

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年1月27日提出
【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】	代表取締役 村上 雅彦
【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】	雄谷 敦史
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【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）（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「Aナビ80」、「ステージ1」、「アセット・ナビゲーション・ファンド」、「Aナビ」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%（税抜1%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

平成27年 1月28日から平成28年 1月26日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

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】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外

目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本 北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行いません。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル（含む日本）

目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド

目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

ファンドの仕組み

当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



- (主な投資制限)
- ・ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
 - ・ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- (分配方針)
- ・ 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
 - ※ 将来の分配金の支払いおよびその全額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

- 主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。
- 国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

- 各資産の運用は資産全体の値動きを表す代表的な指数に連動することをめざすインデックス運用で行ないます。

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含みます。)に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス(総合)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

※TOPIX(東証株価指数)：TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

※MSCI-KOKUSAIインデックス：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※日興債券パフォーマンスインデックス(総合)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※シティ世界国債インデックス(除く日本)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※基本投資比率から乖離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

○市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

信託金限度額

- ・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2)【ファンドの沿革】

平成11年10月29日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

平成13年6月1日

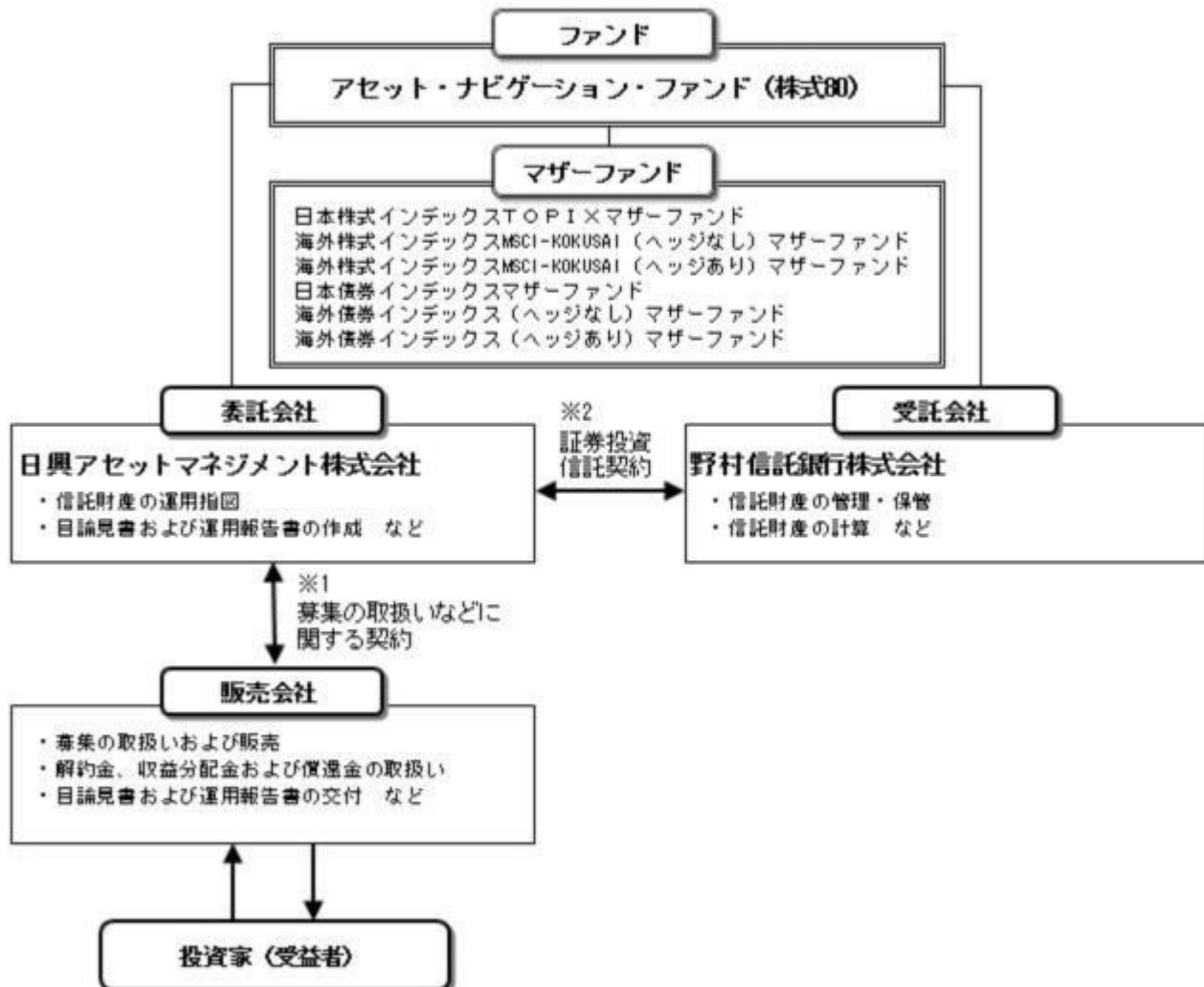
・ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ1）

（3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（平成26年11月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%

DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%
---------------	---	-------------	-------

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
 - 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
 - 株式の標準実質組入比率.....80%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....20%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券

- 5) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
 - 6) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」受益証券
 - 7) 株券または新株引受権証書
 - 8) 国債証券
 - 9) 地方債証券
 - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 11) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 12) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 13) コマーシャル・ペーパー
 - 14) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)~14)の証券または証書の性質を有するもの
 - 16) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。))で投資法人債券に類する証券
 - 17) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 18) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 19) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7) コマーシャル・ペーパー

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

9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの

10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

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

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

13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。

1) 信用取引

2) 先物取引等

3) スワップ取引

4) 金利先渡取引

5) 有価証券の貸付

6) 公社債の空売

7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に

掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。)には投資しません。

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド >
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7) コマーシャル・ペーパー

8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの

10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの

12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

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

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

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

16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

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

6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

1) 信用取引

2) 先物取引等

3) スワップ取引

4) 金利先渡取引

5) 為替先渡取引

6) 有価証券の貸付

7) 公社債の空売

- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限りま。
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 有価証券の貸付
- 5) 公社債の空売
- 6) 公社債の借入

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、

第13条および第14条に定めるものに限りです。）

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りです。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りです。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 為替先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限りです。）

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 為替先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
 - 8) 外国為替予約取引

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>

運用の基本方針

基本方針

わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）^{*}の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* T O P I X（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部に上場されている普通株式全銘柄（算出対象除外後の整理ポスト割当銘柄および算出対象組入前の新規上場銘柄を除きます。）の浮動株調整後の時価総額を指数化したもので、市場全体の動向を反映するものです。

