

【表紙】

| | |
|--------------------------------------|-------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成22年7月26日 |
| 【発行者名】 | 日興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 ビリー・ウェード・ワイルダー |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区赤坂九丁目7番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 犬伏 貴民 |
| 【電話番号】 | 03-6447-6147 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】 | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】 | 継続募集額 上限5兆円 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので、平成22年1月26日付をもって提出しました有価証券届出書（平成22年4月21日付で有価証券届出書の訂正届出書を提出済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

下線部__は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

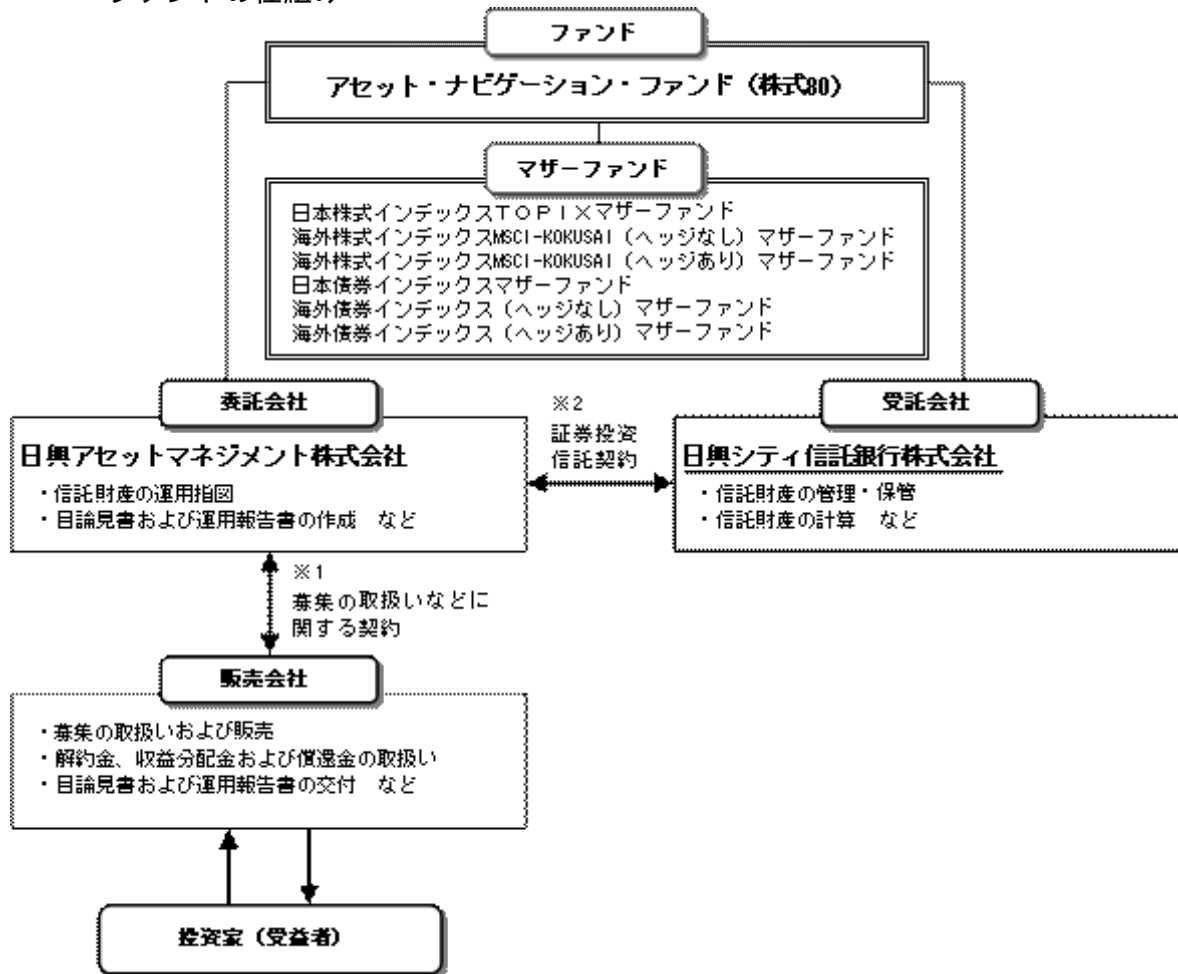
第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(2) ファンドの仕組み

<訂正前>

ファンドの仕組み



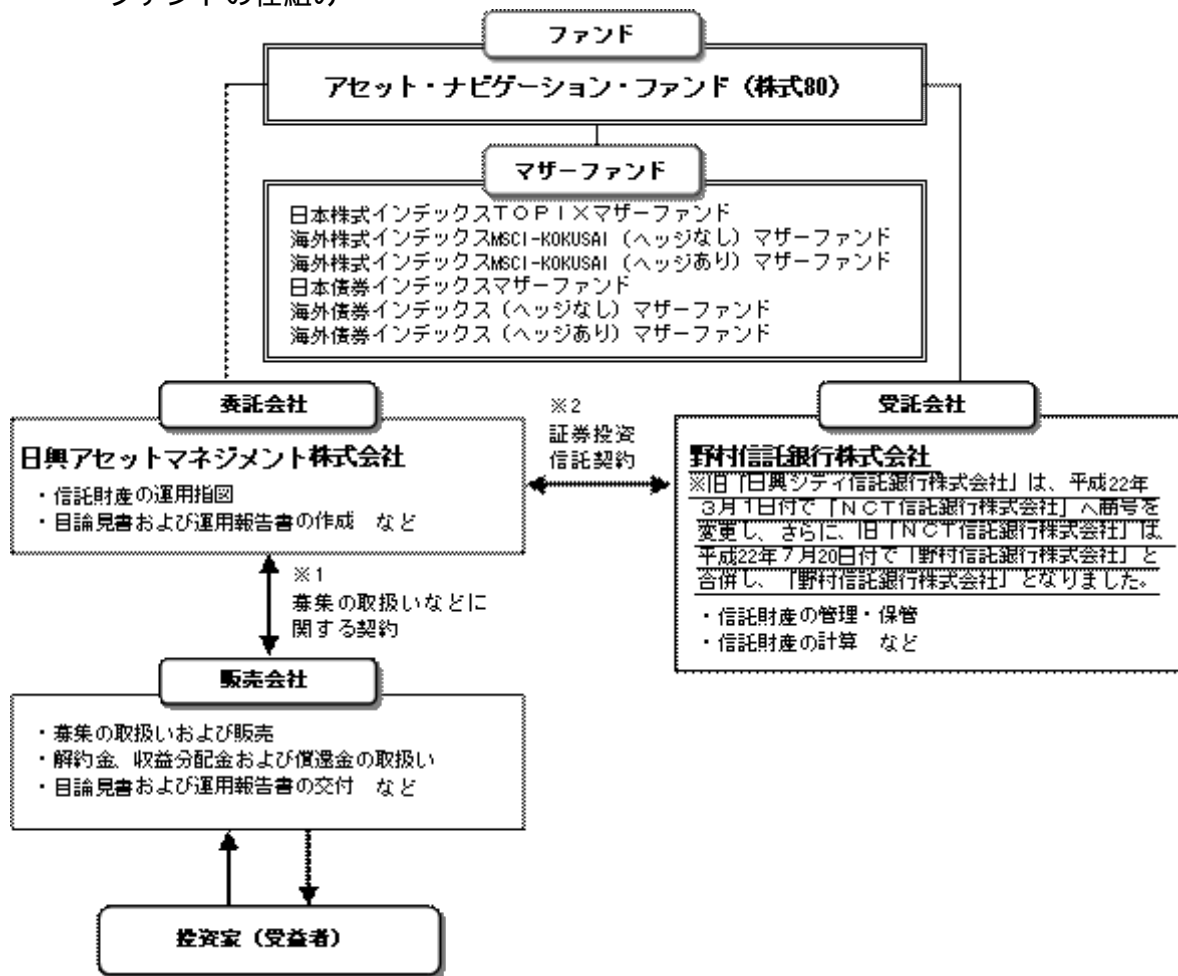
(略)

委託会社の概況（平成21年12月末現在）

(略)

< 訂正後 >

ファンドの仕組み



(略)

委託会社の概況（平成22年5月末現在）

(略)

2 投資方針

(2) 投資対象

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

<訂正前>

| その他 | |
|------|---------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 日興シティ信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

<訂正後>

| その他 | |
|------|------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

<海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド>

<訂正前>

| その他 | |
|------|---------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 日興シティ信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

<訂正後>

| その他 | |
|------|------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

<海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド>

<訂正前>

| その他 | |
|------|---------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 日興シティ信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

<訂正後>

| その他 | |
|------|------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

< 日本債券インデックスマザーファンド >

< 訂正前 >

| その他 | |
|------|---------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 日興シティ信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

< 訂正後 >

| その他 | |
|------|------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

< 訂正前 >

| その他 | |
|------|---------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 日興シティ信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

< 訂正後 >

| その他 | |
|------|------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

< 訂正前 >

| その他 | |
|------|---------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 日興シティ信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

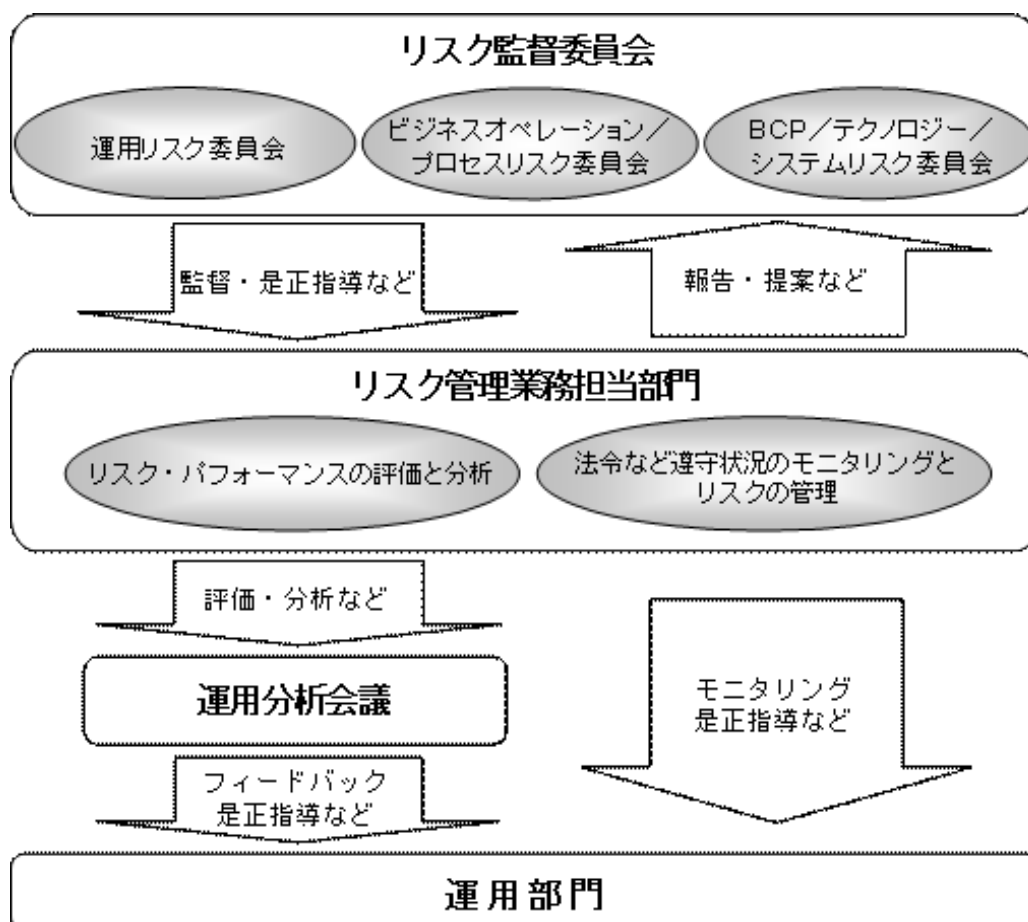
< 訂正後 >

| その他 | |
|------|------------|
| 委託会社 | (略) |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | (略) |
| 決算日 | (略) |

3 投資リスク

(2) リスク管理体制

<訂正前>



全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。本委員会およびその部門別委員会においては、各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

リスク・パフォーマンスの評価と分析

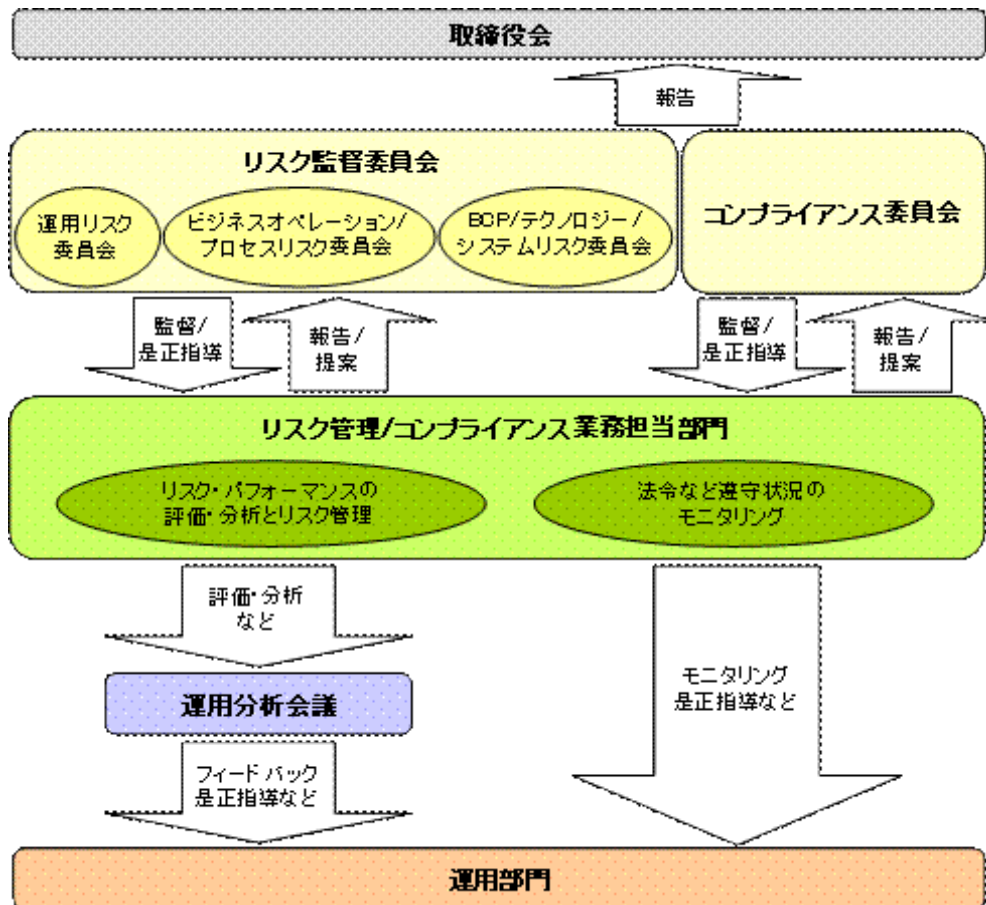
ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果を運用分析会議に報告し、問題点については運用部門に原因の究明と是正指導を行ないます。

