7,200	440.00	3,168,000	
津田駒工業	18,000	160.00	2,880,000	
島精機製作所	10,500	2,047.00	21,493,500	
日阪製作所	9,400	957.00	8,995,800	
やまびこ	3,100	5,320.00	16,492,000	
ペガサスミシン製造	8,800	586.00	5,156,800	
ナプテスコ	45,200	3,020.00	136,504,000	
三井海洋開発	7,900	2,011.00	15,886,900	
レオン自動機	7,000	498.00	3,486,000	

S M C	22,700	31,285.00	710,169,500
新川	6,200	652.00	4,042,400
ホソカワミクロン	13,000	724.00	9,412,000
ユニオンツール	3,700	2,964.00	10,966,800
オイレス工業	9,300	2,130.00	19,809,000
日精エー・エス・ビー機械	3,000	2,838.00	8,514,000
サトーホールディングス	9,200	2,574.00	23,680,800
日本エアーテック	4,200	662.00	2,780,400
日精樹脂工業	5,600	1,219.00	6,826,400
ワイエイシイ	3,800	660.00	2,508,000
小松製作所	367,800	2,587.50	951,682,500
住友重機械工業	203,000	631.00	128,093,000
日立建機	33,200	2,397.00	79,580,400
日工	11,000	403.00	4,433,000
巴工業	2,800	1,690.00	4,732,000
井関農機	77,000	221.00	17,017,000
T O W A	8,100	725.00	5,872,500
丸山製作所	19,000	223.00	4,237,000
北川鉄工所	36,000	220.00	7,920,000
クボタ	358,000	1,737.00	621,846,000
荏原実業	2,500	1,413.00	3,532,500
三菱化工機	24,000	468.00	11,232,000
月島機械	13,100	1,215.00	15,916,500
帝国電機製作所	5,000	1,235.00	6,175,000
新東工業	17,500	807.00	14,122,500
澁谷工業	6,300	2,433.00	15,327,900
アイチ コーポレーション	10,600	566.00	5,999,600
小森コーポレーション	18,100	1,368.00	24,760,800
鶴見製作所	5,500	1,860.00	10,230,000
住友精密工業	13,000	504.00	6,552,000
酒井重工業	15,000	300.00	4,500,000
荏原製作所	154,000	475.00	73,150,000
石井鐵工所	13,000	224.00	2,912,000
西島製作所	7,500	853.00	6,397,500
北越工業	7,100	982.00	6,972,200
ダイキン工業	103,300	8,126.00	839,415,800
オルガノ	15,000	471.00	7,065,000
トーヨーカネツ	43,000	243.00	10,449,000
栗田工業	42,000	2,442.00	102,564,000
椿本チエイン	38,000	915.00	34,770,000
大同工業	17,000	253.00	4,301,000
日本コンベヤ	23,000	245.00	5,635,000

木村化工機	7,800	500.00	3,900,000
アネスト岩田	11,700	780.00	9,126,000
ダイフク	35,100	1,312.00	46,051,200
サムコ	1,000	1,117.00	1,117,000
加藤製作所	16,000	913.00	14,608,000
油研工業	16,000	246.00	3,936,000
タダノ	34,000	1,389.00	47,226,000
フジテック	20,700	1,130.00	23,391,000
C K D	19,900	1,118.00	22,248,200
キトー	8,700	1,195.00	10,396,500
平和	15,800	2,303.00	36,387,400
理想科学工業	8,600	1,937.00	16,658,200
S A N K Y O	21,500	4,030.00	86,645,000
日本金銭機械	6,800	1,685.00	11,458,000
マースエンジニアリング	4,000	2,054.00	8,216,000
福島工業	4,100	1,793.00	7,351,300
オーイズミ	4,000	844.00	3,376,000
ダイコク電機	3,000	1,817.00	5,451,000
アマノ	23,700	1,212.00	28,724,400
サンデン	45,000	590.00	26,550,000
マックス	11,000	1,232.00	13,552,000
グローリー	22,700	3,225.00	73,207,500
新晃工業	5,000	1,358.00	6,790,000
大和冷機工業	10,300	729.00	7,508,700
セガサミーホールディングス	76,500	1,507.00	115,285,500
日本ピストンリング	32,000	241.00	7,712,000
リケン	31,000	454.00	14,074,000
T P R	8,500	3,015.00	25,627,500
ホシザキ電機	15,500	5,900.00	91,450,000
大豊工業	6,100	1,285.00	7,838,500
日本精工	146,000	1,395.00	203,670,000
N T N	167,000	501.00	83,667,000
ジェイテクト	75,800	1,935.00	146,673,000
不二越	67,000	642.00	43,014,000
日本トムソン	27,000	573.00	15,471,000
T H K	47,200	2,847.00	134,378,400
ユーシン精機	3,200	2,173.00	6,953,600
前澤給装工業	2,700	1,427.00	3,852,900
イーグル工業	10,100	2,097.00	21,179,700
前澤工業	8,200	327.00	2,681,400
日本ピラー工業	7,800	893.00	6,965,400
キッツ	31,900	575.00	18,342,500

日立工機	19,000	918.00	17,442,000
マキタ	46,200	5,570.00	257,334,000
日立造船	55,500	657.00	36,463,500
三菱重工業	1,188,000	667.40	792,871,200
I H I	511,000	605.00	309,155,000
イビデン	46,500	1,771.00	82,351,500
コニカミノルタ	168,900	1,288.00	217,543,200
ブラザー工業	91,600	2,109.00	193,184,400
ミネベア	105,000	1,796.00	188,580,000
日立製作所	1,702,000	893.60	1,520,907,200
東芝	1,492,000	480.70	717,204,400
三菱電機	709,000	1,378.50	977,356,500
富士電機	197,000	469.00	92,393,000
東洋電機製造	15,000	416.00	6,240,000
安川電機	83,300	1,501.00	125,033,300
シンフォニアテクノロジー	49,000	197.00	9,653,000
明電舎	65,000	349.00	22,685,000
オリジン電気	10,000	485.00	4,850,000
山洋電気	16,000	774.00	12,384,000
デンヨー	6,400	1,837.00	11,756,800
東芝テック	51,000	812.00	41,412,000
芝浦メカトロニクス	12,000	341.00	4,092,000
マブチモーター	21,700	4,665.00	101,230,500
日本電産	76,600	7,961.00	609,812,600
東光高岳	3,600	1,666.00	5,997,600
ダイヘン	39,000	567.00	22,113,000
ヤーマン	900	1,502.00	1,351,800
J V C ケンウッド	52,700	286.00	15,072,200
第一精工	2,700	2,175.00	5,872,500
日新電機	17,000	629.00	10,693,000
大崎電気工業	11,000	776.00	8,536,000
オムロン	80,000	5,120.00	409,600,000
日東工業	11,400	2,231.00	25,433,400
I D E C	8,400	1,002.00	8,416,800
不二電機工業	700	1,570.00	1,099,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	137,000	531.00	72,747,000
サクサホールディングス	18,000	227.00	4,086,000
メルコホールディングス	3,900	1,937.00	7,554,300
テクノメディカ	1,600	2,550.00	4,080,000
日本電気	917,000	363.00	332,871,000
富士通	683,000	628.50	429,265,500
沖電気工業	245,000	240.00	58,800,000

岩崎通信機	31,000	100.00	3,100,000
電気興業	20,000	547.00	10,940,000
サンケン電気	36,000	937.00	33,732,000
ナカヨ	7,000	380.00	2,660,000
アイホン	4,100	1,888.00	7,740,800
ルネサスエレクトロニクス	36,700	755.00	27,708,500
セイコーエプソン	48,400	5,010.00	242,484,000
ワコム	55,900	483.00	26,999,700
アルバック	13,000	1,724.00	22,412,000
アクセル	3,300	1,510.00	4,983,000
E I Z O	6,500	2,487.00	16,165,500
ジャパンディスプレイ	109,300	391.00	42,736,300
日本信号	19,600	1,215.00	23,814,000
京三製作所	17,000	369.00	6,273,000
能美防災	9,400	1,519.00	14,278,600
ホーチキ	5,000	927.00	4,635,000
エレコム	2,200	2,587.00	5,691,400
日本無線	15,000	373.00	5,595,000
パナソニック	863,800	1,376.00	1,188,588,800
シャープ	599,000	227.00	135,973,000
アンリツ	44,400	812.00	36,052,800
富士通ゼネラル	22,000	1,206.00	26,532,000
日立国際電気	19,000	1,792.00	34,048,000
ソニー	456,000	2,462.50	1,122,900,000
T D K	42,800	7,480.00	320,144,000
帝国通信工業	17,000	232.00	3,944,000
ミツミ電機	25,100	922.00	23,142,200
タムラ製作所	27,000	401.00	10,827,000
アルプス電気	56,000	2,317.00	129,752,000
池上通信機	24,000	181.00	4,344,000
パイオニア	106,500	219.00	23,323,500
日本電波工業	6,600	968.00	6,388,800
鈴木	900	822.00	739,800
日本トリム	1,800	2,563.00	4,613,400
ローランド ディー . ジー .	2,900	3,580.00	10,382,000
フォスター電機	7,200	1,987.00	14,306,400
クラリオン	37,000	360.00	13,320,000
S M K	21,000	448.00	9,408,000
ヨコオ	5,600	637.00	3,567,200
東光	17,000	354.00	6,018,000
ホシデン	22,500	644.00	14,490,000
ヒロセ電機	11,500	13,910.00	159,965,000

日本航空電子工業	20,000	2,994.00	59,880,000
TOA	7,600	1,187.00	9,021,200
日立マクセル	10,600	1,966.00	20,839,600
古野電気	8,600	936.00	8,049,600
ユニデン	19,000	225.00	4,275,000
アルパイン	16,900	1,914.00	32,346,600
スミダコーポレーション	6,600	817.00	5,392,200
アイコム	3,900	2,752.00	10,732,800
リオン	2,000	1,369.00	2,738,000
船井電機	7,200	1,412.00	10,166,400
横河電機	70,900	1,292.00	91,602,800
新電元工業	27,000	611.00	16,497,000
アズビル	23,100	2,829.00	65,349,900
東亜ディーケーケー	3,000	578.00	1,734,000
日本光電工業	15,100	5,790.00	87,429,000
チノー	2,500	1,171.00	2,927,500
共和電業	8,600	472.00	4,059,200
日本電子材料	3,000	602.00	1,806,000
堀場製作所	13,100	3,815.00	49,976,500
アドバンテスト	48,300	1,362.00	65,784,600
小野測器	3,600	975.00	3,510,000
エスペック	7,900	1,085.00	8,571,500
パナソニック デバイスSUNX	6,300	738.00	4,649,400
キーエンス	16,100	53,830.00	866,663,000
日置電機	3,700	1,711.00	6,330,700
シスメックス	54,900	5,320.00	292,068,000
メガチップス	7,400	1,380.00	10,212,000
OBARA GROUP	4,600	5,480.00	25,208,000
澤藤電機	5,000	236.00	1,180,000
コーセル	10,300	1,277.00	13,153,100
新日本無線	5,000	484.00	2,420,000
オブテックス	4,900	1,914.00	9,378,600
千代田インテグレ	3,100	2,153.00	6,674,300
レーザーテック	7,300	1,318.00	9,621,400
スタンレー電気	51,100	2,679.00	136,896,900
岩崎電気	25,000	231.00	5,775,000
ウシオ電機	43,100	1,355.00	58,400,500
岡谷電機産業	3,900	407.00	1,587,300
ヘリオス テクノ ホールディング	6,600	419.00	2,765,400
日本セラミック	4,100	1,648.00	6,756,800
遠藤照明	3,300	1,311.00	4,326,300
日本デジタル研究所	6,000	1,572.00	9,432,000

古河電池	5,000	1,003.00	5,015,000
双信電機	3,500	410.00	1,435,000
山一電機	8,400	791.00	6,644,400
図研	5,200	1,128.00	5,865,600
日本電子	30,000	587.00	17,610,000
カシオ計算機	71,000	1,881.00	133,551,000
ファナック	73,800	19,910.00	1,469,358,000
日本シイエムケイ	18,200	352.00	6,406,400
エンプラス	3,200	4,220.00	13,504,000
大真空	14,000	351.00	4,914,000
ローム	34,900	7,400.00	258,260,000
浜松ホトニクス	29,500	5,740.00	169,330,000
三井ハイテック	9,400	818.00	7,689,200
新光電気工業	26,800	831.00	22,270,800
京セラ	116,400	5,254.00	611,565,600
太陽誘電	37,200	1,496.00	55,651,200
村田製作所	74,400	13,300.00	989,520,000
ユーシン	10,100	678.00	6,847,800
双葉電子工業	12,100	1,948.00	23,570,800
北陸電気工業	31,000	173.00	5,363,000
ニチコン	22,400	898.00	20,115,200
日本ケミコン	57,000	335.00	19,095,000
K O A	9,800	1,122.00	10,995,600
市光工業	18,000	254.00	4,572,000
小糸製作所	42,500	3,680.00	156,400,000
ミツバ	13,100	2,118.00	27,745,800
スター精密	13,500	1,446.00	19,521,000
S C R E E Nホールディングス	67,000	729.00	48,843,000
キャノン電子	6,500	1,912.00	12,428,000
キャノン	410,900	3,850.00	1,581,965,000
リコー	213,100	1,183.00	252,097,300
M U T O Hホールディングス	10,000	463.00	4,630,000
東京エレクトロン	59,600	8,462.00	504,335,200
トヨタ紡織	25,400	1,553.00	39,446,200
鬼怒川ゴム工業	16,000	500.00	8,000,000
ユニプレス	13,600	1,993.00	27,104,800
豊田自動織機	64,700	6,250.00	404,375,000
モリタホールディングス	12,500	1,187.00	14,837,500
三櫻工業	9,100	736.00	6,697,600
デンソー	175,300	5,419.00	949,950,700
東海理化電機製作所	18,800	2,401.00	45,138,800
三井造船	274,000	200.00	54,800,000

川崎重工業	515,000	546.00	281,190,000
名村造船所	20,500	1,247.00	25,563,500
サノヤホールディングス	12,100	364.00	4,404,400
日本車輛製造	26,000	350.00	9,100,000
ニチユ三菱フォークリフト	8,200	736.00	6,035,200
近畿車輛	11,000	319.00	3,509,000
日産自動車	994,900	1,019.50	1,014,300,550
いすゞ自動車	224,100	1,534.00	343,769,400
トヨタ自動車	977,900	7,659.00	7,489,736,100
日野自動車	101,200	1,730.00	175,076,000
三菱自動車工業	259,800	1,062.00	275,907,600
エフテック	4,600	1,150.00	5,290,000
レシップホールディングス	2,400	846.00	2,030,400
G M B	1,100	1,306.00	1,436,600
武蔵精密工業	7,600	2,253.00	17,122,800
日産車体	31,100	1,327.00	41,269,700
新明和工業	29,000	1,110.00	32,190,000
極東開発工業	13,200	1,346.00	17,767,200
日信工業	13,000	1,761.00	22,893,000
トピー工業	61,000	241.00	14,701,000
ティラド	28,000	245.00	6,860,000
曙ブレーキ工業	32,300	405.00	13,081,500
タチエス	11,200	1,690.00	18,928,000
N O K	34,600	3,310.00	114,526,000
フタバ産業	23,400	570.00	13,338,000
カヤバ工業	80,000	488.00	39,040,000
シロキ工業	16,000	310.00	4,960,000
大同メタル工業	11,000	1,091.00	12,001,000
プレス工業	36,000	397.00	14,292,000
カルソニックカンセイ	54,000	633.00	34,182,000
太平洋工業	14,900	922.00	13,737,800
ケーヒン	16,500	1,839.00	30,343,500
河西工業	9,400	1,039.00	9,766,600
アイシン精機	65,100	4,220.00	274,722,000
富士機工	8,000	537.00	4,296,000
マツダ	211,200	2,623.00	553,977,600
ダイハツ工業	84,600	1,560.00	131,976,000
今仙電機製作所	6,600	1,554.00	10,256,400
本田技研工業	637,900	3,646.00	2,325,783,400
スズキ	148,200	3,781.50	560,418,300
富士重工業	241,200	4,400.00	1,061,280,000
安永	2,400	587.00	1,408,800

ヤマハ発動機	107,800	2,475.00	266,805,000
ショーワ	16,700	1,090.00	18,203,000
T B K	9,200	639.00	5,878,800
エクセディ	9,600	2,809.00	26,966,400
豊田合成	23,000	2,488.00	57,224,000
愛三工業	11,000	1,058.00	11,638,000
盟和産業	7,000	147.00	1,029,000
ヨロズ	6,600	2,165.00	14,289,000
エフ・シー・シー	10,400	2,142.00	22,276,800
シマノ	30,700	15,580.00	478,306,000
テイ・エス テック	15,000	2,854.00	42,810,000
テルモ	108,700	2,791.00	303,381,700
クリエートメディック	2,400	1,002.00	2,404,800
日機装	23,000	1,030.00	23,690,000
島津製作所	85,000	1,252.00	106,420,000
J M S	13,000	287.00	3,731,000
ショットモリテックス	1,500	253.00	379,500
長野計器	4,600	692.00	3,183,200
ブイ・テクノロジー	1,400	2,437.00	3,411,800
東京計器	24,000	290.00	6,960,000
愛知時計電機	9,000	326.00	2,934,000
オーバル	5,200	355.00	1,846,000
東京精密	12,700	2,325.00	29,527,500
マニー	2,000	6,750.00	13,500,000
ニコン	132,300	1,498.00	198,185,400
トプコン	21,400	2,350.00	50,290,000
オリンパス	105,600	4,175.00	440,880,000
理研計器	6,300	1,230.00	7,749,000
タムロン	5,500	2,394.00	13,167,000
H O Y A	168,700	4,246.50	716,384,550
ノーリツ鋼機	6,400	631.00	4,038,400
エー・アンド・デイ	6,500	488.00	3,172,000
シチズンホールディングス	87,300	972.00	84,855,600
リズム時計工業	31,000	158.00	4,898,000
大研医器	4,900	1,230.00	6,027,000
松風	3,500	1,463.00	5,120,500
セイコーホールディングス	50,000	685.00	34,250,000
ニプロ	45,300	1,010.00	45,753,000
パラマウントベッドホールディングス	7,500	3,250.00	24,375,000
S H O - B I	2,400	404.00	969,600
前田工織	7,000	1,129.00	7,903,000
永大産業	10,000	443.00	4,430,000

アートネイチャー	5,100	1,205.00	6,145,500
ダンロップスポーツ	4,500	1,305.00	5,872,500
バンダイナムコホールディングス	78,200	2,374.00	185,646,800
共立印刷	12,800	290.00	3,712,000
フランスベッドホールディングス	49,000	179.00	8,771,000
パイロットコーポレーション	6,200	6,960.00	43,152,000
萩原工業	1,500	1,920.00	2,880,000
トッパン・フォームズ	12,700	1,195.00	15,176,500
フジシールインターナショナル	8,600	3,360.00	28,896,000
タカラトミー	25,400	669.00	16,992,600
廣済堂	6,600	459.00	3,029,400
アーク	22,400	136.00	3,046,400
タカノ	3,100	586.00	1,816,600
プロネクサス	7,200	730.00	5,256,000
ホクシン	5,600	129.00	722,400
ウッドワン	12,000	272.00	3,264,000
大建工業	29,000	258.00	7,482,000
凸版印刷	200,000	774.00	154,800,000
大日本印刷	216,000	1,052.50	227,340,000
図書印刷	11,000	313.00	3,443,000
共同印刷	22,000	383.00	8,426,000
日本写真印刷	11,900	1,847.00	21,979,300
光村印刷	7,000	261.00	1,827,000
宝印刷	4,000	836.00	3,344,000
アシックス	70,400	2,775.00	195,360,000
ツツミ	3,500	2,376.00	8,316,000
小松ウオール工業	2,200	2,675.00	5,885,000
ヤマハ	52,100	1,707.00	88,934,700
河合楽器製作所	2,400	2,350.00	5,640,000
クリナップ	7,200	860.00	6,192,000
ビジョン	13,400	7,370.00	98,758,000
兼松日産農林	10,000	153.00	1,530,000
キングジム	5,900	749.00	4,419,100
リンテック	16,900	2,607.00	44,058,300
T A S A K I	1,300	1,847.00	2,401,100
イトーキ	14,900	583.00	8,686,700
任天堂	43,600	12,185.00	531,266,000
三菱鉛筆	5,800	3,380.00	19,604,000
タカラスタンダード	29,000	886.00	25,694,000
コクヨ	36,800	888.00	32,678,400
ナカバヤシ	15,000	209.00	3,135,000
グローブライド	34,000	208.00	7,072,000

岡村製作所	27,200	862.00	23,446,400
美津濃	38,000	572.00	21,736,000
アデランス	8,200	1,056.00	8,659,200
東京電力	601,200	478.00	287,373,600
中部電力	216,900	1,380.50	299,430,450
関西電力	289,200	1,130.00	326,796,000
中国電力	98,000	1,520.00	148,960,000
北陸電力	69,400	1,547.00	107,361,800
東北電力	177,100	1,398.00	247,585,800
四国電力	63,800	1,375.00	87,725,000
九州電力	156,500	1,101.00	172,306,500
北海道電力	66,300	901.00	59,736,300
沖縄電力	4,600	3,750.00	17,250,000
電源開発	47,700	4,370.00	208,449,000
東京瓦斯	862,000	685.00	590,470,000
大阪瓦斯	734,000	464.00	340,576,000
東邦瓦斯	180,000	613.00	110,340,000
北海道瓦斯	14,000	288.00	4,032,000
西部瓦斯	80,000	257.00	20,560,000
静岡瓦斯	20,100	741.00	14,894,100
SBSホールディングス	5,200	951.00	4,945,200
東武鉄道	379,000	543.00	205,797,000
相鉄ホールディングス	121,000	517.00	62,557,000
東京急行電鉄	385,000	766.00	294,910,000
京浜急行電鉄	194,000	883.00	171,302,000
小田急電鉄	227,000	1,085.00	246,295,000
京王電鉄	198,000	911.00	180,378,000
京成電鉄	106,000	1,594.00	168,964,000
富士急行	19,000	1,165.00	22,135,000
新京成電鉄	9,000	390.00	3,510,000
東日本旅客鉄道	129,900	9,109.00	1,183,259,100
西日本旅客鉄道	68,200	5,854.00	399,242,800
東海旅客鉄道	63,500	18,865.00	1,197,927,500
西武ホールディングス	56,500	2,831.00	159,951,500
鴻池運輸	4,400	2,364.00	10,401,600
西日本鉄道	92,000	501.00	46,092,000
ハマキョウレックス	2,200	3,730.00	8,206,000
サカイ引越センター	1,200	3,610.00	4,332,000
近畿日本鉄道	713,000	400.00	285,200,000
阪急阪神ホールディングス	476,000	647.00	307,972,000
南海電気鉄道	159,000	470.00	74,730,000
京阪電気鉄道	159,000	684.00	108,756,000

神戸電鉄	17,000	352.00	5,984,000
名糖運輸	2,900	702.00	2,035,800
名古屋鉄道	256,000	453.00	115,968,000
山陽電気鉄道	26,000	449.00	11,674,000
日本通運	281,000	649.00	182,369,000
ヤマトホールディングス	124,600	2,502.50	311,811,500
山九	86,000	459.00	39,474,000
丸運	3,800	253.00	961,400
丸全昭和運輸	24,000	384.00	9,216,000
センコー	29,000	637.00	18,473,000
トナミホールディングス	15,000	392.00	5,880,000
日本梱包運輸倉庫	23,200	1,768.00	41,017,600
日本石油輸送	8,000	232.00	1,856,000
福山通運	43,000	638.00	27,434,000
セイノーホールディングス	55,000	1,189.00	65,395,000
神奈川中央交通	8,000	572.00	4,576,000
日立物流	14,800	1,406.00	20,808,800
日本郵船	599,000	348.00	208,452,000
商船三井	372,000	383.00	142,476,000
川崎汽船	312,000	331.00	103,272,000
N S ユナイテッド海運	37,000	359.00	13,283,000
飯野海運	38,000	676.00	25,688,000
共栄タンカー	13,000	230.00	2,990,000
日本航空	136,600	3,710.00	506,786,000
A N A ホールディングス	1,395,000	301.40	420,453,000
パスコ	16,000	346.00	5,536,000
トランコム	2,000	4,480.00	8,960,000
日新	27,000	284.00	7,668,000
三菱倉庫	46,000	1,746.00	80,316,000
三井倉庫ホールディングス	41,000	401.00	16,441,000
住友倉庫	52,000	626.00	32,552,000
澁澤倉庫	18,000	338.00	6,084,000
東陽倉庫	12,000	297.00	3,564,000
乾汽船	4,700	963.00	4,526,100
日本トランスシティ	16,000	373.00	5,968,000
ケイヒン	13,000	181.00	2,353,000
中央倉庫	4,100	914.00	3,747,400
安田倉庫	5,500	1,018.00	5,599,000
東洋埠頭	22,000	197.00	4,334,000
宇徳	5,700	553.00	3,152,100
上組	85,000	1,122.00	95,370,000
サンリツ	1,700	536.00	911,200

キムラユニティー	1,800	992.00	1,785,600
キューソー流通システム	2,000	1,419.00	2,838,000
郵船ロジスティクス	6,500	1,324.00	8,606,000
近鉄エクスプレス	6,300	4,710.00	29,673,000
東海運	3,800	276.00	1,048,800
エーアイティー	3,300	1,085.00	3,580,500
N E C ネットエスアイ	8,800	2,454.00	21,595,200
システナ	6,800	855.00	5,814,000
デジタルアーツ	3,700	1,140.00	4,218,000
新日鉄住金ソリューションズ	5,800	3,135.00	18,183,000
キューブシステム	3,000	556.00	1,668,000
コア	2,900	865.00	2,508,500
ソフトクリエイティブホールディングス	2,300	905.00	2,081,500
I T ホールディングス	23,200	1,923.00	44,613,600
ネオス	1,900	637.00	1,210,300
電算システム	2,400	1,518.00	3,643,200
グリー	42,300	684.00	28,933,200
コーエーテクモホールディングス	15,800	1,723.00	27,223,400
三菱総合研究所	2,700	2,939.00	7,935,300
ボルテージ	1,200	1,267.00	1,520,400
電算	800	2,296.00	1,836,800
A G S	1,100	950.00	1,045,000
ファインデックス	1,000	7,100.00	7,100,000
ヒト・コミュニケーションズ	1,000	1,755.00	1,755,000
ブレインパッド	700	1,284.00	898,800
K L a b	7,400	1,207.00	8,931,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	4,600	820.00	3,772,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,072.00	1,715,200
ネクソン	66,300	1,107.00	73,394,100
アイスタイル	2,300	500.00	1,150,000
エムアップ	1,900	699.00	1,328,100
エイチーム	900	4,565.00	4,108,500
e n i s h	1,800	1,463.00	2,633,400
コロプラ	12,200	2,449.00	29,877,800
モバイルクリエイティブ	3,000	736.00	2,208,000
オルトプラス	1,300	892.00	1,159,600
ブロードリーフ	5,800	1,687.00	9,784,600
ハーツユナイテッドグループ	2,100	2,031.00	4,265,100
ベリサーブ	800	1,041.00	832,800
ティーガイア	7,000	1,171.00	8,197,000
豆蔵ホールディングス	5,500	678.00	3,729,000
テクマトリックス	3,000	619.00	1,857,000

GMOペイメントゲートウェイ	6,100	2,078.00	12,675,800
ザッパラス	3,900	605.00	2,359,500
インターネットイニシアティブ	11,300	2,443.00	27,605,900
GMOクラウド	1,200	1,034.00	1,240,800
ビットアイル	7,900	507.00	4,005,300
SRAホールディングス	3,700	1,459.00	5,398,300
システムインテグレータ	1,000	524.00	524,000
パイブドビット	700	1,808.00	1,265,600
朝日ネット	7,100	505.00	3,585,500
コムチュア	1,200	1,963.00	2,355,600
パナソニック インフォメーションシステムズ	1,600	2,972.00	4,755,200
フェイス	2,100	1,168.00	2,452,800
野村総合研究所	39,600	3,800.00	150,480,000
サイバネットシステム	5,700	465.00	2,650,500
CEホールディングス	800	1,296.00	1,036,800
インテージホールディングス	4,000	1,713.00	6,852,000
東邦システムサイエンス	2,100	581.00	1,220,100
ソースネクスト	3,500	789.00	2,761,500
ティー・ワイ・オー	6,900	180.00	1,242,000
クレスコ	1,600	1,718.00	2,748,800
フジ・メディア・ホールディングス	72,800	1,460.00	106,288,000
オービック	24,100	3,850.00	92,785,000
ジャストシステム	9,500	767.00	7,286,500
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,500	973.00	1,459,500
ヤフー	501,300	409.00	205,031,700
トレンドマイクロ	37,100	3,180.00	117,978,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,300	925.00	1,202,500
日本オラクル	11,200	4,870.00	54,544,000
アルファシステムズ	2,300	1,578.00	3,629,400
フューチャーアーキテクト	7,300	660.00	4,818,000
CAC Holdings	4,700	1,126.00	5,292,200
ソフトバンク・テクノロジー	1,900	1,211.00	2,300,900
トーセ	1,700	737.00	1,252,900
オービックビジネスコンサルタント	4,400	3,265.00	14,366,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,900	4,275.00	33,772,500
アイティフォー	8,400	464.00	3,897,600
東計電算	1,200	1,700.00	2,040,000
エクスネット	600	1,437.00	862,200
大塚商会	18,800	3,900.00	73,320,000
サイボウズ	9,300	372.00	3,459,600
ソフトブレーン	9,500	194.00	1,843,000
電通国際情報サービス	4,300	1,132.00	4,867,600

E Mシステムズ	800	1,700.00	1,360,000
ウェザーニューズ	2,100	2,836.00	5,955,600
C I J	5,900	480.00	2,832,000
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,352.00	946,400
日本エンタープライズ	4,600	377.00	1,734,200
WOWOW	1,700	5,050.00	8,585,000
日本コロムビア	2,400	387.00	928,800
イマジカ・ロボット ホールディングス	3,700	501.00	1,853,700
ネットワンシステムズ	28,400	732.00	20,788,800
アルゴグラフィックス	2,900	1,808.00	5,243,200
マーベラス	11,800	1,421.00	16,767,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	13,900	1,939.00	26,952,100
日本ユニシス	19,300	1,039.00	20,052,700
兼松エレクトロニクス	4,400	1,711.00	7,528,400
東京放送ホールディングス	41,900	1,326.00	55,559,400
日本テレビホールディングス	63,900	1,960.00	125,244,000
朝日放送	6,900	941.00	6,492,900
テレビ朝日ホールディングス	19,100	1,834.00	35,029,400
スカパーJ S A Tホールディングス	53,100	706.00	37,488,600
テレビ東京ホールディングス	5,700	2,640.00	15,048,000
コネクシオ	4,900	1,042.00	5,105,800
クロップス	600	535.00	321,000
日本電信電話	273,700	6,632.00	1,815,178,400
K D D I	236,900	8,129.00	1,925,760,100
光通信	6,300	6,820.00	42,966,000
N T T ドコモ	576,400	1,969.50	1,135,219,800
G M O インターネット	23,300	964.00	22,461,200
K A D O K A W A ・ D W A N G O	18,200	1,743.00	31,722,600
学研ホールディングス	23,000	249.00	5,727,000
ゼンリン	9,200	1,430.00	13,156,000
昭文社	4,200	875.00	3,675,000
インプレスホールディングス	4,900	124.00	607,600
アイネット	3,600	895.00	3,222,000
松竹	46,000	1,168.00	53,728,000
東宝	49,900	2,579.00	128,692,100
東映	26,000	690.00	17,940,000
A O I P r o .	3,200	771.00	2,467,200
エヌ・ティ・ティ・データ	43,200	4,490.00	193,968,000
D T S	7,200	2,524.00	18,172,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	25,400	2,599.00	66,014,600
シーイーシー	4,600	1,016.00	4,673,600
カブコン	17,900	1,750.00	31,325,000