T O P I Xの指数値およびT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利およびT O P I Xの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行いません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI-KOKUSAI インデックスは、MSCI Inc. が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないません。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* 日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興フィナンシャル・インテリジェンス株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からBBB格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS M B C日興証券株式会社に帰属します。また、S M B C日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%(1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

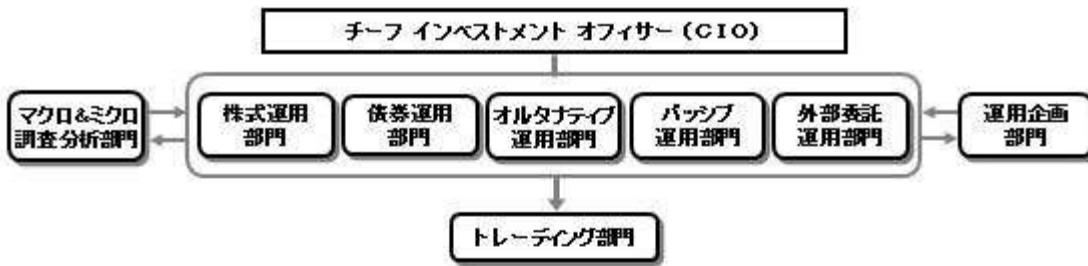
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(平成10年10月30日設定)
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)

*シティ世界国債インデックス(除く日本)は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(ヘッジあり・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。

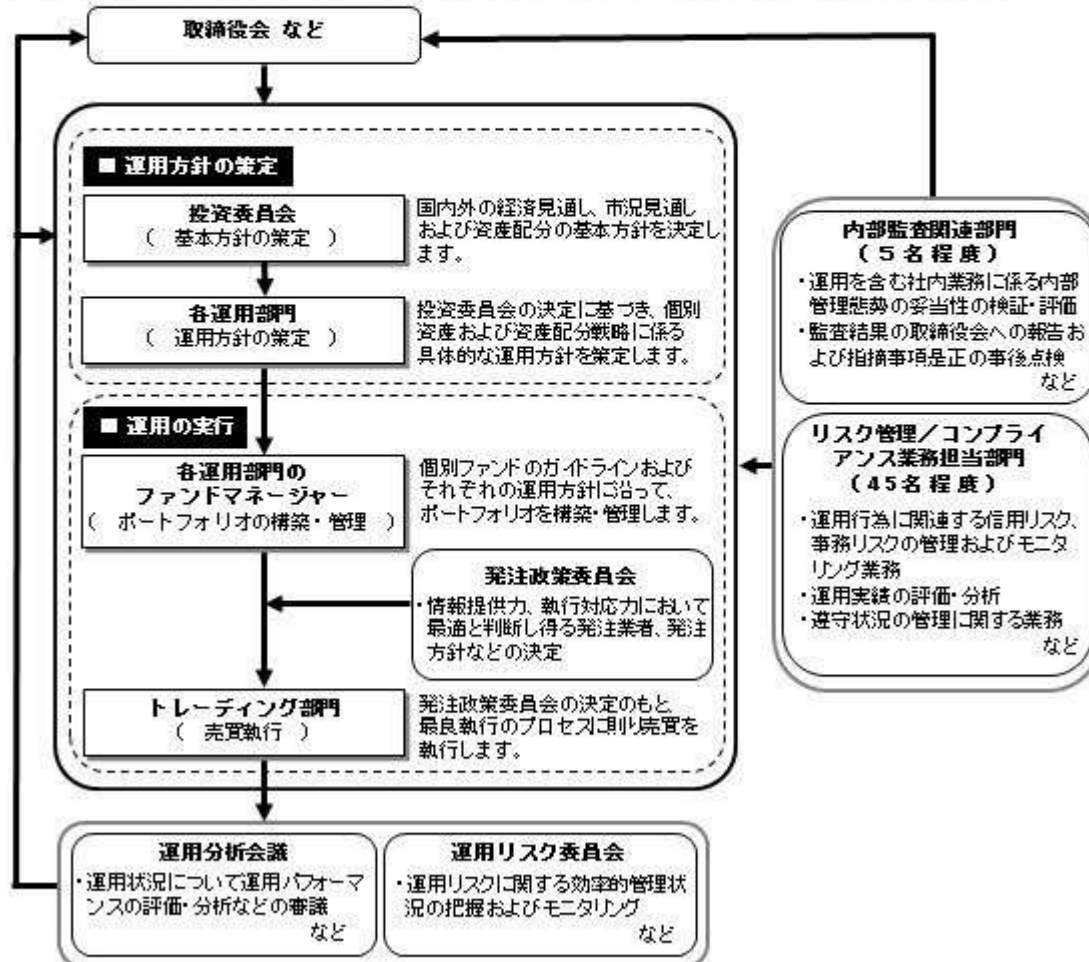
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

上記体制は平成26年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

(5)【投資制限】

約款に定める投資制限

<アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)>

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投

資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。

15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

3) 外貨建資産への投資は行ないません。

4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価

総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- < 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) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
 - 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

< 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) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有

価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

- 4) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- < 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >
- 1) 株式への投資は行ないません。
 - 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由によ