法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

法令・諸規則、信託約款などの遵守状況とリスク管理状況のモニタリングを行ないます。その結果についてはリスク監督委員会、あるいはその部門別委員会へ報告され運用部門に是正指導を行なうなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

**全社的なリスク管理**

当社は運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。本委員会およびその部門別委員会においては、各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果については運用分析会議に報告し、リスク管理状況についてはリスク監督委員会あるいはその部門別委員会へ報告され、問題点については運用部門に原因の究明と是正指導を行ないます。

法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス関連部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成22年7月26日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(千円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 204,207 | 94.86 |
| 日本 | 204,207 | 94.86 |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 11,054 | 5.14 |
| 純資産総額 | 215,261 | 100.00 |

(3) 運用実績

純資産の推移

| | 1口当たりの純資産額(円) | 純資産総額(百万円) |
|------------|---------------|------------|
| 2009年5月末日 | 0.7560 | 205 |
| 2009年6月末日 | 0.7753 | 212 |
| 2009年7月末日 | 0.7966 | 220 |
| 2009年8月末日 | 0.8101 | 224 |
| 2009年9月末日 | 0.7885 | 219 |
| 2009年10月末日 | 0.7820 | 219 |
| 2009年11月末日 | 0.7517 | 212 |
| 2009年12月末日 | 0.7975 | 226 |
| 2010年1月末日 | 0.7836 | 218 |
| 2010年2月末日 | 0.7806 | 217 |
| 2010年3月末日 | 0.8443 | 235 |
| 2010年4月末日 | 0.8519 | 236 |
| 2010年5月末日 | 0.7762 | 215 |

分配の推移

| | 1口当たり税込み分配金(円) |
|-----------------------------------|----------------|
| 第1計算期間(1999年10月29日～2000年10月26日) | 0 |
| 第2計算期間(2000年10月27日～2001年10月26日) | 0 |
| 第3計算期間(2001年10月27日～2002年10月28日) | 0 |
| 第4計算期間(2002年10月29日～2003年10月27日) | 0 |
| 第5計算期間(2003年10月28日～2004年10月26日) | 0 |
| 第6計算期間(2004年10月27日～2005年10月26日) | 0 |
| 第7計算期間(2005年10月27日～2006年10月26日) | 0.0010 |
| 第8計算期間(2006年10月27日～2007年10月26日) | 0.0010 |
| 第9計算期間(2007年10月27日～2008年10月27日) | 0 |
| 第10計算期間(2008年10月28日～2009年10月26日) | 0 |
| 第11中間計算期間(2009年10月27日～2010年4月26日) | - |

収益率の推移

| | 収益率（％） |
|-----------------------------------|--------|
| 第1計算期間（1999年10月29日～2000年10月26日） | 4.91 |
| 第2計算期間（2000年10月27日～2001年10月26日） | 14.55 |
| 第3計算期間（2001年10月27日～2002年10月28日） | 15.18 |
| 第4計算期間（2002年10月29日～2003年10月27日） | 13.48 |
| 第5計算期間（2003年10月28日～2004年10月26日） | 5.40 |
| 第6計算期間（2004年10月27日～2005年10月26日） | 22.72 |
| 第7計算期間（2005年10月27日～2006年10月26日） | 15.63 |
| 第8計算期間（2006年10月27日～2007年10月26日） | 0.35 |
| 第9計算期間（2007年10月27日～2008年10月27日） | 44.10 |
| 第10計算期間（2008年10月28日～2009年10月26日） | 22.11 |
| 第11中間計算期間（2009年10月27日～2010年4月26日） | 8.23 |

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額、以下、「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（参考）日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価していません。

（1）投資状況

| 投資資産の種類 | 時価（千円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|------------|---------|
| 株式 | 31,331,472 | 98.76 |
| 日本 | 31,331,472 | 98.76 |
| 有価証券指数等先物取引(買建) | (386,540) | (1.22) |
| 日本 | (386,540) | (1.22) |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 393,352 | 1.24 |
| 純資産総額 | 31,724,824 | 100.00 |

（参考）海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価していません。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（1）投資状況

| 投資資産の種類 | 時価（千円） | 投資比率（％） |
|----------|------------|---------|
| 株式 | 65,415,309 | 95.37 |
| アメリカ | 36,555,885 | 53.30 |
| イギリス | 6,738,060 | 9.82 |
| カナダ | 3,736,039 | 5.45 |
| フランス | 3,038,789 | 4.43 |
| スイス | 2,659,441 | 3.88 |
| オーストラリア | 2,565,663 | 3.74 |
| ドイツ | 2,520,281 | 3.67 |
| スペイン | 1,151,777 | 1.68 |
| イタリア | 898,871 | 1.31 |
| スウェーデン | 890,536 | 1.30 |
| オランダ | 834,704 | 1.22 |
| 香港 | 793,663 | 1.16 |
| シンガポール | 495,306 | 0.72 |
| フィンランド | 370,054 | 0.54 |
| アイルランド | 344,048 | 0.50 |
| デンマーク | 325,048 | 0.47 |
| ベルギー | 315,653 | 0.46 |
| イスラエル | 245,944 | 0.36 |
| ノルウェー | 213,832 | 0.31 |
| ルクセンブルグ | 175,653 | 0.26 |
| ジャージー | 109,273 | 0.16 |
| オーストリア | 106,769 | 0.16 |
| ギリシャ | 93,916 | 0.14 |
| バミューダ諸島 | 86,608 | 0.13 |
| ポルトガル | 75,664 | 0.11 |
| ケイマン諸島 | 28,678 | 0.04 |
| ニュージーランド | 21,738 | 0.03 |
| ガーンジー島 | 10,979 | 0.02 |
| キプロス | 9,789 | 0.01 |
| 中国 | 2,637 | 0.00 |
| 投資証券 | 1,048,674 | 1.53 |
| アメリカ | 573,550 | 0.84 |
| オーストラリア | 168,779 | 0.25 |
| カナダ | 98,100 | 0.14 |

| | | |
|-----------------------|-------------|--------|
| イギリス | 88,913 | 0.13 |
| フランス | 74,621 | 0.11 |
| 香港 | 20,622 | 0.03 |
| シンガポール | 14,465 | 0.02 |
| オランダ | 9,620 | 0.01 |
| 有価証券指数等先物取引(買建) | (2,408,337) | (3.51) |
| アメリカ | (1,565,407) | (2.28) |
| ドイツ | (842,930) | (1.23) |
| 為替予約取引(買建) | (2,162,091) | (3.15) |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 2,123,529 | 3.10 |
| 純資産総額 | 68,587,514 | 100.00 |

(参考) 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり) マザーファンド

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(1) 投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(千円) | 投資比率(%) |
|-----------------|----------|---------|
| 株式 | 995,460 | 90.71 |
| アメリカ | 554,145 | 50.50 |
| イギリス | 101,199 | 9.22 |
| カナダ | 56,490 | 5.15 |
| フランス | 46,621 | 4.25 |
| スイス | 40,782 | 3.72 |
| オーストラリア | 40,373 | 3.68 |
| ドイツ | 39,004 | 3.55 |
| スペイン | 17,779 | 1.62 |
| イタリア | 14,814 | 1.35 |
| オランダ | 12,915 | 1.18 |
| スウェーデン | 12,761 | 1.16 |
| 香港 | 11,538 | 1.05 |
| シンガポール | 7,864 | 0.72 |
| フィンランド | 5,941 | 0.54 |
| アイルランド | 5,836 | 0.53 |
| ベルギー | 5,553 | 0.51 |
| デンマーク | 4,813 | 0.44 |
| ノルウェー | 4,645 | 0.42 |
| イスラエル | 2,809 | 0.26 |
| ジャージー | 2,305 | 0.21 |
| ルクセンブルグ | 2,186 | 0.20 |
| オーストリア | 1,826 | 0.17 |
| バミューダ諸島 | 1,509 | 0.14 |
| ギリシャ | 1,286 | 0.12 |
| ポルトガル | 457 | 0.04 |
| 投資証券 | 15,219 | 1.39 |
| アメリカ | 9,149 | 0.83 |
| カナダ | 2,138 | 0.19 |
| オーストラリア | 1,308 | 0.12 |
| フランス | 1,072 | 0.10 |
| イギリス | 895 | 0.08 |
| 香港 | 654 | 0.06 |
| 有価証券指数等先物取引(買建) | (84,100) | (7.66) |
| アメリカ | (54,665) | (4.98) |
| ドイツ | (29,435) | (2.68) |
| 為替予約取引(買建) | (2,902) | (0.26) |

| | | |
|-----------------------|-------------|---------|
| 為替予約取引(売建) | (1,031,004) | (93.95) |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 86,677 | 7.90 |
| 純資産総額 | 1,097,357 | 100.00 |

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(千円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------------|---------|
| 国債証券 | 29,221,682 | 75.17 |
| 日本 | 29,221,682 | 75.17 |
| 地方債証券 | 2,510,467 | 6.46 |
| 日本 | 2,510,467 | 6.46 |
| 特殊債券 | 3,738,894 | 9.62 |
| 日本 | 3,738,894 | 9.62 |
| 社債券 | 3,222,268 | 8.29 |
| 日本 | 3,122,281 | 8.03 |
| ドイツ | 99,987 | 0.26 |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 182,031 | 0.47 |
| 純資産総額 | 38,875,342 | 100.00 |

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(1) 投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(千円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-------------|---------|
| 国債証券 | 639,171,662 | 98.65 |
| アメリカ | 252,808,176 | 39.02 |
| イタリア | 64,825,606 | 10.01 |
| ドイツ | 62,643,203 | 9.67 |
| フランス | 60,381,731 | 9.32 |
| イギリス | 46,006,295 | 7.10 |
| スペイン | 27,806,844 | 4.29 |
| カナダ | 18,972,921 | 2.93 |
| ベルギー | 17,644,552 | 2.72 |
| オランダ | 15,932,433 | 2.46 |
| ギリシャ | 12,626,994 | 1.95 |
| オーストリア | 11,069,964 | 1.71 |
| ポルトガル | 6,393,056 | 0.99 |
| アイルランド | 6,000,563 | 0.93 |
| デンマーク | 5,648,917 | 0.87 |
| ポーランド | 5,607,192 | 0.87 |
| オーストラリア | 5,517,227 | 0.85 |
| スウェーデン | 4,075,354 | 0.63 |
| スイス | 3,598,970 | 0.56 |
| フィンランド | 3,471,630 | 0.54 |
| マレーシア | 3,430,498 | 0.53 |
| シンガポール | 2,514,363 | 0.39 |
| ノルウェー | 2,195,162 | 0.34 |
| 為替予約取引(売建) | (263,915) | (0.04) |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 8,750,779 | 1.35 |
| 純資産総額 | 647,922,442 | 100.00 |

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド

以下の運用状況は平成22年5月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。
- ・為替予約取引の金額は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(1) 投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(千円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|--------------|---------|
| 国債証券 | 28,752,538 | 92.97 |
| アメリカ | 11,379,148 | 36.80 |
| イタリア | 2,912,633 | 9.42 |
| ドイツ | 2,786,410 | 9.01 |
| フランス | 2,691,243 | 8.70 |
| イギリス | 2,070,592 | 6.70 |
| スペイン | 1,276,854 | 4.13 |
| カナダ | 841,330 | 2.72 |
| ベルギー | 799,054 | 2.58 |
| オランダ | 700,550 | 2.27 |
| ギリシャ | 495,382 | 1.60 |
| オーストリア | 485,987 | 1.57 |
| ポルトガル | 308,679 | 1.00 |
| オーストラリア | 275,622 | 0.89 |
| アイルランド | 270,327 | 0.87 |
| デンマーク | 265,574 | 0.86 |
| ポーランド | 251,458 | 0.81 |
| スウェーデン | 206,981 | 0.67 |
| マレーシア | 183,497 | 0.59 |
| フィンランド | 163,938 | 0.53 |
| スイス | 162,612 | 0.53 |
| シンガポール | 117,392 | 0.38 |
| ノルウェー | 107,264 | 0.35 |
| 為替予約取引(売建) | (29,880,396) | (96.62) |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | 2,172,773 | 7.03 |
| 純資産総額 | 30,925,311 | 100.00 |

第2【財務ハイライト情報】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 財務ハイライト情報」を以下の内容に更新・追加するとともに、「中間財務諸表」を追加します。

<更新・追加>

- (1) 以下の情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」および「中間財務諸表」から抜粋して記載したものです。
- (2) 「財務諸表」および「中間財務諸表」については、あらた監査法人による監査および中間監査を受けております。また、当該監査法人による監査報告書および中間監査報告書は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」に記載されている「財務諸表」および「中間財務諸表」に添付されています。

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）

1 中間貸借対照表

（単位：円）

| 科目 | 期別 | 前中間計算期間末 平成21年4月27日現在 | 当中間計算期間末 平成22年4月26日現在 |
|-----------------|----|--------------------------|--------------------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 9,521,225 | 11,882,334 |
| 親投資信託受益証券 | | 183,077,785 | 227,558,654 |
| 流動資産合計 | | 192,599,010 | 239,440,988 |
| 資産合計 | | 192,599,010 | 239,440,988 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払受託者報酬 | | 47,120 | 58,579 |
| 未払委託者報酬 | | 670,040 | 832,709 |
| その他未払費用 | | 7,487 | 9,323 |
| 流動負債合計 | | 724,647 | 900,611 |
| 負債合計 | | 724,647 | 900,611 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 269,159,013 | 277,464,102 |
| 剰余金 | | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | | 77,284,650 | 38,923,725 |
| （分配準備積立金） | | 31,809,579 | 29,065,689 |
| 元本等合計 | | 191,874,363 | 238,540,377 |
| 純資産合計 | | 191,874,363 | 238,540,377 |
| 負債純資産合計 | | 192,599,010 | 239,440,988 |

2 中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

| 科目 | 期別 | 前中間計算期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 当中間計算期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|-------------------------|----|--|--|
| | | 金額 | 金額 |
| 営業収益 | | | |
| 受取利息 | | 7,081 | 5,398 |
| 有価証券売買等損益 | | 16,962,447 | 19,256,779 |
| 営業収益合計 | | 16,969,528 | 19,262,177 |
| 営業費用 | | | |
| 受託者報酬 | | 47,120 | 58,579 |
| 委託者報酬 | | 670,040 | 832,709 |
| その他費用 | | 7,487 | 9,323 |
| 営業費用合計 | | 724,647 | 900,611 |
| 営業利益 | | 16,244,881 | 18,361,566 |
| 経常利益 | | 16,244,881 | 18,361,566 |
| 中間純利益 | | 16,244,881 | 18,361,566 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | | 259,286 | 300,241 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 88,316,614 | 57,640,569 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 2,202,875 | 3,890,994 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 2,202,875 | 3,890,994 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | - | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 7,156,506 | 3,235,475 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | - |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 7,156,506 | 3,235,475 |
| 分配金 | | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | | 77,284,650 | 38,923,725 |

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 項目 | 期別 | 前中間計算期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 当中間計算期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|-----------------|----|--|--|
| 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当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