ジャステック	4,000	877.00	3,508,000
S C S K	16,600	2,981.00	49,484,600
日本システムウエア	2,600	1,007.00	2,618,200
アイネス	9,500	918.00	8,721,000
T K C	5,900	2,085.00	12,301,500
富士ソフト	9,600	2,348.00	22,540,800
N S D	14,800	1,835.00	27,158,000
コナミ	28,400	2,008.00	57,027,200
福井コンピュータホールディングス	1,900	803.00	1,525,700
J B C Cホールディングス	5,800	751.00	4,355,800
ミロク情報サービス	4,600	633.00	2,911,800
ソフトバンク	369,900	6,922.00	2,560,447,800
ハウスイ	6,000	126.00	756,000
高千穂交易	2,700	1,042.00	2,813,400
伊藤忠食品	1,700	3,905.00	6,638,500
エレマテック	3,300	2,676.00	8,830,800
J A L U X	2,000	2,396.00	4,792,000
あらた	16,000	320.00	5,120,000
トーメンデバイス	1,100	1,824.00	2,006,400
東京エレクトロン デバイス	1,400	1,516.00	2,122,400
双日	468,200	159.00	74,443,800
アルフレッサ ホールディングス	82,800	1,436.00	118,900,800
横浜冷凍	17,400	800.00	13,920,000
山下医科器械	600	1,615.00	969,000
ラサ商事	3,300	539.00	1,778,700
アルコニックス	4,000	1,949.00	7,796,000
神戸物産	1,200	9,020.00	10,824,000
あい ホールディングス	11,200	2,054.00	23,004,800
ディーブイエックス	2,100	1,049.00	2,202,900
ダイワボウホールディングス	64,000	200.00	12,800,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,200	891.00	11,761,200
八洲電機	5,500	556.00	3,058,000
U K Cホールディングス	4,500	1,825.00	8,212,500
O C H Iホールディングス	1,800	1,369.00	2,464,200
T O K A Iホールディングス	34,200	534.00	18,262,800
三洋貿易	4,200	1,297.00	5,447,400
ウイン・パートナーズ	2,300	1,455.00	3,346,500
ミタチ産業	1,700	709.00	1,205,300
シップヘルスケアホールディングス	12,800	2,764.00	35,379,200
明治電機工業	2,000	1,107.00	2,214,000
スターティア	600	1,567.00	940,200
富士興産	2,700	598.00	1,614,600

協栄産業	9,000	215.00	1,935,000
小野建	6,100	967.00	5,898,700
佐島電機	5,600	761.00	4,261,600
エコートレーディング	1,600	659.00	1,054,400
伯東	4,800	1,183.00	5,678,400
コンドーテック	5,100	825.00	4,207,500
中山福	4,000	885.00	3,540,000
ナガイレーベン	10,100	1,890.00	19,089,000
三菱食品	7,700	2,553.00	19,658,100
松田産業	5,100	1,298.00	6,619,800
メディカルホールディングス	70,000	1,390.00	97,300,000
アドヴァン	3,600	1,336.00	4,809,600
S P K	1,500	2,024.00	3,036,000
萩原電気	1,900	1,873.00	3,558,700
アズワン	5,000	3,145.00	15,725,000
スズデン	2,300	694.00	1,596,200
尾家産業	2,300	844.00	1,941,200
シモジマ	4,300	1,022.00	4,394,600
ドウシシャ	9,100	1,676.00	15,251,600
小津産業	1,400	1,909.00	2,672,600
高速	4,200	891.00	3,742,200
黒田電気	11,800	1,603.00	18,915,400
丸文	6,200	805.00	4,991,000
ハピネット	4,300	1,301.00	5,594,300
橋本総業	1,300	1,640.00	2,132,000
エクセル	3,200	1,359.00	4,348,800
マルカキカイ	2,300	1,552.00	3,569,600
ガリバーインターナショナル	21,200	831.00	17,617,200
日本エム・ディ・エム	5,900	602.00	3,551,800
進和	4,200	1,321.00	5,548,200
エスケイジャパン	1,800	231.00	415,800
ダイトエレクトロン	3,200	603.00	1,929,600
シークス	4,400	2,396.00	10,542,400
田中商事	2,200	673.00	1,480,600
オーハシテクニカ	4,300	1,507.00	6,480,100
マクニカ	3,600	3,335.00	12,006,000
白銅	2,300	1,142.00	2,626,600
伊藤忠商事	585,600	1,207.00	706,819,200
丸紅	612,000	681.50	417,078,000
高島	13,000	247.00	3,211,000
長瀬産業	42,700	1,438.00	61,402,600
蝶理	4,500	1,876.00	8,442,000

豊田通商	77,900	2,689.00	209,473,100
三共生興	12,000	466.00	5,592,000
兼松	139,000	168.00	23,352,000
ツカモトコーポレーション	13,000	132.00	1,716,000
三井物産	593,100	1,545.00	916,339,500
日本紙パルプ商事	36,000	325.00	11,700,000
日立ハイテクノロジーズ	24,300	3,690.00	89,667,000
カメイ	9,100	758.00	6,897,800
東都水産	12,000	193.00	2,316,000
OUGホールディングス	11,000	225.00	2,475,000
スターゼン	27,000	394.00	10,638,000
山善	26,900	833.00	22,407,700
椿本興業	8,000	302.00	2,416,000
住友商事	412,800	1,193.00	492,470,400
内田洋行	17,000	363.00	6,171,000
三菱商事	536,100	2,107.00	1,129,562,700
第一実業	17,000	586.00	9,962,000
キャノンマーケティングジャパン	20,000	1,981.00	39,620,000
西華産業	23,000	291.00	6,693,000
佐藤商事	6,300	731.00	4,605,300
菱洋エレクトロ	8,100	1,277.00	10,343,700
東京産業	7,000	447.00	3,129,000
ユアサ商事	6,100	2,318.00	14,139,800
神鋼商事	18,000	263.00	4,734,000
小林産業	5,200	254.00	1,320,800
阪和興業	70,000	428.00	29,960,000
カナデン	7,000	782.00	5,474,000
菱電商事	11,000	799.00	8,789,000
フルサト工業	3,900	1,598.00	6,232,200
岩谷産業	77,000	796.00	61,292,000
すてきナイスグループ	30,000	189.00	5,670,000
昭光通商	25,000	166.00	4,150,000
ニチモウ	11,000	200.00	2,200,000
極東貿易	8,000	217.00	1,736,000
イワキ	11,000	217.00	2,387,000
三愛石油	18,000	779.00	14,022,000
稲畑産業	16,800	1,036.00	17,404,800
G S Iクレオス	19,000	135.00	2,565,000
明和産業	5,600	453.00	2,536,800
ワキタ	14,900	1,118.00	16,658,200
東邦ホールディングス	24,100	1,745.00	42,054,500
サンゲツ	13,300	3,040.00	40,432,000

ミツウロコグループホールディングス	11,300	558.00	6,305,400
シナネン	15,000	462.00	6,930,000
伊藤忠エネクス	15,500	974.00	15,097,000
サンリオ	19,600	2,934.00	57,506,400
サンワテクノス	4,500	1,165.00	5,242,500
リョーサン	11,800	2,520.00	29,736,000
新光商事	8,200	1,178.00	9,659,600
トーホー	16,000	446.00	7,136,000
三信電気	9,700	846.00	8,206,200
東陽テクニカ	10,300	1,022.00	10,526,600
モスフードサービス	9,200	2,313.00	21,279,600
加賀電子	6,300	1,463.00	9,216,900
ソーダニッカ	7,000	493.00	3,451,000
立花エレテック	4,300	1,620.00	6,966,000
フォーバル	1,400	1,194.00	1,671,600
P a l t a c	11,200	1,392.00	15,590,400
ヤマタネ	35,000	174.00	6,090,000
丸紅建材リース	6,000	296.00	1,776,000
日鉄住金物産	46,000	399.00	18,354,000
トラスコ中山	8,700	3,020.00	26,274,000
オートバックスセブン	25,800	1,692.00	43,653,600
加藤産業	10,100	2,159.00	21,805,900
イノテック	6,500	496.00	3,224,000
イエローハット	6,600	2,314.00	15,272,400
富士エレクトロニクス	3,600	1,383.00	4,978,800
J Kホールディングス	7,100	575.00	4,082,500
日伝	2,900	2,450.00	7,105,000
北沢産業	6,000	179.00	1,074,000
杉本商事	3,800	1,229.00	4,670,200
因幡電機産業	10,300	3,915.00	40,324,500
バイテック	2,400	956.00	2,294,400
ミスミグループ本社	26,100	4,100.00	107,010,000
江守グループホールディングス	3,000	1,069.00	3,207,000
アルテック	5,100	209.00	1,065,900
タキヒヨー	12,000	409.00	4,908,000
スズケン	29,000	3,375.00	97,875,000
ジェコス	4,800	1,694.00	8,131,200
ルネサスイーストン	3,200	709.00	2,268,800
ローソン	26,500	7,580.00	200,870,000
サンエー	5,300	3,905.00	20,696,500
ダイユーエイト	1,400	827.00	1,157,800
カワチ薬品	5,400	1,778.00	9,601,200

エービーシー・マート	9,900	5,720.00	56,628,000
ハードオフコーポレーション	3,400	1,104.00	3,753,600
アスクル	7,300	1,905.00	13,906,500
ゲオホールディングス	13,200	995.00	13,134,000
アダストリアホールディングス	5,900	2,920.00	17,228,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	9,000	125.00	1,125,000
くらコーポレーション	4,100	3,215.00	13,181,500
キャンドウ	3,300	1,522.00	5,022,600
パル	4,100	3,010.00	12,341,000
エディオン	32,100	834.00	26,771,400
サーラコーポレーション	6,000	595.00	3,570,000
ワッツ	2,800	810.00	2,268,000
あみやき亭	1,200	3,845.00	4,614,000
ひらまつ	9,600	635.00	6,096,000
ゲンキー	700	7,520.00	5,264,000
サッポロドラッグストア	600	1,857.00	1,114,200
大黒天物産	1,700	3,790.00	6,443,000
ハニーズ	5,500	993.00	5,461,500
アルペン	6,200	1,636.00	10,143,200
クオール	7,100	769.00	5,459,900
ジェイアイエヌ	4,800	3,490.00	16,752,000
ビックカメラ	30,400	1,351.00	41,070,400
D C Mホールディングス	33,900	745.00	25,255,500
Monotaro	13,600	2,683.00	36,488,800
きちり	1,400	689.00	964,600
アークランドサービス	800	3,730.00	2,984,000
J.フロント リテイリング	88,500	1,424.00	126,024,000
ドトール・日レスホールディングス	12,300	1,801.00	22,152,300
マツモトキヨシホールディングス	15,600	3,590.00	56,004,000
ブロンコビリー	1,200	3,330.00	3,996,000
スタートトゥデイ	21,800	2,413.00	52,603,400
物語コーポレーション	1,700	3,915.00	6,655,500
ココカラファイン	7,300	2,820.00	20,586,000
三越伊勢丹ホールディングス	139,100	1,575.00	219,082,500
ウエルシアホールディングス	6,300	3,915.00	24,664,500
クリエイトSDホールディングス	2,900	4,015.00	11,643,500
丸善CHIホールディングス	8,100	353.00	2,859,300
エー・ピーカンパニー	1,000	1,873.00	1,873,000
チムニー	1,300	2,215.00	2,879,500
ネクステージ	700	662.00	463,400
ジョイフル本田	3,800	4,005.00	15,219,000
キリン堂ホールディングス	2,300	766.00	1,761,800

すかいらーく	25,700	1,287.00	33,075,900
ブックオフコーポレーション	4,000	877.00	3,508,000
あさひ	4,600	1,089.00	5,009,400
日本調剤	900	3,720.00	3,348,000
コスモス薬品	4,000	18,070.00	72,280,000
トーエル	3,700	640.00	2,368,000
一六堂	1,700	428.00	727,600
セブン&アイ・ホールディングス	292,600	4,212.00	1,232,431,200
薬王堂	1,000	1,898.00	1,898,000
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	4,900	1,629.00	7,982,100
ツルハホールディングス	13,800	7,650.00	105,570,000
サンマルクホールディングス	2,500	7,370.00	18,425,000
フェリシモ	1,800	1,008.00	1,814,400
トリドール	7,500	1,753.00	13,147,500
クスリのアオキ	3,100	7,230.00	22,413,000
メディカルシステムネットワーク	6,300	356.00	2,242,800
総合メディカル	1,700	5,870.00	9,979,000
はるやま商事	2,900	707.00	2,050,300
カップ・クリエイティブホールディングス	11,200	1,139.00	12,756,800
ライトオン	5,200	746.00	3,879,200
良品計画	8,700	13,650.00	118,755,000
三城ホールディングス	8,700	470.00	4,089,000
コナカ	8,200	616.00	5,051,200
ハウス オブ ローゼ	800	1,404.00	1,123,200
G-7ホールディングス	1,500	1,027.00	1,540,500
イオン北海道	5,100	708.00	3,610,800
コジマ	10,300	293.00	3,017,900
ヒマラヤ	1,600	998.00	1,596,800
コーナン商事	10,700	1,318.00	14,102,600
エコス	2,400	957.00	2,296,800
ワタミ	8,300	1,143.00	9,486,900
マルシェ	1,700	886.00	1,506,200
ドンキホーテホールディングス	24,200	8,630.00	208,846,000
西松屋チェーン	13,800	975.00	13,455,000
ゼンショーホールディングス	36,000	1,014.00	36,504,000
幸楽苑	4,300	1,654.00	7,112,200
ハークスレイ	1,900	984.00	1,869,600
サイゼリヤ	10,400	1,940.00	20,176,000
ポブラ	3,000	565.00	1,695,000
ユナイテッドアローズ	9,200	3,355.00	30,866,000
ハイデイ日高	4,400	3,750.00	16,500,000
京都きもの友禅	4,400	1,012.00	4,452,800

コロワイド	23,200	1,861.00	43,175,200
壱番屋	2,800	4,990.00	13,972,000
トップカルチャー	2,800	496.00	1,388,800
P L A N T	1,800	1,298.00	2,336,400
スギホールディングス	12,500	5,400.00	67,500,000
スクロール	9,100	280.00	2,548,000
ヨンドシーホールディングス	5,300	1,791.00	9,492,300
ファミリーマート	23,700	4,885.00	115,774,500
木曽路	8,600	2,007.00	17,260,200
サトレストランシステムズ	6,500	977.00	6,350,500
千趣会	12,600	818.00	10,306,800
タカキュー	4,900	219.00	1,073,100
ケーヨー	13,100	546.00	7,152,600
上新電機	15,000	962.00	14,430,000
日本瓦斯	11,200	2,710.00	30,352,000
ベスト電器	22,500	134.00	3,015,000
マルエツ	18,000	517.00	9,306,000
ロイヤルホールディングス	11,700	1,658.00	19,398,600
東天紅	5,000	188.00	940,000
いなげや	7,800	1,237.00	9,648,600
島忠	17,000	2,776.00	47,192,000
チヨダ	8,200	2,471.00	20,262,200
ライフコーポレーション	4,700	1,672.00	7,858,400
カスミ	14,300	1,012.00	14,471,600
リンガーハット	6,800	2,169.00	14,749,200
M r M a x	7,000	290.00	2,030,000
テンアライド	5,800	373.00	2,163,400
A O K Iホールディングス	16,100	1,251.00	20,141,100
オークワ	11,000	932.00	10,252,000
コメリ	12,000	2,342.00	28,104,000
青山商事	17,600	2,826.00	49,737,600
しまむら	8,100	9,990.00	80,919,000
C F S コーポレーション	5,200	702.00	3,650,400
はせがわ	2,400	561.00	1,346,400
高島屋	102,000	980.00	99,960,000
松屋	14,600	1,667.00	24,338,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,100	1,954.00	64,677,400
近鉄百貨店	27,000	317.00	8,559,000
ニッセンホールディングス	14,700	320.00	4,704,000
パルコ	6,700	971.00	6,505,700
丸井グループ	84,400	1,132.00	95,540,800
アクシアル リテイリング	5,400	2,468.00	13,327,200

イオン	288,500	1,214.50	350,383,250
ユニグループ・ホールディングス	67,500	642.00	43,335,000
イズミ	15,600	4,325.00	67,470,000
東武ストア	9,000	282.00	2,538,000
平和堂	14,200	2,393.00	33,980,600
フジ	7,900	2,125.00	16,787,500
ヤオコー	4,000	7,300.00	29,200,000
ゼビオ	9,500	2,044.00	19,418,000
ケーズホールディングス	16,100	3,010.00	48,461,000
Olympicグループ	4,100	824.00	3,378,400
日産東京販売ホールディングス	11,800	264.00	3,115,200
アインファーマシーズ	7,700	3,705.00	28,528,500
元気寿司	2,200	2,776.00	6,107,200
ヤマダ電機	276,500	395.00	109,217,500
アークランドサカモト	5,000	2,094.00	10,470,000
ニトリホールディングス	30,200	6,580.00	198,716,000
グルメ杵屋	5,000	919.00	4,595,000
愛眼	5,600	251.00	1,405,600
ケーユーホールディングス	3,700	617.00	2,282,900
吉野家ホールディングス	19,700	1,349.00	26,575,300
松屋フーズ	3,400	2,507.00	8,523,800
サガミチェーン	9,000	1,100.00	9,900,000
関西スーパーマーケット	5,200	799.00	4,154,800
王将フードサービス	5,100	4,195.00	21,394,500
プレナス	7,800	2,131.00	16,621,800
ミニストップ	5,200	1,579.00	8,210,800
アークス	12,200	2,376.00	28,987,200
パロー	15,100	2,124.00	32,072,400
藤久	600	1,676.00	1,005,600
ベルク	3,100	3,080.00	9,548,000
大庄	3,700	1,390.00	5,143,000
ファーストリテイリング	14,000	42,700.00	597,800,000
サンドラッグ	14,800	4,915.00	72,742,000
サクスパー ホールディングス	5,300	1,572.00	8,331,600
ヤマザワ	1,500	1,669.00	2,503,500
やまや	1,200	1,522.00	1,826,400
ベルーナ	17,500	500.00	8,750,000
島根銀行	1,500	1,389.00	2,083,500
じもとホールディングス	50,200	225.00	11,295,000
足利ホールディングス	44,000	468.00	20,592,000
東京TYフィナンシャルグループ	9,000	3,340.00	30,060,000
新生銀行	666,000	194.00	129,204,000

あおぞら銀行	472,000	389.00	183,608,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,612,900	625.00	3,508,062,500
りそなホールディングス	818,400	576.30	471,643,920
三井住友トラスト・ホールディングス	1,547,000	425.90	658,867,300
三井住友フィナンシャルグループ	529,000	4,090.00	2,163,610,000
第四銀行	88,000	389.00	34,232,000
北越銀行	76,000	214.00	16,264,000
西日本シティ銀行	245,000	350.00	85,750,000
千葉銀行	270,000	766.00	206,820,000
横浜銀行	483,000	634.60	306,511,800
常陽銀行	254,000	580.00	147,320,000
群馬銀行	166,000	747.00	124,002,000
武蔵野銀行	11,200	3,850.00	43,120,000
千葉興業銀行	14,500	795.00	11,527,500
筑波銀行	29,100	353.00	10,272,300
七十七銀行	118,000	635.00	74,930,000
青森銀行	55,000	346.00	19,030,000
秋田銀行	46,000	321.00	14,766,000
山形銀行	42,000	503.00	21,126,000
岩手銀行	4,900	4,865.00	23,838,500
東邦銀行	63,000	400.00	25,200,000
東北銀行	38,000	154.00	5,852,000
みちのく銀行	35,000	225.00	7,875,000
ふくおかフィナンシャルグループ	284,000	608.00	172,672,000
静岡銀行	205,000	1,044.00	214,020,000
十六銀行	88,000	393.00	34,584,000
スルガ銀行	73,900	2,169.00	160,289,100
八十二銀行	127,000	743.00	94,361,000
山梨中央銀行	45,000	466.00	20,970,000
大垣共立銀行	87,000	358.00	31,146,000
福井銀行	60,000	263.00	15,780,000
北國銀行	78,000	380.00	29,640,000
清水銀行	2,400	2,873.00	6,895,200
滋賀銀行	70,000	635.00	44,450,000
南都銀行	68,000	403.00	27,404,000
百五銀行	67,000	489.00	32,763,000
京都銀行	134,000	958.00	128,372,000
紀陽銀行	27,500	1,481.00	40,727,500
三重銀行	31,000	259.00	8,029,000
ほくほくフィナンシャルグループ	476,000	233.00	110,908,000
広島銀行	206,000	572.00	117,832,000
山陰合同銀行	43,000	887.00	38,141,000

中国銀行	50,300	1,623.00	81,636,900
鳥取銀行	22,000	225.00	4,950,000
伊予銀行	74,800	1,299.00	97,165,200
百十四銀行	77,000	388.00	29,876,000
四国銀行	54,000	244.00	13,176,000
阿波銀行	57,000	632.00	36,024,000
鹿児島銀行	49,000	721.00	35,329,000
大分銀行	43,000	410.00	17,630,000
宮崎銀行	47,000	399.00	18,753,000
肥後銀行	57,000	622.00	35,454,000
佐賀銀行	42,000	265.00	11,130,000
十八銀行	43,000	333.00	14,319,000
沖縄銀行	5,500	4,640.00	25,520,000
琉球銀行	14,400	1,596.00	22,982,400
セブン銀行	235,900	494.00	116,534,600
みずほフィナンシャルグループ	9,682,500	197.30	1,910,357,250
高知銀行	27,000	152.00	4,104,000
山口フィナンシャルグループ	70,000	1,209.00	84,630,000
長野銀行	23,000	211.00	4,853,000
名古屋銀行	63,000	420.00	26,460,000
北洋銀行	105,400	442.00	46,586,800
愛知銀行	2,500	5,620.00	14,050,000
第三銀行	40,000	193.00	7,720,000
中京銀行	29,000	203.00	5,887,000
東日本銀行	30,000	319.00	9,570,000
大光銀行	25,000	215.00	5,375,000
愛媛銀行	41,000	247.00	10,127,000
トマト銀行	27,000	176.00	4,752,000
みなと銀行	63,000	217.00	13,671,000
京葉銀行	58,000	628.00	36,424,000
関西アーバン銀行	9,700	1,190.00	11,543,000
栃木銀行	35,000	519.00	18,165,000
北日本銀行	2,200	2,975.00	6,545,000
東和銀行	96,000	96.00	9,216,000
福島銀行	86,000	89.00	7,654,000
大東銀行	45,000	142.00	6,390,000
トモニホールディングス	53,700	487.00	26,151,900
フィデアホールディングス	40,300	214.00	8,624,200
池田泉州ホールディングス	57,700	541.00	31,215,700
F P G	6,300	1,493.00	9,405,900
S B Iホールディングス	84,200	1,309.00	110,217,800
ジャフコ	9,700	4,035.00	39,139,500

大和証券グループ本社	655,000	882.50	578,037,500
野村ホールディングス	1,431,000	632.70	905,393,700
岡三証券グループ	60,000	883.00	52,980,000
丸三証券	22,400	829.00	18,569,600
東洋証券	28,000	349.00	9,772,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	80,300	811.00	65,123,300
光世証券	17,000	242.00	4,114,000
水戸証券	22,500	417.00	9,382,500
いちよし証券	14,700	1,229.00	18,066,300
松井証券	35,600	1,025.00	36,490,000
だいこう証券ビジネス	3,600	766.00	2,757,600
マネックスグループ	82,400	251.00	20,682,400
カブドットコム証券	31,200	590.00	18,408,000
極東証券	9,700	1,815.00	17,605,500
岩井コスモホールディングス	7,300	1,368.00	9,986,400
マネースクウェアHD	2,300	1,278.00	2,939,400
マネーパートナーズグループ	7,500	388.00	2,910,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	155,400	3,006.00	467,132,400
アニコムホールディングス	2,900	1,466.00	4,251,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	223,000	2,757.00	614,811,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	67,000	1,657.00	111,019,000
第一生命保険	448,200	1,626.50	728,997,300
東京海上ホールディングス	287,900	3,877.50	1,116,332,250
T&Dホールディングス	255,000	1,330.00	339,150,000
全国保証	18,200	3,440.00	62,608,000
クレディセゾン	57,100	2,049.00	116,997,900
アクリーティブ	4,800	212.00	1,017,600
芙蓉総合リース	7,300	3,880.00	28,324,000
興銀リース	13,100	2,205.00	28,885,500
東京センチュリーリース	16,400	2,828.00	46,379,200
日本証券金融	33,100	591.00	19,562,100
アイフル	117,000	379.00	44,343,000
ポケットカード	5,200	547.00	2,844,400
リコーリース	5,500	3,050.00	16,775,000
イオンフィナンシャルサービス	45,900	2,224.00	102,081,600
アコム	140,500	320.00	44,960,000
ジャックス	39,000	567.00	22,113,000
オリエントコーポレーション	161,700	183.00	29,591,100
日立キャピタル	13,700	2,466.00	33,784,200
アプラスフィナンシャル	33,500	131.00	4,388,500
オリックス	495,200	1,409.50	697,984,400
三菱UFJリース	177,400	527.00	93,489,800

日本取引所グループ	102,700	2,775.00	284,992,500
イー・ギャランティ	2,000	1,698.00	3,396,000
アサックス	1,200	1,449.00	1,738,800
N E C キャピタルソリューション	2,800	1,893.00	5,300,400
日本駐車場開発	76,300	120.00	9,156,000
ヒューリック	118,100	1,087.00	128,374,700
東京建物不動産販売	3,600	389.00	1,400,400
三栄建築設計	2,800	900.00	2,520,000
野村不動産ホールディングス	42,100	2,147.00	90,388,700
プレサンスコーポレーション	2,400	3,735.00	8,964,000
常和ホールディングス	2,900	3,805.00	11,034,500
日本管理センター	3,400	1,332.00	4,528,800
エストラスト	800	670.00	536,000
フージャースホールディングス	10,500	507.00	5,323,500
オープンハウス	4,400	2,165.00	9,526,000
東急不動産ホールディングス	183,400	829.00	152,038,600
飯田グループホールディングス	45,400	1,501.00	68,145,400
パーク24	35,200	1,862.00	65,542,400
パラカ	2,600	929.00	2,415,400
三井不動産	371,000	3,112.50	1,154,737,500
三菱地所	520,000	2,410.50	1,253,460,000
平和不動産	13,200	1,791.00	23,641,200
東京建物	153,000	863.00	132,039,000
ダイビル	18,000	1,075.00	19,350,000
京阪神ビルディング	11,600	677.00	7,853,200
住友不動産	168,000	3,936.00	661,248,000
大京	112,000	176.00	19,712,000
テーオーシー	24,200	705.00	17,061,000
東京楽天地	12,000	505.00	6,060,000
レオパレス21	76,600	752.00	57,603,200
スターツコーポレーション	8,000	1,658.00	13,264,000
フジ住宅	9,000	676.00	6,084,000
空港施設	8,500	710.00	6,035,000
明和地所	4,000	495.00	1,980,000
住友不動産販売	5,000	2,830.00	14,150,000
ゴールドクレスト	6,300	2,070.00	13,041,000
日本エスリード	2,800	1,235.00	3,458,000
日神不動産	9,400	477.00	4,483,800
タカラレーベン	31,500	497.00	15,655,500
サンヨーハウジング名古屋	4,000	1,260.00	5,040,000
イオンモール	45,200	2,108.00	95,281,600
ファースト住建	2,600	1,218.00	3,166,800

トーセイ	9,600	748.00	7,180,800
穴吹興産	6,000	254.00	1,524,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	43,500	1,240.00	53,940,000
サンフロンティア不動産	7,600	974.00	7,402,400
エフ・ジェー・ネクスト	5,400	555.00	2,997,000
ランドビジネス	3,500	399.00	1,396,500
グランディハウス	6,200	300.00	1,860,000
日本空港ビルディング	24,200	5,160.00	124,872,000
日本工営	25,000	472.00	11,800,000
ネクスト	9,100	1,035.00	9,418,500
日本M&Aセンター	11,400	3,885.00	44,289,000
ノバレーゼ	1,900	872.00	1,656,800
アコーディア・ゴルフ	28,100	1,178.00	33,101,800
タケエイ	7,200	932.00	6,710,400
トラスト・テック	1,300	1,775.00	2,307,500
パソナグループ	5,800	632.00	3,665,600
CDS	1,700	963.00	1,637,100
リンクアンドモチベーション	10,500	158.00	1,659,000
GCAサヴィアン	5,800	1,225.00	7,105,000
エス・エム・エス	8,300	1,169.00	9,702,700
テンプホールディングス	14,600	4,095.00	59,787,000
リニカル	2,000	905.00	1,810,000
クックパッド	3,900	4,485.00	17,491,500
エスクリ	3,400	993.00	3,376,200
アイ・ケイ・ケイ	2,000	949.00	1,898,000
学情	3,000	1,036.00	3,108,000
スタジオアリス	3,400	1,756.00	5,970,400
シミックホールディングス	2,900	1,999.00	5,797,100
総合警備保障	24,700	2,973.00	73,433,100
カカクコム	49,300	1,606.00	79,175,800
アイロムホールディングス	1,800	1,959.00	3,526,200
ルネサンス	4,200	1,169.00	4,909,800
ディップ	1,800	4,975.00	8,955,000
オプト	3,300	700.00	2,310,000
ツクイ	9,200	1,026.00	9,439,200
総合臨床ホールディングス	3,400	463.00	1,574,200
キャリアデザインセンター	2,700	926.00	2,500,200
エムスリー	64,100	2,106.00	134,994,600
ツカダ・グローバルホールディング	6,000	754.00	4,524,000
アウトソーシング	3,200	1,943.00	6,217,600
ディー・エヌ・エー	36,500	1,426.00	52,049,000
博報堂DYホールディングス	102,600	1,169.00	119,939,400