り基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

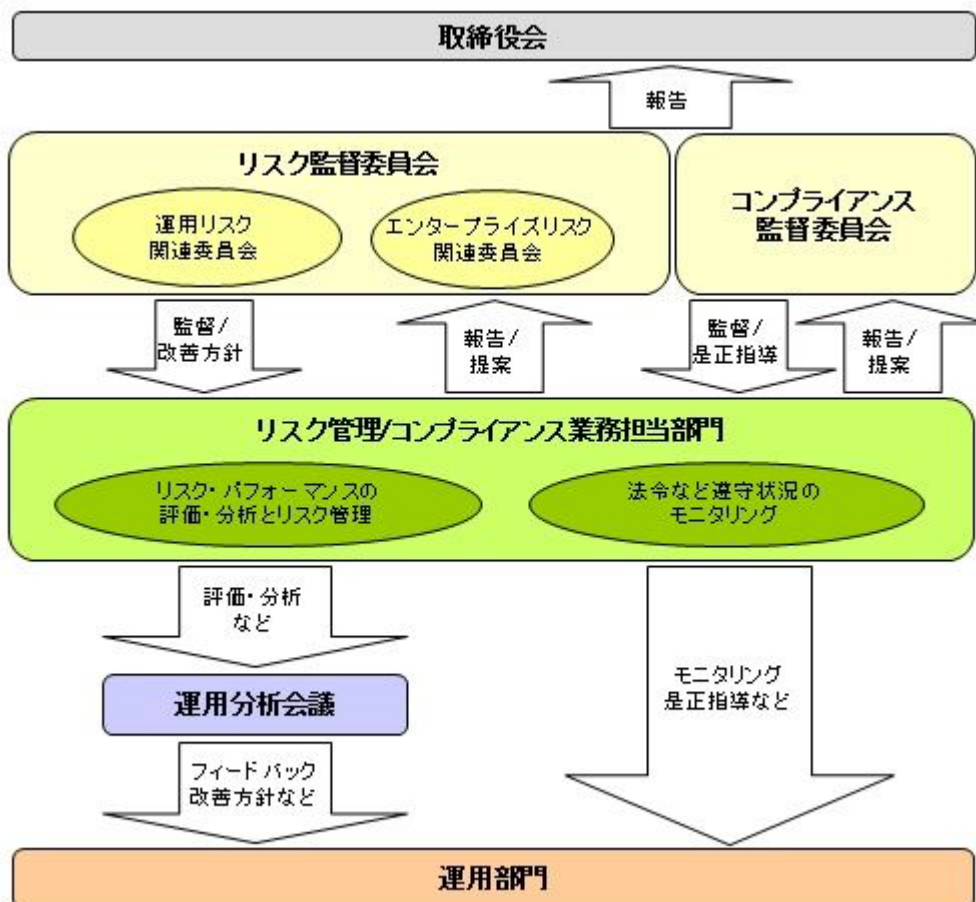
・運用制限や規制上の制限に関する事項

関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、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についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況につ

いてはリスク管理部門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。両委員会およびそれに関連する部門別委員会においては、法令遵守状況や各種リスク(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、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

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、問題点の原因の究明や改善策策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

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、コンプライアンス業務担当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関連の委員会に報告され、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26年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	10.8%	12.3%	20.4%	14.9%	2.3%	7.3%	10.3%
最大値	46.1%	65.0%	65.7%	83.9%	4.1%	34.9%	43.7%
最小値	-11.4%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-12.7%	-10.1%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2009年12月から2014年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2009年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債 ……NOMURA-ボンドパフォーマンス・インデックス国債

先進国債 ……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債 ……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAI インデックス（配当込、円ベース）

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

当指数は、野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLC に帰属します。

4【手数料等及び税金】**（１）【申込手数料】**

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は1.08%（税抜1%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受ける場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことです。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.8208%（税抜0.76%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.76%	0.26%	0.45%	0.05%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

- ・ 組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・ 信託事務の処理に要する諸費用
- ・ 信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴

収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

* 解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みません。)を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当等(申告分離課税を選択したものに限りません。)と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益(譲渡益)および普通分配金(申告分離課税を選択したものに限りません。)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%(所得税のみ)の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

原則として、益金不算入制度が適用されます。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

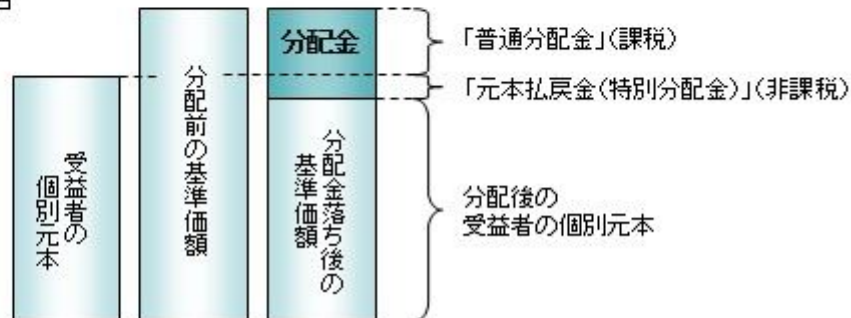
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成27年 1月27日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

以下の運用状況は2014年11月28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】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	149,970,713	95.44
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		7,158,076	4.56
合計（純資産総額）		157,128,789	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックストピックスマザーファンド	80,954,760	1.0409	84,265,810	1.1708	94,781,833	60.32

日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	8,100,151	1.7388	14,084,543	1.9968	16,174,381	10.29
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	12,710,244	1.1758	14,944,705	1.2446	15,819,169	10.07
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	3,343,508	2.1715	7,260,428	2.3795	7,955,877	5.06
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド	5,285,714	1.4263	7,539,401	1.4444	7,634,685	4.86
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	5,763,371	1.3099	7,549,677	1.3195	7,604,768	4.84

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.44
合計	95.44

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第6計算期間末 (2005年10月26日)	273	273	1.0116	1.0116
第7計算期間末 (2006年10月26日)	331	331	1.1687	1.1697
第8計算期間末 (2007年10月26日)	311	311	1.1636	1.1646
第9計算期間末 (2008年10月27日)	164	164	0.6505	0.6505
第10計算期間末 (2009年10月26日)	222	222	0.7943	0.7943
第11計算期間末 (2010年10月26日)	212	212	0.7548	0.7548
第12計算期間末 (2011年10月26日)	184	184	0.7191	0.7191
第13計算期間末 (2012年10月26日)	185	185	0.7518	0.7518
第14計算期間末 (2013年10月28日)	198	198	1.0963	1.0973
第15計算期間末 (2014年10月27日)	149	149	1.1748	1.1758
2013年11月末日	188		1.1406	
12月末日	171		1.1721	
2014年1月末日	157		1.1191	
2月末日	156		1.1230	

3月末日	156	1.1259
4月末日	153	1.1065
5月末日	155	1.1328
6月末日	159	1.1707
7月末日	161	1.1882
8月末日	159	1.1864
9月末日	159	1.2213
10月末日	155	1.2246
11月末日	157	1.2928

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	0.0000
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	0.0010
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.0010
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	0.0000
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	0.0000
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0000
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0.0000
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0.0000
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	22.72
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	15.63
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.35
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	44.10
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	22.11
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	4.97
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	4.73
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	4.55
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	45.96
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	7.25

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち、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。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	79,716,243	905,414,249
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	105,184,984	91,974,687
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	54,775,405	70,648,230
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	39,696,045	54,456,013
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	40,558,097	13,000,445
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	31,178,453	29,716,908
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	26,532,382	51,181,847
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	20,084,711	30,295,119
第14期	2012年10月27日～2013年10月28日	14,612,172	80,167,991
第15期	2013年10月29日～2014年10月27日	7,347,662	61,141,524