第三部【ファンドの詳細情報】

第4【ファンドの経理状況】

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」を以下の内容に更新・追加するとともに、「中間財務諸表」を追加します。

<更新・追加>

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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、その後の改正を含みます。）並びに同規則第38条の3及び第57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、その後の改正を含みます。）に基づき作成しております。
なお、中間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、前中間計算期間（平成20年10月28日から平成21年4月27日まで）及び当中間計算期間（平成21年10月27日から平成22年4月26日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）

（１）中間貸借対照表

（単位：円）

| 科目 | 期別 | 前中間計算期間末 平成21年4月27日現在 | 当中間計算期間末 平成22年4月26日現在 |
|-----------------|----|--------------------------|--------------------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 9,521,225 | 11,882,334 |
| 親投資信託受益証券 | | 183,077,785 | 227,558,654 |
| 流動資産合計 | | 192,599,010 | 239,440,988 |
| 資産合計 | | 192,599,010 | 239,440,988 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払受託者報酬 | | 47,120 | 58,579 |
| 未払委託者報酬 | | 670,040 | 832,709 |
| その他未払費用 | | 7,487 | 9,323 |
| 流動負債合計 | | 724,647 | 900,611 |
| 負債合計 | | 724,647 | 900,611 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 269,159,013 | 277,464,102 |
| 剰余金 | | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | | 77,284,650 | 38,923,725 |
| （分配準備積立金） | | 31,809,579 | 29,065,689 |
| 元本等合計 | | 191,874,363 | 238,540,377 |
| 純資産合計 | | 191,874,363 | 238,540,377 |
| 負債純資産合計 | | 192,599,010 | 239,440,988 |

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位:円)

| 科目 | 期別 | 前中間計算期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 当中間計算期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|-------------------------|----|--|--|
| | | 金額 | 金額 |
| 営業収益 | | | |
| 受取利息 | | 7,081 | 5,398 |
| 有価証券売買等損益 | | 16,962,447 | 19,256,779 |
| 営業収益合計 | | 16,969,528 | 19,262,177 |
| 営業費用 | | | |
| 受託者報酬 | | 47,120 | 58,579 |
| 委託者報酬 | | 670,040 | 832,709 |
| その他費用 | | 7,487 | 9,323 |
| 営業費用合計 | | 724,647 | 900,611 |
| 営業利益 | | 16,244,881 | 18,361,566 |
| 経常利益 | | 16,244,881 | 18,361,566 |
| 中間純利益 | | 16,244,881 | 18,361,566 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | | 259,286 | 300,241 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | 88,316,614 | 57,640,569 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 2,202,875 | 3,890,994 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 2,202,875 | 3,890,994 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | - | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 7,156,506 | 3,235,475 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | - |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 7,156,506 | 3,235,475 |
| 分配金 | | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 77,284,650 | 38,923,725 |

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 期 別 | 前中間計算期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 当中間計算期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|-----------------|--|--|
| 項 目 | | |
| 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当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 前中間計算期間末 平成21年4月27日現在 | | 当中間計算期間末 平成22年4月26日現在 | |
|--------------------------|---|--------------------------|---|
| 1. | 期首元本額 252,685,723 円 | 1. | 期首元本額 280,243,375 円 |
| | 期中追加設定元本額 22,782,346 円 | | 期中追加設定元本額 15,919,200 円 |
| | 期中解約元本額 6,309,056 円 | | 期中解約元本額 18,698,473 円 |
| 2. | 中間計算期間末日における 受益権の総数 269,159,013 口 | 2. | 中間計算期間末日における 受益権の総数 277,464,102 口 |
| 3. | 元本の欠損 中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は77,284,650円であります。 | 3. | 元本の欠損 中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は38,923,725円であります。 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前中間計算期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 当中間計算期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|--|--|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(1口当たり情報)

| 前中間計算期間末 平成21年4月27日現在 | | 当中間計算期間末 平成22年4月26日現在 | |
|--------------------------|-----------|--------------------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 0.7129 円 | 1口当たり純資産額 | 0.8597 円 |
| (1万口当たり純資産額) | (7,129 円) | (1万口当たり純資産額) | (8,597 円) |

(参考)

当ファンドは「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

1. 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| 科目 | 対象年月日 | 平成21年4月27日現在 | 平成22年4月26日現在 |
|-------------|-------|----------------|----------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 78,165,378 | 56,671,797 |
| 株式 | | 28,808,283,950 | 34,962,766,840 |
| 派生商品評価勘定 | | 13,203,284 | 14,525,069 |
| 未収入金 | | - | 44,646,538 |
| 未収配当金 | | 337,433,490 | 312,508,889 |
| 流動資産合計 | | 29,237,086,102 | 35,391,119,133 |
| 資産合計 | | 29,237,086,102 | 35,391,119,133 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 85,644 | - |
| 前受金 | | 12,250,000 | 8,990,000 |
| 未払解約金 | | 10,892,869 | 20,912,416 |
| 流動負債合計 | | 23,228,513 | 29,902,416 |
| 負債合計 | | 23,228,513 | 29,902,416 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 47,473,736,393 | 47,213,079,455 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 18,259,878,804 | 11,851,862,738 |
| 元本等合計 | | 29,213,857,589 | 35,361,216,717 |
| 純資産合計 | | 29,213,857,589 | 35,361,216,717 |
| 負債純資産合計 | | 29,237,086,102 | 35,391,119,133 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|-----------------------|---|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>デリバティブ取引</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> | <p>デリバティブ取引</p> <p>同左</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 平成21年4月27日現在 | | | 平成22年4月26日現在 | | |
|--------------|---|------------------|--------------|--------------------------------------|---|
| 1. | 期首 | 平成20年10月28日 | 1. | 期首 | 平成21年10月27日 |
| | 期首元本額 | 46,500,062,239 円 | | 期首元本額 | 47,548,685,652 円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 9,159,979,795 円 | | 期首からの追加設定元本額 | 3,287,892,784 円 |
| | 期首からの解約元本額 | 8,186,305,641 円 | | 期首からの解約元本額 | 3,623,498,981 円 |
| | 平成21年4月27日現在の元本の内訳 | | | 平成22年4月26日現在の元本の内訳 | |
| | D C インデックスバランス （株式20） | 148,772,846 円 | | D C インデックスバランス （株式20） | 146,802,724 円 |
| | D C インデックスバランス （株式40） | 512,438,610 円 | | D C インデックスバランス （株式40） | 537,841,214 円 |
| | D C インデックスバランス （株式60） | 970,195,602 円 | | D C インデックスバランス （株式60） | 1,062,741,710 円 |
| | D C インデックスバランス （株式80） | 1,047,576,195 円 | | D C インデックスバランス （株式80） | 1,212,351,634 円 |
| | インデックスファンド日本株 式（D C 専用） | 809,292,745 円 | | インデックスファンド日本 株式（D C 専用） | 771,481,374 円 |
| | 世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月 分配型 | 24,260,430,508 円 | | 世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月 分配型 | 23,842,980,303 円 |
| | グローバルコレクション（債 券/株式/不動産・資源・食 料等）隔月分配型 | 27,768,764 円 | | 全世界株式債券ファンド （日本・先進国・新興国） 毎月分配型 | 16,377,855 円 |
| | 全世界株式債券ファンド（日 本・先進国・新興国）毎月分 配型 | 11,858,882 円 | | 日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（株 式資産） | 227,027,600 円 |
| | 日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（株式 資産） | 213,122,047 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式80） | 193,046,181 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式80） | 188,186,424 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式60） | 170,456,761 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式60） | 169,412,641 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式40） | 280,168,307 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式40） | 309,928,815 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式20） | 352,377,701 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式20） | 452,426,062 円 | | 国際分散型ファンド40（適 格機関投資家向け） | 14,651,162,320 円 |
| | 国際分散型ファンド40（適格 機関投資家向け） | 14,386,720,550 円 | | 世界アセットバランスファ ンド40（適格機関投資家向 け） | 95,157,097 円 |
| | 世界アセットバランスファン ド40（適格機関投資家向け） | 105,381,897 円 | | 世界アセットバランスファ ンド25（適格機関投資家向 け） | 128,010,222 円 |
| | 世界アセットバランスファン ド25（適格機関投資家向け） | 183,410,596 円 | | 3資産バランスファンド （適格機関投資家向け） | 137,012,017 円 |
| | 3資産バランスファンド（適 格機関投資家向け） | 524,858,592 円 | | グローバルバランスファン ド35（適格機関投資家向 け） | 82,517,110 円 |
| | グローバルバランスファンド 35（適格機関投資家向け） | 69,057,189 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20） | 300,185,446 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 20） | 304,115,033 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40） | 798,809,690 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 40） | 795,890,224 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60） | 1,087,624,973 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 60） | 995,755,837 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80） | 1,118,947,216 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 80） | 987,136,334 円 | | （合計） | 47,213,079,455 円 |
| | （合計） | 47,473,736,393 円 | | 2. | 本報告書における開示対象 ファンドの中間計算期間末 日における当該親投資信託 の受益権の総数 |
| 2. | 本報告書における開示対象 ファンドの中間計算期間末 日における当該親投資信託の受 益権の総数 | 47,473,736,393 円 | | 3. | 元本の欠損 |
| 3. | 元本の欠損 | | | | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は11,851,862,738円であります。 |

| | |
|--|--|
| <p>貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は18,259,878,804円であります。</p> <p>4. 担保資産</p> <p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券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>株式 252,237,000 円</p> | <p>4. 担保資産</p> <p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券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>株式 258,510,000 円</p> |
|--|--|

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|------|----------------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 396,410,000 | - | 409,640,000 | 13,230,000 |
| | | 合計 | 396,410,000 | - | 409,640,000 |

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成22年4月26日現在 | | | |
|------|----------------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 374,000,000 | - | 388,635,000 | 14,635,000 |
| | | 合計 | 374,000,000 | - | 388,635,000 |

(注)時価の算定方法

1. 計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(1口当たり情報)

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|--------------|-----------|--------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 0.6154 円 | 1口当たり純資産額 | 0.7490 円 |
| (1万口当たり純資産額) | (6,154 円) | (1万口当たり純資産額) | (7,490 円) |

2. 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

| 科目 | 対象年月日 | 平成21年4月27日現在 | 平成22年4月26日現在 |
|-------------|-------|----------------|----------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 329,423,857 | 345,047,147 |
| コール・ローン | | 358,335,852 | 1,583,543,891 |
| 株式 | | 56,552,075,746 | 75,112,591,121 |
| 投資証券 | | 737,309,363 | 1,139,155,001 |
| 派生商品評価勘定 | | 53,610,615 | 127,830,742 |
| 未収入金 | | 2,312,148 | 3,364,002 |
| 未収配当金 | | 121,806,927 | 96,120,516 |
| 差入委託証拠金 | | 121,281,315 | 518,694,139 |
| 流動資産合計 | | 58,276,155,823 | 78,926,346,559 |
| 資産合計 | | 58,276,155,823 | 78,926,346,559 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 5,822,392 | 4,807,166 |
| 未払金 | | 19,599,382 | 21,585 |
| 未払解約金 | | 940,221 | 59,680,242 |
| 流動負債合計 | | 26,361,995 | 64,508,993 |
| 負債合計 | | 26,361,995 | 64,508,993 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 84,263,040,032 | 81,036,799,077 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 26,013,246,204 | 2,174,961,511 |
| 元本等合計 | | 58,249,793,828 | 78,861,837,566 |
| 純資産合計 | | 58,249,793,828 | 78,861,837,566 |
| 負債純資産合計 | | 58,276,155,823 | 78,926,346,559 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|----------------------------|--|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>(1)デリバティブ取引 同左</p> <p>(2)為替予約取引 同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 平成21年4月27日現在 | | | 平成22年4月26日現在 | | |
|--------------|--|------------------|--------------|---|------------------|
| 1. | 期首 | 平成20年10月28日 | 1. | 期首 | 平成21年10月27日 |
| | 期首元本額 | 77,820,389,733 円 | | 期首元本額 | 81,113,705,231 円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 15,813,675,042 円 | | 期首からの追加設定元本額 | 4,244,908,323 円 |
| | 期首からの解約元本額 | 9,371,024,743 円 | | 期首からの解約元本額 | 4,321,814,477 円 |
| | 平成21年4月27日現在の元本の内訳 | | | 平成22年4月26日現在の元本の内訳 | |
| | インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用） | 8,101,628,461 円 | | インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用） | 10,186,941,498 円 |
| | DCインデックスバランス（株式20） | 45,258,076 円 | | DCインデックスバランス（株式20） | 38,231,893 円 |
| | DCインデックスバランス（株式40） | 151,357,390 円 | | DCインデックスバランス（株式40） | 140,648,478 円 |
| | DCインデックスバランス（株式60） | 284,759,589 円 | | DCインデックスバランス（株式60） | 273,711,626 円 |
| | DCインデックスバランス（株式80） | 316,970,652 円 | | DCインデックスバランス（株式80） | 311,245,925 円 |
| | 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 | 22,078,727,792 円 | | 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 | 18,583,450,085 円 |
| | 日興五大陸株式ファンド | 22,941,570,526 円 | | 日興五大陸株式ファンド | 24,086,244,610 円 |
| | グローバルコレクション（債券/株式/不動産・資源・食料等）隔月分配型 | 24,411,671 円 | | 全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 | 83,972,277 円 |
| | 全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 | 82,945,577 円 | | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産） | 230,860,510 円 |
| | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産） | 235,957,638 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 24,994,241 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 28,970,075 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 21,950,658 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 25,288,722 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 36,017,573 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 46,130,264 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 45,576,394 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 68,211,878 円 | | 国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け） | 19,070,281,462 円 |
| | 国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け） | 21,631,343,655 円 | | 3資産バランスファンド（適格機関投資家向け） | 105,896,984 円 |
| | 3資産バランスファンド（適格機関投資家向け） | 461,625,339 円 | | グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け） | 26,002,447 円 |
| | グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け） | 25,140,146 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 38,752,802 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 45,884,975 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 103,320,431 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 118,397,186 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 141,560,519 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 151,006,231 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 144,726,193 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 151,175,272 円 | | 年金積立 インデックスファンド海外株式（ヘッジなし） | 7,342,412,471 円 |
| | 年金積立 インデックスファンド海外株式（ヘッジなし） | 7,246,278,917 円 | | （合計） | 81,036,799,077 円 |
| | （合計） | 84,263,040,032 円 | 2. | 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 81,036,799,077 口 |
| 2. | 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 84,263,040,032 口 | 3. | 元本の欠損 | |
| 3. | 元本の欠損 | | | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,174,961,511円であります。 | |
| | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は26,013,246,204円であります。 | | | | |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|------|----------------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 916,500,180 | - | 969,107,573 | 52,607,393 |
| | | 合計 | 916,500,180 | - | 969,107,573 |

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成22年4月26日現在 | | | |
|------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 2,503,181,316 | - | 2,601,704,898 | 98,523,582 |
| | | 合計 | 2,503,181,316 | - | 2,601,704,898 |