ぐるなび	9,100	1,937.00	17,626,700
一休	5,800	1,436.00	8,328,800
ファンコミュニケーションズ	13,200	1,203.00	15,879,600
ジェイコムホールディングス	1,600	791.00	1,265,600
P G Mホールディングス	10,700	1,187.00	12,700,900
W D Bホールディングス	2,700	853.00	2,303,100
ティア	2,600	570.00	1,482,000
バリューコマース	6,400	562.00	3,596,800
J Pホールディングス	19,100	361.00	6,895,100
E P Sホールディングス	9,300	1,505.00	13,996,500
プレステージ・インターナショナル	5,600	980.00	5,488,000
アミューズ	2,300	3,210.00	7,383,000
ドリームインキュベータ	2,700	2,407.00	6,498,900
クイック	3,300	868.00	2,864,400
T A C	6,500	234.00	1,521,000
ケネディクス	106,800	518.00	55,322,400
電通	82,500	4,895.00	403,837,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	960.00	3,552,000
ぴあ	2,200	2,097.00	4,613,400
イオンファンタジー	2,400	1,453.00	3,487,200
ネクシィーズ	3,600	566.00	2,037,600
みらかホールディングス	19,500	5,500.00	107,250,000
アルプス技研	3,000	1,416.00	4,248,000
ダイオーズ	1,600	902.00	1,443,200
日本空調サービス	3,600	838.00	3,016,800
オリエンタルランド	20,000	31,810.00	636,200,000
ダスキン	21,000	1,810.00	38,010,000
明光ネットワークジャパン	7,400	1,221.00	9,035,400
ファルコホールディングス	3,500	1,265.00	4,427,500
秀英予備校	1,500	310.00	465,000
田谷	1,300	803.00	1,043,900
ラウンドワン	21,300	758.00	16,145,400
リゾートトラスト	27,500	2,762.00	75,955,000
ビー・エム・エル	4,400	3,100.00	13,640,000
ワタベウェディング	2,500	501.00	1,252,500
もしもしホットライン	13,800	1,245.00	17,181,000
早稲田アカデミー	1,100	804.00	884,400
ユー・エス・エス	89,600	1,822.00	163,251,200
東京個別指導学院	3,700	349.00	1,291,300
サイバーエージェント	13,600	4,620.00	62,832,000
楽天	321,600	1,620.00	520,992,000
テー・オー・ダブリュー	2,500	861.00	2,152,500

セントラルスポーツ	2,500	1,985.00	4,962,500
フルキャストホールディングス	7,600	463.00	3,518,800
リゾートソリューション	9,000	245.00	2,205,000
リブセンス	5,200	717.00	3,728,400
ジャパンマテリアル	3,300	1,746.00	5,761,800
ベクトル	1,200	1,436.00	1,723,200
ウチヤマホールディングス	3,300	590.00	1,947,000
サクセスホールディングス	1,200	1,256.00	1,507,200
アサンテ	1,800	1,260.00	2,268,000
E R Iホールディングス	1,700	1,001.00	1,701,700
リクルートホールディングス	84,000	3,500.00	294,000,000
リロ・ホールディング	2,500	8,530.00	21,325,000
東祥	1,700	2,757.00	4,686,900
エイチ・アイ・エス	12,100	3,815.00	46,161,500
共立メンテナンス	3,700	6,720.00	24,864,000
イチネンホールディングス	8,500	1,083.00	9,205,500
建設技術研究所	4,600	1,489.00	6,849,400
スペース	4,000	1,125.00	4,500,000
燦ホールディングス	1,500	1,753.00	2,629,500
スバル興業	5,000	452.00	2,260,000
東京テアトル	28,000	141.00	3,948,000
よみうりランド	16,000	478.00	7,648,000
東京都競馬	51,000	298.00	15,198,000
カナモト	10,400	3,180.00	33,072,000
東京ドーム	52,000	527.00	27,404,000
西尾レントオール	6,000	3,550.00	21,300,000
トランス・コスモス	9,700	1,900.00	18,430,000
乃村工藝社	14,500	1,090.00	15,805,000
藤田観光	27,000	381.00	10,287,000
K N T - C Tホールディングス	36,000	152.00	5,472,000
日本管財	3,600	2,580.00	9,288,000
トーカイ	3,300	3,500.00	11,550,000
白洋舎	10,000	246.00	2,460,000
セコム	71,900	6,875.00	494,312,500
セントラル警備保障	3,300	1,160.00	3,828,000
丹青社	9,300	804.00	7,477,200
メイテック	10,000	3,575.00	35,750,000
アサツー ディ・ケイ	13,900	2,959.00	41,130,100
応用地質	7,800	1,715.00	13,377,000
船井総研ホールディングス	8,300	939.00	7,793,700
進学会	3,200	469.00	1,500,800
ベネッセホールディングス	27,100	3,490.00	94,579,000

イオンディライト	7,200	2,541.00	18,295,200
ナック	5,200	1,082.00	5,626,400
ニチイ学館	14,500	1,025.00	14,862,500
ダイセキ	11,900	1,939.00	23,074,100
ステップ	2,500	824.00	2,060,000
合 計	116,738,600		144,709,271,060

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	227,867,478
コール・ローン	2,662,495,963
国債証券	241,912,495,652
派生商品評価勘定	16,129,234
未収入金	2,850
未収利息	2,295,011,098
前払費用	102,702,383
差入委託証拠金	152,184,194
流動資産合計	247,368,888,852
資産合計	247,368,888,852
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,507,345
前受金	15,341,089
未払金	1,798,660
未払解約金	201,585,225
流動負債合計	241,232,319
負債合計	241,232,319
純資産の部	
元本等	
元本	87,062,303,721
剰余金	
剰余金又は欠損金()	160,065,352,812

	平成27年 1月20日現在
項目	金額（円）
元本等合計	247,127,656,533
純資産合計	247,127,656,533
負債純資産合計	247,368,888,852

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p> <p>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)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</p> <p>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)派生商品取引等損益</p> <p>約定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</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）

	平成27年 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		87,062,303,721口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8385円 (28,385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27年 1月20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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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。
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経営会議に報告します。 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27年 1月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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) 有価証券 売買目的有価証券

	平成27年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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> <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>

(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成27年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 1月21日
期首元本額	90,141,679,369円
期中追加設定元本額	30,868,688,014円
期中一部解約元本額	33,948,063,662円
期末元本額	87,062,303,721円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	3,609,413,529円

区分	平成27年 1月20日現在
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	178,399,150円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,415,876,977円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	988,045,619円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	960,589,937円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,059,239円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	4,611,945,517円
世界経済インデックスファンド	1,008,735,036円
マイセレクション25	6,712,303円
マイセレクション50	5,058,079円
マイセレクション75	3,544,753円
DCマイセレクション25	1,065,028,288円
DCマイセレクション50	940,506,533円
DCマイセレクション75	639,106,376円
DC外国債券インデックス・オープン	1,330,165,343円
DCマイセレクションS25	392,238,941円
DCマイセレクションS50	337,662,429円
DCマイセレクションS75	154,924,104円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	879,443円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	46,116,638円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	33,082,996円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	12,383,671円
DC世界経済インデックスファンド	941,760,163円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	17,270,229,021円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	164,252,074円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	13,819,384円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	4,823,308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）	181,748,211円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	545,109,749円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	794,963,657円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	5,575,973,474円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,068,090,311円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	7,061,121,890円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,034,633,133円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,604,105,224円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,711,401,365円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,228,050,893円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,095,428,349円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,508,133,301円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	379,869,857円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	528,939,368円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	2,245,623,499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）	1,440,152,747円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	595,212,299円

区分	平成27年 1月20日現在
外国債券ファンド・シリーズ1	151,431,604円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,154,751,509円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,153,638,506円
分散投資コア戦略ファンドA	390,858,997円
分散投資コア戦略ファンドS	551,689,588円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	12,454,086円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	222,694,306円
コア投資戦略ファンド(切替型)	495,203,704円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	59,819,919円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	54,223,491円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	258,718,001円
SMT インデックスバランス・オープン	33,041,682円
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)	8,780,862,150円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成27年 1月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		10,998,058,486
合計		10,998,058,486

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成27年 1月20日現在)

区分	種類	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	1,767,815,177	-	1,783,156,266	15,341,089
	合計	1,767,815,177	-	1,783,156,266	15,341,089

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

区分	種類	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	2,308,360,800	-	2,286,641,600	21,719,200
	アメリカドル	1,023,546,340	-	1,023,024,800	521,540
	カナダドル	100,419,130	-	100,500,600	81,470
	ユーロ	975,009,930	-	955,113,600	19,896,330
	イギリスポンド	209,385,400	-	208,002,600	1,382,800
	合計		2,308,360,800	-	2,286,641,600

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	18,002,460.96	
		T 0.375% 02/15/16	3,000,000.00	3,005,390.64	
		T 0.375% 03/15/16	11,000,000.00	11,018,046.93	
		T 0.375% 05/31/16	1,500,000.00	1,501,962.88	
		T 0.5% 07/31/17	12,000,000.00	11,943,515.64	
		T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,356,888.62	
		T 0.625% 08/15/16	17,300,000.00	17,366,902.38	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	6,982,363.29	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	996,640.63	
		T 0.625% 11/15/16	13,000,000.00	13,040,371.11	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,975,585.95	
		T 0.625% 12/15/16	10,000,000.00	10,029,492.20	
		T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,057,656.28	

T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,383,585.93	
T 0.75% 03/31/18	10,000,000.00	9,951,757.80	
T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	6,014,179.68	
T 0.75% 10/31/17	13,750,000.00	13,742,211.86	
T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,894,109.37	
T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,071,093.80	
T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,505,800.79	
T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,031,738.30	
T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	5,027,539.05	
T 0.875% 08/15/17	8,800,000.00	8,837,296.86	
T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,239,914.05	
T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,976,367.18	
T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,024,086.92	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	903,656.25	
T 1.25% 02/29/20	11,000,000.00	10,958,320.34	
T 1.25% 10/31/18	15,600,000.00	15,695,671.83	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,496,562.50	
T 1.25% 11/30/18	9,400,000.00	9,452,140.67	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,117,677.73	
T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,798,886.71	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,229,777.35	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,944,484.37	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,028,417.98	
T 1.5% 01/31/19	10,000,000.00	10,140,039.10	
T 1.5% 02/28/19	10,000,000.00	10,140,429.70	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,459,554.70	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,374,830.06	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,896,062.50	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,584,945.31	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,049,316.40	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,487,871.10	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,627,001.92	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,117,182.64	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,827,906.25	
T 1.75% 05/15/23	10,200,000.00	10,202,191.36	
T 1.75% 05/31/16	18,000,000.00	18,354,375.00	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,061,874.99	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,333,960.94	
T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,135,611.33	
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	875,549.80	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,576,025.40	
T 1.875% 11/30/21	3,000,000.00	3,051,503.91	

T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,412,906.25
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,913,867.21
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,979,308.57
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,951,328.12
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,211,652.32
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,105,527.34
T 2.125% 06/30/21	10,000,000.00	10,337,890.60
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,306,589.85
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,741,972.64
T 2.25% 03/31/21	6,600,000.00	6,877,406.25
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,646,152.33
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,997,070.31
T 2.25% 11/15/24	4,400,000.00	4,564,742.20
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,188,046.88
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,909,560.50
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,897,765.60
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,026,582.03
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,252,402.33
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,275,195.30
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,511,250.00
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	638,589.84
T 2.75% 02/15/24	8,100,000.00	8,754,011.73
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,018,128.89
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,402,031.28
T 2.75% 11/15/23	5,200,000.00	5,616,710.94
T 2.75% 11/15/42	8,400,000.00	8,919,093.79
T 2.75% 11/30/16	6,250,000.00	6,514,282.25
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,141,541.00
T 2.875% 05/15/43	11,500,000.00	12,506,923.77
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,488,900.35
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,564,160.15
T 2% 02/15/23	8,600,000.00	8,787,789.08
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,900,195.32
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,364,226.55
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,972,921.89
T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,355,000.00
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,462,203.12
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,658,554.71
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,684,160.16
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,139,394.53
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,870,068.33
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,404,589.85
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,803,085.96

T 3.125% 08/15/44	6,150,000.00	7,025,894.56	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,808,750.00	
T 3.125% 11/15/41	2,800,000.00	3,199,656.26	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,627,179.67	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,611,035.15	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,685,800.79	
T 3.375% 05/15/44	9,900,000.00	11,827,792.94	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,154,886.73	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,416,406.26	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,738,125.98	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,858,593.75	
T 3.625% 02/15/44	4,200,000.00	5,238,597.67	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,985,925.78	
T 3.75% 08/15/41	4,700,000.00	5,978,455.08	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,502,734.40	
T 3.75% 11/15/43	3,400,000.00	4,332,875.00	
T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	5,402,250.00	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	9,992,070.36	
T 3% 05/15/42	5,500,000.00	6,132,070.34	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,065,162.14	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,650,625.00	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	809,531.25	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,796,782.21	
T 4.25% 11/15/40	4,200,000.00	5,721,023.44	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,917,535.15	
T 4.375% 05/15/40	2,700,000.00	3,728,953.12	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,792,070.32	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,717,140.62	
T 4.5% 02/15/36	1,200,000.00	1,672,828.12	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	10,673,003.89	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,394,394.53	
T 4.5% 08/15/39	2,100,000.00	2,936,554.69	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,422,167.95	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,640,322.26	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,434,494.13	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	744,765.62	
T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,106,656.25	
T 5.25% 02/15/29	1,400,000.00	1,940,312.50	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,796,996.09	
T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,458,062.51	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,688,789.06	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,394,244.14	

	T 6.125% 11/15/27	350,000.00	512,469.72
	T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,695,117.19
	T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,678,117.20
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	6,931,918.00
	T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,383,496.09
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,408,687.50
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,746,939.46
	アメリカドル 小計	799,650,000.00	842,350,828.23 (99,313,162,648)
カナダドル	CAN 1.25% 02/01/16	3,850,000.00	3,862,859.00
	CAN 1.25% 03/01/18	1,800,000.00	1,817,802.00
	CAN 1.25% 08/01/17	1,100,000.00	1,110,400.50
	CAN 1.25% 09/01/18	1,400,000.00	1,414,623.00
	CAN 1.5% 02/01/17	2,300,000.00	2,329,693.00
	CAN 1.5% 06/01/23	2,100,000.00	2,113,986.00
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,676,622.75
	CAN 1.75% 03/01/19	1,000,000.00	1,030,410.00
	CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	875,797.50
	CAN 1% 05/01/16	3,300,000.00	3,303,547.50
	CAN 2.25% 06/01/25	900,000.00	953,824.50
	CAN 2.5% 06/01/24	2,100,000.00	2,280,463.50
	CAN 2.75% 06/01/22	1,300,000.00	1,429,772.50
	CAN 2.75% 09/01/16	1,550,000.00	1,596,383.75
	CAN 2.75% 12/01/48	650,000.00	753,753.00
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	423,794.00
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,420,895.00
	CAN 3.25% 06/01/21	2,100,000.00	2,363,770.50
	CAN 3.5% 06/01/20	1,650,000.00	1,853,502.75
	CAN 3.5% 12/01/45	2,250,000.00	2,974,398.75
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	3,016,723.50
	CAN 4.0% 06/01/41	2,100,000.00	2,917,687.50
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,941,695.00
	CAN 4% 06/01/16	2,050,000.00	2,136,038.50
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,503,908.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,650,000.00	2,465,199.00
	CAN 5.75% 06/01/33	1,750,000.00	2,768,368.75
	CAN 5% 06/01/37	1,850,000.00	2,829,121.75
	CAN 8.0% 06/01/27	550,000.00	935,225.50
	カナダドル 小計	49,400,000.00	56,100,267.00 (5,533,730,336)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	17,766,360.00
	MBONO 4.75% 06/14/18	38,700,000.00	39,027,789.00
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,384,240.00

	MBONO 6.25% 06/16/16	26,000,000.00	26,957,580.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	20,800,000.00	22,330,048.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	18,100,000.00	19,286,455.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	16,000,000.00	18,710,000.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	8,300,000.00	9,987,888.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	9,700,000.00	10,648,951.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	36,800,000.00	46,946,680.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	28,400,000.00	37,115,108.00	
	MBONO 8% 06/11/20	18,700,000.00	21,404,394.00	
	MBONO 8% 12/07/23	26,450,000.00	31,345,233.75	
	メキシコペソ 小計	281,750,000.00	323,910,726.75 (2,610,720,457)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,147,795.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,700,000.00	1,950,682.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,750,000.00	2,069,663.75	
	BGB 3.25% 09/28/16	2,050,000.00	2,166,675.75	
	BGB 3.5% 06/28/17	350,000.00	380,471.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	900,000.00	1,374,601.50	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	3,020,850.00	
	BGB 3% 06/22/34	850,000.00	1,099,577.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,550,000.00	1,765,899.50	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,800,000.00	3,050,460.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,984,495.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,970,952.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,850,000.00	2,350,138.25	
	BGB 4.25% 09/28/22	1,850,000.00	2,396,194.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,200,000.00	1,676,544.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,150,000.00	2,427,178.00	
	BGB 4% 03/28/22	2,750,000.00	3,479,795.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,100,000.00	1,582,839.50	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,400,000.00	3,762,720.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,184,534.50	
	BGB 5% 03/28/35	2,400,000.00	3,976,620.00	
	BKO 0.25% 03/11/16	4,100,000.00	4,119,946.50	
	BTNS 1.75% 02/25/17	2,500,000.00	2,596,800.00	
	BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,697,686.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	5,200,000.00	5,336,578.00	
	BTNS 2.5% 07/25/16	4,000,000.00	4,158,800.00	
	BTPS 1.15% 05/15/17	2,000,000.00	2,030,560.00	
	BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,478,744.00	
	BTPS 1.5% 12/15/16	1,200,000.00	1,225,206.00	
	BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,649,050.00	
	BTPS 2.5% 05/01/19	2,000,000.00	2,148,300.00	

BTPS 2.5% 12/01/24	1,650,000.00	1,776,233.25	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,164,350.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,545,744.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,500,000.00	4,053,770.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	3,700,000.00	3,857,342.50	
BTPS 3.75% 08/01/16	4,900,000.00	5,153,918.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,643,160.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,600,000.00	3,081,026.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,337,491.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	3,500,000.00	4,088,892.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,068,117.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,685,024.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	2,650,000.00	3,124,098.25	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	5,021,922.75	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,950,000.00	4,918,559.75	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	3,402,945.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,150,000.00	2,648,950.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	7,500,000.00	8,513,175.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,800,000.00	4,178,784.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,700,000.00	4,650,437.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,800,000.00	5,886,432.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	1,850,000.00	2,380,404.25	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	2,254,302.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,400,000.00	2,572,608.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,500,000.00	5,897,650.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,168,658.50	
BTPS 4% 09/01/20	4,000,000.00	4,659,200.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,600,000.00	3,516,812.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,413,651.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,300,000.00	5,822,393.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,716,077.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,950,000.00	3,824,203.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,200,000.00	3,181,299.00	
BTPS 5% 03/01/22	2,800,000.00	3,502,814.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,050,000.00	3,971,786.25	
BTPS 5% 08/01/34	3,800,000.00	5,071,708.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,100,000.00	4,187,201.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,900,000.00	5,780,599.50	
BTPS 6% 05/01/31	4,000,000.00	5,879,740.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,168,852.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,287,052.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	3,037,732.50	

DBR 1.5% 05/15/23	3,950,000.00	4,368,384.00
DBR 1.5% 05/15/24	3,850,000.00	4,252,960.25
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	3,196,394.50
DBR 1.75% 02/15/24	1,950,000.00	2,198,020.50
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	3,024,405.00
DBR 1% 08/15/24	850,000.00	899,028.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,820,012.50
DBR 2.25% 09/04/21	2,800,000.00	3,205,930.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,100,000.00	2,411,787.00
DBR 2.5% 07/04/44	2,200,000.00	2,961,508.00
DBR 2.5% 08/15/46	900,000.00	1,221,453.00
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,944,695.00
DBR 2% 08/15/23	1,000,000.00	1,148,075.00
DBR 3.25% 01/04/20	1,200,000.00	1,397,328.00
DBR 3.25% 07/04/21	2,800,000.00	3,379,852.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,100,000.00	3,174,118.50
DBR 3.5% 01/04/16	4,900,000.00	5,072,823.00
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	4,063,552.50
DBR 3.75% 01/04/17	3,600,000.00	3,876,048.00
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,789,183.00
DBR 3% 07/04/20	3,300,000.00	3,844,533.00
DBR 4.0% 01/04/18	1,000,000.00	1,123,310.00
DBR 4.0% 01/04/37	2,950,000.00	4,689,821.50
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,546,480.00
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,782,211.00
DBR 4.25% 07/04/39	2,000,000.00	3,372,400.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	3,057,070.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,800,000.00	4,714,024.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,100,000.00	3,823,375.50
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,818,070.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,450,000.00	4,178,646.50
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,518,757.75
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,449,088.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	2,236,493.75
DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,657,769.50
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	608,784.40
FRTR 0.5% 11/25/19	2,550,000.00	2,604,952.50
FRTR 1.75% 05/25/23	4,050,000.00	4,486,529.25
FRTR 1.75% 11/25/24	2,500,000.00	2,765,212.50
FRTR 1% 05/25/18	3,500,000.00	3,621,712.50
FRTR 1% 05/25/19	2,300,000.00	2,399,061.00
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,598,537.50
FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	5,073,684.00

FRTR 2.25% 10/25/22	2,750,000.00	3,145,683.75	
FRTR 2.5% 05/25/30	2,550,000.00	3,048,295.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	3,700,000.00	4,205,956.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	4,989,126.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	4,400,000.00	4,587,726.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,700,000.00	2,389,656.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,800,000.00	6,975,138.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	6,900,000.00	8,137,480.50	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,500,000.00	5,811,255.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,629,663.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	2,800,000.00	3,423,574.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,050,000.00	3,590,612.50	
FRTR 3% 04/25/22	5,000,000.00	5,966,900.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000.00	7,797,438.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,250,000.00	3,638,212.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,528,153.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,100,000.00	6,756,123.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,200,000.00	5,316,496.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,800,000.00	4,511,472.00	
FRTR 4% 04/25/18	3,800,000.00	4,301,790.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,900,000.00	3,239,101.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,872,848.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,350,000.00	5,077,863.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,700,000.00	5,906,809.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,400,000.00	5,884,159.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,451,125.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,708,444.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,659,280.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,571,746.40	
IRISH 2.4% 05/15/30	450,000.00	498,975.75	
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,086,565.50	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,050,000.00	1,298,120.25	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,294,628.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,400,000.00	4,100,859.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	925,796.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,400,000.00	1,479,282.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,650,000.00	2,308,110.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	350,000.00	400,321.25	
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	943,507.50	
NETHER 0.25% 01/15/20	950,000.00	962,354.75	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,900,000.00	1,975,772.00	
NETHER 1.25% 01/15/19	2,200,000.00	2,313,817.00	

NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,230,660.00
NETHER 2.25% 07/15/22	2,350,000.00	2,699,774.00
NETHER 2.5% 01/15/17	3,250,000.00	3,419,243.75
NETHER 2.5% 01/15/33	1,350,000.00	1,704,260.25
NETHER 2.75% 01/15/47	550,000.00	776,759.50
NETHER 2% 07/15/24	2,000,000.00	2,283,140.00
NETHER 3.25% 07/15/21	2,300,000.00	2,763,818.00
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,320,061.25
NETHER 3.75% 01/15/23	1,700,000.00	2,162,816.50
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	3,564,275.00
NETHER 4.0% 07/15/18	1,400,000.00	1,598,436.00
NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,729,655.25
NETHER 4% 01/15/37	1,850,000.00	2,941,139.25
NETHER 4% 07/15/16	4,450,000.00	4,723,452.50
NETHER 4% 07/15/19	1,900,000.00	2,243,567.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,750,000.00	2,791,118.75
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	313,871.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,126,365.50
OBL 0.5% 02/23/18	4,000,000.00	4,080,300.00
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,434,872.00
OBL 0.5% 04/12/19	3,250,000.00	3,333,021.25
OBL 0.5% 10/13/17	450,000.00	458,039.25
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,057,225.00
OBL 1.25% 10/14/16	1,050,000.00	1,075,872.00
OBL 1% 10/12/18	2,750,000.00	2,866,558.75
OBL 2.75% 04/08/16	5,500,000.00	5,695,525.00
RAGB 1.65% 10/21/24	500,000.00	554,865.00
RAGB 1.75% 10/20/23	1,350,000.00	1,509,117.75
RAGB 1.95% 06/18/19	550,000.00	598,130.50
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	622,697.50
RAGB 3.15% 06/20/44	800,000.00	1,184,804.00
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,122,434.25
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,862,242.50
RAGB 3.5% 09/15/21	2,200,000.00	2,689,742.00
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,371,584.50
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	949,012.50
RAGB 3.9% 07/15/20	1,250,000.00	1,514,543.75
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,891,448.00
RAGB 4.3% 09/15/17	900,000.00	1,004,958.00
RAGB 4.35% 03/15/19	2,300,000.00	2,720,141.00
RAGB 4.65% 01/15/18	2,850,000.00	3,252,847.50
RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,533,777.00
RAGB 4% 09/15/16	1,950,000.00	2,083,194.75

RAGB 6.25% 07/15/27	900,000.00	1,509,156.00	
RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	560,389.50	
RFGB 1.125% 09/15/18	150,000.00	156,550.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	711,402.25	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	882,244.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	614,025.00	
RFGB 1.875% 04/15/17	200,000.00	208,854.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	607,135.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	687,458.75	
RFGB 2% 04/15/24	650,000.00	741,016.25	
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	705,204.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,150,000.00	1,390,672.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,700,000.00	1,878,636.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,076,508.00	
RFGB 4% 07/04/25	900,000.00	1,213,074.00	
SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,114,225.00	
SPGB 2.75% 04/30/19	2,800,000.00	3,045,602.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,750,000.00	1,945,825.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	3,700,000.00	3,811,203.50	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,100,000.00	1,141,794.50	
SPGB 3.3% 07/30/16	2,950,000.00	3,084,402.00	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,564,458.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	3,700,000.00	3,955,799.50	
SPGB 3.8% 04/30/24	3,550,000.00	4,275,797.50	
SPGB 4.1% 07/30/18	4,300,000.00	4,828,878.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,674,591.50	
SPGB 4.25% 10/31/16	1,850,000.00	1,978,353.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,445,024.75	
SPGB 4.4% 10/31/23	1,000,000.00	1,250,640.00	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,350,855.50	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,100,000.00	3,637,075.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,900,000.00	2,449,765.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,324,818.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,500,000.00	3,220,950.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	2,650,000.00	3,238,671.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,800,000.00	2,533,905.00	
SPGB 4% 04/30/20	4,000,000.00	4,651,340.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	1,700,000.00	2,312,238.00	
SPGB 5.15% 10/31/44	900,000.00	1,316,281.50	
SPGB 5.4% 01/31/23	4,300,000.00	5,651,855.50	
SPGB 5.5% 04/30/21	3,200,000.00	4,080,160.00	
SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,605,024.00	

	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	3,358,957.50
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,500,000.00	3,303,025.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,150,000.00	3,061,868.75
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,250,000.00	3,304,113.75
	ユーロ 小計	603,730,000.00	732,760,984.80 (100,131,788,572)
イギリスボ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	5,050,000.00	5,122,720.00
	UKT 1.75% 01/22/17	2,600,000.00	2,666,235.00
	UKT 1.75% 07/22/19	4,000,000.00	4,128,820.00
	UKT 1.75% 09/07/22	4,000,000.00	4,118,300.00
	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,030,285.00
	UKT 2.25% 09/07/23	3,150,000.00	3,358,545.75
	UKT 2.75% 09/07/24	2,850,000.00	3,163,015.50
	UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,150,979.50
	UKT 3.25% 01/22/44	3,800,000.00	4,654,126.00
	UKT 3.5% 01/22/45	1,350,000.00	1,732,198.50
	UKT 3.5% 07/22/68	1,900,000.00	2,682,923.50
	UKT 3.75% 07/22/52	2,100,000.00	2,938,404.00
	UKT 3.75% 09/07/19	2,050,000.00	2,305,655.50
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	3,029,294.50
	UKT 3.75% 09/07/21	2,900,000.00	3,367,364.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,900,000.00	3,970,375.50
	UKT 4.25% 06/07/32	2,900,000.00	3,880,301.50
	UKT 4.25% 09/07/39	2,200,000.00	3,090,164.00
	UKT 4.25% 12/07/27	1,900,000.00	2,459,274.50
	UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	3,111,438.00
	UKT 4.25% 12/07/46	2,150,000.00	3,173,819.25
	UKT 4.25% 12/07/49	1,900,000.00	2,866,957.50
	UKT 4.25% 12/07/55	2,100,000.00	3,291,351.00
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,636,145.00
	UKT 4.5% 09/07/34	2,700,000.00	3,773,034.00
	UKT 4.5% 12/07/42	2,600,000.00	3,875,560.00
	UKT 4.75% 03/07/20	3,600,000.00	4,262,796.00
	UKT 4.75% 12/07/30	2,400,000.00	3,348,924.00
	UKT 4.75% 12/07/38	1,700,000.00	2,540,437.50
	UKT 4% 01/22/60	1,650,000.00	2,515,672.50
	UKT 4% 03/07/22	1,550,000.00	1,839,749.25
	UKT 4% 09/07/16	3,350,000.00	3,546,594.75
UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,322,844.75	
UKT 5% 03/07/25	2,400,000.00	3,186,708.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,450,000.00	2,216,165.50	
UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,818,615.00	
UKT 8% 06/07/21	2,000,000.00	2,839,750.00	

	イギリスポンド 小計	94,000,000.00	116,015,544.25 (20,638,005,166)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	450,000.00	520,645.50
	SWISS 2.5% 03/12/16	200,000.00	207,959.00
	SWISS 3% 01/08/18	3,100,000.00	3,458,530.50
	SWISS 4% 02/11/23	1,700,000.00	2,294,090.50
	SWISS 4% 04/08/28	400,000.00	611,284.00
	スイスフラン 小計	5,850,000.00	7,092,509.50 (950,041,647)
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	8,550,000.00	9,184,025.25
	SGB 2.5% 05/12/25	7,250,000.00	8,505,917.50
	SGB 3.5% 03/30/39	6,100,000.00	8,799,707.50
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	10,246,782.00
	SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,502,068.25
	SGB 3% 07/12/16	6,550,000.00	6,840,983.75
	SGB 4.25% 03/12/19	13,300,000.00	15,623,177.50
	SGB 5% 12/01/20	10,150,000.00	12,937,596.00
	スウェーデンクローナ 小計	68,950,000.00	81,640,257.75 (1,182,150,932)
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	6,700,000.00	7,091,347.00
	NGB 3.75% 05/25/21	9,300,000.00	10,840,359.00
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,325,307.25
	NGB 4.25% 05/19/17	8,750,000.00	9,463,868.75
	NGB 4.5% 05/22/19	8,200,000.00	9,474,936.00
	ノルウェークローネ 小計	38,500,000.00	43,195,818.00 (666,511,471)
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,150,000.00	10,054,523.25
	DGB 1.75% 11/15/25	5,250,000.00	5,889,922.50
	DGB 2.5% 11/15/16	7,450,000.00	7,818,924.00
	DGB 3% 11/15/21	12,700,000.00	15,145,321.50
	DGB 4.5% 11/15/39	16,450,000.00	28,567,892.50
	DGB 4% 11/15/17	6,500,000.00	7,267,942.50
	DGB 4% 11/15/19	13,500,000.00	16,112,182.50
	DGB 7% 11/10/24	3,500,000.00	5,735,450.00
	デンマーククローネ 小計	74,500,000.00	96,592,158.75 (1,776,329,799)
ポーランド ズロチ	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,174,508.50
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,964,304.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,350,000.00	1,470,730.50
	POLGB 3.75% 04/25/18	3,100,000.00	3,295,408.50
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,850,000.00	3,041,463.00
	POLGB 4.75% 10/25/16	3,650,000.00	3,843,888.00