（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2014年11月28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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	28,822,728,360	99.22
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		225,883,033	0.78
合計（純資産総額）		29,048,611,393	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	225,680,000	0.78

(注)先物取引は、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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
------	----	-----	----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	193,100	6,195.00	1,196,254,500	7,314.00	1,412,333,400	4.86
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,108,200	587.90	651,510,780	686.40	760,668,480	2.62
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	73,000	7,439.98	543,118,540	7,963.00	581,299,000	2.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	104,500	4,018.50	419,933,250	4,475.00	467,637,500	1.61
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	125,900	3,330.50	419,309,950	3,571.50	449,651,850	1.55
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,907,900	189.92	362,348,368	204.50	390,165,550	1.34
日本	株式	KDDI	情報・通信業	46,800	6,780.09	317,308,212	7,604.00	355,867,200	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,000	6,452.00	348,408,000	6,351.00	342,954,000	1.18
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	86,900	3,559.00	309,277,100	3,802.50	330,437,250	1.14
日本	株式	キヤノン	電気機器	81,100	3,275.50	265,643,050	3,801.50	308,301,650	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	336,000	804.60	270,345,600	916.50	307,944,000	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	14,600	17,910.00	261,486,000	20,020.00	292,292,000	1.01
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	166,900	1,626.50	271,462,850	1,707.00	284,898,300	0.98
日本	株式	三菱地所	不動産業	103,000	2,333.29	240,328,870	2,671.50	275,164,500	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	54,900	4,579.50	251,414,550	4,972.00	272,962,800	0.94
日本	株式	パナソニック	電気機器	170,600	1,221.58	208,401,548	1,532.50	261,444,500	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,800	3,991.00	230,679,800	4,427.50	255,909,500	0.88
日本	株式	三井不動産	不動産業	73,000	3,056.00	223,088,000	3,430.50	250,426,500	0.86
日本	株式	三菱商事	卸売業	105,800	2,044.50	216,308,100	2,245.00	237,521,000	0.82
日本	株式	ソニー	電気機器	90,000	1,899.47	170,952,300	2,600.00	234,000,000	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	25,700	8,274.00	212,641,800	8,897.00	228,652,900	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	56,800	3,255.96	184,938,528	3,880.50	220,412,400	0.76
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	196,400	945.60	185,715,840	1,108.50	217,709,400	0.75
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	12,500	14,970.00	187,125,000	17,275.00	215,937,500	0.74
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	113,800	1,739.50	197,955,100	1,851.50	210,700,700	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	26,300	6,898.00	181,417,400	7,990.00	210,137,000	0.72
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	47,600	3,310.50	157,579,800	4,318.00	205,536,800	0.71
日本	株式	小松製作所	機械	72,600	2,450.90	177,935,340	2,811.00	204,078,600	0.70
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	282,400	606.30	171,219,120	714.00	201,633,600	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	140,000	1,328.50	185,990,000	1,426.50	199,710,000	0.69

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.41
		建設業	2.62
		食料品	4.04
		繊維製品	0.76
		パルプ・紙	0.22

化学	5.85
医薬品	4.43
石油・石炭製品	0.46
ゴム製品	0.89
ガラス・土石製品	0.93
鉄鋼	1.54
非鉄金属	0.96
金属製品	0.64
機械	5.30
電気機器	13.06
輸送用機器	11.79
精密機器	1.46
その他製品	1.38
電気・ガス業	2.05
陸運業	3.94
海運業	0.32
空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.23
情報・通信業	6.90
卸売業	4.16
小売業	4.05
銀行業	9.15
証券、商品先物取引業	1.44
保険業	2.35
その他金融業	1.27
不動産業	3.11
サービス業	2.85
合 計	99.22

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2014年12月	買建	16	日本円	208,198,535	225,680,000	0.78

(注)先物取引は、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。

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2014年11月28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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	50,161,733,699	57.76
	カナダ	3,740,478,196	4.31
	モーリシャス	5,491,883	0.01
	ドイツ	3,240,937,207	3.73
	イタリア	770,108,389	0.89
	フランス	3,184,928,935	3.67
	オランダ	1,285,625,184	1.48
	スペイン	1,273,693,876	1.47
	ベルギー	445,986,192	0.51
	オーストリア	80,090,073	0.09
	ルクセンブルク	127,065,745	0.15
	フィンランド	319,934,315	0.37
	アイルランド	1,071,420,427	1.23
	ポルトガル	54,159,125	0.06
	イギリス	6,924,630,690	7.97
	スイス	3,528,072,775	4.06
	スウェーデン	1,105,322,178	1.27
	ノルウェー	246,760,268	0.28
	デンマーク	543,565,273	0.63
	ケイマン	81,194,398	0.09
	オーストラリア	2,395,287,574	2.76
	パミューダ	139,390,452	0.16
	ニュージーランド	41,732,828	0.05
	香港	987,627,091	1.14
	シンガポール	570,891,735	0.66
	イスラエル	193,876,598	0.22
	ジャージー	458,048,650	0.53
ガーンジー	25,474,766	0.03	
英ヴァージン諸島	45,723,443	0.05	
小計		83,049,251,965	95.62
投資証券	アメリカ	1,443,520,982	1.66
	カナダ	14,974,454	0.02
	フランス	107,693,786	0.12
	オランダ	11,902,454	0.01
	イギリス	118,599,561	0.14
	オーストラリア	231,248,584	0.27
	香港	38,619,100	0.04

	シンガポール	29,741,564	0.03
	小計	1,996,300,485	2.30
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,803,505,482	2.08
合計(純資産総額)		86,849,057,932	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,286,292,152	1.48
	買建	ドイツ	475,117,440	0.55

(注)先物取引は、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。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,180,010,190	1.36
	売建		298,961,800	0.34

(注)為替予約取引は、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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	138,502	12,440.16	1,722,987,124	14,069.37	1,948,635,884	2.24
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	98,651	11,171.55	1,102,084,845	11,170.37	1,101,968,210	1.27
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	181,044	5,453.94	987,404,906	5,645.48	1,022,080,734	1.18
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	65,221	12,193.05	795,243,559	12,675.43	826,704,761	0.95
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	115,120	6,053.37	696,864,645	6,417.52	738,785,409	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	231,233	3,031.41	700,963,694	3,176.84	734,590,267	0.85
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	74,443	8,324.55	619,704,811	8,839.09	658,008,861	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	62,469	10,068.46	628,967,052	10,508.28	656,441,893	0.76
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	87,000	6,944.83	604,200,227	7,133.99	620,657,843	0.71
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	53,103	10,505.23	557,859,361	11,393.42	605,025,313	0.70
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	43,891	13,704.03	601,483,989	13,609.45	597,332,603	0.69