(注)時価の算定方法

1. 計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（通貨関連）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|-----------|--------|--------------|-------|-------------|-----------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 571,579,040 | - | 566,759,870 | 4,819,170 |
| | アメリカドル | 335,948,163 | - | 330,852,230 | 5,095,933 |
| | ユーロ | 235,630,877 | - | 235,907,640 | 276,763 |
| | 合計 | 571,579,040 | - | 566,759,870 | 4,819,170 |

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 平成22年4月26日現在 | | | |
|-----------|--------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,702,953,516 | - | 1,727,453,510 | 24,499,994 |
| | アメリカドル | 1,004,003,184 | - | 1,025,519,650 | 21,516,466 |
| | ユーロ | 698,950,332 | - | 701,933,860 | 2,983,528 |
| | 合計 | 1,702,953,516 | - | 1,727,453,510 | 24,499,994 |

（注）時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

（1口当たり情報）

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|--------------|-----------|--------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 0.6913 円 | 1口当たり純資産額 | 0.9732 円 |
| （1万口当たり純資産額） | （6,913 円） | （1万口当たり純資産額） | （9,732 円） |

3. 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| 科目 | 対象年月日 | 平成21年4月27日現在 | 平成22年4月26日現在 |
|-------------|-------|---------------|---------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 2,820,991 | 6,085,921 |
| コール・ローン | | 52,411,242 | 19,510,232 |
| 株式 | | 919,219,929 | 1,161,949,877 |
| 投資証券 | | 10,057,888 | 15,280,565 |
| 派生商品評価勘定 | | 11,587,981 | 934,629 |
| 未収入金 | | 49,641 | 53,059 |
| 未収配当金 | | 2,012,188 | 1,501,013 |
| 差入委託証拠金 | | 36,909,637 | 26,119,065 |
| 流動資産合計 | | 1,035,069,497 | 1,231,434,361 |
| 資産合計 | | 1,035,069,497 | 1,231,434,361 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 19,107,996 | 46,041,726 |
| 未払金 | | 8,233,704 | 39,258 |
| 未払解約金 | | 615,502 | 3,006,712 |
| 流動負債合計 | | 27,957,202 | 49,087,696 |
| 負債合計 | | 27,957,202 | 49,087,696 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 1,836,854,755 | 1,540,256,737 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 829,742,460 | 357,910,072 |
| 元本等合計 | | 1,007,112,295 | 1,182,346,665 |
| 純資産合計 | | 1,007,112,295 | 1,182,346,665 |
| 負債純資産合計 | | 1,035,069,497 | 1,231,434,361 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 | 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|----------------------------|------|---|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | | 株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 | 株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 (3) 時価が入手できなかった有価証券 同左 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | | (1)デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。 | (1)デリバティブ取引 同左 (2)為替予約取引 同左 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | | 外貨建取引等の処理基準 「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条及び第61条にしたがって処理しております。 | 外貨建取引等の処理基準 同左 |

[次へ](#)

(貸借対照表に関する注記)

| 平成21年4月27日現在 | | | 平成22年4月26日現在 | | |
|--------------|--|-----------------|--------------|--|-----------------|
| 1. | 期首 | 平成20年10月28日 | 1. | 期首 | 平成21年10月27日 |
| | 期首元本額 | 2,111,169,382 円 | | 期首元本額 | 1,614,863,595 円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 590,824,972 円 | | 期首からの追加設定元本額 | 98,657,793 円 |
| | 期首からの解約元本額 | 865,139,599 円 | | 期首からの解約元本額 | 173,264,651 円 |
| | 平成21年4月27日現在の元本の内訳 | | | 平成22年4月26日現在の元本の内訳 | |
| | インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用) | 30,648,960 円 | | インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用) | 36,520,857 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 36,639,053 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 30,919,474 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 32,869,539 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 27,460,415 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 59,925,061 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 45,181,166 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 87,537,970 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 57,095,093 円 |
| | 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 367,192,329 円 | | 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 280,256,092 円 |
| | 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 319,407,633 円 | | 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 188,493,877 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 59,242,851 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 48,516,767 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 153,612,386 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 130,065,607 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 192,105,726 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 176,268,692 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 192,614,259 円 | | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 179,471,973 円 |
| | 年金積立 インデックスファンド海外株式(ヘッジあり) | 305,058,988 円 | | 年金積立 インデックスファンド海外株式(ヘッジあり) | 340,006,724 円 |
| | (合計) | 1,836,854,755 円 | | (合計) | 1,540,256,737 円 |
| 2. | 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 1,836,854,755 口 | 2. | 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 1,540,256,737 口 |
| 3. | 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は829,742,460円であります。 | | 3. | 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は357,910,072円であります。 | |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|------|----------------|--------------|-------|------------|-----------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 63,832,251 | - | 66,835,005 | 3,002,754 |
| | 合計 | 63,832,251 | - | 66,835,005 | 3,002,754 |

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成22年4月26日現在 | | | |
|------|----------------|--------------|-------|------------|---------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 26,083,589 | - | 26,914,189 | 830,600 |
| | 合計 | 26,083,589 | - | 26,914,189 | 830,600 |

(注)時価の算定方法

1. 計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定します。
2. 先物取引の残高表示は契約額ベースです。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（通貨関連）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|-----------|--------------|--------------|-------|-------------|------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | 950,561,931 | - | 961,084,700 | 10,522,769 |
| | アメリカドル | 545,034,587 | - | 540,933,350 | 4,101,237 |
| | カナダドル | 43,919,688 | - | 45,031,060 | 1,111,372 |
| | オーストラリアドル | 30,850,526 | - | 32,751,290 | 1,900,764 |
| | イギリスポンド | 89,731,543 | - | 96,732,140 | 7,000,597 |
| | スイスフラン | 36,708,741 | - | 37,527,400 | 818,659 |
| | 香港ドル | 10,790,195 | - | 10,829,150 | 38,955 |
| | スウェーデンクローナ | 9,203,125 | - | 9,766,280 | 563,155 |
| | シンガポールドル | 5,068,377 | - | 5,128,440 | 60,063 |
| | デンマーククローネ | 3,955,214 | - | 4,008,280 | 53,066 |
| | ノルウェークローネ | 4,396,110 | - | 4,514,110 | 118,000 |
| | ユーロ | 170,903,825 | - | 173,863,200 | 2,959,375 |
| | 合計 | 950,561,931 | - | 961,084,700 | 10,522,769 |

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 平成22年4月26日現在 | | | |
|-----------|--------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | 1,156,454,873 | - | 1,202,392,570 | 45,937,697 |
| | アメリカドル | 640,763,572 | - | 665,692,650 | 24,929,078 |
| | カナダドル | 59,675,487 | - | 63,992,480 | 4,316,993 |
| | オーストラリアドル | 48,548,511 | - | 51,322,280 | 2,773,769 |
| | イギリスポンド | 119,450,800 | - | 126,534,340 | 7,083,540 |
| | スイスフラン | 45,467,556 | - | 46,823,730 | 1,356,174 |
| | 香港ドル | 13,065,601 | - | 13,523,960 | 458,359 |
| | スウェーデンクローナ | 15,801,068 | - | 16,322,290 | 521,222 |
| | シンガポールドル | 7,368,743 | - | 7,784,770 | 416,027 |
| | デンマーククローネ | 4,746,594 | - | 4,808,160 | 61,566 |
| | ノルウェークローネ | 6,147,111 | - | 6,385,530 | 238,419 |
| | ユーロ | 195,419,830 | - | 199,202,380 | 3,782,550 |
| | 合計 | 1,156,454,873 | - | 1,202,392,570 | 45,937,697 |

（注）時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

（1口当たり情報）

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|--------------|-----------|--------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 0.5483 円 | 1口当たり純資産額 | 0.7676 円 |
| （1万口当たり純資産額） | （5,483 円） | （1万口当たり純資産額） | （7,676 円） |

4. 「日本債券インデックスマザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| 科目 | 対象年月日 | 平成21年4月27日現在 | 平成22年4月26日現在 |
|-------------|-------|----------------|----------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 187,587,040 | 9,041,205 |
| 国債証券 | | 25,100,049,856 | 29,975,051,550 |
| 地方債証券 | | 2,033,920,000 | 2,500,842,000 |
| 特殊債券 | | 3,759,827,000 | 3,833,390,000 |
| 社債券 | | 3,089,512,000 | 3,215,284,000 |
| 未収入金 | | - | 10,021,400 |
| 未収利息 | | 105,888,638 | 122,138,215 |
| 前払費用 | | 10,849,999 | 5,421,613 |
| 流動資産合計 | | 34,287,634,533 | 39,671,189,983 |
| 資産合計 | | 34,287,634,533 | 39,671,189,983 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 168,455,820 | - |
| 未払解約金 | | 13,317,909 | 17,384,854 |
| 流動負債合計 | | 181,773,729 | 17,384,854 |
| 負債合計 | | 181,773,729 | 17,384,854 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 29,594,518,055 | 33,400,095,109 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 4,511,342,749 | 6,253,710,020 |
| 元本等合計 | | 34,105,860,804 | 39,653,805,129 |
| 純資産合計 | | 34,105,860,804 | 39,653,805,129 |
| 負債純資産合計 | | 34,287,634,533 | 39,671,189,983 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|-----------------|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 平成21年4月27日現在 | | | 平成22年4月26日現在 | | |
|--------------|--|------------------|--------------|---|------------------|
| 1. | 期首 | 平成20年10月28日 | 1. | 期首 | 平成21年10月27日 |
| | 期首元本額 | 30,966,595,295 円 | | 期首元本額 | 32,047,347,137 円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 6,265,967,842 円 | | 期首からの追加設定元本額 | 2,539,508,517 円 |
| | 期首からの解約元本額 | 7,638,045,082 円 | | 期首からの解約元本額 | 1,186,760,545 円 |
| | 平成21年4月27日現在の元本の内訳 | | | 平成22年4月26日現在の元本の内訳 | |
| | D C インデックスバランス （株式20） | 334,326,260 円 | | D C インデックスバランス （株式20） | 384,088,030 円 |
| | D C インデックスバランス （株式40） | 411,441,867 円 | | D C インデックスバランス （株式40） | 504,763,841 円 |
| | D C インデックスバランス （株式60） | 286,536,619 円 | | D C インデックスバランス （株式60） | 368,845,419 円 |
| | D C インデックスバランス （株式80） | 45,457,711 円 | | D C インデックスバランス （株式80） | 62,560,129 円 |
| | インデックスファンド日本債券 （D C 専用） | 837,869,391 円 | | インデックスファンド日本債券 （D C 専用） | 977,323,601 円 |
| | 世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月 分配型 | 12,801,786,368 円 | | 世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月 分配型 | 14,033,079,354 円 |
| | グローバルコレクション（債券 /株式/不動産・資源・食 料等）隔月分配型 | 14,813,266 円 | | 全世界株式債券ファンド （日本・先進国・新興国） 毎月分配型 | 10,139,568 円 |
| | 全世界株式債券ファンド（日 本・先進国・新興国）毎月分 配型 | 6,296,428 円 | | 日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（債 券資産） | 331,334,863 円 |
| | 日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（債券 資産） | 331,412,737 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式80） | 9,755,221 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式80） | 7,855,295 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式60） | 58,774,039 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式60） | 50,489,848 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式40） | 261,541,507 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式40） | 249,230,848 円 | | アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式20） | 951,868,166 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ ファンド（株式20） | 1,021,526,816 円 | | 国際分散型ファンド40（適 格機関投資家向け） | 9,170,771,485 円 |
| | 国際分散型ファンド40（適格 機関投資家向け） | 7,524,344,154 円 | | 世界アセットバランスファ ンド40（適格機関投資家向 け） | 148,194,066 円 |
| | 世界アセットバランスファン ド40（適格機関投資家向け） | 130,077,049 円 | | 世界アセットバランスファ ンド25（適格機関投資家向 け） | 279,106,561 円 |
| | 世界アセットバランスファン ド25（適格機関投資家向け） | 316,765,351 円 | | 3資産バランスファンド （適格機関投資家向け） | 86,271,898 円 |
| | 3資産バランスファンド（適 格機関投資家向け） | 280,002,296 円 | | グローバルバランスファン ド35（適格機関投資家向 け） | 41,235,796 円 |
| | グローバルバランスファンド 35（適格機関投資家向け） | 29,659,237 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20） | 812,999,731 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 20） | 707,351,323 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40） | 751,845,823 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 40） | 641,111,566 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60） | 373,553,899 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 60） | 297,745,688 円 | | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80） | 57,530,149 円 |
| | 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株式 80） | 42,924,125 円 | | 年金積立 インデックスファ ンド日本債券 | 3,627,291,170 円 |
| | 年金積立 インデックスファ ンド日本債券 | 3,150,194,035 円 | | 日本債券インデックスファ ンド（個人型年金向け） | 97,220,793 円 |
| | 日本債券インデックスファン ド（個人型年金向け） | 75,299,777 円 | | （合計） | 33,400,095,109 円 |
| | （合計） | 29,594,518,055 円 | 2. | 本報告書における開示対象 ファンドの中間計算期間末 日における当該親投資信託 の受益権の総数 | 33,400,095,109 円 |

| | |
|--|------------------|
| 2. 本報告書における開示対象 ファンドの中間計算期間末日 における当該親投資信託の受 益権の総数 | 29,594,518,055 口 |
|--|------------------|

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(1口当たり情報)

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|--------------|------------|--------------|------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1524 円 | 1口当たり純資産額 | 1.1872 円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,524 円) | (1万口当たり純資産額) | (11,872 円) |