	POLGB 4% 10/25/23	3,350,000.00	3,832,852.25	
	POLGB 5.25% 10/25/17	3,300,000.00	3,613,599.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,050,000.00	2,416,017.25	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	3,027,219.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,957,158.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,350,000.00	4,201,352.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,250,000.00	2,771,606.25	
	POLGB 5% 04/25/16	6,550,000.00	6,819,008.50	
	ポーランドズロチ 小計	41,700,000.00	46,429,115.00 (1,463,445,704)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	2,500,000.00	2,533,687.50	
	ACGB 2.75% 10/21/19	550,000.00	563,422.75	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,850,000.00	1,951,250.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,550,000.00	1,624,826.25	
	ACGB 3.25% 10/21/18	550,000.00	571,587.50	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,000,000.00	1,104,305.00	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,550,000.00	1,783,902.75	
	ACGB 4.25% 07/21/17	2,650,000.00	2,784,818.75	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,250,000.00	3,610,668.75	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,150,000.00	1,398,394.25	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,850,000.00	2,236,021.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,300,000.00	2,380,120.50	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,550,000.00	3,979,869.50	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,350,000.00	3,675,385.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,900,000.00	3,540,030.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,500,000.00	2,995,762.50	
ACGB 5.75% 07/15/22	2,250,000.00	2,754,798.75		
ACGB 6% 02/15/17	3,350,000.00	3,607,950.00		
	オーストラリアドル 小計	38,650,000.00	43,096,801.75 (4,161,427,176)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	150,000.00	148,590.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	950,000.00	956,593.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	800,000.00	832,292.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	850,000.00	883,179.75	
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	951,997.50	
	SIGB 2.75% 04/01/42	400,000.00	424,778.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	100,000.00	107,243.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	216,221.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	324,207.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	800,000.00	881,048.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	700,000.00	767,641.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	463,116.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	800,000.00	921,692.00	

	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	841,352.00	
	SIGB 3% 09/01/24	950,000.00	1,047,166.00	
	SIGB 4% 09/01/18	650,000.00	720,294.25	
	シンガポールドル 小計	9,750,000.00	10,487,410.50 (925,933,473)	
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	2,600,000.00	2,590,406.00	
	MGS 3.26% 03/01/18	1,450,000.00	1,431,092.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,900,000.00	2,875,219.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	2,400,000.00	2,312,664.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,450,000.00	1,397,495.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,521,976.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,900,000.00	1,761,433.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,400,000.00	2,388,228.00	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,200,000.00	1,194,072.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	100,000.00	94,300.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,700,000.00	2,709,234.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,499,745.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	350,000.00	337,160.25	
	MGS 4.048% 09/30/21	350,000.00	353,568.25	
	MGS 4.127% 04/15/32	2,050,000.00	1,986,111.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,300,000.00	2,327,531.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	950,000.00	968,886.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,689,935.50	
	MGS 4.262% 09/15/16	1,000,000.00	1,013,045.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,662,088.00	
MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,115,026.00		
MGS 4.935% 09/30/43	850,000.00	892,245.00		
MGS 5.248% 09/15/28	1,000,000.00	1,095,305.00		
	マレーシアリンギット 小計	37,350,000.00	37,216,767.25 (1,224,431,642)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	19,650,000.00	24,426,718.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	13,900,000.00	11,367,698.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	11,300,000.00	9,293,515.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	13,400,000.00	13,285,430.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	10,900,000.00	11,106,446.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	9,100,000.00	9,456,447.00	
	SAGB 7% 02/28/31	18,500,000.00	17,000,482.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	10,450,000.00	10,917,689.75	
	SAGB 8.5% 01/31/37	4,600,000.00	4,763,231.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	7,200,000.00	7,597,332.00	
	SAGB 8% 12/21/18	12,000,000.00	12,553,680.00	
	南アフリカランド 小計	131,000,000.00	131,768,670.25 (1,334,816,629)	

合計		241,912,495,652	
		(241,912,495,652)	

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	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 147銘柄	100.0%	41.1%
カナダドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 247銘柄	100.0%	41.4%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	8.5%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.4%
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 8銘柄	100.0%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 18銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 23銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.6%

(注)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。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	平成27年 1月20日現在
項目	金額（円）
預金	4,822,106,991
コール・ローン	551,065,648
株式	213,073,399,696
投資信託受益証券	189,463,166
投資証券	5,343,065,564
派生商品評価勘定	81,601,742
未収入金	30,153,325
未収配当金	176,981,730
未収利息	828
前払金	19,558,633
差入委託証拠金	1,579,544,645
流動資産合計	225,866,941,968
資産合計	225,866,941,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	99,136,571
未払金	88,750,730
未払解約金	129,877,064
流動負債合計	317,764,365
負債合計	317,764,365
純資産の部	
元本等	
元本	115,343,620,405
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	110,205,557,198
元本等合計	225,549,177,603
純資産合計	225,549,177,603
負債純資産合計	225,866,941,968

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 1月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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) 投資証券</p>

	平成27年 1月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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>(1)先物取引</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>株式及び投資証券は、原則として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> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</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)

平成27年 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,343,620,405口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9555円 (1万口当たり純資産額) (19,555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27年 1月20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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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。
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経営会議に報告します。 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

平成27年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(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

	平成27年 1月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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> <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>

(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成27年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 1月21日
期首元本額	100,196,822,690円
期中追加設定元本額	40,055,545,052円
期中一部解約元本額	24,908,747,337円
期末元本額	115,343,620,405円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,514,153,249円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,542,640円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	21,810,971,215円
世界経済インデックスファンド	1,513,145,488円

区分	平成27年 1月20日現在
マイセレクション25	4,809,260円
マイセレクション50	21,374,152円
マイセレクション75	24,660,633円
外国株式インデックス・オープン	992,224,058円
DCマイセレクション25	837,116,481円
DCマイセレクション50	3,985,113,145円
DCマイセレクション75	4,565,701,141円
DC外国株式インデックス・オープン	6,020,052,027円
DCマイセレクションS25	279,906,873円
DCマイセレクションS50	1,430,739,069円
DCマイセレクションS75	1,139,878,749円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,583,888円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	140,799,740円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	149,027,037円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	73,808,154円
DC世界経済インデックスファンド	1,417,713,058円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	25,779,992,943円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	59,257,135円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	34,702,172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）	195,811,755円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	333,410,633円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,136,915,485円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	1,642,148,264円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	943,838,701円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,910,365,265円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	805,659,328円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,212,333,267円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	4,874,538,771円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,719,772,068円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	791,104,354円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	828,117,246円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	235,494,793円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,701,573,651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）	4,231,669,016円
外国株式ファンド・シリーズ1	616,939,005円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,425,891,337円
コア投資戦略ファンド（成長型）	8,157,930,089円
分散投資コア戦略ファンドA	621,668,258円
分散投資コア戦略ファンドS	873,579,029円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	55,936,700円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	107,407,294円
コア投資戦略ファンド（切替型）	763,639,698円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	270,721,607円

区分	平成27年 1月20日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	26,980,236円
SMT インデックスバランス・オープン	48,902,248円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,820,846,561
投資信託受益証券	15,817,606
投資証券	686,499,108
合計	5,523,163,275

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 1月20日現在）

区分	種類	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	6,980,662,917	-	6,961,104,284	19,558,633
合計		6,980,662,917	-	6,961,104,284	19,558,633

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 1月20日現在）

区分	種類	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	447,721,886	-	449,745,690	2,023,804
	アメリカドル	300,439,819	-	302,505,740	2,065,921
	カナダドル	22,061,380	-	22,389,010	327,630
	ユーロ	13,570,030	-	13,664,000	93,970

	イギリスポンド	29,933,363	-	30,061,720	128,357
	スイスフラン	47,240,754	-	46,615,220	625,534
	オーストラリアドル	19,326,740	-	19,310,000	16,740
	香港ドル	15,149,800	-	15,200,000	50,200
	合計	447,721,886	-	449,745,690	2,023,804

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)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	31,497	78.45	2,470,939.65	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,745	37.22	102,168.90	
	APACHE CORP	23,930	62.25	1,489,642.50	
	BAKER HUGHES	27,194	56.56	1,538,092.64	
	CABOT OIL & GAS CORP	26,114	29.04	758,350.56	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,808	43.48	556,891.84	
	CHENIERE ENERGY INC	14,036	73.23	1,027,856.28	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	33,542	19.03	638,304.26	
	CHEVRON CORP	117,750	105.12	12,377,880.00	
	CIMAREX ENERGY CO	5,528	98.95	546,995.60	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	14,569	8.26	120,339.94	
	CONCHO RESOURCES INC	7,024	105.00	737,520.00	
	CONOCOPHILLIPS	76,319	63.08	4,814,202.52	
	CONSOL ENERGY INC	14,731	30.26	445,760.06	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,154	39.60	204,098.40	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,702	100.94	272,739.88	
	DENBURY RESOURCES INC	18,996	6.85	130,122.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,311	60.70	1,475,677.70	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,474	31.65	109,952.10	
	ENERGEN CORP	4,802	64.78	311,073.56	
ENSCO PLC-CL A	14,882	28.99	431,429.18		
EOG RESOURCES INC	34,045	90.31	3,074,603.95		

EQT CORPORATION	9,485	75.59	716,971.15
EXXON MOBIL	264,460	91.12	24,097,595.20
FMC TECHNOLOGIES INC	13,816	40.12	554,297.92
HALLIBURTON CO	53,008	39.13	2,074,203.04
HELMERICH & PAYNE	6,883	63.47	436,864.01
HESS CORP	17,367	70.02	1,216,037.34
HOLLYFRONTIER CORP	11,175	30.84	344,637.00
KINDER MORGAN INC	111,682	41.53	4,638,153.46
MARATHON OIL CORP	42,322	26.60	1,125,765.20
MARATHON PETROLEUM CORP	17,705	77.56	1,373,199.80
MURPHY OIL CORP	10,060	47.68	479,660.80
NABORS INDUSTRIES LTD	13,930	10.63	148,075.90
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,865	58.28	1,565,692.20
NOBLE CORP PLC	14,396	16.48	237,246.08
NOBLE ENERGY INC	22,390	45.49	1,018,521.10
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,434	78.06	3,780,758.04
OCEANEERING INTL INC	6,110	53.99	329,878.90
ONEOK INC	13,214	42.89	566,748.46
PHILLIPS 66	34,802	60.83	2,117,005.66
PIONEER NATURAL RESOURCES	8,968	149.97	1,344,930.96
QEP RESOURCES INC	9,981	19.89	198,522.09
RANGE RESOURCES CORP	10,750	49.58	532,985.00
SCHLUMBERGER	80,426	81.33	6,541,046.58
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,624	25.01	515,806.24
SPECTRA ENERGY CORP	41,977	33.37	1,400,772.49
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	10,497	18.90	198,393.30
TESORO CORP	8,241	71.03	585,358.23
VALERO ENERGY CORP	32,981	45.40	1,497,337.40
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	48,171	10.34	498,088.14
WHITING PETROLEUM CORP	10,548	28.28	298,297.44
WILLIAMS COS	43,081	42.00	1,809,402.00
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	13,327	139.71	1,861,915.17
AIRGAS INC	4,296	110.48	474,622.08
ALBEMARLE CORP	4,304	58.52	251,870.08
ALCOA	72,694	15.28	1,110,764.32
ASHLAND INC	4,431	120.44	533,669.64
AVERY DENNISON CORP	6,084	52.72	320,748.48
BALL CORP	8,446	64.87	547,892.02
CELANESE CORP-SERIES A	9,269	56.46	523,327.74
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,955	297.63	879,496.65
CROWN HOLDINGS INC	8,966	46.21	414,318.86
DOW CHEMICAL CO	74,462	44.79	3,335,152.98

DU PONT (E. I) DE NEMOURS	57,016	74.25	4,233,438.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,830	71.07	627,548.10
ECOLAB INC	16,892	102.21	1,726,531.32
FMC CORP	8,555	58.29	498,670.95
FREEMPORT-MCMORAN INC	65,180	19.24	1,254,063.20
INT'L PAPER CO	25,484	54.08	1,378,174.72
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,822	107.36	517,689.92
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,232	79.84	2,174,202.88
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,206	107.94	346,055.64
MEADWESTVACO CORP	10,117	44.63	451,521.71
MONSANTO CO	32,689	117.59	3,843,899.51
MOSAIC CO/THE	20,217	45.99	929,779.83
NEWMONT MINING CORP	29,365	22.29	654,545.85
NUCOR CORP	19,888	44.42	883,424.96
OWENS-ILLINOIS INC	11,001	23.83	262,153.83
PPG INDUSTRIES INC	8,622	230.38	1,986,336.36
PRAXAIR INC	18,245	123.53	2,253,804.85
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,598	62.52	537,546.96
SEALED AIR CORP	11,641	41.87	487,408.67
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,217	273.82	1,428,518.94
SIGMA-ALDRICH	7,449	137.48	1,024,088.52
VULCAN MATERIALS CO	8,339	66.89	557,795.71
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,454	57.49	141,080.46
3 M COMPANY	38,191	162.00	6,186,942.00
AGCO CORP	4,746	43.33	205,644.18
AMETEK INC	15,516	48.56	753,456.96
B/E AEROSPACE INC	6,245	59.63	372,389.35
BOEING CO	42,481	130.78	5,555,665.18
CATERPILLAR	37,073	83.86	3,108,941.78
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	5,158	40.17	207,196.86
CUMMINS INC	10,917	140.86	1,537,768.62
DANAHER CORP	39,191	82.54	3,234,825.14
DEERE&CO	21,248	87.30	1,854,950.40
DOVER CORP	10,404	69.57	723,806.28
EATON CORP	29,675	64.59	1,916,708.25
EMERSON ELECTRIC CO	43,426	60.35	2,620,759.10
FASTENAL CO	17,687	45.25	800,336.75
FLOWSERVE CORP	8,133	55.68	452,845.44
FLUOR CORP	10,027	54.03	541,758.81
GENERAL DYNAMICS CORP	17,693	139.07	2,460,565.51
GENERAL ELECTRIC CO	622,182	23.59	14,677,273.38
GRAINGER (WW) INC	3,835	241.29	925,347.15

HONEYWELL INTL INC	46,151	98.22	4,532,951.22
ILLINOIS TOOL WORKS	23,472	93.29	2,189,702.88
INGERSOLL-RAND PLC	16,803	61.62	1,035,400.86
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	38.95	308,367.15
JOY GLOBAL INC	6,537	42.19	275,796.03
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,450	125.67	684,901.50
LOCKHEED MARTIN CORP	16,769	194.71	3,265,091.99
MASCO CORP	21,330	24.17	515,546.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,325	153.33	1,889,792.25
PACCAR INC	22,182	64.50	1,430,739.00
PALL CORP	6,924	99.58	689,491.92
PARKER HANNIFIN CORP	9,227	120.00	1,107,240.00
PENTAIR PLC	12,104	64.48	780,465.92
PRECISION CASTPARTS CORP	8,943	199.63	1,785,291.09
QUANTA SERVICES INC	12,064	26.37	318,127.68
RAYTHEON COMPANY	19,364	105.73	2,047,355.72
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,623	104.69	902,741.87
ROCKWELL COLLIN	7,244	85.18	617,043.92
ROPER INDUSTRIES INC	6,234	145.75	908,605.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,562	49.25	470,928.50
SNAP-ON INC	3,801	132.56	503,860.56
SPX CORP	1,919	81.87	157,108.53
STANLEY BLACK&DECKER	9,286	91.83	852,733.38
TEXTRON	17,592	42.87	754,169.04
TRANSDIGM GROUP INC	3,167	204.00	646,068.00
UNITED RENTALS INC	5,642	82.31	464,393.02
UNITED TECHNOLOGIES CORP	53,919	116.15	6,262,691.85
WABTEC CORP	6,250	83.24	520,250.00
XYLEM INC	11,717	34.47	403,884.99
ADT CORPORATION	9,887	33.66	332,796.42
CINTAS CORP	5,750	78.93	453,847.50
DUN & BRADSTREET CORP	2,027	117.16	237,483.32
EQUIFAX INC	7,222	83.32	601,737.04
IHS INC-CLASS A	4,024	116.64	469,359.36
MANPOWER GROUP	4,455	66.01	294,074.55
NIELSEN NV	21,363	42.70	912,200.10
REPUBLIC SERVICES INC	16,828	40.17	675,980.76
ROBERT HALF INTL INC	8,298	57.16	474,313.68
STERICYCLE INC	5,019	134.15	673,298.85
TOWERS WATSON & CO-CL A	4,476	114.38	511,964.88
TYCO INTERNATIONAL PLC	28,694	42.50	1,219,495.00
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,906	62.90	560,187.40

WASTE MANAGEMENT INC	27,717	52.24	1,447,936.08
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,923	49.81	544,074.63
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,364	73.45	687,785.80
CSX CORP	62,292	34.86	2,171,499.12
DELTA AIR LINES INC	13,337	45.84	611,368.08
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,420	43.37	538,655.40
FEDEX CORP	16,778	176.76	2,965,679.28
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	26,635	21.28	566,792.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,573	79.82	444,836.86
KANSAS CITY SOUTHERN	6,896	109.98	758,422.08
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,299	103.58	1,998,990.42
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,854	39.48	389,035.92
UNION PACIFIC CORP	55,674	111.90	6,229,920.60
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	65.75	354,458.25
UNITED PARCEL SERVICE B	43,845	110.30	4,836,103.50
AUTOLIV INC	5,543	102.11	565,995.73
BORGWARNER INC	14,428	50.80	732,942.40
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	18,764	66.59	1,249,494.76
FORD MOTOR COMPANY	224,793	15.02	3,376,390.86
GENERAL MOTORS CO	79,838	33.68	2,688,943.84
HARLEY-DAVIDSON	13,690	63.20	865,208.00
JOHNSON CONTROLS INC	41,537	45.39	1,885,364.43
TESLA MOTORS INC	5,475	193.07	1,057,058.25
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,987	102.99	719,591.13
COACH INC	16,177	36.11	584,151.47
DR HORTON INC	21,692	23.76	515,401.92
FOSSIL GROUP INC	3,153	97.74	308,174.22
GARMIN LTD	6,629	52.83	350,210.07
HANESBRANDS INC	6,352	107.16	680,680.32
HASBRO INC	6,979	52.54	366,676.66
JARDEN CORP	11,913	46.16	549,904.08
LEGGETT & PLATT INC	9,020	44.35	400,037.00
LENNAR CORP-CL A	11,040	43.20	476,928.00
LULULEMON ATHLETICA INC	6,262	63.00	394,506.00
MATTEL INC	19,894	27.81	553,351.61
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,846	67.01	860,810.46
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,694	168.45	622,254.30
NEWELL RUBBERMAID	16,407	38.16	626,091.12
NIKE B	42,896	92.99	3,988,899.04
POLARIS INDUSTRIES INC	3,714	138.06	512,754.84
PULTE GROUP INC	20,589	21.57	444,104.73
PVH CORP	5,223	111.42	581,946.66

RALPH LAUREN CORPORATION	3,635	170.05	618,131.75
TOLL BROTHERS INC	9,602	33.93	325,795.86
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,429	65.20	679,970.80
VF CORP	21,544	72.57	1,563,448.08
WHIRLPOOL CORP	4,864	200.17	973,626.88
BLOCK H & R INC	17,436	32.87	573,121.32
CARNIVAL CORPORATION	24,004	45.46	1,091,221.84
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,940	711.11	1,379,553.40
DARDEN RESTAURANTS INC	7,865	59.10	464,821.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	25,470	25.86	658,654.20
LAS VEGAS SANDS CORP	25,201	54.89	1,383,282.89
MARRIOTT INTL A	14,589	75.89	1,107,159.21
MCDONALD'S CORP	60,929	91.49	5,574,394.21
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,010	20.01	500,450.10
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,621	44.85	296,951.85
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,505	82.99	871,809.95
STARBUCKS CORP	46,661	80.61	3,761,343.21
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,000	72.48	869,760.00
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,349	85.01	624,738.49
WYNN RESORTS LTD	5,061	146.99	743,916.39
YUM BRANDS INC	27,412	72.43	1,985,451.16
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	19.91	211,065.91
CBS CORP-CL B	30,480	55.56	1,693,468.80
CHARTER COMMUNICATION-A	4,754	161.11	765,916.94
COMCAST CORP-CL A	133,330	56.77	7,569,144.10
COMCAST CORP-SPECIAL A	26,836	56.34	1,511,940.24
DIRECTV	29,696	85.55	2,540,492.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,963	29.41	234,231.64
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,394	28.54	467,884.76
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,827	71.85	993,469.95
INTERPUBLIC GROUP OF COS	26,809	19.77	530,013.93
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,620	46.40	678,368.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	39,644	45.11	1,788,340.84
LIBERTY MEDIA CORP	4,935	34.54	170,479.57
LIBERTY MEDIA CORP-C	13,068	34.70	453,459.60
NEWS CORP-CLASS A	23,149	15.06	348,623.94
OMNICOM GROUP	15,757	73.58	1,159,400.06
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	73.57	362,037.97
SIRIUS XM HOLDINGS INC	151,498	3.53	534,787.94
THE WALT DISNEY CO	101,129	95.18	9,625,458.22
TIME WARNER CABLE-A	17,393	146.76	2,552,596.68
TIME WARNER INC	53,073	83.18	4,414,612.14

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,525	34.94	3,023,183.50
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	27,391	33.59	920,063.69
VIACOM INC-CLASS B	23,239	68.07	1,581,878.73
ADVANCE AUTO PARTS	4,609	150.00	691,350.00
AMAZON.COM	24,360	290.74	7,082,426.40
AUTONATION INC	5,015	58.07	291,221.05
AUTOZONE INC	2,043	580.85	1,186,676.55
BED BATH & BEYOND INC	12,699	73.54	933,884.46
BEST BUY COMPANY INC	18,782	34.99	657,182.18
CARMAX INC	13,070	63.51	830,075.70
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,316	53.11	282,332.76
DOLLAR GENERAL CORP	19,004	67.63	1,285,240.52
DOLLAR TREE INC	12,181	66.71	812,594.51
EXPEDIA INC	6,028	83.48	503,217.44
FAMILY DOLLAR STORES	6,125	75.28	461,090.00
FOOT LOCKER INC	9,388	52.07	488,833.16
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	36.35	272,297.85
GAP	14,004	40.50	567,162.00
GENUINE PARTS CO	9,630	97.10	935,073.00
HOME DEPOT	83,470	104.12	8,690,896.40
KOHL'S CORP	13,086	59.34	776,523.24
L BRANDS INC	15,338	82.10	1,259,249.80
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	26,746	27.93	747,015.78
LKQ CORP	17,829	25.63	456,957.27
LOWES COMPANIES	61,296	67.99	4,167,515.04
MACY'S INC	22,106	63.14	1,395,772.84
NETFLIX INC	3,580	337.34	1,207,677.20
NORDSTROM INC	8,354	76.89	642,339.06
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,504	182.91	1,189,646.64
PETSMART INC	5,725	81.46	466,387.12
PRICELINE GROUP INC/THE	3,259	1,008.22	3,285,788.98
ROSS STORES INC	13,253	92.90	1,231,203.70
SIGNET JEWELERS LTD	4,912	124.68	612,428.16
STAPLES INC	38,447	17.35	667,055.45
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,441	74.94	2,805,828.54
TIFFANY & CO	8,147	88.40	720,194.80
TJX COMPANIES INC	43,093	66.75	2,876,457.75
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,290	76.52	634,350.80
TRIPADVISOR INC	6,929	68.18	472,419.22
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,634	129.72	471,402.48
URBAN OUTFITTERS INC	6,170	33.32	205,584.40
COSTCO WHOLESALE CORP	27,222	139.72	3,803,457.84

CVS HEALTH CORP	71,840	98.74	7,093,481.60
KROGER CO	28,975	66.74	1,933,791.50
SAFEWAY INC	13,682	35.17	481,195.94
SYSCO CORP	36,683	40.02	1,468,053.66
WAL-MART STORES	99,958	86.77	8,673,355.66
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	56,421	76.03	4,289,688.63
WHOLE FOODS MKT INC	22,659	51.46	1,166,032.14
ALTRIA GROUP INC	123,056	53.05	6,528,120.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,256	47.68	1,919,406.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,709	89.44	689,492.96
BUNGE LIMITED	8,621	91.96	792,787.16
CAMPBELL SOUP CO (US)	12,938	46.55	602,263.90
COCA-COLA CO	244,780	42.53	10,410,493.40
COCA-COLA ENTERPRISES	13,696	43.12	590,571.52
CONAGRA	26,641	36.23	965,203.43
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,481	111.60	1,169,679.60
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,286	76.46	939,387.56
GENERAL MILLS INC	38,182	53.41	2,039,300.62
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,590	110.66	1,061,229.40
HORMEL FOODS CORP	9,273	51.49	477,466.77
JM SMUCKER CO	6,141	101.86	625,522.26
KELLOGG CO	16,702	68.12	1,137,740.24
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	7,658	129.00	987,882.00
KRAFT FOODS GROUP INC	36,985	65.76	2,432,133.60
LORILLARD INC	22,526	65.21	1,468,920.46
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,477	74.36	555,989.72
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	12,498	100.35	1,254,174.30
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,598	75.05	720,329.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	104,714	36.94	3,868,135.16
MONSTER BEVERAGE CORP	8,862	118.89	1,053,603.18
PEPSICO INC	93,446	97.29	9,091,361.34
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	96,887	82.70	8,012,554.90
REYNOLDS AMERICAN INC	19,968	67.57	1,349,237.76
TYSON FOODS INC	19,183	40.36	774,225.88
AVON PRODUCTS INC	24,395	7.47	182,230.65
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,845	82.34	645,957.30
CLOROX COMPANY	8,118	109.08	885,511.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	56,727	69.17	3,923,806.59
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,934	131.09	515,708.06
ESTEE LAUDER CO-CL A	14,604	74.22	1,083,908.88
HERBALIFE LTD	4,464	31.24	139,455.36
KIMBERLY-CLARK CORP	23,264	117.65	2,737,009.60

PROCTER & GAMBLE CO	167,895	91.25	15,320,418.75
ABBOTT LABORATORIES	93,371	44.49	4,154,075.79
AETNA INC	22,105	92.56	2,046,038.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,056	92.42	1,299,055.52
ANTHEM INC	17,085	136.01	2,323,730.85
BARD C R INC	4,457	174.06	775,785.42
BAXTER INTERNATIONAL	33,719	72.01	2,428,105.19
BECTON DICKINSON & CO	11,974	140.38	1,680,910.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	81,969	14.46	1,185,271.74
CARDINAL HEALTH	21,014	82.26	1,728,611.64
CAREFUSION CORP	11,956	59.50	711,382.00
CERNER CORP	19,236	65.59	1,261,689.24
CIGNA CORP	16,466	107.89	1,776,516.74
COVIDIEN PLC	28,091	104.05	2,922,868.55
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,713	75.05	804,010.65
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,058	50.76	459,784.08
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,675	129.16	862,143.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,301	85.38	3,953,179.38
HCA HOLDINGS INC	18,563	69.84	1,296,439.92
HENRY SCHEIN INC	5,009	139.50	698,755.50
HOLOGIC INC	14,349	29.02	416,479.72
HUMANA INC	9,650	149.94	1,446,921.00
INTUITIVE SURGICAL INC	2,255	530.63	1,196,570.65
LABORATORY CRP OF AMER	5,381	117.04	629,792.24
MCKESSON CORP	14,397	213.98	3,080,670.06
MEDTRONIC	60,813	72.76	4,424,753.88
OMNICARE INC	5,836	74.33	433,789.88
PATTERSON COMPANIES INC	4,632	50.30	232,989.60
QUEST DIAGNOSTICS	9,138	69.74	637,284.12
RESMED INC	8,940	60.73	542,926.20
ST JUDE MEDICAL INC	17,655	66.34	1,171,232.70
STRYKER CORP	21,240	92.45	1,963,638.00
THE COOPER COS INC	3,161	159.75	504,969.75
UNITEDHEALTH GROUP INC	60,280	105.77	6,375,815.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,764	108.22	623,780.08
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,180	87.59	541,306.20
ZIMMER HOLDINGS INC	10,395	117.00	1,216,215.00
ABBVIE INC	98,740	64.54	6,372,679.60
ACTAVIS PLC	16,407	268.66	4,407,904.62
AGILENT TECHNOLOGIES	20,632	38.25	789,174.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,322	180.44	2,223,381.68
ALLERGAN INC	18,457	218.66	4,035,807.62

AMGEN	47,116	158.43	7,464,587.88
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,158	99.45	910,763.10
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	102,858	62.31	6,409,081.98
CELGENE CORP	49,610	121.81	6,042,994.10
ENDO INTERNATIONAL PLC	9,181	79.99	734,388.19
GILEAD SCIENCES INC	93,746	100.71	9,441,159.66
HOSPIRA INC	10,628	63.22	671,902.16
ILLUMINA INC	8,626	183.82	1,585,631.32
INCYTE CORP	9,669	74.38	719,180.22
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,851	164.97	635,299.47
JOHNSON & JOHNSON	174,882	104.04	18,194,723.28
LILLY (ELI) & CO	62,434	70.68	4,412,835.12
MALLINCKRODT PLC	6,682	105.00	701,610.00
MEDIVATION INC	5,003	108.53	542,975.59
MERCK & CO	178,877	63.03	11,274,617.31
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,700	292.00	496,400.00
MYLAN INC	23,106	56.00	1,293,936.00
PERRIGO CO PLC	8,371	160.52	1,343,712.92
PFIZER	393,188	32.80	12,896,566.40
PHARMACYCLICS INC	4,064	145.51	591,352.64
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	4,953	59.58	295,099.74
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,942	408.69	2,019,745.98
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	4,273	120.19	513,571.87
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,823	125.29	3,110,073.67
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,575	122.86	1,790,684.50
WATERS CORP	5,319	113.46	603,493.74
ZOETIS INC	31,369	44.22	1,387,137.18
BANK OF AMERICA CORP	652,092	15.38	10,029,174.96
BB&T CORP	44,933	36.02	1,618,486.66
CIT GROUP INC	10,896	44.40	483,782.40
CITIGROUP	188,012	47.61	8,951,251.32
COMERICA INC	10,764	41.47	446,383.08
FIFTH THIRD BANCORP	52,474	18.30	960,274.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,821	48.40	378,536.40
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.11	252,367.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,227	9.92	528,011.84
JPMORGAN CHASE & CO	233,230	55.93	13,044,553.90
KEY CORP	51,836	12.40	642,766.40
M & T BANK CORP	7,467	115.03	858,929.01
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,326	15.45	437,636.70
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,290	14.28	261,181.20