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16,218	34,057.77	552,349,076	35,515.64	575,992,795	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	95,717	5,766.07	551,911,601	5,916.22	566,283,710	0.65
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	146,540	3,441.67	504,343,099	3,676.95	538,820,693	0.62
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	439,911	1,168.24	513,922,375	1,173.44	516,210,104	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	114,392	3,922.87	448,745,105	4,362.68	499,056,491	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	119,776	4,004.45	479,637,015	4,153.41	497,480,022	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	243,139	1,976.80	480,638,537	2,022.91	491,849,603	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	91,202	4,850.97	442,418,795	5,236.40	477,570,764	0.55
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	26,940	16,500.91	444,534,692	17,520.50	472,002,370	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	66,653	6,811.23	453,988,933	7,064.24	470,852,955	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	70,047	6,124.31	428,989,823	6,399.78	448,286,083	0.52
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	6,570	64,896.44	426,369,657	64,758.11	425,460,835	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	6,635	63,818.18	423,433,687	63,887.94	423,896,516	0.49
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	45,710	9,537.61	435,964,341	9,177.01	419,481,246	0.48
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	21,892	19,162.71	419,510,231	19,147.34	419,173,753	0.48
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,974	13,089.24	457,783,195	11,858.46	414,738,095	0.48
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	38,063	10,476.36	398,761,702	10,867.70	413,657,326	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	34,851	11,184.55	389,793,031	11,746.15	409,365,091	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	82,273	4,579.04	376,732,007	4,950.29	407,275,217	0.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	8.82
		素材	5.05
		資本財	7.01
		商業・専門サービス	0.85
		運輸	2.11
		自動車・自動車部品	1.65
		耐久消費財・アパレル	1.64

	消費者サービス	1.65
	メディア	2.96
	小売	3.14
	食品・生活必需品小売り	2.07
	食品・飲料・タバコ	6.09
	家庭用品・パーソナル用品	1.75
	ヘルスケア機器・サービス	3.29
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.72
	銀行	9.56
	各種金融	3.94
	保険	4.14
	不動産	0.61
	ソフトウェア・サービス	6.86
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.52
	電気通信サービス	3.17
	公益事業	3.26
	半導体・半導体製造装置	1.77
投資証券		2.30
合計		97.92

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1412	買建	21	米ドル	10,714,125	1,266,730,998	10,879,575	1,286,292,152	1.48
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1412	買建	105	ユーロ	3,138,820	462,034,304	3,227,700	475,117,440	0.55

(注)先物取引は、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。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	7,021,000.00	801,318,481	829,688,620	0.96
	ユーロ	買建	2,381,000.00	345,937,741	350,321,570	0.40
	米ドル	売建	2,000,000.00	235,100,000	236,440,000	0.27
	加ドル	売建	260,000.00	27,141,660	27,092,000	0.03
	豪ドル	売建	140,000.00	14,093,940	14,093,800	0.02
	香港ドル	売建	1,400,000.00	21,224,000	21,336,000	0.02

(注)為替予約取引は、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。

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2014年11月28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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	1,126,526,114	57.41
	カナダ	81,936,459	4.18
	ドイツ	71,758,133	3.66
	イタリア	16,761,134	0.85
	フランス	71,915,730	3.66
	オランダ	24,880,598	1.27
	スペイン	29,260,059	1.49
	ベルギー	11,438,060	0.58
	オーストリア	766,264	0.04
	ルクセンブルク	3,150,409	0.16
	フィンランド	8,091,773	0.41
	アイルランド	25,768,852	1.31
	ポルトガル	1,070,830	0.05
	イギリス	155,839,936	7.94
	スイス	86,398,337	4.40
	スウェーデン	12,832,689	0.65
	ノルウェー	8,303,478	0.42
	デンマーク	11,058,918	0.56
	ケイマン	1,430,450	0.07
	オーストラリア	55,730,761	2.84
	バミューダ	2,468,343	0.13
	香港	22,046,059	1.12
	シンガポール	14,035,977	0.72
	イスラエル	2,851,637	0.15
ジャージー	12,505,657	0.64	
英ヴァージン諸島	1,533,080	0.08	
	小計	1,860,359,737	94.81
投資証券	アメリカ	32,178,488	1.64
	フランス	1,892,815	0.10
	イギリス	3,755,124	0.19
	オーストラリア	3,983,453	0.20
	香港	1,163,771	0.06
	小計	42,973,651	2.19

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		58,902,204	3.00
合計(純資産総額)		1,962,235,592	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	49,001,605	2.50
	買建	ドイツ	18,099,712	0.92

(注)先物取引は、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。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		1,961,098,360	99.94

(注)為替予約取引は、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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,104	12,440.16	38,614,258	14,069.36	43,671,324	2.23
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,206	11,171.55	24,644,445	11,170.37	24,641,837	1.26
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,050	5,453.94	22,088,497	5,645.48	22,864,204	1.17
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,440	12,193.05	17,558,006	12,675.43	18,252,631	0.93
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	5,125	3,031.41	15,536,014	3,176.84	16,281,306	0.83
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	2,533	6,053.37	15,333,201	6,417.52	16,255,589	0.83
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,647	8,324.55	13,710,541	8,839.09	14,557,992	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	1,383	10,068.46	13,924,690	10,508.28	14,532,955	0.74
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,921	6,944.83	13,341,019	7,133.99	13,704,411	0.70
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,177	10,505.23	12,364,659	11,393.42	13,410,067	0.68
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	969	13,704.03	13,279,214	13,609.45	13,187,562	0.67
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	357	34,057.78	12,158,628	35,515.64	12,679,087	0.65