5. 「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| 科目 | 対象年月日 | 平成21年4月27日現在 | 平成22年4月26日現在 |
|-------------|-------|-----------------|-----------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 354,778,447 | 137,285,042 |
| コール・ローン | | 415,529,408 | 234,594,474 |
| 国債証券 | | 643,179,343,667 | 678,605,727,261 |
| 派生商品評価勘定 | | 15,470 | - |
| 未収利息 | | 9,934,483,571 | 9,918,007,070 |
| 前払費用 | | 677,073,756 | 380,530,895 |
| 流動資産合計 | | 654,561,224,319 | 689,276,144,742 |
| 資産合計 | | 654,561,224,319 | 689,276,144,742 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 2,259,890 | - |
| 未払金 | | 1,011,682,870 | - |
| 未払解約金 | | 858,971 | 171,311,597 |
| 流動負債合計 | | 1,014,801,731 | 171,311,597 |
| 負債合計 | | 1,014,801,731 | 171,311,597 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 426,311,440,411 | 437,750,541,697 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 227,234,982,177 | 251,354,291,448 |
| 元本等合計 | | 653,546,422,588 | 689,104,833,145 |
| 純資産合計 | | 653,546,422,588 | 689,104,833,145 |
| 負債純資産合計 | | 654,561,224,319 | 689,276,144,742 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|----------------------------|---|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>為替予約取引</p> <p>同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|------------------------------------|-------------------|------------------------------|-------------------|
| 1. 期首 | 平成20年10月28日 | 1. 期首 | 平成21年10月27日 |
| 期首元本額 | 444,628,186,777 円 | 期首元本額 | 449,277,081,384 円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 32,214,168,037 円 | 期首からの追加設定元本額 | 6,640,893,807 円 |
| 期首からの解約元本額 | 50,530,914,403 円 | 期首からの解約元本額 | 18,167,433,494 円 |
| 平成21年4月27日現在の元本の内訳 | | 平成22年4月26日現在の元本の内訳 | |
| インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用） | 7,783,147,367 円 | インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用） | 8,411,348,828 円 |
| DCインデックスバランス（株式20） | 38,213,157 円 | DCインデックスバランス（株式20） | 45,370,574 円 |
| DCインデックスバランス（株式40） | 66,314,882 円 | DCインデックスバランス（株式40） | 85,243,941 円 |
| DCインデックスバランス（株式60） | 82,414,682 円 | DCインデックスバランス（株式60） | 111,623,853 円 |
| DCインデックスバランス（株式80） | 67,380,823 円 | DCインデックスバランス（株式80） | 95,212,578 円 |
| 財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 | 227,796,165,103 円 | 財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 | 239,856,717,848 円 |
| 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 | 9,388,430,277 円 | 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 | 10,665,083,765 円 |
| 日興五大陸債券ファンド（毎月分配型） | 161,160,910,635 円 | 日興五大陸債券ファンド（毎月分配型） | 157,591,822,239 円 |
| グローバルコレクション（債券/株式/不動産・資源・食料等）隔月分配型 | 10,592,834 円 | 全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 | 51,542,365 円 |
| 全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 | 36,165,844 円 | 日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用） | 1,537,480,253 円 |
| 日興外国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用） | 1,104,743,129 円 | 財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型 | 2,528,234 円 |
| 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産） | 213,066,703 円 | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産） | 222,618,134 円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 5,868,825 円 | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 7,497,174 円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 7,398,574 円 | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 8,926,166 円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 20,255,878 円 | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 22,083,106 円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 57,877,028 円 | アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 55,459,831 円 |
| 世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け） | 3,473,727,567 円 | 世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け） | 2,855,588,911 円 |
| 国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け） | 1,845,199,877 円 | 国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け） | 2,322,318,348 円 |
| 世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け） | 135,659,204 円 | 世界アセットバランスファンド40（適格機関投資家向け） | 157,489,717 円 |
| 世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け） | 269,649,569 円 | 世界アセットバランスファンド25（適格機関投資家向け） | 242,114,161 円 |
| 3資産バランスファンド（適格機関投資家向け） | 200,149,089 円 | 3資産バランスファンド（適格機関投資家向け） | 64,335,619 円 |
| グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け） | 49,560,985 円 | グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け） | 69,910,985 円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 39,755,907 円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20） | 47,346,004 円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 51,669,502 円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） | 63,091,708 円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 44,551,017 円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60） | 56,863,514 円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 31,733,917 円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80） | 43,729,883 円 |

| | | | | | |
|--|-----------------|---|--|-----------------|---|
| 年金積立 インデックスファン ド海外債券(ヘッジなし) | 12,159,674,976 | 円 | 年金積立 インデックスファン ド海外債券(ヘッジなし) | 12,865,075,269 | 円 |
| 海外債券インデックスファン ド(個人型年金向け) | 171,163,060 | 円 | 海外債券インデックスファン ド(個人型年金向け) | 192,118,689 | 円 |
| (合計) | 426,311,440,411 | 円 | (合計) | 437,750,541,697 | 円 |
| 2. 本報告書における開示対象 ファンドの中間計算期間末日 における当該親投資信託の受 益権の総数 | 426,311,440,411 | 口 | 2. 本報告書における開示対象 ファンドの中間計算期間末 日における当該親投資信託 の受益権の総数 | 437,750,541,697 | 口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|-----------|---------|--------------|-------|-------------|-----------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 706,992,320 | - | 704,747,900 | 2,244,420 |
| | アメリカドル | 242,653,050 | - | 241,455,300 | 1,197,750 |
| | イギリスポンド | 34,756,680 | - | 34,760,600 | 3,920 |
| | ユーロ | 429,582,590 | - | 428,532,000 | 1,050,590 |
| | 合計 | 706,992,320 | - | 704,747,900 | 2,244,420 |

平成22年4月26日現在

該当事項はありません。

（注）時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

（1口当たり情報）

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|--------------|------------|--------------|------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.5330 円 | 1口当たり純資産額 | 1.5742 円 |
| （1万口当たり純資産額） | （15,330 円） | （1万口当たり純資産額） | （15,742 円） |

6. 「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| 科目 | 対象年月日 | 平成21年4月27日現在 | 平成22年4月26日現在 |
|-------------|-------|----------------|----------------|
| | | 金額 | 金額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 預金 | | 24,657,165 | 165,268,110 |
| コール・ローン | | 2,428,921,154 | 1,025,597,815 |
| 国債証券 | | 25,741,198,113 | 32,332,909,005 |
| 派生商品評価勘定 | | 51,927,505 | 1,312,206 |
| 未収利息 | | 375,453,020 | 438,391,421 |
| 前払費用 | | 74,249,670 | 80,046,951 |
| 流動資産合計 | | 28,696,406,627 | 34,043,525,508 |
| 資産合計 | | | |
| | | 28,696,406,627 | 34,043,525,508 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,976,349,261 | 1,347,069,681 |
| 未払金 | | 49,176,680 | - |
| 未払解約金 | | 213,871 | 617,051 |
| 流動負債合計 | | 2,025,739,812 | 1,347,686,732 |
| 負債合計 | | | |
| | | 2,025,739,812 | 1,347,686,732 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | | 22,887,261,789 | 27,474,332,970 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 3,783,405,026 | 5,221,505,806 |
| 元本等合計 | | 26,670,666,815 | 32,695,838,776 |
| 純資産合計 | | | |
| | | 26,670,666,815 | 32,695,838,776 |
| 負債純資産合計 | | | |
| | | 28,696,406,627 | 34,043,525,508 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年4月27日 | 自 平成21年10月27日 至 平成22年4月26日 |
|----------------------------|---|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>為替予約取引</p> <p>同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成21年4月27日現在 | | | 平成22年4月26日現在 | | |
|--------------|---|------------------|--------------|---|------------------|
| 1. | 期首 | 平成20年10月28日 | 1. | 期首 | 平成21年10月27日 |
| | 期首元本額 | 22,771,913,202 円 | | 期首元本額 | 24,087,399,964 円 |
| | 期首からの追加設定元本額 | 4,216,503,650 円 | | 期首からの追加設定元本額 | 3,600,664,810 円 |
| | 期首からの解約元本額 | 4,101,155,063 円 | | 期首からの解約元本額 | 213,731,804 円 |
| | 平成21年4月27日現在の元本の内訳 | | | 平成22年4月26日現在の元本の内訳 | |
| | インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用) | 367,784,652 円 | | インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用) | 401,026,164 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 7,811,128 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 9,684,424 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 10,007,790 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 11,675,380 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 27,399,450 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 28,849,505 円 |
| | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 77,823,114 円 | | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 72,693,528 円 |
| | 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 19,919,906,535 円 | | 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 24,290,114,075 円 |
| | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 53,814,817 円 | | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 62,110,705 円 |
| | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 70,428,429 円 | | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 82,949,158 円 |
| | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 58,887,443 円 | | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 74,092,441 円 |
| | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 42,464,138 円 | | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 57,140,309 円 |
| | 年金積立インデックスファンド海外債券(ヘッジあり) | 2,250,934,293 円 | | 年金積立インデックスファンド海外債券(ヘッジあり) | 2,383,997,281 円 |
| | (合計) | 22,887,261,789 円 | | (合計) | 27,474,332,970 円 |
| 2. | 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 22,887,261,789 円 | 2. | 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 27,474,332,970 円 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成21年4月27日現在 | | | |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | 24,273,647,237 | - | 26,198,086,010 | 1,924,438,773 |
| | アメリカドル | 8,134,622,389 | - | 8,643,247,400 | 508,625,011 |
| | カナダドル | 591,157,351 | - | 641,715,680 | 50,558,329 |
| | オーストラリアドル | 115,957,122 | - | 127,110,740 | 11,153,618 |
| | イギリスポンド | 2,218,891,728 | - | 2,420,658,230 | 201,766,502 |
| | スイスフラン | 186,790,629 | - | 193,328,200 | 6,537,571 |
| | スウェーデンクローナ | 164,144,585 | - | 176,504,840 | 12,360,255 |
| | シンガポールドル | 128,338,993 | - | 131,924,580 | 3,585,587 |
| | マレーシアリングgit | 145,454,915 | - | 151,580,120 | 6,125,205 |
| | デンマーククローネ | 229,447,325 | - | 241,830,060 | 12,382,735 |
| | ノルウェークローネ | 78,530,908 | - | 82,998,530 | 4,467,622 |
| | ポーランドズロチ | 194,982,134 | - | 200,006,720 | 5,024,586 |
| | ユーロ | 12,085,329,158 | - | 13,187,180,910 | 1,101,851,752 |
| | 買建 ユーロ | 28,253,303 | - | 28,270,320 | 17,017 |
| | | 28,253,303 | - | 28,270,320 | 17,017 |
| 合計 | 24,301,900,540 | - | 26,226,356,330 | 1,924,421,756 | |

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 平成22年4月26日現在 | | | |
|-----------|--------------|----------------|-------|----------------|---------------|
| | | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | 31,754,399,755 | - | 33,100,157,230 | 1,345,757,475 |
| | アメリカドル | 11,868,443,458 | - | 12,344,646,330 | 476,202,872 |
| | カナダドル | 876,250,701 | - | 965,977,570 | 89,726,869 |
| | オーストラリアドル | 259,586,912 | - | 276,954,200 | 17,367,288 |
| | イギリスポンド | 2,196,661,686 | - | 2,347,206,080 | 150,544,394 |
| | スイスフラン | 177,273,191 | - | 183,166,520 | 5,893,329 |
| | スウェーデンクローナ | 191,171,914 | - | 200,895,420 | 9,723,506 |
| | シンガポールドル | 116,574,734 | - | 123,176,450 | 6,601,716 |
| | マレーシアリングgit | 177,888,315 | - | 195,389,890 | 17,501,575 |
| | デンマーククローネ | 282,555,382 | - | 290,168,210 | 7,612,828 |
| | ノルウェークローネ | 117,983,692 | - | 123,958,000 | 5,974,308 |
| | ポーランドズロチ | 296,182,983 | - | 304,646,090 | 8,463,107 |
| | ユーロ | 15,193,826,787 | - | 15,743,972,470 | 550,145,683 |
| | 合計 | 31,754,399,755 | - | 33,100,157,230 | 1,345,757,475 |

(注)時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しています。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用います。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

(1口当たり情報)

| 平成21年4月27日現在 | | 平成22年4月26日現在 | |
|--------------|------------|--------------|------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1653 円 | 1口当たり純資産額 | 1.1901 円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,653 円) | (1万口当たり純資産額) | (11,901 円) |

第5【設定及び解約の実績】

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第5 設定及び解約の実績」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

| | 設定数量（口） | 解約数量（口） |
|-----------------------------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間（1999年10月29日～2000年10月26日） | 770,816,417 | 0 |
| 第2計算期間（2000年10月27日～2001年10月26日） | 44,640,606 | 445,937 |
| 第3計算期間（2001年10月27日～2002年10月28日） | 237,700,926 | 16,781,081 |
| 第4計算期間（2002年10月29日～2003年10月27日） | 76,441,992 | 41,919,018 |
| 第5計算期間（2003年10月28日～2004年10月26日） | 109,219,759 | 83,867,439 |
| 第6計算期間（2004年10月27日～2005年10月26日） | 79,716,243 | 905,414,249 |
| 第7計算期間（2005年10月27日～2006年10月26日） | 105,184,984 | 91,974,687 |
| 第8計算期間（2006年10月27日～2007年10月26日） | 54,775,405 | 70,648,230 |
| 第9計算期間（2007年10月27日～2008年10月27日） | 39,696,045 | 54,456,013 |
| 第10計算期間（2008年10月28日～2009年10月26日） | 40,558,097 | 13,000,445 |
| 第11中間計算期間（2009年10月27日～2010年4月26日） | 15,919,200 | 18,698,473 |

（注）第1計算期間の設定数量には、当初設定数量を含みます。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

原届出書の「第四部 特別情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

(1) 資本金の額

| | | |
|------------|----------|-----------------|
| 平成22年5月末現在 | 資本金 | 17,363,045,900円 |
| | 発行可能株式総数 | 220,000,000株 |
| | 発行済株式総数 | 197,012,500株 |

過去5年間における主な資本金の増減

| 年月日 | 変更後(変更前) |
|------------|----------------------------------|
| 平成18年7月6日 | 16,223,228,400円(16,174,272,500円) |
| 平成19年4月13日 | 16,287,728,400円(16,223,228,400円) |
| 平成20年6月23日 | 16,403,045,900円(16,287,728,400円) |
| 平成21年10月1日 | 17,363,045,900円(16,403,045,900円) |

(2) 会社の意思決定機構

・株主総会

取締役・監査役などの選任、定款変更などに係る決議などを行いません。

毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年4月1日から3ヵ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

10名以内の取締役で構成され、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の終結の時までを任期とします。

取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選任します。また、取締役中より取締役会長および取締役社長各1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を選任することができます。

・監査役会

5名以内の監査役で構成され、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の終結の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

(平成22年5月末現在)

(3) 運用の意思決定プロセス

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用に関するリスク・パフォーマンスの評価と分析および法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理については、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第四部 特別情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

- ・「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なうとともに「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）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成22年5月末現在の投資信託などは次の通りです。

| 種 類 | ファンド本数 | 純資産額 (単位：億円) |
|---------|--------|-----------------|
| 投資信託総合計 | 379 | 63,215 |
| 株式投資信託 | 304 | 50,596 |
| 単位型 | 41 | 941 |
| 追加型 | 263 | 49,655 |
| 公社債投資信託 | 75 | 12,618 |
| 単位型 | 58 | 900 |
| 追加型 | 17 | 11,718 |
| 投資法人合計 | 1 | 36 |

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第四部 特別情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

1. 当社の財務諸表は、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の「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条の規定により、改正前の「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）に基づいて、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「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）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

| | 第50期 (平成21年3月31日) | | 第51期 (平成22年3月31日) | |
|------------|----------------------|--------|----------------------|--------|
| 資産の部 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金・預金 | | 27,759 | 3 | 23,445 |
| 前払費用 | | 393 | | 359 |
| 未収入金 | | 3,869 | | 2 |
| 未収委託者報酬 | | 5,506 | | 6,451 |
| 未収収益 | 3 | 582 | 3 | 592 |
| 立替金 | | 222 | | 177 |
| 繰延税金資産 | | 862 | | 1,644 |
| その他 | 2 | 30 | 2 | 30 |
| 流動資産合計 | | 39,226 | | 32,703 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | 1 | 313 | 1 | 134 |
| 器具備品 | 1 | 346 | 1 | 215 |
| 有形固定資産合計 | | 660 | | 350 |
| 無形固定資産 | | | | |
| ソフトウェア | | 73 | | 52 |
| 電話加入権等 | | 21 | | - |
| 無形固定資産合計 | | 94 | | 52 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 1,243 | | 11,021 |
| 関係会社株式 | | 7,719 | | 8,659 |
| 関係会社長期貸付金 | | 60 | | 60 |
| 長期差入保証金 | | 1,037 | | 1,042 |
| 繰延税金資産 | | 1,218 | | 1,031 |
| その他 | | 0 | | - |
| 子会社投資損失引当金 | | 576 | | 576 |
| 投資その他の資産合計 | | 10,702 | | 21,239 |
| 固定資産合計 | | 11,458 | | 21,642 |
| 資産合計 | | 50,684 | | 54,345 |