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,655	84.44	2,841,828.20
REGIONS FINL CORP	86,246	9.07	782,251.22
SUNTRUST BANKS	33,247	38.19	1,269,702.93
US BANCORP	111,849	41.52	4,643,970.48
WELLS FARGO & CO	307,522	51.64	15,880,436.08
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,486	195.39	681,129.54
ALLY FINANCIAL INC	27,249	20.40	555,879.60
AMERICAN EXPRESS	58,455	86.04	5,029,468.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,706	124.66	1,459,269.96
BANK NEW YORK CO	70,396	37.46	2,637,034.16
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	71,300	149.21	10,638,673.00
BLACKROCK INC	8,258	348.07	2,874,362.06
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,918	76.65	2,676,464.70
CME GROUP INC	19,924	85.04	1,694,336.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,821	60.17	1,734,159.57
EATON VANCE CORP	6,650	38.98	259,217.00
FRANKLIN RESOURCES INC	25,443	51.80	1,317,947.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,617	177.23	4,362,870.91
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7,090	209.40	1,484,646.00
INVESCO LTD	27,134	36.34	986,049.56
LEGG MASON INC	6,202	53.39	331,124.78
LEUCADIA NATIONAL CORP	18,806	21.84	410,723.04
MCGRAW-HILL FINANCIAL	16,941	90.77	1,537,734.57
MOODY'S CORP	11,932	94.13	1,123,159.16
MORGAN STANLEY	91,509	34.89	3,192,749.01
NASDAQ OMX GROUP	7,604	46.29	351,989.16
NAVIENT CORP	25,310	20.15	509,996.50
NORTHERN TRUST CORP	14,001	62.30	872,262.30
PRICE T ROWE GROUP INC	16,462	81.50	1,341,653.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,569	52.65	398,507.85
SCHWAB (CHARLES) CORP	73,094	26.90	1,966,228.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,203	39.55	324,428.65
STATE STREET CORP	26,405	73.66	1,944,992.30
SYNCHRONY FINANCIAL	11,555	28.99	334,979.45
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,322	33.02	538,952.44
VOYA FINANCIAL INC	13,566	38.91	527,853.06
ACE LTD	20,902	111.75	2,335,798.50
AFLAC	28,291	58.18	1,645,970.38
ALLEGHANY CORP	983	453.34	445,633.22
ALLSTATE CORP	27,031	70.84	1,914,876.04
AMERICAN INT'L GROUP	88,648	51.11	4,530,799.28
AON PLC	17,238	95.56	1,647,263.28

ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,944	59.25	470,682.00
ASSURANT INC	4,030	65.18	262,675.40
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	48.90	290,514.90
CHUBB CORPORATION	15,032	103.34	1,553,406.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,898	51.75	512,221.50
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	170.70	502,028.70
FNF GROUP	14,901	36.47	543,439.47
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	29,919	7.30	218,408.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,099	39.96	1,122,836.04
LINCOLN NATIONAL CORP	16,451	51.43	846,074.93
LOEWS CORP	20,294	39.31	797,757.14
MARSH & MCLENNAN COS	33,947	56.73	1,925,813.31
METLIFE INC	59,440	48.99	2,911,965.60
PARTNERRE LTD	2,555	113.76	290,656.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,316	48.03	879,717.48
PROGRESSIVE CORP	35,318	26.37	931,335.66
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28,511	81.00	2,309,391.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,183	96.40	210,441.20
TORCHMARK CORP	8,367	51.85	433,828.95
TRAVELERS COS INC/THE	21,121	106.54	2,250,231.34
UNUM GROUP	16,333	31.75	518,572.75
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,724	43.92	427,078.08
WR BERKLEY CORP	7,065	49.34	348,587.10
XL GROUP PLC	16,172	35.53	574,591.16
CBRE GROUP INC-A	19,000	33.09	628,710.00
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	45.54	429,077.88
WEYERHAEUSER CO	32,649	36.63	1,195,932.87
ACCENTURE PLC-CL A	39,278	88.89	3,491,421.42
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,784	20.25	643,626.00
ADOBE SYSTEMS INC	29,485	71.73	2,114,959.05
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	10,430	59.22	617,664.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,982	289.55	1,152,988.10
ANSYS INC	5,240	82.69	433,295.60
AUTODESK INC	13,405	56.85	762,074.25
AUTOMATIC DATA PROCESS	29,974	84.57	2,534,901.18
CA INC	21,128	31.36	662,574.08
CITRIX SYSTEMS INC	10,361	58.38	604,875.18
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,951	55.03	2,088,633.28
COMPUTER SCIENCES CORP	9,202	62.89	578,713.78
EBAY	69,486	53.66	3,728,618.76
ELECTRONIC ARTS INC	19,706	48.08	947,563.01
EQUINIX INC	3,222	220.24	709,613.28

FACEBOOK INC-A	122,559	75.18	9,213,985.62
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,940	63.29	1,135,422.60
FIREEYE INC	5,457	32.89	179,480.73
FISERV INC	15,487	73.04	1,131,170.48
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,720	139.72	659,478.40
GOOGLE INC-CL A	17,597	510.45	8,982,476.63
GOOGLE INC-CL C	17,853	508.08	9,070,752.24
INTL BUSINESS MACHINES CORP	58,855	157.14	9,248,474.70
INTUIT INC	16,885	86.42	1,459,201.70
LINKEDIN CORP - A	6,538	214.18	1,400,308.84
MASTERCARD INC-CLASS A	62,329	83.80	5,223,170.20
MICROSOFT CORP	486,089	46.24	22,476,755.36
NETSUITE INC	2,264	104.04	235,546.56
NUANCE COMMUNICATIONS INC	14,585	13.52	197,189.20
ORACLE CORP	221,322	43.51	9,629,720.22
PAYCHEX INC	20,404	47.30	965,109.20
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	45.99	317,331.00
RED HAT INC	11,958	65.19	779,542.02
SALESFORCE.COM INC	35,880	56.64	2,032,243.20
SERVICENOW INC	8,327	63.96	532,594.92
SYMANTEC CORP	43,416	25.63	1,112,752.08
SYNOPSYS INC	9,398	42.41	398,569.18
TERADATA CORP	9,511	42.93	408,307.23
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,333	34.13	318,535.29
TWITTER INC	23,398	37.31	872,979.38
VANTIV INC - CL A	8,373	34.14	285,854.22
VERISIGN INC	7,532	56.66	426,763.12
VISA INC-CLASS A SHARES	30,730	254.95	7,834,613.50
VMWARE INC-CLASS A	5,459	80.61	440,049.99
WESTERN UNION CO	31,913	17.22	549,541.86
WORKDAY INC-CLASS A	6,075	78.40	476,280.00
XEROX CORP	69,076	13.60	939,433.60
YAHOO	58,846	46.47	2,734,573.62
AMPHENOL CORPORATION	19,619	52.42	1,028,427.98
APPLE INC	371,875	105.99	39,415,031.25
ARROW ELECTRONICS INC	5,800	55.58	322,364.00
AVNET INC	7,613	41.69	317,385.97
CISCO SYSTEMS	318,143	27.68	8,806,198.24
CORNING	80,653	23.17	1,868,730.01
EMC CORP	126,213	27.88	3,518,818.44
F5 NETWORKS INC	4,710	126.29	594,825.90
FLEXTRONICS INTL LTD	33,519	10.87	364,351.53

FLIR SYSTEMS INC	9,284	30.01	278,612.84
HARRIS CORP	6,029	67.64	407,801.56
HEWLETT-PACKARD CO	116,332	38.34	4,460,168.88
JUNIPER NETWORKS INC	24,010	21.63	519,336.30
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,419	64.05	859,486.95
NETAPP INC	18,924	38.75	733,305.00
PALO ALTO NETWORKS INC	4,460	125.01	557,544.60
QUALCOMM	104,100	71.29	7,421,289.00
SANDISK CORP	14,057	78.92	1,109,448.72
SEAGATE TECHNOLOGY	20,213	63.41	1,281,706.33
TE CONNECTIVITY LTD	25,599	63.05	1,614,016.95
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,724	24.74	364,271.76
WESTERN DIGITAL CORP	13,915	106.37	1,480,138.55
AT&T INC	321,591	33.80	10,869,775.80
CENTURYLINK INC	35,690	38.40	1,370,496.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	60,783	6.83	415,147.89
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	17,992	47.80	860,017.60
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,025	109.51	878,857.87
SPRINT CORP	41,934	4.08	171,090.72
T-MOBILE US INC	14,563	29.14	424,365.82
VERIZON COMMUNICATIONS	257,042	47.99	12,335,445.58
WINDSTREAM HOLDINGS INC	33,150	8.44	279,786.00
AES CORP	40,950	13.37	547,501.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,080	69.60	492,768.00
AMEREN CORPORATION	15,288	46.54	711,503.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	30,481	63.57	1,937,677.17
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,588	55.71	589,857.48
CALPINE CORP	21,395	21.43	458,494.85
CENTERPOINT ENERGY INC	25,781	23.00	592,963.00
CMS ENERGY CORP	17,142	36.64	628,082.88
CONSOLIDATED EDISON INC	18,125	69.10	1,252,437.50
DOMINION RESOURCES	36,243	77.76	2,818,255.68
DTE ENERGY COMPANY	11,115	89.96	999,905.40
DUKE ENERGY CORP	43,937	87.35	3,837,896.95
EDISON INTL	19,141	68.00	1,301,588.00
ENERGY CORP	11,273	88.67	999,576.91
EXELON CORP	53,579	37.38	2,002,783.02
FIRSTENERGY CORP	26,125	40.92	1,069,035.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,800	80.59	386,832.00
MDU RESOURCES GROUP INC	10,361	23.70	245,555.70
NEXTERA ENERGY INC	27,137	108.22	2,936,766.14
NISOURCE INC	19,865	44.01	874,258.65

	NORTHEAST UTILITIES	19,653	55.55	1,091,724.15	
	NRG ENERGY INC	21,373	26.30	562,109.90	
	OGE ENERGY CORP	12,751	35.03	446,667.53	
	PEPCO HOLDINGS INC	14,374	27.30	392,410.20	
	PG&E CORP	28,767	58.16	1,673,088.72	
	PINNACLE WEST CAPITAL	7,037	71.42	502,582.54	
	PPL CORPORATION	41,510	35.33	1,466,548.30	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	31,246	43.55	1,360,763.30	
	SCANA CORP	8,592	62.62	538,031.04	
	SEMPRA ENERGY	14,592	112.95	1,648,166.40	
	SOUTHERN CO	55,713	51.35	2,860,862.55	
	WISCONSIN ENERGY CORP	13,286	55.86	742,155.96	
	XCEL ENERGY INC	31,317	37.02	1,159,355.34	
	ALTERA CORPORATION	18,185	34.84	633,565.40	
	ANALOG DEVICES	19,569	53.69	1,050,659.61	
	APPLIED MATERIALS	76,125	23.47	1,786,653.75	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,444	103.82	1,603,396.08	
	BROADCOM CORP-CL A	33,065	41.72	1,379,471.80	
	CREE INC	6,609	30.90	204,218.10	
	INTEL CORP	307,442	36.45	11,206,260.90	
	KLA-TENCOR CORP	9,743	67.83	660,916.40	
	LAM RESEARCH CORP	10,244	77.58	794,729.52	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,013	45.32	680,389.16	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	24,929	15.53	387,272.01	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	16,812	32.01	538,236.18	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,695	44.84	524,403.80	
	MICRON TECHNOLOGY	66,798	28.99	1,936,474.02	
	NVIDIA CORP	32,924	19.96	657,163.04	
	QORVO INC	9,299	65.81	611,967.19	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,058	73.85	890,483.30	
	TEXAS INSTRUMENTS	66,428	53.28	3,539,615.98	
	XILINX INC	16,914	41.21	697,110.51	
	アメリカドル 小計	19,287,783		1,142,794,909.03	(134,735,519,774)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	40.91	359,598.90	
	ARC RESOURCES LTD	18,796	22.38	420,654.48	
	BAYTEX ENERGY CORP	9,931	18.40	182,730.40	
	CAMECO CORP	23,878	17.30	413,089.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	68,899	34.41	2,370,814.59	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	7.96	230,680.80	
	CENOVUS ENERGY INC	45,395	23.80	1,080,401.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,020	30.04	781,640.80	

ENBRIDGE	53,188	56.02	2,979,591.76
ENCANA CORP	43,107	15.70	676,779.90
ENERPLUS CORP	10,454	10.74	112,275.96
HUSKY ENERGY INC	20,460	26.25	537,075.00
IMPERIAL OIL	19,205	46.29	888,999.45
INTER PIPELINE LTD	19,069	31.13	593,617.97
KEYERA CORP	4,917	78.00	383,526.00
MEG ENERGY CORP	8,375	20.07	168,086.25
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	19,513	4.16	81,174.08
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	4,574	27.21	124,458.54
PEMBINA PIPELINE CORP	21,237	38.08	808,704.96
PENN WEST PETROLEUM LTD	23,074	2.10	48,455.40
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	33.21	304,602.12
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	26.08	240,848.80
SUNCOR ENERGY	91,929	35.55	3,268,075.95
TALISMAN ENERGY INC	62,493	8.97	560,562.21
TOURMALINE OIL CORP	10,102	38.24	386,300.48
TRANSCANADA CORP	44,611	53.18	2,372,412.98
VERMILION ENERGY INC	5,975	52.55	313,986.25
AGNICO EAGLE MINES	12,166	38.94	473,744.04
AGRIUM INC	8,660	118.85	1,029,241.00
BARRICK GOLD CORP	69,970	14.21	994,273.70
ELDORADO GOLD CORP	45,613	9.06	413,253.78
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	39,609	13.40	530,760.60
FRANCO-NEVADA CORP	9,259	65.94	610,538.46
GOLDCORP INC	48,877	28.67	1,401,303.59
KINROSS GOLD CORP	81,986	4.31	353,359.66
METHANEX CORP	6,468	55.45	358,650.60
NEW GOLD INC	29,614	5.48	162,284.72
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	52,494	41.72	2,190,049.68
SILVER WHEATON CORP	21,380	28.25	603,985.00
TECK RESOURCES LTD-CL B	32,900	14.41	474,089.00
YAMANA GOLD INC	47,555	5.32	252,992.60
BOMBARDIER B	96,927	2.71	262,672.17
CAE INC	18,429	14.73	271,459.17
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	21.52	253,161.28
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,158	41.97	384,361.26
CANADIAN NATL RAILWAY CO	51,279	80.44	4,124,882.76
CP RAILWAY LIMITED	10,877	215.81	2,347,365.37
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,470	113.11	1,523,591.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,067	66.84	472,358.28
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,714	46.35	589,293.90

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	25,738	29.53	760,043.14
THOMSON REUTERS CORP	23,276	47.65	1,109,101.40
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,548	120.80	549,398.40
DOLLARAMA INC	7,218	59.37	428,532.66
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	25,030	45.00	1,126,350.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,833	87.34	334,774.22
LOBLAW COMPANIES LTD	14,753	59.92	883,999.76
METRO INC	5,250	92.78	487,095.00
WESTON (GEORGE) LTD	3,518	96.26	338,642.68
SAPUTO INC	15,250	34.46	525,515.00
CATAMARAN CORPORATION	12,279	61.35	753,316.65
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	19,973	187.77	3,750,330.21
BANK MONTREAL	40,543	75.48	3,060,185.64
BANK NOVA SCOTIA	76,072	61.65	4,689,838.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	25,025	90.93	2,275,523.25
NATIONAL BANK OF CANADA	19,651	45.12	886,653.12
ROYAL BANK OF CANADA	89,873	75.80	6,812,373.40
TORONTO-DOMINION BANK	114,914	50.54	5,807,753.56
CI FINANCIAL CORP	15,063	31.92	480,810.96
IGM FINANCIAL INC	5,864	43.79	256,784.56
ONEX CORP	5,970	68.11	406,616.70
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,225	607.70	744,432.50
GREAT-WEST LIFECO INC	17,649	31.51	556,119.99
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	40.48	280,162.08
INTACT FINANCIAL CORP	7,805	83.07	648,361.35
MANULIFE FINANCIAL CORP	117,006	20.30	2,375,221.80
POWER CORP OF CANADA	21,844	29.64	647,456.16
POWER FINANCIAL CORP	14,959	33.59	502,472.81
SUN LIFE FINANCIAL INC	38,891	37.90	1,473,968.90
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	35,052	60.95	2,136,419.40
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	19.36	107,138.24
CGI GROUP INC - CL A	14,453	46.70	674,955.10
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,236	345.00	426,420.00
OPEN TEXT CORP	7,246	71.31	516,712.26
BCE INC	16,476	57.05	939,955.80
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	23,300	46.92	1,093,236.00
TELUS CORP	16,454	42.77	703,737.58
ATCO LTD -CLASS I	4,000	49.28	197,120.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	43.79	318,221.93
FORTIS INC	17,872	40.15	717,560.80
TRANSALTA CORP	15,621	11.16	174,330.36
	2,394,067		91,724,458.92

	カナダドル 小計			(9,047,700,627)
ユーロ	ENI	159,693	14.35	2,291,594.55
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	8.78	226,751.76
	NESTE OIL OYJ	9,335	22.23	207,517.05
	OMV AG	8,150	22.18	180,767.00
	REPSOL SA	67,695	15.26	1,033,364.17
	SAIPEM	15,941	7.48	119,238.68
	TECHNIP S.A.	6,028	47.73	287,716.44
	TENARIS SA	29,111	12.12	352,825.32
	TOTAL SA	132,865	43.05	5,720,502.57
	VOPAK	4,507	51.56	232,380.92
	AIR LIQUIDE	21,474	104.90	2,252,622.60
	AKZO NOBEL	15,099	61.19	923,907.81
	ARCELORMITTAL	63,516	8.31	527,944.99
	ARKEMA	4,293	58.54	251,312.22
	BASF SE	57,019	73.36	4,182,913.84
	CRH	47,927	20.30	972,918.10
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	34.16	144,428.48
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,433	60.60	511,039.80
	IMERYS SA	1,975	59.65	117,808.75
	K+S AG	9,866	24.82	244,874.12
	KONINKLIJKE DSM NV	10,824	43.39	469,707.48
	LAFARGE (FRANCE)	11,807	59.43	701,690.01
	LANXESS	4,818	35.19	169,569.51
	LINDE AG	11,575	160.90	1,862,417.50
	SOLVAY SA	3,601	113.00	406,913.00
	STORA ENSO OYJ R	31,297	7.79	243,803.63
	SYMRISE AG	8,131	54.27	441,269.37
	THYSSEN KRUPP	26,897	20.74	557,978.26
	UMICORE	7,367	33.15	244,252.88
	UPM KYMMENE CORP	32,348	14.61	472,604.28
	VOESTALPINE AG	7,829	29.78	233,186.76
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	11,476	31.23	358,395.48
	AIRBUS GROUP NV	36,742	46.65	1,714,014.30
	ALSTOM RGPT	13,896	26.58	369,425.16
	ANDRITZ AG	5,242	46.73	244,984.87
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	41.91	245,328.49
	BOUYGUES ORD	9,786	30.85	301,947.03
	BRENTAG AG	9,887	46.13	456,087.31
	CNH INDUSTRIAL NV	59,434	6.45	383,646.47
	FERROVIAL SA	26,070	17.81	464,306.70
	FINMECCANICA SPA	28,941	8.50	246,143.20

GEA GROUP AG	11,636	36.64	426,343.04
KONE OYJ-B	18,524	39.88	738,737.12
KONINKLIJKE PHILIPS	59,387	24.68	1,465,671.16
LEGRAND SA	16,738	42.82	716,804.85
MAN SE	2,329	94.12	219,205.48
METSO OYJ	6,575	25.52	167,794.00
OCI NV	5,400	28.89	156,006.00
OSRAM LICHT AG	4,722	37.35	176,390.31
PRYSMIAN SPA	14,715	15.13	222,637.95
REXEL SA	18,266	15.31	279,652.46
SAFRAN SA	16,142	56.17	906,696.14
SAINT-GOBAIN	27,612	33.97	938,117.70
SCHNEIDER ELECTRIC SE	32,758	63.58	2,082,753.64
SIEMENS	49,205	96.93	4,769,440.65
THALES SA	6,178	48.05	296,852.90
VALLOUREC	5,583	20.15	112,497.45
VINCI S.A.	29,893	48.47	1,448,913.71
WARTSILA OYJ	9,741	37.30	363,339.30
ZARDOYA OTIS SA	10,201	9.60	97,929.60
ZODIAC AEROSPACE	10,962	28.84	316,198.89
BUREAU VERITAS SA	14,517	18.26	265,153.00
EDENRED	11,350	24.04	272,910.75
RANDSTAD HOLDING NV	7,953	42.33	336,650.49
SOCIETE BIC SA	1,899	115.40	219,144.60
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	25,753	17.41	448,359.73
ADP	1,728	105.90	182,995.20
ATLANTIA SPA	25,489	21.40	545,464.60
BOLLORE	31,100	3.67	114,230.30
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,159	14.31	173,995.29
DEUTSCHE POST AG-REG	60,359	27.97	1,688,543.02
FRAPORT AG	2,319	52.08	120,773.52
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	25,823	11.49	296,706.27
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	67,869	6.45	438,026.52
TNT EXPRESS	22,191	5.61	124,491.51
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,629	94.22	1,943,664.38
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	70.02	250,741.62
CONTINENTAL AG	6,881	190.50	1,310,830.50
DAIMLER AG	59,765	74.73	4,466,238.45
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	54,746	10.57	578,665.22
MICHELIN	11,096	79.12	877,915.52
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	21.04	129,985.12
PEUGEOT SA	25,648	11.37	291,746.00

PIRELLI & CO	16,123	11.89	191,702.47
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,612	69.91	671,974.92
RENAULT SA	11,420	63.90	729,738.00
VALEO SA	4,436	115.05	510,361.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,127	192.65	1,950,966.55
VOLKSWAGEN STAMM	1,890	187.35	354,091.50
ADIDAS AG	12,378	58.81	727,950.18
CHRISTIAN DIOR	3,139	146.10	458,607.90
HERMES INTERNATIONAL	1,648	287.05	473,058.40
HUGO BOSS AG	2,901	106.25	308,231.25
KERING	4,505	167.05	752,560.25
LUXOTTICA GROUP SPA	10,468	49.88	522,143.84
LVMH	17,401	134.20	2,335,214.20
ACCOR	11,075	39.39	436,299.62
SODEXO	5,517	84.86	468,172.62
ALTICE SA	5,811	65.75	382,073.25
AXEL SPRINGER SE	2,489	52.17	129,851.13
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,179	29.41	270,000.28
JC DECAUX SA	4,674	29.67	138,677.58
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	114.35	151,285.05
LAGADERE S.C.A	9,057	23.51	212,975.35
NUMERICABLE-SFR	5,900	44.00	259,600.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	13,151	38.60	507,628.60
PUBLICIS GROUPE	11,865	62.68	743,698.20
REED ELSEVIER NV	43,591	20.45	891,435.95
RTL GROUP	2,054	81.28	166,967.60
SES	19,261	31.22	601,328.42
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	47.19	151,967.90
WOLTERS KLUWER	17,586	26.76	470,601.36
INDITEX	69,575	24.75	1,721,981.25
CARREFOUR	37,233	27.14	1,010,503.62
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	75.22	277,336.14
COLRUYT SA	4,415	40.90	180,595.57
DELHAIZE GROUP	6,304	67.94	428,293.76
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.59	258,336.26
JERONIMO MARTINS	15,262	9.43	143,996.97
KONINKLIJKE AHOLD NV	55,697	15.86	883,354.42
METRO STAMM	10,502	27.39	287,649.78
ANHEUSER-BUSCH INBEV	50,043	101.10	5,059,347.30
DANONE (GROUPE)	36,140	55.72	2,013,720.80
HEINEKEN HOLDING NV	6,365	56.45	359,304.25
HEINEKEN NV	14,353	63.84	916,295.52

KERRY GROUP PLC-A	10,508	61.71	648,448.68
PERNOD-RICARD	13,307	102.75	1,367,294.25
REMY COINTREAU	1,575	61.61	97,035.75
UNILEVER NV-CVA	100,911	34.75	3,506,657.25
BEIERSDORF AG	6,416	75.29	483,060.64
HENKEL AG & CO KGAA	6,911	85.91	593,724.01
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,170	96.55	1,078,463.50
LOREAL	15,665	146.75	2,298,838.75
CELESIO AG	2,526	26.37	66,623.25
ESSILOR INTERNATIONAL	12,815	97.68	1,251,769.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,460	66.11	889,840.60
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,725	48.10	1,141,291.12
BAYER	51,296	124.00	6,360,704.00
GRIFOLS SA	9,815	34.83	341,856.45
MERCK KGAA	7,656	87.86	672,656.16
ORION OYJ-CLASS B	5,839	28.63	167,170.57
QIAGEN N.V.	13,359	20.55	274,594.24
SANOFI	73,816	79.72	5,884,611.52
UCB (GROUPE)	7,379	69.72	514,463.88
BANCO BILBAO VIZCAYA	384,847	7.65	2,944,849.24
BANCO DE SABADELL SA	217,781	2.30	502,638.54
BANCO SANTANDER SA	887,348	6.05	5,373,779.48
BANKINTER SA	40,000	6.68	267,320.00
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.07	173,486.20
BNP PARIBAS	67,093	46.61	3,127,540.19
CAIXABANK	136,475	4.22	576,743.35
COMMERZBANK AG	58,185	10.76	626,361.52
CREDIT AGRICOLE SA	64,020	10.72	686,294.40
ERSTE GROUP BANK AG	17,314	19.24	333,207.93
ING GROEP NV-CVA	243,470	11.09	2,701,299.65
INTESA SANPAOLO	746,630	2.53	1,888,973.90
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.20	143,260.00
KBC GROEP NV	16,257	46.96	763,428.72
NATIXIS	55,840	5.63	314,658.40
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,746	10.11	58,092.06
SOCIETE GENERALE	46,138	34.86	1,608,601.37
UNICREDIT SPA	283,078	5.35	1,514,467.30
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,565	6.12	333,937.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	87,439	25.05	2,190,346.95
DEUTSCHE BOERSE	11,601	64.31	746,060.31
EURAZEO	2,073	58.49	121,249.77
EXOR SPA	5,807	34.48	200,225.36

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,049	71.43	360,650.07
MEDIOBANCA	41,923	7.13	299,120.60
WENDEL	1,898	92.52	175,602.96
AEGON	116,051	6.22	722,417.47
AGEAS	13,863	29.74	412,354.93
ALLIANZ SE-REG	28,861	142.15	4,102,591.15
ASSICURAZIONI GENERALI	75,378	17.49	1,318,361.22
AXA	115,280	20.03	2,309,634.80
CNP ASSURANCES	11,830	15.07	178,337.25
DELTA LLOYD NV	11,075	18.05	199,959.12
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,957	77.44	306,430.08
MAPFRE SA	65,064	2.90	189,010.92
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,976	172.30	1,891,164.80
NN GROUP NV	9,318	24.12	224,750.16
SAMPO OYJ-A SHS	28,970	40.68	1,178,499.60
SCOR SE	10,368	25.92	268,790.40
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	71,163	2.25	160,116.75
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	37.64	85,216.96
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	16,308	29.57	482,227.56
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	18,648	21.39	398,973.96
IMMOFINANZ AG	55,175	2.07	114,212.25
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	26,199	33.45	876,356.55
ATOS	5,213	65.36	340,721.68
CAP GEMINI SA	8,393	61.25	514,071.25
DASSAULT SYSTEMES SA	7,319	51.56	377,367.64
GEMALTO	4,790	65.08	311,733.20
SAP SE	57,237	57.51	3,291,699.87
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,947	38.12	302,979.37
ALCATEL-LUCENT	166,458	2.81	469,078.64
NOKIA CORP	236,631	6.62	1,566,497.22
BELGACOM	10,096	31.29	315,903.84
DEUTSCHE TELEKOM	197,481	14.19	2,803,242.79
ELISA A	10,064	23.92	240,730.88
ILIAD SA	1,701	199.40	339,179.40
KPN (KON.)	190,345	2.64	503,272.18
ORANGE	115,843	14.69	1,701,733.67
TELECOM ITALIA ORD	615,605	0.93	572,512.65
TELECOM ITALIA RNC	412,771	0.73	304,212.22
TELEFONICA	265,259	12.22	3,242,791.27
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	4.69	176,320.66
VIVENDI	75,879	20.57	1,560,831.03
E.ON SE	124,766	13.20	1,646,911.20

	ELECTRICITE DE FRANCE	14,123	21.69	306,327.87
	ENAGAS	12,914	26.57	343,124.98
	ENEL	415,811	3.70	1,539,332.32
	ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.67	206,157.09
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	140,452	3.43	482,873.97
	FORTUM OYJ	26,516	18.22	483,121.52
	GAS NATURAL SDG SA	21,787	19.61	427,352.00
	GDF SUEZ	90,420	18.63	1,684,524.60
	IBERDROLA SA	328,140	5.67	1,860,553.80
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,766	73.36	496,353.76
	RWE STAMM	28,959	23.52	681,115.68
	SNAM SPA	124,066	4.13	512,640.71
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	15.63	324,635.10
	TERNA SPA	94,904	3.74	355,700.19
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,206	15.79	398,002.74
	ASML HOLDING NV	22,166	89.38	1,981,197.08
	INFINEON TECHNOLOGIES	71,173	9.27	659,844.88
	STMICROELECTRONICS	42,509	6.68	284,045.13
	ユーロ 小計	13,765,780		196,558,594.53 (26,859,731,942)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	8.14	213,317.55
	BG GROUP	211,128	8.55	1,805,355.52
	BP PLC	1,143,188	4.08	4,674,495.73
	PETROFAC LTD	16,711	6.26	104,610.86
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	245,927	21.21	5,216,111.67
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	151,042	21.67	3,273,080.14
	TULLOW OIL PLC	53,566	3.69	197,926.37
	ANGLO AMERICAN PLC	86,556	10.89	943,027.62
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	6.93	176,273.83
	BHP BILLITTON PLC	130,731	13.68	1,788,400.08
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	27.33	236,814.45
	FRESNILLO PLC	17,743	8.76	155,428.68
	GLENCORE PLC	657,088	2.47	1,627,606.97
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,014	35.12	421,931.68
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,202	54.25	282,208.50
	REXAM PLC	44,988	4.44	199,926.67
	RIO TINTO PLC REG	78,744	28.56	2,248,928.64
	ASHTREAD GROUP PLC	32,745	10.41	340,875.45
	BAE SYSTEMS PLC	195,621	4.88	955,999.82
	BUNZL PLC	19,453	18.70	363,771.10
	COBHAM PLC	72,398	3.25	235,365.89
	IMI PLC	14,701	12.45	183,027.45