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	2,117	5,766.07	12,206,785	5,916.22	12,524,657	0.64
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,238	3,441.67	11,144,145	3,676.95	11,905,974	0.61
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	9,781	1,168.24	11,426,572	1,173.44	11,477,436	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	2,561	3,922.87	10,046,473	4,362.68	11,172,841	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	2,648	4,004.45	10,603,784	4,153.41	10,998,256	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	5,371	1,976.80	10,617,423	2,022.91	10,865,078	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,016	4,850.97	9,779,570	5,236.40	10,556,596	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,492	6,811.23	10,162,356	7,064.24	10,539,850	0.54
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	587	16,481.26	9,674,501	17,520.50	10,284,536	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	1,548	6,124.31	9,480,438	6,399.79	9,906,875	0.50
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	155	63,818.19	9,891,820	63,887.94	9,902,632	0.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	1,033	9,537.61	9,852,355	9,177.01	9,479,854	0.48
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	799	13,089.24	10,458,306	11,858.46	9,474,917	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	146	64,896.44	9,474,881	64,758.11	9,454,685	0.48
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	484	19,162.71	9,274,756	19,147.34	9,267,317	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	1,844	4,579.04	8,443,764	4,950.29	9,128,335	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	769	11,184.55	8,600,925	11,746.15	9,032,790	0.46
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	826	10,476.36	8,653,474	10,867.70	8,976,722	0.46

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	8.72
		素材	4.93
		資本財	7.25
		商業・専門サービス	0.77
		運輸	2.16
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.33
		消費者サービス	1.88
		メディア	2.93

	小売	3.07
	食品・生活必需品小売り	2.02
	食品・飲料・タバコ	6.04
	家庭用品・パーソナル用品	1.57
	ヘルスケア機器・サービス	3.31
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.66
	銀行	9.44
	各種金融	3.82
	保険	4.06
	不動産	0.68
	ソフトウェア・サービス	6.87
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.58
	電気通信サービス	3.01
	公益事業	3.18
	半導体・半導体製造装置	1.81
投資証券		2.19
合計		97.00

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI 1412	買建	4	米ドル	407,750	48,208,282	414,460	49,001,605	2.50
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1412	買建	4	ユーロ	119,800	17,634,560	122,960	18,099,712	0.92

(注)先物取引は、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。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	10,488,000.00	1,141,241,300	1,239,438,080	63.16
	加ドル	売建	789,000.00	78,817,801	82,048,010	4.18
	ユーロ	売建	1,737,000.00	245,546,314	255,572,540	13.02
	英ポンド	売建	902,000.00	160,405,678	167,319,900	8.53
	スイスフラン	売建	664,000.00	76,170,132	81,328,800	4.14
	スウェーデンクローナ	売建	809,000.00	12,077,065	12,831,570	0.65
	ノルウェークローネ	売建	518,000.00	8,495,866	8,790,220	0.45
	デンマーククローネ	売建	560,000.00	10,527,190	11,072,340	0.56

豪ドル	売建	611,000.00	59,298,078	61,238,030	3.12
香港ドル	売建	1,658,000.00	23,313,745	25,264,610	1.29
シンガポールドル	売建	132,000.00	11,292,471	11,978,010	0.61
イスラエルシケル	売建	139,000.00	4,057,008	4,216,250	0.21

(注)為替予約取引は、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。

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2014年11月28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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	28,010,290,599	79.84
地方債証券	日本	2,332,553,000	6.65
特殊債券	日本	2,604,075,000	7.42
社債券	日本	1,787,444,000	5.09
	オーストラリア	203,117,000	0.58
	小計	1,990,561,000	5.67
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		147,074,901	0.42
合計(純資産総額)		35,084,554,500	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	105.31	789,840,000	105.29	789,675,000	1.300	2019/3/20	2.25
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	673,000,000	106.08	713,952,050	106.05	713,750,150	1.300	2019/12/20	2.03
日本	国債証券	第107回利付国債(5年)	705,000,000	100.51	708,644,850	100.56	708,969,150	0.200	2017/12/20	2.02
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	106.30	617,626,240	106.23	617,225,350	1.400	2019/9/20	1.76
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	108.65	592,175,200	108.90	593,515,900	1.400	2022/12/20	1.69
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	103.59	478,618,140	103.47	478,045,260	1.700	2016/12/20	1.36
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	445,000,000	100.55	447,487,550	100.51	447,309,550	0.500	2015/12/20	1.27
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	410,000,000	107.14	439,312,200	107.23	439,679,900	1.300	2021/3/20	1.25
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	406,000,000	104.60	424,684,120	104.54	424,452,700	1.400	2018/3/20	1.21

日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	420,000,000	100.48	422,047,000	100.53	422,230,200	0.200	2017/9/20	1.20
日本	国債証券	第334回利付国債(2年)	420,000,000	100.09	420,379,149	100.09	420,379,149	0.100	2015/11/15	1.20
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	370,000,000	100.48	371,776,000	100.55	372,057,200	0.200	2019/3/20	1.06
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	310,000,000	109.28	338,774,200	113.98	353,359,700	2.000	2042/3/20	1.01
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	350,000,000	100.63	352,208,500	100.61	352,138,500	0.400	2016/6/20	1.00
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	331,000,000	105.61	349,595,580	105.53	349,314,230	1.700	2018/3/20	1.00
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	118.22	326,289,960	121.87	336,377,760	2.400	2038/9/20	0.96
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	119.13	309,753,600	119.78	311,451,400	2.300	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	260,000,000	119.01	309,439,000	119.65	311,092,600	2.300	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	108.88	304,886,400	110.57	309,615,600	1.700	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	104.26	299,237,680	104.21	299,097,050	1.300	2018/3/20	0.85
日本	国債証券	第113回利付国債(20年)	240,000,000	116.75	280,214,400	118.14	283,538,400	2.100	2029/9/20	0.81
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	275,000,000	102.12	280,830,000	102.46	281,789,750	0.600	2023/3/20	0.80
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	280,000,000	100.59	281,677,200	100.59	281,663,200	0.300	2016/12/20	0.80
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	270,000,000	103.89	280,516,500	104.16	281,253,600	0.800	2022/9/20	0.80
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	104.01	271,468,710	103.89	271,155,510	1.700	2017/3/20	0.77
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	110.97	263,017,860	111.02	263,136,360	1.900	2021/3/22	0.75
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	119.25	248,040,000	121.46	252,647,200	2.400	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	106.49	237,477,160	106.43	237,347,820	1.500	2019/6/20	0.68
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	114.54	229,099,500	118.44	236,898,000	2.200	2041/3/20	0.68
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	221,000,000	105.05	232,178,180	105.03	232,116,300	1.300	2018/12/20	0.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.84
地方債証券	6.65
特殊債券	7.42
社債券	5.67
合計	99.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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2014年11月28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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	85,233,258,549	38.98
	カナダ	5,088,939,474	2.33
	メキシコ	2,425,201,889	1.11
	ドイツ	18,073,642,521	8.27
	イタリア	22,242,636,706	10.17
	フランス	22,002,097,124	10.06
	オランダ	5,846,367,536	2.67
	スペイン	12,114,906,019	5.54
	ベルギー	5,877,361,718	2.69
	オーストリア	3,653,560,176	1.67
	フィンランド	1,444,661,036	0.66
	アイルランド	1,789,014,741	0.82
	イギリス	18,000,178,790	8.23
	スイス	743,287,979	0.34
	スウェーデン	1,095,402,436	0.50
	ノルウェー	614,627,358	0.28
	デンマーク	1,827,506,374	0.84
	ポーランド	1,396,594,707	0.64
	オーストラリア	3,646,413,624	1.67
	シンガポール	840,717,833	0.38
マレーシア	1,111,798,334	0.51	
南アフリカ	1,196,132,820	0.55	
	小計	216,264,307,744	98.90
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,395,414,467	1.10
合計（純資産総額）		218,659,722,211	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		323,475,270	0.15