(単位：百万円)

| | 第50期 (平成21年 3月31日) | | 第51期 (平成22年 3月31日) | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
| 負債の部 | | | | |
| 流動負債 | | | | |
| 預り金 | | 181 | | 645 |
| 未払金 | | 2,811 | | 3,478 |
| 未払収益分配金 | | 7 | | 8 |
| 未払償還金 | | 187 | | 194 |
| 未払手数料 | | 2,391 | 3 | 2,872 |
| その他未払金 | | 225 | | 402 |
| 未払費用 | 3 | 3,701 | 3 | 3,804 |
| 未払法人税等 | | - | | 404 |
| 未払消費税等 | | - | | 129 |
| 賞与引当金 | | 1,821 | | 2,015 |
| 特別賞与引当金 | | - | | 1,204 |
| 役員賞与引当金 | | 191 | | 235 |
| 役員特別賞与引当金 | | - | | 106 |
| その他 | | 16 | | 5 |
| 流動負債合計 | | 8,723 | | 12,028 |
| 固定負債 | | | | |
| 退職給付引当金 | | 612 | | 743 |
| その他 | | 102 | | 102 |
| 固定負債合計 | | 714 | | 846 |
| 負債合計 | | 9,438 | | 12,875 |
| 純資産の部 | | | | |
| 株主資本 | | | | |
| 資本金 | | 16,403 | | 17,363 |
| 資本剰余金 | | | | |
| 資本準備金 | | 4,272 | | 5,220 |
| その他資本剰余金 | | 4 | | 4 |
| 資本剰余金合計 | | 4,277 | | 5,225 |
| 利益剰余金 | | | | |
| その他利益剰余金 | | | | |
| 繰越利益剰余金 | | 20,593 | | 18,814 |
| 利益剰余金合計 | | 20,593 | | 18,814 |
| 自己株式 | | - | | 53 |
| 株主資本合計 | | 41,273 | | 41,349 |
| 評価・換算差額等 | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | | 26 | | 121 |
| 評価・換算差額等合計 | | 26 | | 121 |
| 純資産合計 | | 41,246 | | 41,470 |
| 負債純資産合計 | | 50,684 | | 54,345 |

（ 2 ） 【 損益計算書 】

(単位：百万円)

| | 第50期 (自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日) | 第51期 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日) |
|------------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 56,567 | 49,510 |
| その他営業収益 | 2,962 | 2,788 |
| 営業収益計 | 59,529 | 52,298 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 27,877 | 24,262 |
| 広告宣伝費 | 1,298 | 878 |
| 公告費 | 17 | 11 |
| 調査費 | 12,861 | 11,406 |
| 調査費 | 854 | 699 |
| 委託調査費 | 11,990 | 10,689 |
| 図書費 | 15 | 17 |
| 委託計算費 | 491 | 450 |
| 営業雑経費 | 714 | 585 |
| 通信費 | 190 | 167 |
| 印刷費 | 340 | 310 |
| 協会費 | 49 | 42 |
| 諸会費 | 7 | 6 |
| その他 | 126 | 58 |
| 営業費用計 | 43,260 | 37,594 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 7,124 | 6,920 |
| 役員報酬 | 228 | 239 |
| 役員賞与引当金繰入額 | 191 | 235 |
| 給料・手当 | 4,879 | 4,343 |
| 賞与 | 4 | 86 |
| 賞与引当金繰入額 | 1,821 | 2,015 |
| 交際費 | 79 | 76 |
| 寄付金 | 33 | 55 |
| 旅費交通費 | 264 | 253 |
| 租税公課 | 255 | 225 |
| 不動産賃借料 | 921 | 921 |
| 退職給付費用 | 336 | 315 |
| 退職金 | 14 | 5 |
| 固定資産減価償却費 | 801 | 358 |
| 諸経費 | 2,992 | 2,710 |
| 一般管理費計 | 12,824 | 11,842 |
| 営業利益 | 3,444 | 2,862 |

(単位:百万円)

| | 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | |
|-----------------------|-------------------------------------|-------|-------------------------------------|-------|
| 営業外収益 | | | | |
| 受取利息 | | 2 | | 2 |
| 受取配当金 | 1 | 710 | 1 | 714 |
| 有価証券売却益 | | 160 | | - |
| 有価証券償還益 | | 73 | | 13 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 106 | | 23 |
| その他 | | 122 | | 123 |
| 営業外収益計 | | 1,176 | | 876 |
| 営業外費用 | | | | |
| 支払利息 | | 15 | | 9 |
| 有価証券売却損 | | 51 | | - |
| 有価証券償還損 | | 200 | | - |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | | 129 | | 56 |
| 支払源泉所得税 | | - | | 71 |
| 為替差損 | | - | | 53 |
| 弁護士報酬等 | | 37 | | 37 |
| その他 | | 2 | | 111 |
| 営業外費用計 | | 438 | | 340 |
| 経常利益 | | 4,182 | | 3,397 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 38 | | 84 |
| 特別利益計 | | 38 | | 84 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 226 | | 12 |
| 投資有価証券評価損 | | 569 | | - |
| 関係会社株式評価損 | | 454 | | - |
| 固定資産処分損 | | 0 | | 7 |
| 特別賞与引当金繰入額 | | - | | 3,742 |
| 役員特別賞与引当金繰入額 | | - | | 355 |
| 割増退職金 | | 433 | | 29 |
| その他 | | - | | 246 |
| 特別損失計 | | 1,685 | | 4,393 |
| 税引前当期純利益又は税引前当期純損失() | | 2,535 | | 911 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 273 | | 482 |
| 法人税等調整額 | | 568 | | 697 |
| 法人税等合計 | | 842 | | 214 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 1,693 | | 696 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

| | 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 前期末残高 | 16,287 | 16,403 |
| 当期変動額 | | |
| 新株の発行 | 115 | 960 |
| 当期変動額合計 | 115 | 960 |
| 当期末残高 | 16,403 | 17,363 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | |
| 前期末残高 | 4,157 | 4,272 |
| 当期変動額 | | |
| 新株の発行 | 115 | 948 |
| 当期変動額合計 | 115 | 948 |
| 当期末残高 | 4,272 | 5,220 |
| その他資本剰余金 | | |
| 前期末残高 | 4 | 4 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 4 | 4 |
| 資本剰余金合計 | | |
| 前期末残高 | 4,161 | 4,277 |
| 当期変動額 | | |
| 新株の発行 | 115 | 948 |
| 当期変動額合計 | 115 | 948 |
| 当期末残高 | 4,277 | 5,225 |
| 利益剰余金 | | |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 前期末残高 | 21,660 | 20,593 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 2,760 | 1,082 |
| 当期純利益又は当期純損失 | 1,693 | 696 |
| 当期変動額合計 | 1,067 | 1,779 |
| 当期末残高 | 20,593 | 18,814 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 前期末残高 | 21,660 | 20,593 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 2,760 | 1,082 |
| 当期純利益又は当期純損失 | 1,693 | 696 |
| 当期変動額合計 | 1,067 | 1,779 |
| 当期末残高 | 20,593 | 18,814 |

(単位:百万円)

| | 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|-------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 自己株式 | | |
| 前期末残高 | - | - |
| 当期変動額 | | |
| 自己株式の取得 | - | 223 |
| 自己株式の処分 | - | 170 |
| 当期変動額合計 | - | 53 |
| 当期末残高 | - | 53 |
| 株主資本合計 | | |
| 前期末残高 | 42,109 | 41,273 |
| 当期変動額 | | |
| 新株の発行 | 230 | 1,908 |
| 剰余金の配当 | 2,760 | 1,082 |
| 当期純利益又は当期純損失 | 1,693 | 696 |
| 自己株式の取得 | - | 223 |
| 自己株式の処分 | - | 170 |
| 当期変動額合計 | 836 | 75 |
| 当期末残高 | 41,273 | 41,349 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 前期末残高 | 99 | 26 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 126 | 148 |
| 当期変動額合計 | 126 | 148 |
| 当期末残高 | 26 | 121 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 前期末残高 | 99 | 26 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 126 | 148 |
| 当期変動額合計 | 126 | 148 |
| 当期末残高 | 26 | 121 |
| 純資産合計 | | |
| 前期末残高 | 42,208 | 41,246 |
| 当期変動額 | | |
| 新株の発行 | 230 | 1,908 |
| 剰余金の配当 | 2,760 | 1,082 |
| 当期純利益又は当期純損失 | 1,693 | 696 |
| 自己株式の取得 | - | 223 |
| 自己株式の処分 | - | 170 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 126 | 148 |
| 当期変動額合計 | 962 | 224 |
| 当期末残高 | 41,246 | 41,470 |

重要な会計方針

| | 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|--------------------|--|--|
| 1 資産の評価基準及び評価方法 | (1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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(評価差額は、全部純資産直入 法により処理し、売却原価は、総平 均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 | (1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左 |
| 2 固定資産の減価償却の方 法 | (1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。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。 | (1) 有形固定資産 同左 (2) 無形固定資産 同左 |
| 3 引当金の計上基準 | (1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充て るため、支払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。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てる ため、支払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 従業員の退職給付に備えるため、当 事業年度末における退職給付債務及 び年金資産の見込額に基づき計上し ております。 数理計算上の差異は、各事業年度の 発生時における従業員の平均残存勤 務期間以内の一定の年数(10年)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。 | (1) 賞与引当金 同左 (2) 役員賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左 |

| | 第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|---------------------------|--|---|
| 4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。</p> <p>-</p> <p>-</p> <p>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、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p> | <p>(4) 子会社投資損失引当金 同左</p> <p>(5) 特別賞与引当金 従業員に支給する特別賞与の支払に充てるため、支払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。</p> <p>(6) 役員特別賞与引当金 役員に支給する特別賞与の支払に充てるため、支払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。</p> <p>消費税等の会計処理 同左</p> |

会計方針の変更

| 第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|---------------------------------------|---|
| - | <p>(「退職給付に係る会計基準」の一部改正) 当事業年度より、「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準第19号 平成20年7月31日)を適用しております。これにより退職給付債務の差額が26百万円(増加)発生しておりますが、翌事業年度から費用処理されるため当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。</p> |

注記事項

（貸借対照表関係）

| 第50期 (平成21年3月31日) | 第51期 (平成22年3月31日) |
|---|--|
| <p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 704百万円</p> <p>器具備品 424百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 28百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 272百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務64百万円に対して保証を行っております。</p> | <p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 905百万円</p> <p>器具備品 502百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、NCT信託銀行株式会社に信託しております。なお、日興シティ信託銀行株式会社は平成22年3月1日付でNCT信託銀行株式会社に社名変更を行っております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 10,095百万円</p> <p>未収収益 33百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 4百万円</p> <p>未払費用 256百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務32百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務240百万円に対して保証を行っております。</p> |

（損益計算書関係）

| 第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|--|--|
| <p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 703百万円</p> | <p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 712百万円</p> |

(株主資本等変動計算書関係)

第50期（自平成20年4月1日至平成21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 | 前事業年度末 株式数(株) | 当事業年度 増加株式数(株) | 当事業年度 減少株式数(株) | 当事業年度末 株式数(株) |
|-------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | 184,047,500 | 965,000 | - | 185,012,500 |

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加965,000株は、第三者割当による新株の発行による増加であります。

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 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

| 区分 | 新株予約権の内訳 | 新株予約権の目的となる 株式の種類 | 新株予約権の目的となる株式の数(株) | | | | 当事業年度末残高 (百万円) |
|----------|------------------------|----------------------|--------------------|-------------|-------------|------------|-------------------|
| | | | 前事業 年度末 | 当事業年度 増加 | 当事業年度 減少 | 当事業 年度末 | |
| 提出 会社 | 平成16年度 ストックオプション(1) | 普通株式 | 6,000,000 | - | - | 6,000,000 | - |
| | 平成16年度 ストックオプション(2) | 普通株式 | 6,000,000 | - | - | 6,000,000 | - |
| | 平成16年度 ストックオプション(3) | 普通株式 | 6,000,000 | - | 670,000 | 5,330,000 | - |
| | 平成17年度 ストックオプション | 普通株式 | 3,140,000 | - | 300,000 | 2,840,000 | - |
| | 平成18年度 ストックオプション | 普通株式 | 1,470,000 | - | 150,000 | 1,320,000 | - |
| | 平成19年度 ストックオプション(1) | 普通株式 | 4,140,000 | - | 530,000 | 3,610,000 | - |
| | 平成19年度 ストックオプション(2) | 普通株式 | 30,000 | - | - | 30,000 | - |
| 合計 | | | 26,780,000 | - | 1,650,000 | 25,130,000 | - |

(注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しております。

2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来していません。

3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成20年5月23日 取締役会 | 普通株式 | 2,760 | 15 | 平成20年3月31日 | 平成20年6月10日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度後となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|--------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成21年6月30日 取締役会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 1,082 | 5.85 | 平成21年3月31日 | 平成21年6月30日 |

第51期（自 平成21年4月1日 至 平成22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 | 前事業年度末 株式数(株) | 当事業年度 増加株式数(株) | 当事業年度 減少株式数(株) | 当事業年度末 株式数(株) |
|-------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | 185,012,500 | 12,000,000 | - | 197,012,500 |

(注) 平成21年10月1日、当社は、当社取締役から取得した新株予約権を行使した住友信託銀行株式会社に対し、12,000,000株の普通株式を発行いたしました。

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

| 株式の種類 | 前事業年度末 株式数(株) | 当事業年度 増加株式数(株) | 当事業年度 減少株式数(株) | 当事業年度末 株式数(株) |
|-------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | - | 357,000 | 272,000 | 85,000 |

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

| 区分 | 新株予約権の内訳 | 新株予約権の目的となる株式の種類 | 新株予約権の目的となる株式の数(株) | | | | 当事業年度末残高(百万円) |
|------|--------------------|------------------|--------------------|------------|------------|------------|---------------|
| | | | 前事業年度末 | 当事業年度増加 | 当事業年度減少 | 当事業年度末 | |
| 提出会社 | 平成16年度ストックオプション(1) | 普通株式 | 6,000,000 | - | 6,000,000 | - | - |
| | 平成16年度ストックオプション(2) | 普通株式 | 6,000,000 | - | 6,000,000 | - | - |
| | 平成16年度ストックオプション(3) | 普通株式 | 5,330,000 | - | 5,330,000 | - | - |
| | 平成17年度ストックオプション | 普通株式 | 2,840,000 | - | 2,840,000 | - | - |
| | 平成18年度ストックオプション | 普通株式 | 1,320,000 | - | 1,320,000 | - | - |
| | 平成19年度ストックオプション(1) | 普通株式 | 3,610,000 | - | 3,610,000 | - | - |
| | 平成19年度ストックオプション(2) | 普通株式 | 30,000 | - | 30,000 | - | - |
| | 平成21年度ストックオプション(1) | 普通株式 | - | 19,724,100 | 165,000 | 19,559,100 | - |
| 合計 | | | 25,130,000 | 19,724,100 | 25,295,000 | 19,559,100 | - |