MEGGITT PLC	50,990	5.12	261,323.75
MELROSE INDUSTRIES PLC	56,502	2.68	151,820.87
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	116,863	8.69	1,016,123.78
SMITHS GROUP PLC	24,869	10.82	269,082.58
TRAVIS PERKINS PLC	15,233	18.52	282,115.16
WEIR GROUP PLC/THE	13,390	16.96	227,094.40
WOLSELEY LTD	16,165	37.06	599,074.90
AGGREKO PLC	15,329	15.50	237,599.50
BABCOCK INTL GROUP PLC	14,362	10.33	148,359.46
CAPITA GROUP PLC	38,321	10.92	418,465.32
EXPERIAN PLC	61,478	11.55	710,070.90
G4S PLC	90,850	2.83	257,468.90
INTERTEK GROUP PLC	10,210	23.92	244,223.20
EASYJET PLC	11,633	16.12	187,523.96
ROYAL MAIL PLC	36,948	4.30	158,950.29
NEW GKN	102,805	3.65	375,752.27
BURBERRY GROUP PLC	25,903	16.70	432,580.10
PERSIMMON PLC	17,995	14.87	267,585.65
CARNIVAL PLC	10,842	30.20	327,428.40
COMPASS GROUP PLC	103,896	11.08	1,151,167.68
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,805	26.25	388,631.25
MERLIN ENTERTAINME	38,744	4.00	155,208.46
TUI AG-DI	19,000	11.25	213,750.00
TUI AG-NEW	13,064	10.94	142,920.16
WHITBREAD PLC	11,272	48.06	541,732.32
WILLIAM HILL	55,917	3.76	210,583.42
ITV PLC	237,933	2.24	534,873.38
PEARSON	50,717	12.28	622,804.76
REED ELSEVIER PLC	70,842	11.14	789,179.88
SKY PLC	63,893	9.28	592,927.04
WPP PLC	81,605	14.00	1,142,470.00
DIXONS CARPHONE PLC	58,046	4.46	259,175.39
KINGFISHER PLC	147,280	3.27	482,783.84
MARKS & SPENCER GROUP PLC	95,169	4.63	440,917.97
NEXT PLC	9,520	69.00	656,880.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	14,452	7.33	106,005.42
MORRISON SUPERMARKETS	118,741	1.91	227,389.01
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.57	223,672.22
TESCO	503,158	2.21	1,113,991.81
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,988	31.13	684,486.44
BRITISH AMERICAN TOBACCO	115,679	35.98	4,162,130.42
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	11.22	126,359.64

DIAGEO	155,477	19.00	2,954,840.38
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	59,234	29.45	1,744,441.30
SABMILLER PLC	59,852	33.84	2,025,391.68
TATE & LYLE	29,189	6.45	188,269.05
UNILEVER PLC	79,424	27.29	2,167,480.96
RECKITT BENCKISER PLC	40,217	53.70	2,159,652.90
SMITH & NEPHEW PLC	55,347	11.92	659,736.24
ASTRAZENECA	78,474	47.25	3,707,896.50
GLAXOSMITHKLINE	301,047	14.39	4,332,066.33
SHIRE PLC	36,486	47.60	1,736,733.60
BARCLAYS	1,034,984	2.30	2,380,463.20
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,207,935	5.96	7,202,916.40
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,598,779	0.74	2,686,488.52
ROYAL BANK OF SCOTLAND	158,655	3.69	585,436.95
STANDARD CHARTERED PLC	155,730	9.11	1,419,478.95
3I GROUP PLC	62,380	4.39	273,848.20
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,338	4.10	239,244.13
HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,209	9.50	135,056.54
ICAP PLC	32,393	4.48	145,185.42
INVESTEC PLC	30,876	5.39	166,576.02
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	12,910	22.84	294,864.40
SCHRODERS PLC	7,932	26.55	210,594.60
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	14.52	167,401.08
AVIVA PIC	186,131	5.11	951,129.41
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	90,720	3.09	281,050.56
FRIENDS LIFE GROUP LTD	85,120	3.86	328,563.20
LEGAL & GENERAL GROUP	370,684	2.53	940,795.99
OLD MUTUAL PLC	309,515	1.93	599,221.04
PRUDENTIAL	161,747	15.10	2,443,188.43
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	61,005	4.48	273,363.40
STANDARD LIFE PLC	151,002	3.97	599,477.94
SAGE GROUP PLC	69,473	4.69	325,828.37
BT GROUP PLC	504,660	4.11	2,078,189.88
INMARSAT PLC	23,362	8.25	192,736.50
VODAFONE GROUP PLC	1,644,000	2.29	3,772,158.00
CENTRICA PLC	311,265	2.64	824,229.72
NATIONAL GRID PLC	233,663	9.21	2,152,970.88
SEVERN TRENT PLC	14,037	21.27	298,566.99
SSE PLC	59,649	14.89	888,173.61
UNITED UTILITIES GROUP PLC	39,961	9.62	384,424.82
ARM HOLDINGS PLC	87,042	10.17	885,217.14
	17,608,786		102,990,517.80

イギリスポンド 小計				(18,320,983,211)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	13.60	310,025.60
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	352.75	168,261.75
	GIVAUDAN-REG	582	1,636.00	952,152.00
	HOLCIM LTD	14,452	61.90	894,578.80
	SIKA AG-BR	122	2,845.00	347,090.00
	SYNGENTA AG	5,813	294.90	1,714,253.70
	ABB LTD	137,061	17.19	2,356,078.59
	GEBERIT AG-REG	2,352	308.50	725,592.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,042	130.50	135,981.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,485	131.10	325,783.50
	SULZER AG-REG	1,193	93.50	111,545.50
	ADECCO	10,705	61.05	653,540.25
	SGS SA	326	1,754.00	571,804.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,294	118.90	391,656.60
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	32,527	73.20	2,380,976.40
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,917	363.30	696,446.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,872	69.10	198,455.20
	ARYZTA AG	4,970	68.25	339,202.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	953.50	125,862.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	62	4,898.00	303,676.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	56,600.00	339,600.00
	NESTLE SA - REGISTERED	200,071	67.10	13,424,764.10
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,056	125.10	382,305.60
	ACTELION LTD-REG	6,094	102.10	622,197.40
	LONZA GROUP AG-REG	3,394	95.30	323,448.20
	NOVARTIS	142,716	88.05	12,566,143.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	43,593	253.40	11,046,466.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	97,054	18.98	1,842,084.92
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,356	36.55	524,711.80
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	64.70	122,671.20
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,159	234.40	271,669.60
	UBS GROUP AG	228,171	14.38	3,281,098.98
BALOISE HOLDING AG	3,124	116.60	364,258.40	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,866	213.60	398,577.60	
SWISS RE LTD	22,432	78.65	1,764,276.80	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,482	290.40	2,753,572.80	
SWISS PRIME SITE-REG	3,845	74.00	284,530.00	
SWISSCOM	1,362	514.00	700,068.00	
	スイスフラン 小計	1,028,857		64,715,406.89 (8,668,628,752)
	LUNDIN PETROLEUM AB	11,307	109.20	1,234,724.40

スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	18,196	118.50	2,156,226.00	
	ALFA LAVAL AB	19,284	138.80	2,676,619.20	
	ASSA ABLOY B	19,791	433.80	8,585,335.80	
	ATLAS COPCO A	42,287	221.80	9,379,256.60	
	ATLAS COPCO B	23,370	202.90	4,741,773.00	
	SANDVIK AB	61,350	73.25	4,493,887.50	
	SKANSKA B	22,992	178.20	4,097,174.40	
	SKF AB-B	23,955	176.30	4,223,266.50	
	VOLVO B	90,875	90.90	8,260,537.50	
	SECURITAS B	22,844	94.65	2,162,184.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	219.80	2,995,214.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	55.75	1,547,508.50	
	HENNES & MAURITZ B	59,230	333.10	19,729,513.00	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	323.50	1,853,655.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	256.00	3,176,960.00	
	SCA SV CELLULOSA B	34,934	175.60	6,134,410.40	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	84.80	1,789,534.40	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	173.10	1,872,595.80	
	NORDEA BANK AB	193,200	91.50	17,677,800.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	97,417	96.65	9,415,353.05	
	SVENSKA HANDELSBK A	31,899	365.50	11,659,084.50	
	SWEDBANK AB-A	57,927	186.20	10,786,007.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	134.60	1,721,803.20	
	INVESTOR AB-B SHS	29,272	277.50	8,122,980.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,668	236.60	3,470,448.80		
ERICSSON (LM) B	189,918	98.25	18,659,443.50		
HEXAGON AB-B SHS	15,486	247.00	3,825,042.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	524.00	2,268,396.00		
TELE2 AB-B SHS	21,310	96.60	2,058,546.00		
TELIASONERA AB	140,975	52.45	7,394,138.75		
	スウェーデンクローナ 小計	1,351,054		188,169,420.40	(2,724,693,207)
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	23,438	79.15	1,855,117.70	
	STATOIL ASA	66,505	133.50	8,878,417.50	
	SUBSEA 7 SA	18,360	68.80	1,263,168.00	
	NORSK HYDRO	83,896	41.47	3,479,167.12	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,268	395.80	4,459,874.40	
	ORKLA	48,294	54.15	2,615,120.10	
	DNB ASA	59,161	106.60	6,306,562.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,106	127.70	1,290,536.20	
	TELENOR ASA	44,573	167.50	7,465,977.50	
		365,601		37,613,941.12	

ノルウェークローネ 小計				(580,383,111)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	15,049	274.30	4,127,940.70
	VESTAS WIND SYSEMS	14,394	235.00	3,382,590.00
	ISS A/S	7,193	185.70	1,335,740.10
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	218	12,310.00	2,683,580.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	445	12,710.00	5,655,950.00
	DSV A/S	11,156	197.60	2,204,425.60
	PANDORA A/S	7,298	459.00	3,349,782.00
	CARLSBERG AS-B	6,289	481.90	3,030,669.10
	COLOPLAST-B	6,961	541.50	3,769,381.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	485.30	720,185.20
	NOVO NORDISK A/S-B	124,307	292.20	36,322,505.40
	DANSKE BANK A/S	41,593	164.50	6,842,048.50
	TRYG A/S	1,289	719.00	926,791.00
	TDC A/S	52,498	48.93	2,568,727.14
デンマーククローネ 小計		290,174		76,920,316.24 (1,414,564,615)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	33.98	288,456.22
	ORIGIN ENERGY LIMITED	69,132	10.60	732,799.20
	SANTOS	58,141	7.54	438,383.14
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	47,196	34.17	1,612,687.32
	WORLEYPARSONS LTD	10,573	9.13	96,531.49
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.80	306,824.40
	AMCOR	71,571	12.73	911,098.83
	BHP BILLITON LTD	200,676	27.71	5,560,731.96
	BORAL LIMITED	46,867	5.22	244,645.74
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	2.28	206,289.84
	ILUKA RESOURCES LTD	21,335	6.41	136,757.35
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.26	359,212.88
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	11.96	352,198.08
	NEWCREST MINING LIMITED	46,855	12.97	607,709.35
	ORICA LTD	22,850	17.53	400,560.50
	RIO TINTO LTD	27,765	54.16	1,503,752.40
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,336	20.69	110,401.84
	ALS LTD	21,808	5.22	113,837.76
	BRAMBLES LTD	92,276	10.20	941,215.20
	SEEK LTD	21,328	16.83	358,950.24
	ASCIANO GROUP	64,054	5.81	372,153.74
	AURIZON HOLDINGS LTD	136,201	4.55	619,714.55
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	36,374	2.25	81,841.50
TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.90	246,071.30	
TRANSURBAN GROUP	113,279	8.91	1,009,315.89	

	CROWN RESORTS LTD	21,269	12.04	256,078.76	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	33.45	109,147.35	
	TABCORP HOLDINGS	45,765	4.22	193,128.30	
	TATTS GROUP LTD	77,050	3.54	272,757.00	
	REA GROUP LTD	2,513	45.75	114,969.75	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.64	112,155.68	
	METCASH LTD	55,380	1.52	84,454.50	
	WESFARMERS LTD	70,702	42.48	3,003,420.96	
	WOOLWORTHS LTD	79,590	30.27	2,409,189.30	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	9.17	348,496.68	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	4.71	181,579.92	
	COCHLEAR LIMITED	3,856	79.06	304,855.36	
	HEALTHSCOPE LTD	88,599	2.64	233,901.36	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,646	57.24	437,657.04	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,648	17.90	387,499.20	
	CSL LIMITED	29,934	83.47	2,498,590.98	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	172,287	31.28	5,389,137.36	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	11.74	286,185.98	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	12.55	391,622.75	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	101,046	83.10	8,396,922.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	147,978	33.32	4,930,626.96	
	WESTPAC BANKING	194,107	32.63	6,333,711.41	
	ASX LTD	12,620	36.64	462,396.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	17,104	58.25	996,308.00	
	AMP LTD	174,361	5.31	925,856.91	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	138,196	6.26	865,106.96	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	160,000	2.36	377,600.00	
	QBE INSURANCE GROUP	79,242	10.54	835,210.68	
	SUNCORP GROUP LIMITED	76,208	13.85	1,055,480.80	
	COMPUTERSHARE LIMITED	25,705	11.73	301,519.65	
	TELSTRA CORP	277,305	6.17	1,710,971.85	
	TPG TELECOM LTD	20,000	6.35	127,000.00	
	AGL ENERGY LTD	39,790	13.59	540,746.10	
	AUSNET SERVICES	87,439	1.38	120,665.82	
	オーストラリアドル 小計	3,957,938		62,607,093.49 (6,045,340,947)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	8.04	374,262.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,782	4.38	209,285.16	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	8.33	183,393.28	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	108,032	3.32	358,666.24	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	6.67	170,105.01	
	MERIDIAN ENER-PARTLY PAID SH	110,544	1.90	210,033.60	

	MIGHTY RIVER POWER	61,741	3.28	202,510.48	
	ニュージーランドドル 小計	422,168		1,708,255.77 (156,185,825)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	134,000	97.50	13,065,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	78,000	14.70	1,146,600.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	16.92	1,455,120.00	
	MTR CORP	84,000	33.25	2,793,000.00	
	LI & FUNG	378,800	7.25	2,746,300.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	24.15	2,258,025.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	28.70	1,334,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	139,000	37.05	5,149,950.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	17.50	1,176,000.00	
	SANDS CHINA LTD	143,200	35.55	5,090,760.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	10.10	989,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	10.72	1,415,040.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	20.25	2,081,700.00	
	WH GROUP LTD	289,500	4.16	1,204,320.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	30.80	2,610,608.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	221,500	26.10	5,781,150.00	
	HANG SENG BANK	45,700	130.70	5,972,990.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	7.94	1,016,320.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	69,900	174.70	12,211,530.00	
	AIA GROUP LTD	751,400	44.85	33,700,290.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	87,000	140.30	12,206,100.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	139,000	21.20	2,946,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	61,600	52.45	3,230,920.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	36.00	1,440,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	27.30	1,051,050.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	323,500	8.89	2,875,915.00	
	SINO LAND CO	175,400	12.34	2,164,436.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	119.60	12,318,800.00	
	SWIRE PACIFIC A	36,500	103.30	3,770,450.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	24.40	1,688,480.00	
	WHARF HOLDINGS	96,000	59.25	5,688,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	53,000	40.25	2,133,250.00	
	PCCW LTD	232,000	5.25	1,218,000.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	60.75	2,490,750.00	
	CLP HOLDINGS	120,500	68.50	8,254,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	373,163	17.90	6,679,617.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	82,500	78.95	6,513,375.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	71.85	991,530.00	
		5,259,423		180,860,776.70	

香港ドル 小計				(2,750,892,413)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	94,300	8.18	771,374.00
	NOBLE GROUP LTD	227,363	1.00	227,363.00
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	4.15	236,550.00
	SEMBCORP MARINE LTD	41,000	2.96	121,360.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.36	366,240.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.25	166,250.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	2.63	381,350.00
	SINGAPORE AIRLINES	31,533	11.90	375,242.70
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.00	427,125.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.06	377,580.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	38.63	231,780.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.44	186,455.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.17	351,870.00
	DBS GROUP	107,000	19.70	2,107,900.00
	OCBC BANK	183,000	10.19	1,864,770.00
	UNITED OVERSEAS BANK	80,000	22.98	1,838,400.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	7.67	421,850.00
	CAPITALAND LTD	165,500	3.30	546,150.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.06	241,440.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	199,000	2.44	485,560.00
KEPPEL LAND LTD	40,000	3.61	144,400.00	
UOL GROUP LIMITED	22,300	6.78	151,194.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	504,243	3.91	1,971,590.13	
STARHUB LTD	38,000	4.13	156,940.00	
シンガポールドル 小計		3,310,239		14,150,733.83 (1,249,368,289)
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	201	945.60	190,065.60
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	28.30	926,994.80
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,372.00	220,892.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	53,615	227.00	12,170,605.00
	BANK HAPOLIM BM	58,582	18.14	1,062,677.48
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,820	13.50	956,070.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	43.01	352,682.00
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	193.70	650,444.60
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.50	725,614.50
イスラエルシェケル 小計		339,326		17,256,045.98 (519,406,983)
合 計		69,381,196		213,073,399,696 (213,073,399,696)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	230,300.00	
	アメリカドル 小計		329,000	230,300.00 (27,152,370)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	74,495	575,101.40	
		LEND LEASE GROUP	33,337	527,391.34	
		SYDNEY AIRPORT	58,361	288,886.95	
	オーストラリアドル 小計		166,193	1,391,379.69 (134,351,622)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,838,210.00	
	香港ドル 小計		187,000	1,838,210.00 (27,959,174)	
投資信託受益証券合計			682,193	189,463,166 (189,463,166)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20,934	456,361.20	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	52,036	480,292.28	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	24,661	2,402,474.62	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	55,712	591,104.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,054	1,442,310.32	
		BOSTON PROPERTIES	9,476	1,336,968.84	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,160	409,239.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,846	1,722,504.98	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,590	619,339.00	
		DUKE REALTY CORP	21,780	479,377.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,465	1,704,106.35	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,990	910,398.30	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,287	618,356.88	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	33,145	1,008,602.35	
		HCP INC	28,728	1,384,976.88	
		HEALTH CARE REIT INC	20,230	1,705,591.30	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	47,483	1,126,296.76	
		IRON MOUNTAIN INC	9,534	384,506.22	
		KIMCO REALTY CORP	24,134	668,753.14	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318	338,126.70	
		MACERICH CO/THE	8,313	737,529.36	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,538	470,943.22	
		PROLOGIS INC	30,877	1,363,219.55	
		PUBLIC STORAGE	9,157	1,852,003.25	
		RAYONIER INC	7,016	201,359.20	
		REALTY INCOME CORP	14,096	743,986.88	
REGENCY CENTERS CORP	5,269	364,878.25			

	SIMON PROPERTY GROUP	19,304	3,876,243.20	
	SL GREEN REALTY CORP	6,027	771,456.00	
	UDR INC	16,019	530,549.28	
	URBAN EDGE PROPERTIES	5,228	125,367.44	
	VENTAS INC	18,180	1,418,040.00	
	VORNADO REALTY TRUST	10,456	1,194,807.12	
	アメリカドル 小計	589,043	33,440,070.59 (3,942,584,322)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535	175,490.15	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	299,289.65	
	カナダドル 小計	18,018	474,779.80 (46,832,279)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,649	132,068.41	
	GECINA SA	1,953	214,048.80	
	ICADE	2,102	150,187.90	
	KLEPIERRE	6,825	267,267.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,249	1,489,761.60	
	ユーロ 小計	18,778	2,253,333.71 (307,918,051)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	60,977	488,730.65	
	HAMMERSON PLC	46,342	302,613.26	
	INTU PROPERTIES PLC	56,999	196,532.55	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	49,929	618,620.31	
	SEGRO PLC	48,938	197,562.70	
	イギリスポンド 小計	263,185	1,804,059.47 (320,924,139)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	59,205	427,460.10	
	FEDERATION CENTRES	97,628	283,121.20	
	GOODMAN GROUP	104,235	605,605.35	
	GPT GROUP	109,865	477,912.75	
	MIRVAC GROUP	214,622	391,685.15	
	NOVION PROPERTY GROUP	126,802	276,428.36	
	SCENTRE GROUP	315,273	1,166,510.10	
	STOCKLAND	133,303	554,540.48	
	WESTFIELD CORP	126,950	1,161,592.50	
	オーストラリアドル 小計	1,287,883	5,344,855.99 (516,099,294)	
香港ドル	LINK REIT	137,500	7,177,500.00	
	香港ドル 小計	137,500	7,177,500.00 (109,169,775)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000	277,500.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000	200,200.00	

	CAPITAMALL TRUST	141,000	304,560.00	
	SUNTEC REIT	173,000	345,135.00	
	シンガポールドル 小計	535,000	1,127,395.00 (99,537,704)	
	投資証券合計	2,849,407	5,343,065,564 (5,343,065,564)	
	合計		5,532,528,730 (5,532,528,730)	

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	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 600銘柄	97.1%			61.6%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 33銘柄			2.8%	1.8%
カナダドル	株式 91銘柄	99.5%			4.1%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	98.9%			12.3%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 105銘柄	98.3%			8.4%
	投資証券 5銘柄			1.7%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			4.0%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.3%			2.8%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.0%		0.1%
	投資証券 9銘柄			7.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	95.3%			1.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 24銘柄	92.6%			0.6%
	投資証券 4銘柄			7.4%	0.0%

イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%		0.2%
-----------	----	-----	--------	--	------

(注)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。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 1月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	53,911,460
コール・ローン	136,857,097
国債証券	13,359,639,741
未収利息	180,510,275
前払費用	46,194,719
流動資産合計	13,777,113,292
資産合計	13,777,113,292
負債の部	
流動負債	
未払解約金	12,590,327
流動負債合計	12,590,327
負債合計	12,590,327
純資産の部	
元本等	
元本	7,903,790,507
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,860,732,458
元本等合計	13,764,522,965
純資産合計	13,764,522,965
負債純資産合計	13,777,113,292

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

平成27年 1月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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> <p>為替予約取引</p> <p>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>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</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)

平成27年 1月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,903,790,507口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7415円 (1万口当たり純資産額) (17,415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27年 1月20日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>

	平成27年 1月20日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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経営会議に報告します。</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27年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(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)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についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 1月21日
期首元本額	16,642,891,635円
期中追加設定元本額	15,268,889,945円
期中一部解約元本額	24,007,991,073円
期末元本額	7,903,790,507円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	2,914,753,716円
世界経済インデックスファンド	982,456,100円
DC新興国債券インデックス・オープン	2,443,121,251円
DC世界経済インデックスファンド	898,841,036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）	197,976,325円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	79,697,234円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	12,165,561円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	218,095,720円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	59,410,289円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	55,235,053円
新興国債券インデックス・オープン	7,721,327円
SMT インデックスバランス・オープン	34,316,895円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	132,994,447
合計	132,994,447

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	3,800,000.00	5,626,014.00	
		MBONO 10% 12/05/24	13,200,000.00	17,859,402.00	
		MBONO 4.75% 06/14/18	13,000,000.00	13,110,110.00	
		MBONO 5% 06/15/17	11,200,000.00	11,500,160.00	
		MBONO 5% 12/11/19	7,200,000.00	7,249,644.00	
		MBONO 6.25% 06/16/16	10,100,000.00	10,471,983.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	8,600,000.00	9,256,653.00	
		MBONO 6.5% 06/10/21	7,000,000.00	7,514,920.00	
		MBONO 7.25% 12/15/16	7,500,000.00	7,991,625.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	7,000,000.00	8,185,625.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	8,400,000.00	10,108,224.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	7,000,000.00	8,552,880.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	3,000,000.00	3,646,935.00	
		MBONO 7.75% 12/14/17	10,400,000.00	11,417,432.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	6,300,000.00	8,037,067.50	
		MBONO 8.5% 11/18/38	10,500,000.00	13,722,135.00	
		MBONO 8.5% 12/13/18	5,800,000.00	6,611,884.00	
		MBONO 8% 06/11/20	8,000,000.00	9,156,960.00	
		MBONO 8% 12/07/23	6,000,000.00	7,110,450.00	
			メキシコペソ 小計		154,000,000.00
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/17	4,350,000.00	3,464,174.70	
		BLTN 0% 01/01/18	1,000,000.00	711,453.00	
		BLTN 0% 04/01/16	2,100,000.00	1,822,201.50	
		BLTN 0% 07/01/16	4,000,000.00	3,372,720.00	
		BLTN 0% 07/01/17	500,000.00	376,271.00	
		BLTN 0% 10/01/16	4,800,000.00	3,927,100.80	
		BNTNF 10% 01/01/17	4,800,000.00	4,615,771.81	
		BNTNF 10% 01/01/18	1,500,000.00	1,423,929.19	

	BNTNF 10% 01/01/19	3,400,000.00	3,181,210.44	
	BNTNF 10% 01/01/21	3,200,000.00	2,924,829.20	
	BNTNF 10% 01/01/23	2,500,000.00	2,245,535.32	
	BNTNF 10% 01/01/25	2,300,000.00	2,033,577.49	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,100,000.00	1,141,932.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	200,000.00	224,847.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	300,000.00	284,244.00	
	ブラジルリアル 小計	36,050,000.00	31,749,797.45 (1,411,913,492)	
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	50,000,000.00	52,963,750.00	
	チリペソ 小計	50,000,000.00	52,963,750.00 (9,941,295)	
コロンビア ペソ	COLOM 12% 10/22/15	3,800,000,000.00	3,998,949,000.00	
	COLOM 4.375% 03/21/23	6,950,000,000.00	6,161,348,750.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	7,900,000,000.00	8,611,513,500.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	1,700,000,000.00	2,199,757,500.00	
	コロンビアペソ 小計	20,350,000,000.00	20,971,568,750.00 (1,050,675,594)	
ペルーヌエ ボソル	PERUGB 5.2% 09/12/23	1,100,000.00	1,096,150.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	900,000.00	917,343.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	1,050,000.00	1,101,339.75	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	600,000.00	641,832.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	1,400,000.00	1,614,774.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	700,000.00	852,978.00	
	PERUGB 8.6% 08/12/17	300,000.00	335,433.00	
	ペルーヌエボソル 小計	6,050,000.00	6,559,849.75 (256,818,117)	
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	1,850,000.00	2,257,684.50	
	TURKGB 10.4% 03/27/19	2,700,000.00	3,031,573.50	
	TURKGB 10.5% 01/15/20	1,600,000.00	1,839,920.00	
	TURKGB 10.7% 02/24/16	2,100,000.00	2,172,418.50	
	TURKGB 6.3% 02/14/18	1,200,000.00	1,177,812.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	2,750,000.00	2,749,573.75	
	TURKGB 8.2% 07/13/16	250,000.00	253,301.25	
	TURKGB 8.3% 06/20/18	1,900,000.00	1,962,700.00	
	TURKGB 8.5% 07/10/19	1,200,000.00	1,268,964.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	1,600,000.00	1,722,312.00	
	TURKGB 8.8% 09/27/23	1,800,000.00	1,997,208.00	
	TURKGB 8.8% 11/14/18	2,350,000.00	2,488,274.00	
	TURKGB 9.5% 01/12/22	1,700,000.00	1,908,156.50	
	TURKGB 9% 03/08/17	2,250,000.00	2,328,322.50	
	TURKGB 9% 07/24/24	550,000.00	627,426.25	

	トルコリラ 小計	25,800,000.00	27,785,646.75 (1,402,619,447)
ハンガリー フォリント	HGB 4% 04/25/18	113,000,000.00	119,188,445.00
	HGB 5.5% 02/12/16	80,000,000.00	83,504,000.00
	HGB 5.5% 06/24/25	85,000,000.00	102,642,175.00
	HGB 5.5% 12/20/18	130,000,000.00	144,707,550.00
	HGB 5.5% 12/22/16	80,000,000.00	85,910,400.00
	HGB 6.0% 11/24/23	160,000,000.00	196,352,800.00
	HGB 6.5% 06/24/19	188,000,000.00	218,792,520.00
	HGB 6.75% 02/24/17	123,000,000.00	135,664,695.00
	HGB 6.75% 11/24/17	160,000,000.00	180,818,400.00
	HGB 7.5% 11/12/20	132,000,000.00	165,471,900.00
	HGB 7% 06/24/22	144,000,000.00	181,509,840.00
	ハンガリーフォリント 小計	1,395,000,000.00	1,614,562,725.00 (689,579,739)
ポーランド ズロチ	POLGB 0% 07/25/16	1,500,000.00	1,462,552.50
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,200,000.00	3,276,912.00
	POLGB 3.25% 07/25/19	3,050,000.00	3,228,974.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,750,000.00	1,906,502.50
	POLGB 3.75% 04/25/18	3,050,000.00	3,242,256.75
	POLGB 4.75% 04/25/17	1,900,000.00	2,027,642.00
	POLGB 4.75% 10/25/16	4,100,000.00	4,317,792.00
	POLGB 4% 10/25/23	3,250,000.00	3,718,438.75
	POLGB 5.25% 10/25/17	2,800,000.00	3,066,084.00
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,550,000.00	3,005,289.75
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,350,000.00	2,736,140.25
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,550,000.00	4,452,179.25
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,000,000.00	2,463,650.00
	POLGB 5% 04/25/16	2,700,000.00	2,810,889.00
	ポーランドズロチ 小計	37,750,000.00	41,715,302.75 (1,314,866,342)
ロシアルー ブル	RFLB 6.7% 05/15/19	9,200,000.00	7,061,000.00
	RFLB 6.8% 12/11/19	25,600,000.00	18,909,056.00
	RFLB 6.9% 08/03/16	25,000,000.00	22,521,750.00
	RFLB 7.05% 01/19/28	4,500,000.00	2,858,872.50
	RFLB 7.4% 04/19/17	7,000,000.00	6,045,620.00
	RFLB 7.4% 06/14/17	45,000,000.00	38,775,150.00
	RFLB 7.5% 03/15/18	10,000,000.00	8,226,650.00
	RFLB 7.6% 04/14/21	34,000,000.00	24,853,660.00
	RFLB 7.6% 07/20/22	40,000,000.00	28,388,000.00
	RFLB 7% 01/25/23	5,000,000.00	3,395,450.00
	RFLB 7% 08/16/23	30,000,000.00	20,151,600.00
	RFLB 8.15% 02/03/27	46,000,000.00	32,644,820.00

	RUSSIA 7.85% 03/10/18	85,000,000.00	70,662,200.00	
ロシアルーブル 小計		366,300,000.00	284,493,828.50 (517,778,767)	
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	1,750,000.00	1,743,542.50	
	MGS 3.26% 03/01/18	1,400,000.00	1,381,744.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	1,750,000.00	1,735,046.25	
	MGS 3.394% 03/15/17	1,650,000.00	1,643,730.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,100,000.00	1,059,971.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	3,150,000.00	3,035,938.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,750,000.00	1,718,360.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,100,000.00	2,089,699.50	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,900,000.00	1,890,614.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	700,000.00	660,103.50	
	MGS 3.844% 04/15/33	550,000.00	513,730.25	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,400,000.00	1,399,762.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	950,000.00	915,149.25	
	MGS 4.012% 09/15/17	2,200,000.00	2,219,668.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	1,600,000.00	1,616,312.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,950,000.00	1,889,228.25	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,100,000.00	2,125,137.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,300,000.00	1,325,844.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	900,000.00	882,220.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,500,000.00	2,537,675.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	2,800,000.00	2,836,526.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,650,000.00	2,713,282.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,750,000.00	1,773,905.00	
MGS 4.498% 04/15/30	100,000.00	103,552.50		
MGS 5.734% 07/30/19	1,050,000.00	1,133,884.50		
マレーシアリンギット 小計		41,050,000.00	40,944,625.50 (1,347,078,178)	
タイバーツ	THA IGB 2.8% 10/10/17	12,500,000.00	12,697,937.50	
	THA IGB 3.25% 06/16/17	40,500,000.00	41,622,255.00	
	THA IGB 3.45% 03/08/19	11,000,000.00	11,492,360.00	
	THA IGB 3.58% 12/17/27	15,500,000.00	16,832,380.00	
	THA IGB 3.625% 06/16/23	31,900,000.00	34,707,519.00	
	THA IGB 3.65% 12/17/21	37,000,000.00	40,009,765.00	
	THA IGB 3.85% 12/12/25	5,000,000.00	5,638,875.00	
	THA IGB 3.875% 06/13/19	56,500,000.00	60,479,012.50	
	THA IGB 4.125% 11/18/16	8,000,000.00	8,291,840.00	
	THA IGB 4.75% 12/20/24	12,262,000.00	14,552,480.29	
	THA IGB 4.875% 06/22/29	21,000,000.00	25,933,950.00	
	THA IGB 5.125% 03/13/18	16,200,000.00	17,635,725.00	