(注)為替予約取引は、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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,200,000	12,706.95	2,312,665,624	12,657.07	2,303,587,777	5.125	2016/5/15	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,700,000	12,481.57	2,209,239,314	12,437.24	2,201,391,798	4.500	2016/2/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,900,000	13,079.19	2,079,591,806	13,069.03	2,077,976,303	3.625	2021/2/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	16,584.52	1,990,143,422	16,519.87	1,982,384,578	8.000	2021/11/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,200,000	12,978.51	1,972,734,055	12,951.72	1,968,662,509	3.750	2018/11/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	13,043.13	1,799,952,437	13,021.92	1,797,025,801	3.625	2020/2/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,300,000	12,093.63	1,729,389,927	12,070.54	1,726,087,801	2.125	2015/12/31	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	12,877.83	1,674,118,326	12,849.19	1,670,395,928	3.375	2019/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,100,000	12,160.14	1,471,376,968	12,140.74	1,469,029,918	2.250	2016/3/31	0.67
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,080,000	17,506.49	1,414,524,877	17,617.46	1,423,491,106	3.250	2021/7/4	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	12,374.43	1,423,059,692	12,339.33	1,419,023,246	3.250	2016/5/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	15,489.05	1,394,014,830	15,400.38	1,386,034,305	8.125	2019/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,500,000	11,902.43	1,368,780,114	11,895.04	1,367,930,336	1.500	2018/12/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,700,000	13,513.31	1,310,791,994	13,433.88	1,303,086,724	7.500	2016/11/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,950,000	16,446.90	1,307,528,661	16,369.31	1,301,360,380	8.750	2020/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	13,022.84	1,276,239,277	12,960.96	1,270,174,448	4.250	2017/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	12,399.37	1,239,937,125	12,365.19	1,236,519,539	3.250	2016/6/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	12,392.90	1,239,290,554	12,356.88	1,235,688,234	3.000	2016/8/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	12,981.65	1,233,257,130	12,955.42	1,230,765,063	3.500	2020/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	12,091.78	1,209,178,851	12,071.46	1,207,146,773	2.000	2016/1/31	0.55
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,160,000	22,742.40	1,173,507,840	23,373.68	1,206,081,987	9.000	2023/11/1	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,250,000	12,920.32	1,195,129,801	12,865.82	1,190,088,862	4.625	2017/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	13,067.96	1,189,184,533	13,030.23	1,185,751,762	4.000	2018/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,500,000	12,491.73	1,186,715,151	12,462.18	1,183,907,189	2.750	2018/2/28	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	13,091.20	1,178,208,133	13,018.23	1,171,640,827	7.250	2016/5/15	0.54
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,320,000	15,510.46	1,135,365,965	15,523.68	1,136,334,102	3.750	2016/8/1	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,974.81	1,141,784,057	12,903.69	1,135,525,256	4.500	2017/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	14,241.17	1,139,293,837	14,149.72	1,131,978,356	8.750	2017/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	13,117.06	1,128,067,529	13,063.49	1,123,460,254	4.750	2017/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,507.44	1,125,669,677	12,465.87	1,121,928,806	3.125	2017/1/31	0.51

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.90
合計	98.90

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	920,000.00	108,166,356	108,762,400	0.05
	加ドル	売建	100,000.00	10,455,400	10,420,000	0.00
	メキシコペソ	売建	1,419,000.00	12,220,853	12,146,640	0.01
	ユーロ	売建	842,000.00	123,682,821	123,933,980	0.06
	英ポンド	売建	179,000.00	33,171,101	33,242,090	0.02
	ノルウェークローネ	売建	692,000.00	11,899,839	11,764,000	0.01
	ポーランドズロチ	売建	339,000.00	11,923,138	11,929,410	0.01
	南アフリカランド	売建	1,049,000.00	11,280,421	11,276,750	0.01

(注)為替予約取引は、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。

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2014年11月28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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	12,179,846,645	39.32
	カナダ	749,192,317	2.42
	メキシコ	326,906,241	1.06
	ドイツ	2,545,350,059	8.22
	イタリア	3,132,071,600	10.11
	フランス	3,109,309,702	10.04
	オランダ	833,081,951	2.69
	スペイン	1,701,450,353	5.49
	ベルギー	838,530,042	2.71
	オーストリア	530,159,194	1.71
	フィンランド	206,688,560	0.67
	アイルランド	280,286,082	0.90
	イギリス	2,567,220,253	8.29
	スイス	148,299,697	0.48
	スウェーデン	179,183,912	0.58
	ノルウェー	80,289,707	0.26
	デンマーク	254,265,458	0.82
ポーランド	193,707,360	0.63	
オーストラリア	547,571,974	1.77	

	シンガポール	146,165,954	0.47
	マレーシア	220,397,160	0.71
	南アフリカ	163,399,908	0.53
	小計	30,933,374,129	99.87
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		41,395,294	0.13
合計（純資産総額）		30,974,769,423	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		31,574,180,550	101.94