- (注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社へ譲渡され、同日にて同社による行使が行われております。
- 2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、当事業年度中に消却されております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)の増加及び減少は、新株予約権の発行及び失効によるものであります。
- 4 平成21年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|--------------------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成21年6月30日 取締役会 | 普通株式 | 1,082 | 5.85 | 平成21年3月31日 | 平成21年6月30日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度後となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 (百万円) | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|--------------------|-------|-------|-----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成22年5月20日 取締役会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 305 | 1.55 | 平成22年3月31日 | 平成22年6月23日 |

(リース取引関係)

| 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | | | | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | | | |
|-------------------------------------|----------|-------------------|--------|-------------------------------------|--------|-------------------|--------|
| 1 オペレーティング・リース取引 | | | | 1 オペレーティング・リース取引 | | | |
| 解約不能のものに係る未経過リース料 | | 解約不能のものに係る未経過リース料 | | 解約不能のものに係る未経過リース料 | | 解約不能のものに係る未経過リース料 | |
| 1年内 | 906百万円 | 1年内 | 906百万円 | 1年内 | 906百万円 | 1年内 | 906百万円 |
| 1年超 | 942百万円 | 1年超 | 35百万円 | 1年超 | 35百万円 | 1年超 | 35百万円 |
| 合計 | 1,849百万円 | 合計 | 942百万円 | 合計 | 942百万円 | 合計 | 942百万円 |

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

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等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

(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等に係るリスク）の管理

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日（当期の決算日）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、次表に含めておりません（（注）2を参照ください。）。

（単位：百万円）

| | 貸借対照表 計上額() | 時価() | 差額 |
|-----------------------|-----------------|---------|-----|
| (1) 現金及び預金 | 23,445 | 23,445 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 6,451 | 6,451 | - |
| (3) 未収収益 | 592 | 592 | - |
| (4) 投資有価証券 その他有価証券 | 10,873 | 10,873 | - |
| (5) 関係会社株式 子会社株式 | 1,404 | 1,734 | 329 |
| (6) 未払金 | (3,478) | (3,478) | - |
| (7) 未払費用 | (3,804) | (3,804) | - |

()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並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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。

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

これらはほとんど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。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額147百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額4,362百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

| | 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 | 23,445 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 6,451 | - | - | - |
| 未収収益 | 592 | - | - | - |
| 投資有価証券 投資信託 | - | 9,907 | 354 | 448 |
| 合計 | 30,489 | 9,907 | 354 | 448 |

(有価証券関係)

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位:百万円)

| | 種類 | 取得原価 | 貸借対照表計上額 | 差額 |
|----------------------|-----|-------|----------|----|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | 株式 | 7 | 12 | 5 |
| | その他 | 273 | 299 | 25 |
| | 小計 | 280 | 312 | 31 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | その他 | 836 | 759 | 76 |
| | 小計 | 836 | 759 | 76 |
| 合計 | | 1,117 | 1,072 | 45 |

(注) 表中の「取得原価」は減損処理後の帳簿価額であります。当事業年度については、269百万円の減損処理を行っております。減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-------|---------|---------|
| 3,196 | 199 | 278 |

3 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

(単位:百万円)

| | 貸借対照表計上額 |
|-------------|----------|
| 非上場株式 | 121 |
| その他 投資証券 | 50 |
| 合計 | 171 |

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない投資証券につき、投資証券の実質価額の低下を考慮し、50百万円の減損処理を行っております。

4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位:百万円)

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|------------------------|------|---------|----------|------|
| その他有価証券 その他 投資信託 | - | - | 504 | 442 |
| 合計 | - | - | 504 | 442 |

5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位:百万円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------|----------|-----|----|
| 子会社株式 | 500 | 499 | 1 |
| 合計 | 500 | 499 | 1 |

(注) 当事業年度において、時価のある子会社株式につき、時価が著しく下落し回復する見込があると認められないため、404百万円の減損処理を行っております。

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万
円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------|----------|-------|-----|
| 子会社株式 | 1,404 | 1,734 | 329 |
| 合計 | 1,404 | 1,734 | 329 |

(注) 子会社株式（貸借対照表計上額4,362百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、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「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万
円)

| | 種類 | 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 | 株式 | 21 | 7 | 14 |
| | その他 | 9,873 | 9,637 | 235 |
| | 小計 | 9,894 | 9,644 | 250 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | その他 | 979 | 1,024 | 45 |
| | 小計 | 979 | 1,024 | 45 |
| 合計 | | 10,873 | 10,669 | 204 |

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 147百万円）については、市場価格がなく、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。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万
円)

| 種類 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----|-----|---------|---------|
| 株式 | 11 | - | 12 |
| その他 | 230 | 84 | 0 |
| 合計 | 242 | 84 | 12 |

(持分法損益等)

| 第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日) | 第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日) |
|--|--|
| 関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,495 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,019 | 関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,852 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,336 |

（退職給付関係）

| 第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日) | 第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|-------|--------|-----|-------------|-----|---------------|-----|-------------|-----|--------|-----|--------|----|----------|---|------------------|----|-----------------|-----|------------|-----|------------------|--------|-------|------|-----------|------|-----------------|-----|--------|----|---------|-----|---|----------|-----|-------------|-----|---------------|----|-------------|-----|--------|----|--------|----|----------|---|------------------|----|-----------------|-----|------------|-----|------------------|--------|-------|------|-----------|------|-----------------|-----|
| <p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度、キャッシュバラン スプラン型退職金制度、適格退職年金制度及び退職一 時金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td style="text-align: right;">1,429</td></tr> <tr><td>ロ 年金資産</td><td style="text-align: right;">676</td></tr> <tr><td>ハ 未積立退職給付債務</td><td style="text-align: right;">753</td></tr> <tr><td>ニ 未認識数理計算上の差異</td><td style="text-align: right;">141</td></tr> <tr><td>ホ 退職給付引当金残高</td><td style="text-align: right;">612</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 勤務費用</td><td style="text-align: right;">107</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td style="text-align: right;">30</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益</td><td style="text-align: right;">5</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">34</td></tr> <tr><td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td style="text-align: right;">169</td></tr> <tr><td>ヘ 退職給付費用合計</td><td style="text-align: right;">336</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td style="text-align: right;">勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td style="text-align: right;">2.0%</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益率</td><td style="text-align: right;">0.7%</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">10年</td></tr> </table> <p>5 割増退職金に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 流動負債</td><td style="text-align: right;">16</td></tr> <tr><td>ロ 割増退職金</td><td style="text-align: right;">433</td></tr> </table> | イ 退職給付債務 | 1,429 | ロ 年金資産 | 676 | ハ 未積立退職給付債務 | 753 | ニ 未認識数理計算上の差異 | 141 | ホ 退職給付引当金残高 | 612 | イ 勤務費用 | 107 | ロ 利息費用 | 30 | ハ 期待運用収益 | 5 | ニ 数理計算上の差異の費用処理額 | 34 | ホ 確定拠出型企業年金への掛金 | 169 | ヘ 退職給付費用合計 | 336 | イ 退職給付見込額の期間配分方法 | 勤続期間比例 | ロ 割引率 | 2.0% | ハ 期待運用収益率 | 0.7% | ニ 数理計算上の差異の処理年数 | 10年 | イ 流動負債 | 16 | ロ 割増退職金 | 433 | <p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。なお当 社は、当事業年度末に適格退職年金制度を終了して おります。制度終了による影響額は、22百万円の損失で、 内訳は退職給付債務と年金資産の消滅による利益3 百万円及び数理計算上の未認識差異の一括償却によ る損失26百万円であります。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td style="text-align: right;">838</td></tr> <tr><td>ロ 未積立退職給付債務</td><td style="text-align: right;">838</td></tr> <tr><td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td style="text-align: right;">94</td></tr> <tr><td>ニ 退職給付引当金残高</td><td style="text-align: right;">743</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 勤務費用</td><td style="text-align: right;">96</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td style="text-align: right;">28</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益</td><td style="text-align: right;">5</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">33</td></tr> <tr><td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td style="text-align: right;">162</td></tr> <tr><td>ヘ 退職給付費用合計</td><td style="text-align: right;">315</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td style="text-align: right;">勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td style="text-align: right;">1.7%</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益率</td><td style="text-align: right;">0.7%</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">10年</td></tr> </table> | イ 退職給付債務 | 838 | ロ 未積立退職給付債務 | 838 | ハ 未認識数理計算上の差異 | 94 | ニ 退職給付引当金残高 | 743 | イ 勤務費用 | 96 | ロ 利息費用 | 28 | ハ 期待運用収益 | 5 | ニ 数理計算上の差異の費用処理額 | 33 | ホ 確定拠出型企業年金への掛金 | 162 | ヘ 退職給付費用合計 | 315 | イ 退職給付見込額の期間配分方法 | 勤続期間比例 | ロ 割引率 | 1.7% | ハ 期待運用収益率 | 0.7% | ニ 数理計算上の差異の処理年数 | 10年 |
| イ 退職給付債務 | 1,429 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 年金資産 | 676 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ハ 未積立退職給付債務 | 753 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ニ 未認識数理計算上の差異 | 141 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ホ 退職給付引当金残高 | 612 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| イ 勤務費用 | 107 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 利息費用 | 30 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ハ 期待運用収益 | 5 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ニ 数理計算上の差異の費用処理額 | 34 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ホ 確定拠出型企業年金への掛金 | 169 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ヘ 退職給付費用合計 | 336 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| イ 退職給付見込額の期間配分方法 | 勤続期間比例 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 割引率 | 2.0% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ハ 期待運用収益率 | 0.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ニ 数理計算上の差異の処理年数 | 10年 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| イ 流動負債 | 16 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 割増退職金 | 433 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| イ 退職給付債務 | 838 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 未積立退職給付債務 | 838 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ハ 未認識数理計算上の差異 | 94 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ニ 退職給付引当金残高 | 743 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| イ 勤務費用 | 96 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 利息費用 | 28 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ハ 期待運用収益 | 5 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ニ 数理計算上の差異の費用処理額 | 33 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ホ 確定拠出型企業年金への掛金 | 162 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ヘ 退職給付費用合計 | 315 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| イ 退職給付見込額の期間配分方法 | 勤続期間比例 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ロ 割引率 | 1.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ハ 期待運用収益率 | 0.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ニ 数理計算上の差異の処理年数 | 10年 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(ストックオプション等関係)

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

| | 平成16年度ストックオプション(1) | 平成16年度ストックオプション(2) |
|--------------------------|--|--|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社の取締役 1名 | 当社の取締役 1名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 6,070,000株 | 普通株式 6,070,000株 |
| 付与日 | 平成16年8月31日 | 平成16年8月31日 |
| 権利確定条件 | 平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定 | 平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定 |
| 対象勤務期間 | 平成16年8月31日から平成19年3月23日まで | 平成16年8月31日から平成19年7月7日まで |
| 権利行使期間 | 平成16年8月31日から平成26年3月24日まで | 平成16年8月31日から平成26年7月8日まで |
| | 平成16年度ストックオプション(3) | 平成17年度ストックオプション |
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の取締役・従業員 97名 | 当社の従業員及び関係会社の取締役・従業員 147名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 7,640,000株 | 普通株式 3,710,000株 |
| 付与日 | 平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日 | 平成18年2月14日 |
| 権利確定条件 | 上場がなされた日又は平成18年6月24日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 | 上場がなされた日又は平成19年6月23日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 |
| 対象勤務期間 | それぞれの付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで | 付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで |
| 権利行使期間 | 平成18年6月24日から平成26年6月23日まで | 平成19年6月23日から平成27年6月22日まで |

| | 平成18年度ストックオプション | |
|--------------------------|---|------------------|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の従業員 115名 | 当社及び関係会社の従業員 11名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 1,270,000株 | 普通株式 340,000株 |
| 付与日 | 平成18年4月28日 | 平成18年7月18日 |
| 権利確定条件 | 上場がなされた日又は平成21年4月28日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の4分の1ずつ権利確定する。 | 同左 |
| 対象勤務期間 | 付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで | 同左 |
| 権利行使期間 | 平成21年4月28日から平成28年4月27日まで | 同左 |

| | 平成19年度ストックオプション(1) | 平成19年度ストックオプション(2) |
|--------------------------|--|--|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の取締役・従業員 124名 | 当社の従業員 1名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 4,250,000株 | 普通株式 30,000株 |
| 付与日 | 平成19年7月27日 | 平成20年3月31日 |
| 権利確定条件 | 上場がなされた日又は平成21年7月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 | 上場がなされた日又は平成22年3月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 |
| 対象勤務期間 | 付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで | 同左 |
| 権利行使期間 | 平成21年7月19日から平成29年7月18日まで | 平成22年3月19日から平成30年3月18日まで |

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

| | 平成16年度ストックオプション(1) | 平成16年度ストックオプション(2) |
|----------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成16年 8月31日 | 平成16年 8月31日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 付与 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利未確定残 | - | - |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | 6,000,000 | 6,000,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利行使 | 0 | 0 |
| 失効 | 0 | 0 |
| 権利未行使残 | 6,000,000 | 6,000,000 |

| | 平成16年度ストックオプション(3) | 平成17年度ストックオプション |
|----------|--|-----------------|
| 付与日 | 平成17年 1月11日、平成17年 1月28日 平成17年 5月24日、平成17年 6月22日 | 平成18年 2月14日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | 6,000,000 | 3,140,000 |
| 付与 | 0 | 0 |
| 失効 | 670,000 | 300,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利未確定残 | 5,330,000 | 2,840,000 |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利行使 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利未行使残 | - | - |

| 付与日 | 平成18年度ストックオプション | |
|----------|-----------------|------------|
| | 平成18年4月28日 | 平成18年7月18日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | 1,140,000 | 330,000 |
| 付与 | 0 | 0 |
| 失効 | 120,000 | 30,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利未確定残 | 1,020,000 | 300,000 |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利行使 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利未行使残 | - | - |

| 付与日 | 平成19年度ストックオプション(1) | 平成19年度ストックオプション(2) |
|----------|--------------------|--------------------|
| | 平成19年7月27日 | 平成20年3月31日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | 4,140,000 | 30,000 |
| 付与 | 0 | 0 |
| 失効 | 530,000 | 0 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利未確定残 | 3,610,000 | 30,000 |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利行使 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利未行使残 | - | - |

(注) 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

単価情報

| | 平成16年度ストックオプション(1) | 平成16年度ストックオプション(2) |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成16年 8 月31日 | 平成16年 8 月31日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 15,823(分割後159) | 同左 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3 | - | - |

| | 平成16年度ストックオプション(3) | 平成17年度ストックオプション |
|---------------------------|--|-----------------|
| 付与日 | 平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日 | 平成18年 2 月14日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 15,823(分割後159) | 17,666(分割後177) |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3 | - | - |

| | 平成18年度ストックオプション | |
|---------------------------|-----------------|--------------|
| 付与日 | 平成18年 4 月28日 | 平成18年 7 月18日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 19,981(分割後200) | 同左 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3 | - | 0 |

| | 平成19年度ストックオプション(1) | 平成19年度ストックオプション(2) |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成19年 7 月27日 | 平成20年 3 月31日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 450 | 同左 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3 | 0 | 0 |