	タイパーツ 小計	267,362,000.00	289,894,099.29 (1,046,517,698)
フィリピン ペソ	RPGB 7.375% 03/03/21	6,500,000.00	7,691,781.50
	RPGB 8% 07/19/31	11,500,000.00	15,464,901.00
	フィリピンペソ 小計	18,000,000.00	23,156,682.50 (61,365,208)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	4,000,000,000.00	4,887,880,000.00
	INDOGB 10% 07/15/17	2,500,000,000.00	2,655,650,000.00
	INDOGB 11% 09/15/25	3,400,000,000.00	4,190,194,000.00
	INDOGB 11% 11/15/20	4,100,000,000.00	4,777,033,000.00
	INDOGB 12.8% 06/15/21	2,000,000,000.00	2,534,180,000.00
	INDOGB 5.25% 05/15/18	4,700,000,000.00	4,425,097,000.00
	INDOGB 5.625% 05/15/23	5,500,000,000.00	4,848,635,000.00
	INDOGB 6.125% 05/15/28	7,000,000,000.00	5,994,170,000.00
	INDOGB 6.25% 04/15/17	1,600,000,000.00	1,569,408,000.00
	INDOGB 6.625% 05/15/33	19,500,000,000.00	16,862,430,000.00
	INDOGB 7.375% 09/15/16	2,200,000,000.00	2,207,634,000.00
	INDOGB 7.875% 04/15/19	9,100,000,000.00	9,283,183,000.00
	INDOGB 7% 05/15/22	4,500,000,000.00	4,371,120,000.00
	INDOGB 7% 05/15/27	4,500,000,000.00	4,213,485,000.00
	INDOGB 8.25% 06/15/32	7,300,000,000.00	7,439,503,000.00
	INDOGB 8.25% 07/15/21	3,300,000,000.00	3,429,723,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/24	16,000,000,000.00	16,798,080,000.00
	INDOGB 8.375% 03/15/34	3,000,000,000.00	3,093,420,000.00
	INDOGB 8.375% 09/15/26	4,000,000,000.00	4,173,000,000.00
	INDOGB 9.5% 07/15/31	4,400,000,000.00	4,989,292,000.00
INDOGB 9% 03/15/29	11,400,000,000.00	12,454,272,000.00	
	インドネシアルピア 小計	124,000,000,000.00	125,197,389,000.00 (1,176,855,456)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	22,350,000.00	27,783,061.50
	SAGB 6.25% 03/31/36	15,200,000.00	12,430,864.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	12,000,000.00	9,869,220.00
	SAGB 6.75% 03/31/21	13,500,000.00	13,384,575.00
	SAGB 7.25% 01/15/20	13,400,000.00	13,653,796.00
	SAGB 7.75% 02/28/23	8,300,000.00	8,625,111.00
	SAGB 7% 02/28/31	12,000,000.00	11,027,340.00
	SAGB 8.25% 09/15/17	13,400,000.00	13,999,717.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	8,800,000.00	9,285,628.00
	SAGB 8% 01/31/30	4,800,000.00	4,858,152.00
	SAGB 8% 12/21/18	13,100,000.00	13,704,434.00
	南アフリカランド 小計	136,850,000.00	138,621,898.50 (1,404,239,831)
	NIGB 15.1% 04/27/17	132,000,000.00	131,281,260.00

ナイジェリア アナイラ	NIGB 16.39% 01/27/22	15,000,000.00	15,574,500.00	
	NIGB 7% 10/23/19	326,000,000.00	235,313,320.00	
ナイジェリアアナイラ 小計		473,000,000.00	382,169,080.00	(241,721,943)
合計			13,359,639,741	(13,359,639,741)

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	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	10.7%
ブラジルリアル	国債証券 15銘柄	100.0%	10.6%
チリペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	7.9%
ペルーヌエボソル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.9%
トルコリラ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.0%	5.2%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.8%
ロシアルーブル	国債証券 13銘柄	100.0%	3.9%
マレーシアリンギット	国債証券 25銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 12銘柄	100.0%	7.8%
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 21銘柄	100.0%	8.8%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	10.5%
ナイジェリアアナイラ	国債証券 3銘柄	100.0%	1.8%

(注)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。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	431,861,854
コール・ローン	38,627,685
株式	21,736,052,988
投資信託受益証券	57,910,432
投資証券	106,076,013
派生商品評価勘定	12,020,172
未収入金	487,281
未収配当金	18,706,595
未収利息	58
差入委託証拠金	184,507,281
流動資産合計	22,586,250,359
資産合計	22,586,250,359
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,380
前受金	11,857,792
未払金	80,280,095
未払株式払込金	2,685,243
未払解約金	973,884
流動負債合計	95,809,394
負債合計	95,809,394
純資産の部	
元本等	
元本	9,114,836,588
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,375,604,377
元本等合計	22,490,440,965
純資産合計	22,490,440,965
負債純資産合計	22,586,250,359

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 1月20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</p>

	平成27年 1月20日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>株式及び投資証券は、原則として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> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成27年 1月20日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成27年 1月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,114,836,588口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
	2.4675円 (24,675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27年 1月20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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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。
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経営会議に報告します。 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

平成27年 1月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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) 有価証券 売買目的有価証券 「(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についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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>

(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成27年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年 1月21日
期首元本額	9,889,841,624円
期中追加設定元本額	5,014,363,209円

区分	平成27年 1月20日現在
期中一部解約元本額	5,789,368,245円
期末元本額	9,114,836,588円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,220,768,095円
世界経済インデックスファンド	700,135,888円
DC新興国株式インデックス・オープン	2,208,442,155円
DC世界経済インデックスファンド	660,721,114円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	60,277,800円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	26,719,279円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,468,090円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	132,036,323円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	12,889,983円
新興国株式インデックス・オープン	17,503,155円
SMT インデックスバランス・オープン	24,874,706円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	412,552,753
投資信託受益証券	3,253,114
投資証券	2,592,308
合計	413,213,559

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 1月20日現在）

区分	種類	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	567,364,865	-	579,222,657	11,857,792
合計		567,364,865	-	579,222,657	11,857,792

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 1月20日現在）

区分	種類	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	35,217,000	-	35,367,000	150,000
	アメリカドル	35,217,000	-	35,367,000	150,000
合計		35,217,000	-	35,367,000	150,000

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 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	24,583	16.08	395,294.64	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	282,184	4.63	1,307,499.56	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	58,400	1.40	81,935.20	
	LUKOIL-SPON ADR	25,046	40.89	1,024,130.94	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4,721	78.30	369,654.30	
	ROSNEFT OJSC-GDR	67,208	3.53	237,546.67	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	59,974	4.09	245,293.66	
	TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	13,624	25.00	340,600.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	11.15	188,769.50	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	29,965	14.51	434,792.15	
	SEVERSTAL - GDR REG S	15,540	9.19	142,812.60	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,956	27.09	188,438.04	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	13,281	10.54	139,981.74	
	DP WORLD LTD	10,914	20.21	220,571.94	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	13,968	42.99	600,554.16	
	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	13,229	45.85	606,549.65	

	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	44,401	6.77	300,594.77
	CREDICORP LTD	3,177	145.59	462,539.43
	SBERBANK-SPONSORED ADR	135,737	4.09	555,639.40
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	133,795	1.98	265,181.69
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	38,757	2.68	103,868.76
	MEGAFON-GDR	5,708	16.55	94,467.40
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	24,493	8.39	205,496.27
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	5,894	8.13	47,918.22
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	85,721	0.90	77,277.48
	アメリカドル 小計	1,134,206		8,637,408.17 (1,018,350,423)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	587,004	13.70	8,041,954.80
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	184,492	39.42	7,272,674.64
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	5,915	293.27	1,734,692.05
	MEXICHEM SAB DE CV-*	39,490	43.58	1,720,974.20
	MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	48,200	20.80	1,002,560.00
	ALFA S.A.B. -A	147,500	29.39	4,335,025.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	22,300	66.41	1,480,943.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	11,200	171.78	1,923,936.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	9,900	193.93	1,919,907.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	97.35	1,701,678.00
	OHL MEXICO SAB DE CV	37,600	29.02	1,091,152.00
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	129,690	93.86	12,172,703.40
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	142.83	1,556,847.00
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,600	41.49	813,204.00
	WALMART DE MEXICO-SER V	271,980	29.44	8,007,091.20
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	23,075	89.38	2,062,443.50
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	21,000	125.55	2,636,550.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	91,440	125.23	11,451,031.20
	GRUMA S.A.B. -B	9,800	154.01	1,509,298.00
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	81,100	39.18	3,177,498.00
	GRUPO LALA SAB DE CV	35,800	28.68	1,026,744.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	64,100	31.32	2,007,612.00
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	47,800	21.67	1,035,826.00
	GRUPO FIN SANTANDER-B	77,900	28.36	2,209,244.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	127,800	77.55	9,910,890.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	116,500	37.97	4,423,505.00
	COMPARTAMOS SAB DE CV	40,800	27.95	1,140,360.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,623,840	16.60	26,955,744.00
	メキシコペソ 小計	3,904,206		124,322,087.99 (1,002,036,029)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	4,300	24.60	105,780.00

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	141,700	8.88	1,258,296.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	217,440	9.19	1,998,273.60
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	16,500	49.93	823,845.00
BRADSPAR SA -PREF	6,600	14.00	92,400.00
BRASKEM SA-PREF A	8,900	14.07	125,223.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	23,400	4.79	112,086.00
DURATEX SA	21,672	7.25	157,122.00
FIBRIA CELULOSE SA	13,900	30.15	419,085.00
GERDAU SA-PREF	43,200	8.96	387,072.00
METALURGICA GERDAU SA-PREF	8,700	10.35	90,045.00
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	18,500	10.41	192,585.00
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	28,079	4.10	115,123.90
VALE SA	56,900	21.65	1,231,885.00
VALE SA-PREF A	98,315	19.10	1,877,816.50
EMBRAER SA	33,400	21.35	713,090.00
WEG SA	15,720	31.16	489,835.20
CCR SA	41,500	16.20	672,300.00
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	13,500	10.90	147,150.00
LOCALIZA RENT A CAR	3,590	34.60	124,214.00
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	16,100	10.72	172,592.00
ESTACIO PARTICIPACOES SA	13,800	18.15	250,470.00
KROTON EDUCATIONAL SA	72,684	13.15	955,794.60
B2W CIA DIGITAL	6,700	19.90	133,330.00
LOJAS AMERICANAS SA	9,000	12.29	110,610.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	19,347	15.95	308,584.65
LOJAS RENNER S.A.	5,900	73.20	431,880.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	6,600	88.58	584,628.00
RAIA DROGASIL SA	12,900	26.11	336,819.00
AMBEV SA	234,500	16.64	3,902,080.00
BRF SA	31,600	63.19	1,996,804.00
JBS SA	30,600	10.81	330,786.00
M DIAS BRANCO SA	2,100	87.60	183,960.00
SOUZA CRUZ SA	15,400	21.01	323,554.00
HYPERMARCAS SA	12,200	17.20	209,840.00
NATURA COSMETICOS SA	10,700	30.00	321,000.00
ODONTOPREV S.A.	12,400	10.30	127,720.00
QUALICORP SA	8,300	27.10	224,930.00
BANCO BRADESCO S.A.	31,900	33.39	1,065,141.00
BANCO BRADESCO SA-PREF	103,000	34.56	3,559,680.00
BANCO DO BRASIL S.A.	39,200	22.20	870,240.00
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	11,500	12.50	143,750.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	132,609	33.10	4,389,357.90

	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	146,848	9.02	1,324,568.96	
	BM&FBOVESPA SA	85,700	8.95	767,015.00	
	CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,400	33.33	379,962.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	37,000	29.70	1,098,900.00	
	PORTO SEGURO SA	2,000	28.60	57,200.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	22,400	16.00	358,400.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,500	48.86	268,730.00	
	CIELO SA	31,720	38.18	1,211,069.60	
	TOTVS SA	7,300	32.00	233,600.00	
	OI SA-PREFERENCE	18,703	5.00	93,515.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	14,600	49.28	719,488.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,200	11.52	474,624.00	
	AES TIETE SA-PREF	6,100	17.00	103,700.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,700	7.41	131,157.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,300	5.39	87,857.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	10,300	24.30	250,290.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	35,892	11.60	416,347.20	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	32.15	106,095.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	13,100	15.12	198,072.00	
	CPFL ENERGIA SA	15,168	17.52	265,743.36	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	4,700	8.53	40,091.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	5,700	31.46	179,322.00	
	ブラジルリアル 小計	2,207,487		40,832,525.47	(1,815,822,407)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	23,727	6,677.90	158,446,533.30	
	CAP SA	3,824	2,200.20	8,413,564.80	
	EMPRESAS CMPC SA	56,949	1,512.40	86,129,667.60	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,105	14,159.00	58,122,695.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	14,129	6,849.40	96,775,172.60	
	S.A.C.I. FALABELLA	43,024	3,744.70	161,111,972.80	
	CENCOSUD SA	67,389	1,341.00	90,368,649.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	4,164	5,663.10	23,581,148.40	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	1,700.10	25,861,921.20	
	VINA CONCHA Y TORO SA	36,750	1,160.00	42,630,000.00	
	BANCO DE CHILE	1,090,173	69.29	75,538,087.17	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	829	27,586.00	22,868,794.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,909,601	29.55	85,978,709.55	
	CORPBANCA	8,419,981	6.73	56,725,411.99	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	6,032.30	36,760,836.20	
	AES GENER SA	141,749	318.38	45,130,046.62	
	AGUAS ANDINAS SA-A	163,248	356.36	58,175,057.28	
	COLBUN SA	475,888	163.24	77,683,957.12	

	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	158,195	914.10	144,606,049.50
	ENERSIS SA	1,030,498	193.82	199,731,122.36
	チリペソ 小計	14,665,529		1,554,639,396.49 (291,805,814)
コロンビアペソ	CEMENTOS ARGOS SA	11,757	9,030.00	106,165,710.00
	CEMEX LATAM HOLDINGS SA	6,507	15,580.00	101,379,060.00
	GRUPO ARGOS SA	8,118	18,100.00	146,935,800.00
	GRUPO ARGOS SA-PRF	5,515	18,120.00	99,931,800.00
	ALMACENES EXITO SA	5,734	25,520.00	146,331,680.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	9,896	34,700.00	343,391,200.00
	コロンビアペソ 小計	47,527		944,135,250.00 (47,301,176)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,456	19.60	106,937.60
	OPAP SA	18,495	8.50	157,207.50
	FF GROUP	4,231	28.80	121,852.80
	JUMBO SA	13,768	8.85	121,846.80
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	23,354	9.12	212,988.48
	ユーロ 小計	65,304		720,833.18 (98,501,854)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	4,488	56.90	255,367.20
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	61,323	4.63	283,925.49
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	32,009	3.97	127,075.73
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	28,492	5.25	149,583.00
	KOC HOLDING AS	24,818	11.70	290,370.60
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	32,617	3.78	123,292.26
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	18.35	180,490.60
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,354	9.00	291,186.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	30.30	98,717.40
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	15.60	105,300.00
	ARCELIK AS	15,358	14.60	224,226.80
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	10,345	50.90	526,560.50
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,230	20.40	229,092.00
	COCA-COLA ICECEK AS	4,417	46.90	207,157.30
	ULKER BISKUVI SANAYI	9,626	18.30	176,155.80
	AKBANK T.A.S.	80,605	9.00	725,445.00
	TURKIYE GARANTI BANKASI	116,380	10.00	1,163,800.00
	TURKIYE HALK BANKASI	35,397	14.95	529,185.15
	TURKIYE IS BANKASI-C	72,784	6.73	489,836.32
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,943	5.67	294,516.81
YAPI VE KREDI BANKASI	51,724	5.03	260,171.72	
HACI OMER SABANCI HOLDING	42,702	10.50	448,371.00	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	17,796	7.58	134,893.68	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,702	15.05	567,415.10	
	トルコリラ 小計	793,954		7,882,135.46 (397,890,198)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	672	4,730.00	3,178,560.00	
	CEZ AS	7,854	576.80	4,530,187.20	
	チェココルナ 小計	8,526		7,708,747.20 (37,695,773)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	2,292	10,710.00	24,547,320.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,459	3,411.00	28,853,649.00	
	OTP BANK NYRT	9,311	3,580.00	33,333,380.00	
	ハンガリーフォリント 小計	20,062		86,734,349.00 (37,044,240)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	5,516	24.13	133,101.08	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	17,245	50.38	868,803.10	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	66,076	4.25	280,823.00	
	GRUPA AZOTY SA	2,786	66.00	183,876.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	5,955	103.80	618,129.00	
	SYNTHOS SA	33,750	4.04	136,350.00	
	CCC SA	1,281	143.00	183,183.00	
	LPP SA	38	7,407.00	281,466.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,880	22.13	262,904.40	
	EUROCASH SA	5,057	34.50	174,466.50	
	ALIOR BANK SA	2,949	79.00	232,971.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	103.10	207,231.00	
	BANK MILLENNIUM SA	33,017	7.24	239,043.08	
	BANK PEKAO SA	6,497	175.45	1,139,898.65	
	BANK ZACHODNI WBK SA	1,666	348.00	579,768.00	
	GETIN NOBLE BANK SA	69,829	1.83	127,787.07	
	M BANK SA	817	442.70	361,685.90	
	PKO BANK POLSKI SA	42,187	33.11	1,396,811.57	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,671	477.00	1,274,067.00	
	ORANGE POLSKA SA	25,734	7.96	204,842.64	
ENEA SA	12,967	16.20	210,065.40		
ENERGA SA	12,891	21.07	271,613.37		
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	41,804	19.15	800,546.60		
TAURON POLSKA ENERGIA SA	57,033	4.88	278,321.04		
	ポーランドズロチ 小計	461,656		10,447,754.40 (329,313,218)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	229,000	4.39	1,005,310.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	13.34	1,387,360.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,227,400	6.06	7,438,044.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	171,000	21.40	3,659,400.00	

CNOOC LTD-R	853,000	10.56	9,007,680.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	162,000	7.61	1,232,820.00
PETROCHINA CO LTD-H	1,016,000	8.50	8,636,000.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	112,000	6.19	693,280.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	156,000	3.69	575,640.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	58,000	27.50	1,595,000.00
BBMG CORPORATION - H	69,000	6.39	440,910.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	134,000	7.46	999,640.00
CHINA RESOURCES CEMENT	134,000	4.69	628,460.00
FOSUN INTERNATIONAL	67,000	10.22	684,740.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	12.60	1,045,800.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	83,000	4.07	337,810.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	5.68	573,680.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	199,000	2.28	453,720.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	379,000	2.40	909,600.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	124,000	4.90	607,600.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	23,500	60.40	1,419,400.00
CHINA CNR CORP LTD-H	85,500	10.36	885,780.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	208,000	8.82	1,834,560.00
CHINA INTL MARINE CO-H	35,600	15.28	543,968.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	109,500	9.06	992,070.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	200,000	5.69	1,138,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	60,000	11.42	685,200.00
CITIC LTD	122,000	13.32	1,625,040.00
CSR CORP LTD-H	140,000	9.92	1,388,800.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	35,000	14.30	500,500.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	4.31	724,080.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	15,000	22.75	341,250.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	68,000	5.50	374,000.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	27,200	30.65	833,680.00
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	39,500	45.95	1,815,025.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	107,000	11.52	1,232,640.00
AIR CHINA LIMITED-H	64,000	6.39	408,960.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	7.45	804,600.00
CHINA COSCO HOLDINGS-H	75,500	3.92	295,960.00
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	55,513	25.75	1,429,459.75
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	2.38	523,600.00
COSCO PACIFIC LIMITED-R	56,000	11.00	616,000.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	9.02	613,360.00
SINOTRANS LIMITED-H	91,000	5.68	516,880.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	9.15	805,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	150,000	13.16	1,974,000.00

BYD CO LTD-H	26,000	27.40	712,400.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	47,600	18.98	903,448.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	122,000	11.16	1,361,520.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	170,000	2.83	481,100.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	49,750	40.15	1,997,462.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	122,246	6.71	820,270.66
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	42,000	13.30	558,600.00
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	228,000	9.14	2,083,920.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	47,000	19.68	924,960.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	32,000	26.75	856,000.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	320,000	1.32	422,400.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	593,958	1.14	677,112.12
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	70,000	5.16	361,200.00
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	66,000	15.54	1,025,640.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	87,500	7.49	655,375.00
CHAODA MODERN AGRICULTURE	68,000	-	-
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	16,300	3.19	51,997.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	103,000	1.27	130,810.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	63,000	34.50	2,173,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	90,000	17.44	1,569,600.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	51.95	1,039,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	93,600	6.76	632,736.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	269,000	9.87	2,655,030.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	34,500	81.95	2,827,275.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	108,000	5.82	628,560.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	17.04	732,720.00
SINOPHARM GROUP CO-H	56,000	27.60	1,545,600.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	51,000	13.20	673,200.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	146,000	6.53	953,380.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	26,000	28.20	733,200.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	177,000	5.09	900,930.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	108,000	7.49	808,920.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,107,000	3.78	4,184,460.00
BANK OF CHINA LTD-H	3,889,200	4.18	16,256,856.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	417,475	6.35	2,650,966.25
CHINA CITIC BANK-H	410,200	5.63	2,309,426.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,492,620	6.14	21,444,686.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	55,000	4.19	230,450.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	237,423	17.16	4,074,178.68
CHINA MINSHENG BANKING-H	287,000	9.58	2,749,460.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	4.51	626,890.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	3,596,515	5.45	19,601,006.75

CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	221,000	3.63	802,230.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	36,000	15.78	568,080.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	93,500	8.35	780,725.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	60,000	23.60	1,416,000.00
FAR EAST HORIZON LTD	76,000	6.70	509,200.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	74,400	15.36	1,142,784.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	361,000	29.60	10,685,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	122,200	35.45	4,331,990.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	65,824	20.65	1,359,265.60
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	34,700	44.65	1,549,355.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	369,000	3.55	1,309,950.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	162,859	14.36	2,338,655.24
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	128,000	81.20	10,393,600.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	191,040	23.70	4,527,648.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	104,000	20.05	2,085,200.00
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	120,000	2.56	307,200.00
CHINA VANKE CO LTD-H	75,000	16.40	1,230,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	267,285	3.01	804,527.85
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	295,000	3.26	961,700.00
FRANSHION PROPERTIES	220,000	2.26	497,200.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	68,800	8.90	612,320.00
LONGFOR PROPERTIES	73,000	10.48	765,040.00
NEW WORLD CHINA LAND LTD	170,000	4.77	810,900.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	65,500	17.06	1,117,430.00
SHUI ON LAND LTD	209,278	1.75	366,236.50
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	93,091	4.76	443,113.16
SOHO CHINA LTD	113,000	5.38	607,940.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	344,000	1.50	516,000.00
KINGSOFT CORP LTD	40,000	16.16	646,400.00
TENCENT HOLDINGS LTD	249,300	123.00	30,663,900.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	32,000	45.50	1,456,000.00
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	9,300	12.82	119,226.00
LENOVO GROUP LTD	322,000	10.30	3,316,600.00
ZTE CORP-H	40,424	17.74	717,121.76
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	140,000	5.06	708,400.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	3.53	458,900.00
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	294,500	97.00	28,566,500.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	624,000	4.22	2,633,280.00
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	264,000	11.64	3,072,960.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	222,000	5.16	1,145,520.00
CGN POWER CO LTD-H	252,000	3.09	778,680.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	84,000	11.94	1,002,960.00

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	123,000	8.38	1,030,740.00
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	52,000	18.42	957,840.00
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	89,400	20.55	1,837,170.00
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	158,000	4.09	646,220.00
	ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	34,000	43.90	1,492,600.00
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	104,000	10.74	1,116,960.00
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	84,000	6.80	571,200.00
	HUANENG POWER INTL INC-H	190,000	10.88	2,067,200.00
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	551,000	1.68	925,680.00
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	650,000	2.73	1,774,500.00
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,214,000	0.70	849,800.00
	香港ドル 小計	35,175,501		313,657,001.62 (4,770,722,994)
マレーシアリン ギット	BUMI ARMADA BERHAD	65,700	1.22	80,154.00
	PETRONAS DAGANGAN BHD	15,300	16.38	250,614.00
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	161,200	2.63	423,956.00
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	10.02	261,522.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	134,400	5.00	672,000.00
	DIALOG GROUP BHD	222,968	1.65	367,897.20
	GAMUDA BHD	74,700	5.02	374,994.00
	IJM CORP BHD	57,400	6.60	378,840.00
	SIME DARBY BERHAD	132,342	9.30	1,230,780.60
	AIRASIA BHD	64,800	2.79	180,792.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	44,662	6.85	305,934.70
	MISC BHD	56,540	7.60	429,704.00
	UMW HOLDINGS BHD	34,000	10.56	359,040.00
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	31,318	3.47	108,673.46
	GENTING BHD	89,300	8.39	749,227.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	158,400	3.85	609,840.00
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	42,400	2.99	126,776.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	5,100	66.14	337,314.00
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	2.16	173,448.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.10	141,400.00
	IOI CORPORATION BHD	121,240	4.70	569,828.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	19,000	22.00	418,000.00
	PPB GROUP BERHAD	20,500	14.00	287,000.00
	IHH HEALTHCARE BHD	115,400	4.95	571,230.00
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,600	4.70	331,820.00
	AMMB HOLDINGS BHD	89,900	6.44	578,956.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	257,253	5.95	1,530,655.35
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,580	13.98	315,668.40
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,700	16.60	227,420.00

	MALAYAN BANKING BHD	227,199	8.79	1,997,079.21	
	PUBLIC BANK BHD-LOCAL MKT	135,820	17.64	2,395,864.80	
	RHB CAPITAL BHD	33,654	7.80	262,501.20	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	123,060	2.12	260,887.20	
	UEM SUNRISE BHD	119,400	1.32	157,608.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	101,475	7.01	711,339.75	
	DIGI.COM BERHAD	152,000	6.18	939,360.00	
	MAXIS BHD	90,000	6.92	622,800.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	33,952	6.68	226,799.36	
	PETRONAS GAS BHD	31,900	21.40	682,660.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	139,075	14.50	2,016,587.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	247,417	1.67	413,186.39	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	122,325	1.60	195,720.00	
	マレーシアリングット 小計	3,798,380		23,275,878.12 (765,776,390)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	79,000	23.90	1,888,100.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	68,700	27.00	1,854,900.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	3.28	1,878,784.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	57,900	105.50	6,108,450.00	
	PTT PCL-NVDR	49,100	333.00	16,350,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	45.25	2,172,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	8,300	19.70	163,510.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	66,734	54.00	3,603,636.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	6,500	460.00	2,990,000.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	12,600	460.00	5,796,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	23,100	290.00	6,699,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	367,500	10.30	3,785,250.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	98,100	34.00	3,335,400.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	49.00	2,748,900.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	217,158	8.05	1,748,121.90	
	CP ALL PCL-NVDR	192,200	43.00	8,264,600.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	150,100	26.00	3,902,600.00	
	THAI UNION FROZEN PROD-NVDR	111,200	22.10	2,457,520.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	95,800	18.90	1,810,620.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	7,400	143.00	1,058,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	20,200	184.00	3,716,800.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	184.00	2,980,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	56,500	225.00	12,712,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	35,000	224.00	7,840,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	129,950	22.30	2,897,885.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	81,100	181.00	14,679,100.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	430,600	3.00	1,291,800.00	

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	74,800	44.50	3,328,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,300	72.00	2,325,600.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	46,300	247.00	11,436,100.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	378,029	12.30	4,649,756.70	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	29,600	89.25	2,641,800.00	
	タイパーツ 小計	3,618,871		149,116,633.60 (538,311,047)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	63,950	54.40	3,478,880.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	139,100	24.00	3,338,400.00	
	DMCI HOLDINGS INC	345,450	15.26	5,271,567.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	94,750	70.20	6,651,450.00	
	SM INVESTMENTS CORP	5,707	858.50	4,899,459.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	8,510	117.80	1,002,478.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	214.00	5,446,300.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	34,050	198.80	6,769,140.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,420	94.00	4,927,480.00	
	BDO UNIBANK INC	79,961	110.20	8,811,702.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	35,519	91.40	3,246,436.60	
	AYALA CORPORATION	10,780	711.00	7,664,580.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	5.00	3,678,500.00	
	AYALA LAND INC	301,300	34.50	10,394,850.00	
	MEGAWORLD CORP	638,000	5.28	3,368,640.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	266,550	18.78	5,005,809.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,725.00	3,087,750.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	4,760	2,950.00	14,042,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	42.70	3,821,650.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	8.63	5,232,369.00		
	フィリピンペソ 小計	3,539,547		110,139,441.30 (291,869,519)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	945.00	756,472,500.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	20,600	14,900.00	306,940,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	43,600	10,400.00	453,440,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	57,100	21,825.00	1,246,207,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	134,700	14,100.00	1,899,270,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	67,900	17,050.00	1,157,695,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	6,975.00	861,412,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,001,300	7,425.00	7,434,652,500.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	473,000	1,850.00	875,050,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	175,700	2,685.00	471,754,500.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	292,400	3,280.00	959,072,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	79,400	14,550.00	1,155,270,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	24,500.00	490,000,000.00	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	432,100	3,790.00	1,637,659,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	16,900	59,975.00	1,013,577,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	80,500	13,075.00	1,052,537,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	145,800	7,325.00	1,067,985,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	67,600	34,000.00	2,298,400,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	804,500	1,790.00	1,440,055,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	682,900	13,000.00	8,877,700,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	4,570.00	898,005,000.00	
	BANK MANDIRI	479,398	10,725.00	5,141,543,550.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	301,400	5,975.00	1,800,865,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	553,500	11,600.00	6,420,600,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	160,700	2,005.00	322,203,500.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	1,015.00	1,231,195,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	2,451,400	2,855.00	6,998,747,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	133,400	9,500.00	1,267,300,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	4,690.00	809,025,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	491,600	5,200.00	2,556,320,000.00	
	インドネシアルピア 小計	11,673,398		62,900,954,550.00 (591,268,972)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,525	39,050.00	98,601,250.00	
	S-OIL CORPORATION	2,397	53,900.00	129,198,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,647	88,000.00	232,936,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,389	11,500.00	73,473,500.00	
	HANWHA CORPORATION	2,825	29,300.00	82,772,500.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	73,800.00	103,984,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	3,335	67,200.00	224,112,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	484	436,500.00	211,266,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,051	86,500.00	90,911,500.00	
	LG CHEM LTD	1,952	180,000.00	351,360,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	479	133,000.00	63,707,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	838	150,500.00	126,119,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,127	73,000.00	82,271,000.00	
	POSCO	3,321	272,500.00	904,972,500.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	760	131,000.00	99,560,000.00	
	CJ CORP	822	164,500.00	135,219,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,571	57,300.00	90,018,300.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,270	5,260.00	43,500,200.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	1,548	28,150.00	43,576,200.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,338	18,000.00	78,084,000.00	
	DOOSAN CORP	423	101,000.00	42,723,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,342	22,050.00	73,691,100.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	3,212	9,440.00	30,321,280.00	