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 4 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 169百万円

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

| | 平成16年度ストックオプション(1) | 平成16年度ストックオプション(2) |
|--------------------------|--|--|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社の取締役 1名 | 当社の取締役 1名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 6,070,000株 | 普通株式 6,070,000株 |
| 付与日 | 平成16年8月31日 | 平成16年8月31日 |
| 権利確定条件 | 平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定 | 平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定 |
| 対象勤務期間 | 平成16年8月31日から平成19年3月23日まで | 平成16年8月31日から平成19年7月7日まで |
| 権利行使期間 | 平成16年8月31日から平成26年3月24日まで | 平成16年8月31日から平成26年7月8日まで |

| | 平成16年度ストックオプション(3) | 平成17年度ストックオプション |
|--------------------------|--|--|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の取締役・従業員 97名 | 当社の従業員及び関係会社の取締役・従業員 147名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 7,640,000株 | 普通株式 3,710,000株 |
| 付与日 | 平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日 | 平成18年2月14日 |
| 権利確定条件 | 上場がなされた日又は平成18年6月24日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 | 上場がなされた日又は平成19年6月23日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 |
| 対象勤務期間 | それぞれの付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで | 付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで |
| 権利行使期間 | 平成18年6月24日から平成26年6月23日まで | 平成19年6月23日から平成27年6月22日まで |

| | 平成18年度ストックオプション | |
|--------------------------|---|------------------|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の従業員 115名 | 当社及び関係会社の従業員 11名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 1,270,000株 | 普通株式 340,000株 |
| 付与日 | 平成18年4月28日 | 平成18年7月18日 |
| 権利確定条件 | 上場がなされた日又は平成21年4月28日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の4分の1ずつ権利確定する。 | 同左 |
| 対象勤務期間 | 付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで | 同左 |
| 権利行使期間 | 平成21年4月28日から平成28年4月27日まで | 同左 |

| | 平成19年度ストックオプション(1) | 平成19年度ストックオプション(2) |
|--------------------------|--|--|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の取締役・従業員 124名 | 当社の従業員 1名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 4,250,000株 | 普通株式 30,000株 |
| 付与日 | 平成19年7月27日 | 平成20年3月31日 |
| 権利確定条件 | 上場がなされた日又は平成21年7月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 | 上場がなされた日又は平成22年3月19日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。 |
| 対象勤務期間 | 付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで | 同左 |
| 権利行使期間 | 平成21年7月19日から平成29年7月18日まで | 平成22年3月19日から平成30年3月18日まで |

| | 平成21年度ストックオプション(1) |
|--------------------------|--|
| 付与対象者の区分及び人数 | 当社及び関係会社の取締役・従業員 271名 |
| 株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1 | 普通株式 19,724,100株 |
| 付与日 | 平成22年2月8日 |
| 権利確定条件 | 平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。 |
| 対象勤務期間 | 付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで |
| 権利行使期間 | 平成24年1月22日から平成32年1月21日まで |

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

| | 平成16年度ストックオプション(1) | 平成16年度ストックオプション(2) |
|----------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成16年 8月31日 | 平成16年 8月31日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 付与 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利未確定残 | - | - |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | 6,000,000 | 6,000,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利行使 | 6,000,000 | 6,000,000 |
| 失効 | 0 | 0 |
| 権利未行使残 | 0 | 0 |

| | 平成16年度ストックオプション(3) | 平成17年度ストックオプション |
|----------|--|-----------------|
| 付与日 | 平成17年 1月11日、平成17年 1月28日 平成17年 5月24日、平成17年 6月22日 | 平成18年 2月14日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | 5,330,000 | 2,840,000 |
| 付与 | 0 | 0 |
| 失効 | 5,330,000 | 2,840,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利未確定残 | 0 | 0 |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利行使 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利未行使残 | - | - |

| | 平成18年度ストックオプション | |
|----------|-----------------|------------|
| 付与日 | 平成18年4月28日 | 平成18年7月18日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | 1,020,000 | 300,000 |
| 付与 | 0 | 0 |
| 失効 | 1,020,000 | 300,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利未確定残 | 0 | 0 |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利行使 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利未行使残 | - | - |

| | 平成19年度ストックオプション(1) | 平成19年度ストックオプション(2) |
|----------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成19年7月27日 | 平成20年3月31日 |
| 権利確定前(株) | | |
| 期首 | 3,610,000 | 30,000 |
| 付与 | 0 | 0 |
| 失効 | 3,610,000 | 30,000 |
| 権利確定 | 0 | 0 |
| 権利未確定残 | 0 | 0 |
| 権利確定後(株) | | |
| 期首 | - | - |
| 権利確定 | - | - |
| 権利行使 | - | - |
| 失効 | - | - |
| 権利未行使残 | - | - |

| | 平成21年度ストックオプション(1) |
|----------|--------------------|
| 付与日 | 平成22年2月8日 |
| 権利確定前(株) | |
| 期首 | 0 |
| 付与 | 19,724,100 |
| 失効 | 165,000 |
| 権利確定 | 0 |
| 権利未確定残 | 19,559,100 |
| 権利確定後(株) | |
| 期首 | - |
| 権利確定 | - |
| 権利行使 | - |
| 失効 | - |
| 権利未行使残 | - |

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。また、ストックオプションの数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社へ譲渡され、同日にて同社による行使が行われております。
- 3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、当事業年度中に消却されております。

単価情報

| | 平成16年度ストックオプション(1) | 平成16年度ストックオプション(2) |
|-------------------------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成16年 8 月31日 | 平成16年 8 月31日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 15,823(分割後159) | 同左 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2 | - | - |

| | 平成16年度ストックオプション(3) | 平成17年度ストックオプション |
|-------------------------|--|-----------------|
| 付与日 | 平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日 | 平成18年 2 月14日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 15,823(分割後159) | 17,666(分割後177) |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2 | - | - |

| | 平成18年度ストックオプション | |
|---------------------------|-----------------|--------------|
| 付与日 | 平成18年 4 月28日 | 平成18年 7 月18日 |
| 権利行使価格(円) (注) 1 | 19,981(分割後200) | 同左 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 2、3 | - | 0 |

| | 平成19年度ストックオプション(1) | 平成19年度ストックオプション(2) |
|-------------------------|--------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成19年 7 月27日 | 平成20年 3 月31日 |
| 権利行使価格(円) | 450 | 同左 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 3 | 0 | 0 |

| | 平成21年度ストックオプション(1) |
|-------------------------|--------------------|
| 付与日 | 平成22年 2 月 8 日 |
| 権利行使価格(円) | 625 |
| 付与日における公正な評価単価(円) (注) 4 | 0 |

- (注) 1 当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 4 平成21年度ストックオプション(1)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
- 5 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

（税効果会計関係）

| 第50期 (平成21年3月31日) | 第51期 (平成22年3月31日) |
|---|--|
| <p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <p>賞与引当金繰入超過額 895</p> <p>その他 182</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">1,078</p> <p>繰延税金資産(固定)</p> <p>投資有価証券等評価損 171</p> <p>関係会社株式評価損 185</p> <p>退職給付引当金超過額 249</p> <p>子会社投資損失引当金 234</p> <p>固定資産減価償却超過額 215</p> <p>その他 162</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">1,218</p> <p>繰延税金資産合計 2,297</p> <p>繰延税金負債(流動)</p> <p>事業税中間納付還付予定額 216</p> <p>繰延税金負債合計 216</p> <p>繰延税金資産の純額 2,080</p> | <p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <p>賞与引当金繰入超過額 1,309</p> <p>その他 334</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">1,644</p> <p>繰延税金資産(固定)</p> <p>投資有価証券等評価損 79</p> <p>関係会社株式評価損 185</p> <p>退職給付引当金超過額 302</p> <p>子会社投資損失引当金 234</p> <p>固定資産減価償却超過額 249</p> <p>その他 64</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">1,115</p> <p>繰延税金資産合計 2,759</p> <p>繰延税金負債(流動)</p> <p>其他有価証券評価差額金 83</p> <p>繰延税金負債合計 83</p> <p>繰延税金資産の純額 2,676</p> |
| <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.6%</p> <p>(調整)</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 3.6%</p> <p>外国税額控除の影響額等 11.0%</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.2%</p> | <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.6%</p> <p>(調整)</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 30.3%</p> <p>受取配当金等永久に益金に算入されない項目 27.1%</p> <p>海外子会社の留保利益の影響額等 13.9%</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 23.5%</p> |

（関連当事者情報）

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

| 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 | 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(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-------------|----------------|---------|---------------|-------|-------------------|---------------|---|-----------|-------|-----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 日興コーディアル証券株式会社 | 東京都千代田区 | 100,000 | 証券業 | なし | 投資信託受益証券の募集販売 | 信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注)1 | 13,541 | 未払手数料 | 1,406 |

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、未払手数料の期末残高には消費税等が含まれておりません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1 信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。

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

Citigroup Inc. (ニューヨーク証券取引所等に上場)

日興シティホールディングス株式会社

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成20年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

| | |
|----------|-----------|
| 資産合計 | 6,747百万円 |
| 負債合計 | 1,977百万円 |
| 純資産合計 | 4,769百万円 |
| 営業収益 | 10,700百万円 |
| 税引前当期純利益 | 3,968百万円 |
| 当期純利益 | 3,255百万円 |

第51期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 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

| 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 | 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(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|------------|--------|---------------|-------|-------------------|-----------|---------------------|-----------|----|-----------|
| 親会社 | 住友信託銀行株式会社 | 大阪市中央区 | 342,037 | 信託銀行業 | (被所有) 直接 98.59 | | ストックオプション(新株予約権)の行使 | 1,908 | - | - |

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1 平成21年10月1日、当社は、当社取締役から取得した新株予約権（権利行使価格：1株当たり159円）を行使した住友信託銀行株式会社に対し12,000,000株の普通株式を発行しております。
- 2 議決権等の被所有割合は、自己株式（85,000株）を控除して計算しております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

| 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 | 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(百万円) |
|-------------|----------------|---------|---------------|-------|-------------------|---------------|---|-----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 日興コーディアル証券株式会社 | 東京都千代田区 | 149,594 | 証券業 | なし | 投資信託受益証券の募集販売 | 信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払 (注)1 (注)2 | 5,068 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1 信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。
- 2 平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社が当社の親会社となり、日興コーディアル証券株式会社は当社の関連当事者ではなくなりました。上記の金額は、平成21年4月1日から平成21年9月30日までの期間の取引金額であります。また、資本金又は出資金の金額は、平成21年9月30日の資本金額を記載しております。

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

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成21年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場場で円貨に換算したものであります。

| | |
|----------|-----------|
| 資産合計 | 10,090百万円 |
| 負債合計 | 1,626百万円 |
| 純資産合計 | 8,464百万円 |
| 営業収益 | 10,606百万円 |
| 税引前当期純利益 | 4,405百万円 |
| 当期純利益 | 3,482百万円 |

(1株当たり情報)

| 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) | |
|---|---------|---|---------|
| 1株当たり純資産額 | 222円93銭 | 1株当たり純資産額 | 210円58銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 9円16銭 | 1株当たり当期純損失 | 3円64銭 |
| <p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p> | | <p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、当事業年度は1株当たり当期純損失であるため、記載しておりません。</p> | |

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

| 項目 | 第50期 (平成21年3月31日) | 第51期 (平成22年3月31日) |
|------------------------------|----------------------|----------------------|
| 貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円) | 41,246 | 41,470 |
| 普通株式に係る純資産額(百万円) | 41,246 | 41,470 |
| 差額の主な内訳(百万円) | | |
| 新株予約権 | - | - |
| 普通株式の発行済株式数(千株) | 185,013 | 197,013 |
| 普通株式の自己株式数(千株) | - | 85 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(千株) | 185,013 | 196,928 |

2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

| 項目 | 第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日) | 第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日) |
|--|---|-------------------------------------|
| 損益計算書上の当期純利益又は当期純損失(百万円) | 1,693 | 696 |
| 普通株式に係る当期純利益又は当期純損失(百万円) | 1,693 | 696 |
| 普通株主に帰属しない金額(百万円) | - | - |
| 普通株式の期中平均株式数(千株) | 184,790 | 190,975 |
| 希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要 | 平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3) 5,330,000株、平成17年度ストックオプション2,840,000株、平成18年度ストックオプション1,320,000株、平成19年度ストックオプション(1) 3,610,000株、平成19年度ストックオプション(2) 30,000株、 | 平成21年度ストックオプション(1) 19,559,100株 |

（重要な後発事象）

| 第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日) | 第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日) |
|--|--|
| 1 投資有価証券の繰上償還 当社が投資有価証券として保有しているグローバルコレクション（隔月分配型）（121百万円 当事業年度末現在）が平成21年 5月14日に繰上償還されることを、平成21年 5月11日に金融庁に届出ております。 | - |

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

原届出書の「第四部 特別情報 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」を以下の内容に更新・追加します。

<更新・追加>

(1) 受託会社

| 名称 | 資本金の額 (平成22年7月20日現在) | 事業の内容 |
|------------|-------------------------|---|
| 野村信託銀行株式会社 | 30,000百万円 | 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 (平成21年9月末現在) | 事業の内容 |
|----------------|-----------------------------|-------------------------------|
| 株式会社SBI証券 | 47,937百万円 | 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。 |
| 日興コーディアル証券株式会社 | 10,000百万円 (平成21年10月1日現在) | |
| マネックス証券株式会社 | 7,425百万円 | |
| 楽天証券株式会社 1 | 7,477百万円 | |
| ワイエム証券株式会社 | 1,270百万円 | |
| 株式会社足利銀行 | 135,000百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社岩手銀行 | 12,089百万円 | |
| 株式会社きらやか銀行 | 17,700百万円 | |
| ソニー銀行株式会社 2 | 31,000百万円 | |
| 株式会社第三銀行 2 | 37,461百万円 | |
| 株式会社東北銀行 | 8,233百万円 | |
| 株式会社もみじ銀行 | 74,965百万円 | |
| 株式会社琉球銀行 | 54,127百万円 | 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。 |
| ソニー生命保険株式会社 2 | 70,000百万円 | |

1 楽天証券株式会社は、平成22年7月30日より取扱開始予定です。

2 ソニー銀行株式会社、株式会社第三銀行およびソニー生命保険株式会社は、募集の取扱いを行いません。

独立監査人の中間監査報告書

平成21年5月28日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成20年10月28日から平成21年4月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成21年4月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成20年10月28日から平成21年4月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

日興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

-
- (注) 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. 中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成22年6月2日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成21年10月27日から平成22年4月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成22年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成21年10月27日から平成22年4月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

日興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

（注）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．中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻村和之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、日興アセットマネジメント株式会社の平成21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。

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

以上

(注) 上記は、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。

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻 村 和 之
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、日興アセットマネジメント株式会社の平成22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。

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

以 上

(注) 上記は、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。