GS ENGINEERING & CONSTRUCT	3,398	22,050.00	74,925,900.00
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	2,602	41,800.00	108,763,600.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,886	37,900.00	109,379,400.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,967	103,500.00	203,584,500.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	778	72,400.00	56,327,200.00
KCC CORP	326	525,000.00	171,150,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,570	41,400.00	106,398,000.00
LG CORP	4,522	61,200.00	276,746,400.00
LS CORP	1,095	48,250.00	52,833,750.00
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	1,153	60,400.00	69,641,200.00
SAMSUNG C&T CORP	6,506	56,400.00	366,938,400.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,662	31,150.00	51,771,300.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	7,429	18,200.00	135,207,800.00
SK HOLDINGS CO LTD	1,324	163,500.00	216,474,000.00
SK NETWORKS CO LTD	2,484	8,530.00	21,188,520.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	941	86,000.00	80,926,000.00
S-1 CORPORATION	960	71,200.00	68,352,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	556	234,000.00	130,104,000.00
KOREA EXPRESS CO LTD	324	182,000.00	58,968,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,615	44,000.00	71,060,000.00
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	2,165	46,600.00	100,889,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD	3,331	51,100.00	170,214,100.00
HYUNDAI MOBIS	3,252	251,500.00	817,878,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	7,359	172,500.00	1,269,427,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,041	125,000.00	255,125,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,250	121,500.00	151,875,000.00
HYUNDAI WIA CORP	685	183,500.00	125,697,500.00
KIA MOTORS CORPORATION	12,515	51,500.00	644,522,500.00
COWAY CO.,LTD.	2,293	82,300.00	188,713,900.00
LG ELECTRONICS INC	4,349	60,800.00	264,419,200.00
KANGWON LAND INC	4,966	30,200.00	149,973,200.00
PARADISE CO LTD	1,876	25,200.00	47,275,200.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	16,600.00	84,162,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	1,550	104,500.00	161,975,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	590	120,500.00	71,095,000.00
LOTTE SHOPPING CO	451	245,500.00	110,720,500.00
SHINSEGAE CO LTD	417	171,000.00	71,307,000.00
EMART	897	216,000.00	193,752,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	324	342,000.00	110,808,000.00
HITE JINRO CO LTD	1,710	22,400.00	38,304,000.00
KT&G CORP	5,348	76,000.00	406,448,000.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	1,854,000.00	83,430,000.00

ORION CORP	206	997,000.00	205,382,000.00
AMOREPACIFIC CORP	164	2,365,000.00	387,860,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	511	613,000.00	313,243,000.00
PACIFIC CORP	117	1,102,000.00	128,934,000.00
CELLTRION INC	3,482	40,700.00	141,717,400.00
YUHAN CORPORATION	545	168,500.00	91,832,500.00
BS FINANCIAL GROUP INC	8,406	14,250.00	119,785,500.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	5,719	10,900.00	62,337,100.00
HANA FINANCIAL GROUP	12,711	33,050.00	420,098,550.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	10,881	12,900.00	140,364,900.00
KB FINANCIAL GROUP INC	18,396	36,500.00	671,454,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	21,555	43,150.00	930,098,250.00
WOORI BANK	13,555	8,950.00	121,317,250.00
DAEWOO SECURITIES CO LTD	6,990	9,660.00	67,523,400.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,270	48,900.00	62,103,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,583	43,750.00	69,256,250.00
SAMSUNG CARD CO	1,899	37,600.00	71,402,400.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,909	43,450.00	126,396,050.00
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	4,873	11,000.00	53,603,000.00
DONGBU INSURANCE CO LTD	1,632	52,300.00	85,353,600.00
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	7,950.00	97,149,000.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	2,104	25,950.00	54,598,800.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,617	283,000.00	457,611,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	3,048	110,000.00	335,280,000.00
DAUM KAKAO CORP	1,215	152,200.00	184,923,000.00
NAVER CORP	1,404	776,000.00	1,089,504,000.00
NCSOFT CORPORATION	851	189,000.00	160,839,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	1,268	257,500.00	326,510,000.00
SK C&C CO LTD	869	223,000.00	193,787,000.00
LG DISPLAY CO LTD	11,677	35,900.00	419,204,300.00
LG INNOTEK CO LTD	857	106,500.00	91,270,500.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,895	63,400.00	183,543,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,363	1,343,000.00	7,202,509,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,027	1,031,000.00	1,058,837,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	2,452	110,500.00	270,946,000.00
KT CORP	3,800	29,800.00	113,240,000.00
LG UPLUS CORP	12,570	11,850.00	148,954,500.00
SK TELECOM	945	268,000.00	253,260,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORP	12,320	39,300.00	484,176,000.00
KOREA GAS CORPORATION	1,432	44,700.00	64,010,400.00
SK HYNIX INC	28,610	47,000.00	1,344,670,000.00
	388,595		30,166,014,050.00

	韓国ウォン 小計			(3,291,112,132)
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	68,240	65.40	4,462,896.00
	ASIA CEMENT CORP	79,176	38.40	3,040,358.40
	CHINA STEEL	543,261	26.15	14,206,275.15
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	169,061	66.60	11,259,462.60
	FORMOSA PLASTICS CORP	217,824	74.60	16,249,670.40
	NAN YA PLASTICS CORP	240,752	63.80	15,359,977.60
	TAIWAN CEMENT	149,929	41.70	6,252,039.30
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	53.70	1,825,800.00
	TSRC CORP	68,071	34.90	2,375,677.90
	CTCI CORP	17,000	50.00	850,000.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	122,577	31.25	3,830,531.25
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,150	254.50	3,092,175.00
	TAIWAN GLASS IND CORP	65,486	23.00	1,506,178.00
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	111,000	29.45	3,268,950.00
	WALSIN LIHWA CORP	199,000	9.55	1,900,450.00
	CHINA AIRLINES LTD	140,203	15.30	2,145,105.90
	EVA AIRWAYS CORP	133,085	23.55	3,134,151.75
	EVERGREEN MARINE	106,499	22.95	2,444,152.05
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	32,000	49.00	1,568,000.00
	YANG MING MARINE TRANSPORT	143,900	16.50	2,374,350.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	85,061	73.00	6,209,453.00
	CHINA MOTOR CORP	51,000	27.05	1,379,550.00
	YULON MOTOR COMPANY	51,000	45.85	2,338,350.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,440	312.00	3,569,280.00
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	31.25	1,250,000.00
	GIANT MANUFACTURING	13,464	268.50	3,615,084.00
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,550	215.50	2,489,025.00
	POU CHEN	108,780	41.80	4,547,004.00
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	36,847	65.90	2,428,217.30
	FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	3,220	318.50	1,025,570.00
	FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	50,624	27.25	1,379,504.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10,000	443.50	4,435,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	24,544	234.50	5,755,568.00
	STANDARD FOODS CORP	28,159	66.80	1,881,021.20
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	233,073	50.00	11,653,650.00
	SCINOPHARM TAIWAN LTD	12,563	51.50	646,994.50
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	216,009	17.80	3,844,960.20
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	607,780	10.00	6,077,800.00
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	684,001	20.25	13,851,020.25
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	285,868	18.95	5,417,198.60
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	328,715	18.30	6,015,484.50

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	262,792	17.35	4,559,441.20
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	503,557	23.60	11,883,945.20
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	411,302	12.70	5,223,535.40
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	343,566	12.70	4,363,288.20
TAIWAN BUSINESS BANK	30,276	9.14	276,722.64
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	243,033	16.15	3,924,982.95
CHAILEASE HOLDING CO LTD	35,990	74.50	2,681,255.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	333,082	49.25	16,404,288.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	412,067	15.15	6,242,815.05
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	400,951	44.50	17,842,319.50
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	118,153	25.90	3,060,162.70
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	360,070	8.81	3,172,216.70
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	10,000	34.90	349,000.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	32,400	64.40	2,086,560.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,445	48.50	2,252,582.50
ACER INC	93,803	20.10	1,885,440.30
ADVANTECH CO LTD	18,548	233.50	4,330,958.00
ASUSTEK COMPUTER INC	32,092	315.00	10,108,980.00
AU OPTRONICS CORP	396,090	18.50	7,327,665.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	28,700	259.00	7,433,300.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,225	85.80	2,421,705.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	375,000	16.50	6,187,500.00
CLEVO COMPANY	38,008	46.40	1,763,571.20
COMPAL ELECTRONICS	166,760	22.85	3,810,466.00
DELTA ELECTRONICS INC	90,520	181.00	16,384,120.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	48,869	82.50	4,031,692.50
HON HAI PRECISION INDUSTRY	598,314	83.70	50,078,881.80
HTC CORPORATION	37,430	155.50	5,820,365.00
INVENTEC CO LTD	136,511	23.45	3,201,182.95
LARGAN PRECISION CO LTD	5,040	2,430.00	12,247,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	100,204	39.00	3,907,956.00
PEGATRON CORP	73,474	77.10	5,664,845.40
QUANTA COMPUTER INC	121,270	77.70	9,422,679.00
SIMPLIO TECHNOLOGY CO LTD	17,354	151.00	2,620,454.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	74,381	45.15	3,358,302.15
TPK HOLDING CO LTD	16,969	191.50	3,249,563.50
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	30,000	22.30	669,000.00
WISTRON CORP	114,915	29.60	3,401,484.00
WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	36.50	2,963,325.50
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	21,922	86.70	1,900,637.40
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	23,000	15.50	356,500.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	176,315	93.90	16,555,978.50

	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	67,000	75.50	5,058,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	88,200	108.00	9,525,600.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	277,739	38.10	10,581,855.90	
	EPISTAR CORP	57,000	58.10	3,311,700.00	
	HERMES MICROVISION INC	2,000	1,495.00	2,990,000.00	
	INOTERA MEMORIES INC	93,000	42.90	3,989,700.00	
	KINSUS INTERCONNECT TECH	3,000	99.80	299,400.00	
	MEDIATEK INC	68,804	487.00	33,507,548.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	23,045	186.00	4,286,370.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	11,599	214.50	2,487,985.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	11,770	51.60	607,332.00	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	26,157	96.10	2,513,687.70	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	27,944	98.00	2,738,512.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	157,000	47.95	7,528,150.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,195,389	139.00	166,159,071.00	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	99.90	943,555.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	551,000	15.05	8,292,550.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	54,000	52.50	2,835,000.00	
	新台湾ドル 小計	14,759,589		734,039,322.19 (2,745,307,064)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,084	645.20	3,925,396.80	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	234.15	5,186,422.50	
	COAL INDIA LTD	27,309	379.20	10,355,572.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	33,269	347.50	11,560,977.50	
	OIL INDIA LTD	7,461	531.75	3,967,386.75	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	61,278	879.65	53,903,192.70	
	ACC LTD	1,768	1,532.90	2,710,167.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	37,185	246.80	9,177,258.00	
	ASIAN PAINTS LTD	12,841	831.90	10,682,427.90	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	44,425	140.25	6,230,606.25	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	25,076	151.65	3,802,775.40	
	JSW STEEL LTD	4,348	976.65	4,246,474.20	
	SESA STERLITE LTD	53,224	193.15	10,280,215.60	
	TATA STEEL LTD	11,092	384.75	4,267,647.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,375	3,088.50	7,335,187.50	
	ADANI ENTERPRISES LTD	7,547	506.30	3,821,046.10	
	ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,306	1,785.90	4,118,285.40	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,997	281.05	9,554,856.85	
	LARSEN & TOUBRO LTD	16,488	1,614.85	26,625,646.80	
	SIEMENS INDIA LTD	5,358	969.30	5,193,509.40	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	26,078	328.35	8,562,711.30	
	BAJAJ AUTO LTD	3,879	2,403.90	9,324,728.10	

HERO MOTOCORP LTD	1,313	2,841.30	3,730,626.90
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	15,100	1,332.20	20,116,220.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	10,995	455.35	5,006,573.25
TATA MOTORS LTD	37,424	538.50	20,152,824.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	25,219	384.60	9,699,227.40
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	529	5,717.00	3,024,293.00
ITC LTD	106,870	358.80	38,344,956.00
NESTLE INDIA LIMITED	1,289	7,073.95	9,118,321.55
UNITED BREWERIES LTD	4,195	950.05	3,985,459.75
UNITED SPIRITS LTD	2,492	3,373.25	8,406,139.00
DABUR INDIA LTD	30,963	257.80	7,982,261.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,799	1,094.05	6,344,395.95
HINDUSTAN UNILEVER LTD	37,475	892.55	33,448,311.25
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,144	1,200.25	4,973,836.00
AUROBINDO PHARMA LTD	6,635	1,162.85	7,715,509.75
CIPLA LTD	14,115	657.80	9,284,847.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,694	1,712.15	4,612,532.10
DR. REDDY'S LABORATORIES	6,281	3,323.90	20,877,415.90
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	845.35	2,988,312.25
RANBAXY LABORATORIES LTD	7,328	656.35	4,809,732.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	35,244	863.00	30,415,572.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	70,538	1,181.70	83,354,754.60
ICICI BANK LTD	49,530	360.80	17,870,424.00
LIC HOUSING FINANCE LTD	14,381	494.05	7,104,933.05
STATE BANK OF INDIA	73,860	313.15	23,129,259.00
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,218	287.25	4,658,620.50
POWER FINANCE CORPORATION	19,274	293.00	5,647,282.00
RURAL ELECTRIFICATION CORP	17,924	329.15	5,899,684.60
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,654	1,142.60	8,745,460.40
HCL TECHNOLOGIES LTD	13,115	1,644.65	21,569,584.75
INFOSYS LTD	43,372	2,102.50	91,189,630.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	23,616	2,511.00	59,299,776.00
TECH MAHINDRA LTD	2,399	2,800.25	6,717,799.75
WIPRO LTD	27,241	584.20	15,914,192.20
BHARTI AIRTEL LTD	26,488	350.45	9,282,719.60
IDEA CELLULAR LTD	59,982	155.40	9,321,202.80
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	53,477	79.60	4,256,769.20
GAIL INDIA LTD	17,833	440.55	7,856,328.15
NTPC LTD	71,371	141.75	10,116,839.25
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,423	490.05	3,637,641.15
TATA POWER CO LTD	38,219	82.80	3,164,533.20
	1,459,092		868,607,293.50

インドルピー 小計				(1,676,412,076)
カタールリアル	INDUSTRIES QATAR	5,541	145.30	805,107.30
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	2,623	66.60	174,691.80
	DOHA BANK QSC	2,020	56.60	114,332.00
	MASRAF AL RAYAN	26,948	45.00	1,212,660.00
	QATAR ISLAMIC BANK	5,887	104.20	613,425.40
	QATAR NATIONAL BANK	6,413	204.50	1,311,458.50
	BARWA REAL ESTATE CO	3,826	44.40	169,874.40
	OOREDOO QSC	7,280	116.20	845,936.00
	VODAFONE QATAR	19,530	14.79	288,848.70
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,591	189.00	300,699.00
カタールリアル 小計		81,659		5,837,033.10 (189,294,983)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,692	102.72	481,962.24
	SASOL LTD	28,083	396.00	11,120,868.00
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,864	127.26	746,252.64
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,192	360.37	1,150,301.04
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	18,220	129.18	2,353,659.60
	ASSORE LTD	1,860	152.93	284,449.80
	GOLD FIELDS LTD	42,564	66.93	2,848,808.52
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	28,016	75.69	2,120,531.04
	KUMBA IRON ORE LTD	3,983	227.23	905,057.09
	NAMPAK LTD	36,108	41.00	1,480,428.00
	PPC LIMITED	18,299	24.17	442,286.83
	SAPPI LIMITED	32,518	43.00	1,398,274.00
	BARLOWORLD LTD	12,333	87.05	1,073,587.65
	BIDVEST GROUP LTD	14,415	294.20	4,240,893.00
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	102,736	59.00	6,061,424.00
	TSOGO SUN HOLDINGS LTD	25,358	28.00	710,024.00
	NASPERS LTD-N SHS	19,263	1,582.00	30,474,066.00
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	8,083	184.57	1,491,879.31
	MR PRICE GROUP LTD	10,287	241.40	2,483,281.80
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	10,886	146.00	1,589,356.00
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	14,930	75.23	1,123,183.90
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	49,258	79.80	3,930,788.40
	MASSMART HOLDINGS LTD	8,389	164.50	1,379,990.50
	PICK N PAY STORES LTD	18,180	52.79	959,722.20
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	20,394	175.50	3,579,147.00
	SPAR GROUP LIMITED/THE	7,827	170.79	1,336,773.33
TIGER BRANDS LTD	8,940	358.25	3,202,755.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	44,372	41.15	1,825,907.80	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	16,218	113.00	1,832,634.00	

	NETCARE LTD	38,762	37.55	1,455,513.10	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	15,556	417.13	6,488,874.28	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	15,144	181.18	2,743,789.92	
	NEDBANK GROUP LTD	9,337	239.50	2,236,211.50	
	STANDARD BANK GROUP LTD	60,073	140.75	8,455,274.75	
	BRAIT SE	20,371	73.88	1,505,009.48	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,104	103.01	1,040,813.04	
	FIRSTSTRAND LTD	154,098	47.74	7,356,638.52	
	INVESTEC LTD	14,580	95.81	1,396,909.80	
	REMGRO LTD	24,417	260.95	6,371,616.15	
	RMB HOLDINGS LTD	31,762	61.15	1,942,246.30	
	DISCOVERY LIMITED	12,965	117.73	1,526,369.45	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	122.25	761,128.50	
	MMI HOLDINGS LTD	37,032	29.62	1,096,887.84	
	RMI HOLDINGS	40,408	41.96	1,695,519.68	
	SANLAM LTD	91,699	64.20	5,887,075.80	
	MTN GROUP LTD	81,887	204.12	16,714,774.44	
	TELKOM SA LTD	11,353	68.80	781,086.40	
	VODACOM GROUP	16,028	129.45	2,074,824.60	
	南アフリカランド 小計	1,307,070		164,158,856.24 (1,662,929,213)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ARABTEC HOLDING CO	66,132	3.10	205,009.20	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	113,289	7.54	854,199.06	
	DUBAI ISLAMIC BANK	31,286	6.85	214,309.10	
	FIRST GULF BANK	27,750	17.00	471,750.00	
	NATIONAL BANK OF ABU DHABI	40,984	13.60	557,382.40	
	DUBAI FINANCIAL MARKET	127,997	2.10	268,793.70	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	271,482	2.69	730,286.58	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	127,265	7.61	968,486.65	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	806,185		4,270,216.69 (137,287,466)	
	合 計	99,916,344		21,736,052,988 (21,736,052,988)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	メキシコペ ソ	CONTROLADORA COML MEXIC-UB	17,400	827,022.00	
		メキシコペソ 小計	17,400	827,022.00 (6,665,797)	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,500	581,490.00	

	ブラジルレアル	KLABIN SA-UNIT	19,000	263,910.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	2,918	33,994.70	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	148,275.00	
		VIA VAREJO SA	6,400	124,672.00	
ブラジルレアル 小計			81,318	1,152,341.70	(51,244,635)
投資信託受益証券合計			98,718	57,910,432	(57,910,432)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	114,600	5,044,692.00	
		メキシコペソ 小計	114,600	5,044,692.00	(40,660,217)
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	66,858	211,939.86	
		トルコリラ 小計	66,858	211,939.86	(10,698,724)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	102,326	2,874,337.34	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	128,699	1,420,836.96	
		RESILIENT PROPERTY INCOME	13,040	1,106,313.60	
南アフリカランド 小計		244,065	5,401,487.90	(54,717,072)	
投資証券合計			425,523	106,076,013	(106,076,013)
合計				163,986,445	(163,986,445)

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 25銘柄	100.0%			4.6%
メキシコペソ	株式 28銘柄	95.5%			4.6%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.6%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.2%
ブラジルレアル	株式 65銘柄	97.3%			8.3%
	投資信託受 益証券 5銘柄		2.7%		0.2%
チリペソ	株式 20銘柄	100.0%			1.3%
コロンビアペソ	株式 6銘柄	100.0%			0.2%

ユーロ	株式	5銘柄	100.0%			0.4%
トルコリラ	株式	24銘柄	97.4%			1.8%
	投資証券	1銘柄			2.6%	0.0%
チェココルナ	株式	2銘柄	100.0%			0.2%
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	24銘柄	100.0%			1.5%
香港ドル	株式	141銘柄	100.0%			21.8%
マレーシアリングギット	株式	42銘柄	100.0%			3.5%
タイバーツ	株式	32銘柄	100.0%			2.5%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%			1.3%
インドネシアルピア	株式	30銘柄	100.0%			2.7%
韓国ウォン	株式	106銘柄	100.0%			15.0%
新台湾ドル	株式	101銘柄	100.0%			12.5%
インドルピー	株式	63銘柄	100.0%			7.7%
カタールリアル	株式	10銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	48銘柄	96.8%			7.6%
	投資証券	3銘柄			3.2%	0.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	8銘柄	100.0%			0.6%

(注)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。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(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。

2【ファンドの現況】

【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

【純資産額計算書】

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	399,534,969円
負債総額	1,475,986円
純資産総額（ - ）	398,058,983円
発行済口数	334,309,015口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1907円
（1万口当たり純資産額）	（11,907円）

（参考）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	313,405,694,792円
負債総額	8,407,353,281円
純資産総額（ - ）	304,998,341,511円
発行済口数	230,594,615,278口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3227円
（1万口当たり純資産額）	（13,227円）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	155,104,652,652円
負債総額	572,203,682円
純資産総額（ - ）	154,532,448,970円
発行済口数	121,295,010,671口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2740円
（1万口当たり純資産額）	（12,740円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	225,016,205,189円
負債総額	459,224,263円
純資産総額（ - ）	224,556,980,926円
発行済口数	79,238,055,289口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8340円
（1万口当たり純資産額）	（28,340円）

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	250,408,179,899円
負債総額	2,588,626,829円
純資産総額（ - ）	247,819,553,070円
発行済口数	118,709,687,246口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0876円
（1万口当たり純資産額）	（20,876円）

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	14,014,166,581円
負債総額	5,154,872円
純資産総額（ - ）	14,009,011,709円
発行済口数	8,054,047,579口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7394円
（1万口当たり純資産額）	（17,394円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年 2月27日現在）

資産総額	24,188,009,477円
負債総額	8,069,284円
純資産総額（ - ）	24,179,940,193円
発行済口数	9,267,232,003口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6092円
（1万口当たり純資産額）	（26,092円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成27年 2月27日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の経路を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、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については、運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

さらに、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・評価します。この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。

委託会社の機構は平成27年 4月20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】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成27年2月27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	405	6,383,183
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	10	65,007
単位型公社債投資信託	0	0
合計	415	6,448,190

3【委託会社等の経理状況】

- (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。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

なお、財務諸表及び中間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、第28期事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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。
- また、第29期事業年度の中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		8,192,444		10,457,599
前払費用		81,751		114,325
未収委託者報酬		2,210,605		2,735,763
未収運用受託報酬		31,051		15,268
未収入金		676		-
繰延税金資産		61,743		144,183
その他		19,263		3,448
流動資産合計		10,597,535		13,470,589
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	79,281	1	67,359
器具備品	1	103,209	1	87,378
有形固定資産合計		182,491		154,737
無形固定資産				
ソフトウェア		168,561		203,360
その他		1,770		4,686
無形固定資産合計		170,332		208,046
投資その他の資産				
投資有価証券		47,112		69,583
長期前払費用		-		34,773
長期貸付金		31,838		28,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		-		117,743
その他		633		553
貸倒引当金		31,838		28,838
投資その他の資産合計		72,746		247,653
固定資産合計		425,570		610,437
資産合計		11,023,105		14,081,027

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
預り金		19,992		13,353
未払金		1,459,757		1,723,999

未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469
未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
固定負債		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
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	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
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	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	19,128,296	22,773,831
運用受託報酬	94,659	55,511
営業収益合計	19,222,955	22,829,342
営業費用		
支払手数料	9,030,246	10,451,296
広告宣伝費	73,287	76,961

公告費	2,244	-
調査費	4,132,154	5,091,105
調査費	207,030	259,236
委託調査費	3,922,394	4,830,390
図書費	2,729	1,479
営業雑経費	1,294,879	1,264,334
通信費	21,905	17,246
印刷費	330,735	327,214
協会費	21,939	22,524
諸会費	757	773
情報機器関連費	874,151	837,859
その他営業雑経費	45,391	58,716
営業費用合計	14,532,812	16,883,698
一般管理費		
給料	2,259,238	2,201,964
役員報酬	78,205	102,330
給料・手当	1,967,177	1,846,450
賞与	213,855	253,183
退職給付費用	64,787	72,029
役員退職慰労金	-	1,070
福利費	190,716	207,122
交際費	879	2,758
旅費交通費	45,160	45,973
租税公課	25,420	42,862
不動産賃借料	129,096	130,938
寄付金	-	3,385
減価償却費	129,966	119,445
諸経費	1 257,947	1 219,615
一般管理費合計	3,103,213	3,047,165
営業利益	1,586,929	2,898,479

（単位：千
円）

	前事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	当事業年度 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1 23,222
支払補償費	-	14,648
投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112

営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-
特別損失		
統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	-	-
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
合併による増加		350,000	350,000
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	350,000	350,000
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638
当期末残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			706,344
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）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496
当期末残高	4,998	4,998	8,546,410

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000

当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

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。

(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、当事業年度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、当事業年度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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
建 物	23,594	千円	35,517	千円
器具備品	235,212	"	188,630	"
計	258,807	"	224,147	"

(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24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
	諸経費	97,199	千円	73,276
長期前払費用償却	-	"	23,222	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28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26年6月30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とお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26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30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。

当事業年度（平成26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	10,457,599	10,457,599	-
(2) 未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	-
(4) 未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
(5) 未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

(*) 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、並びに(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、並びに(5) 未払法人税等

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) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（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	-	-	-

当事業年度（平成26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	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			

その他	45,159	37,315	7,843
小計	45,159	37,315	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	1,952	2,030	77
小計	1,952	2,030	77
合計	47,112	39,345	7,766

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	61,633	57,226	4,406
小計	61,633	57,226	4,406
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	7,950	8,138	188
小計	7,950	8,138	188
合計	69,583	65,365	4,218

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

（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25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
（1）退職給付債務	268,531	313,992

(2) 退職給付引当金	268,531	313,992
-------------	---------	---------

(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。

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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(1) 退職給付費用	64,787	72,029

(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。

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13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

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25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	16,142	千円	102,368	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347	"	10,277	"
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285	"	33,736	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	"	111,906	"
減価償却超過額	1,067	"	-	"
その他	11,680	"	13,094	"
繰延税金資産 小計	171,228	"	271,384	"
評価性引当額	11,347	"	-	"
繰延税金資産 合計	159,881	"	271,384	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	"	1,503	"
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	"	7,953	"
繰延税金負債 合計	401,693	"	9,457	"
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	"	261,926	"

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

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。

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

(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

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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）	3,172,592千円

（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	議決権等の所有 （被所有） 割合（%）	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
----	----------------	-----	-------------------	---------------	---------------------------	-------------------	-------	--------------	----	--------------

親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	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。

当事業年度(自平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	会社等の名称 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	議決権等の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	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	73,276	-	-

(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	議決権等の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 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	議決権等の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用 の支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

(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。

(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）

当事業年度（平成26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、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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49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金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	10,736,816
未収委託者報酬	3,496,458
繰延税金資産	85,943
その他流動資産	131,122
流動資産合計	14,450,340

固定資産

有形固定資産		
建物	1	62,410
器具備品	1	116,552
有形固定資産合計		178,963
無形固定資産		193,575
投資その他の資産		
投資有価証券		58,781
長期貸付金		27,338
会員権		25,000
その他の投資		20,550
繰延税金資産		122,025
貸倒引当金		27,338
投資その他の資産合計		226,357
固定資産合計		598,896
資産合計		15,049,237
負債の部		
流動負債		
未払金		2,137,961
未払費用		69,372
未払法人税等		681,263
賞与引当金		93,828
その他流動負債	2	185,306
流動負債合計		3,167,732
固定負債		
退職給付引当金		328,845
資産除去債務		12,599
固定負債合計		341,445
負債合計		3,509,177

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		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		65,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		8,721,600

利益剰余金合計	10,887,100
株主資本合計	11,537,100
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,959
評価・換算差額等合計	2,959
純資産合計	11,540,060
負債・純資産合計	15,049,237

中間損益計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			13,096,655
運用受託報酬			8,732
営業収益合計			13,105,387
営業費用			9,550,999
一般管理費	1		1,514,728
営業利益			2,039,658
営業外収益	2		9,123
営業外費用			24,340
経常利益			2,024,441
税引前中間純利益			2,024,441
法人税、住民税及び事業税			668,312
法人税等調整額			53,822
法人税等合計			722,134
中間純利益			1,302,307

中間株主資本等変動計算書

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,302,307	1,302,307	1,302,307
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,269,307	1,272,307	1,272,307
当中間期末残高	65,500	2,100,000	8,721,600	10,887,100	11,537,100

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,302,307
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	244	244	244
当中間期変動額合計	244	244	1,272,551
当中間期末残高	2,959	2,959	11,540,060

重要な会計方針

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
その他有価証券	
時価のあるもの	中間会計期間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。)
時価のないもの	移動平均法による原価法によっております。
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。

(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、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

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中間会計期間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、当事業年度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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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

(中間貸借対照表関係)

第29期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 40,466千円
	器具備品 187,949千円
	計 228,416千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 22,111千円
	無形固定資産 36,655千円
2	営業外収益の主要項目

受取利息

3,339千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

1. 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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

(リ-ス取引関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

平成26年9月30日における貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	10,736,816	10,736,816	-
(2)未収委託者報酬	3,496,458	3,496,458	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,778	58,778	-
(4)未払金	(2,137,961)	(2,137,961)	-

(*)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及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（3）投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成26年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	56,226	51,514	4,711
小計	56,226	51,514	4,711
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,552	2,665	113
小計	2,552	2,665	113
合計	58,778	54,180	4,598

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

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）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1．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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

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

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)	1,703,639千円
J-REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	1,456,865千円

(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)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(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)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,846,686円70銭
1株当たり中間純利益	434,102円38銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益	1,302,307千円
普通株式に係る中間純利益	1,302,307千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】**(1)定款の変更**

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年 4月20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】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1)受託会社**

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年9月末日現在）	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
高木証券株式会社	11,069	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成26年 2月17日	有価証券届出書の訂正届出書
平成26年 4月 3日	有価証券届出書
平成26年 4月 3日	有価証券報告書
平成26年 4月 3日	有価証券届出書の訂正届出書
平成26年10月20日	有価証券届出書
平成26年10月20日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成26年 6月11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 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25年4月1日から平成26年3月31日までの第28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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年3月20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」に掲げられている世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の平成26年1月21日から平成27年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の平成27年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月4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 白川 芳樹 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 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26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。