(注)為替予約取引は、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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,947.69	382,326,261	11,939.38	382,060,245	1.500	2018/8/31	1.23
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	12,053.91	361,617,539	12,041.91	361,257,306	1.500	2016/6/30	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	11,841.47	296,036,836	11,840.54	296,013,743	0.375	2016/4/30	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,450,000	11,980.02	293,510,593	11,967.09	293,193,773	1.375	2015/11/30	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,250,000	12,392.90	278,840,373	12,356.88	278,029,852	3.000	2016/8/31	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,150,000	12,701.41	273,080,357	12,678.32	272,583,883	3.125	2019/5/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	11,768.50	258,907,073	11,761.11	258,744,507	1.000	2018/5/31	0.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	12,721.73	254,434,655	12,715.26	254,305,341	3.125	2021/5/15	0.82
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,500,000	16,078.91	241,183,726	16,034.05	240,510,816	3.750	2017/4/25	0.78
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,540,000	15,511.79	238,881,615	15,523.68	239,064,825	3.750	2016/8/1	0.77
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,400,000	16,708.52	233,919,389	16,682.80	233,559,202	4.000	2018/4/25	0.75
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,110,000	20,929.40	232,316,371	21,029.99	233,432,956	5.000	2018/3/7	0.75
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000	20,278.54	223,063,955	21,092.37	232,016,075	6.500	2027/11/1	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,950,000	11,707.54	228,297,048	11,743.56	228,999,501	2.000	2023/2/15	0.74
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000	18,186.94	218,243,312	18,517.73	222,212,766	4.800	2024/1/31	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,650,000	13,150.31	216,980,222	13,412.63	221,308,548	3.625	2044/2/15	0.71
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,110,000	19,712.73	218,811,388	19,714.05	218,825,985	4.000	2016/9/7	0.71
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,340,000	16,181.39	216,830,682	16,118.02	215,981,568	5.000	2016/10/25	0.70
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,280,000	16,505.38	211,268,977	16,871.13	215,950,549	3.750	2021/8/1	0.70
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,320,000	16,406.66	216,568,012	16,353.07	215,860,648	4.250	2017/7/4	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,750,000	12,175.84	213,077,246	12,144.43	212,527,661	1.875	2017/9/30	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	13,079.19	209,267,100	13,069.03	209,104,534	3.625	2021/2/15	0.68

ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000	17,009.72	204,116,740	16,972.49	203,669,894	4.250	2018/7/4	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,932.91	202,859,587	11,909.82	202,467,027	1.000	2017/3/31	0.65
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000	16,587.30	199,047,632	16,689.39	200,272,772	4.500	2018/8/1	0.65
イギリス	国債証券	UK TREASURY	800,000	23,655.14	189,241,174	24,921.39	199,371,126	4.250	2046/12/7	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,715.85	199,169,519	11,703.84	198,965,387	0.625	2017/11/30	0.64
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,050,000	18,285.95	192,002,546	18,768.91	197,073,567	5.500	2022/9/1	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,091.20	196,368,022	13,018.23	195,273,471	7.250	2016/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,160.14	194,562,244	12,140.74	194,251,890	2.250	2016/3/31	0.63

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.87
合計	99.87

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	104,770,000.00	11,312,773,870	12,378,511,990	39.96
	加ドル	売建	7,297,000.00	700,313,499	759,502,430	2.45
	メキシコペソ	売建	39,361,000.00	315,477,741	336,249,420	1.09
	ユーロ	売建	91,458,000.00	12,542,421,955	13,459,149,010	43.45
	英ポンド	売建	14,133,000.00	2,461,688,568	2,622,355,140	8.47
	スイスフラン	売建	1,291,000.00	146,856,276	158,123,900	0.51
	スウェーデンクローナ	売建	11,558,000.00	172,029,141	183,332,580	0.59
	ノルウェークローネ	売建	4,803,000.00	78,475,136	81,510,710	0.26
	デンマーククローネ	売建	13,281,000.00	245,838,728	262,588,760	0.85
	ポーランドズロチ	売建	5,533,000.00	179,647,104	194,251,820	0.63
	豪ドル	売建	5,514,000.00	523,064,586	553,796,370	1.79
	シンガポールドル	売建	1,622,000.00	137,779,108	147,185,530	0.48
	マレーシアリングット	売建	7,712,000.00	254,727,360	270,922,560	0.87
	南アフリカランド	売建	15,628,000.00	152,471,885	166,700,330	0.54

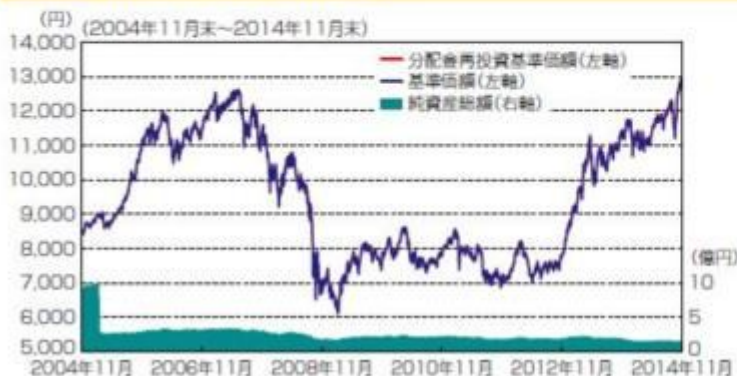
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2014年11月28日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 12,928円

純資産総額…………… 1.57億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2004年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2010年10月	2011年10月	2012年10月	2013年10月	2014年10月	設定来累計
0円	0円	0円	10円	10円	40円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60.32%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.29%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	10.07%
日本債券インデックスマザーファンド	4.84%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.06%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.86%
現金その他	4.56%

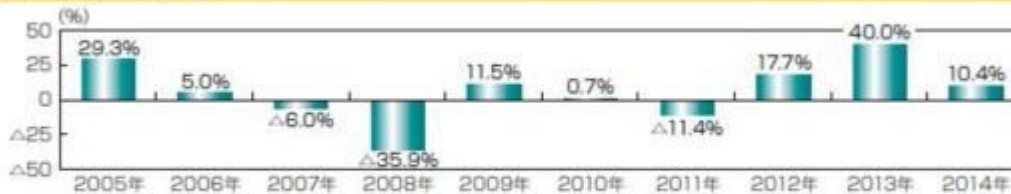
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.86%
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.62%
	3 ソフトバンク	情報・通信業	2.00%
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 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.24%
	2 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.27%
	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.18%
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 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.23%
	2 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1.26%
	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.17%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	国債証券	2.25%
	2 第305回利付国債(10年)	国債証券	2.03%
	3 第107回利付国債(5年)	国債証券	2.02%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン5.125%)	国債証券	1.05%
	2 US TREASURY N/B(クーポン4.500%)	国債証券	1.01%
	3 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	0.95%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン1.500%)	国債証券	1.23%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.500%)	国債証券	1.17%
	3 US TREASURY N/B(クーポン0.375%)	国債証券	0.96%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2014年は、2014年11月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(5) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(7) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

(8) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(9) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請

求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金(解約)手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時まで、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の扱いとなります。

(3) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

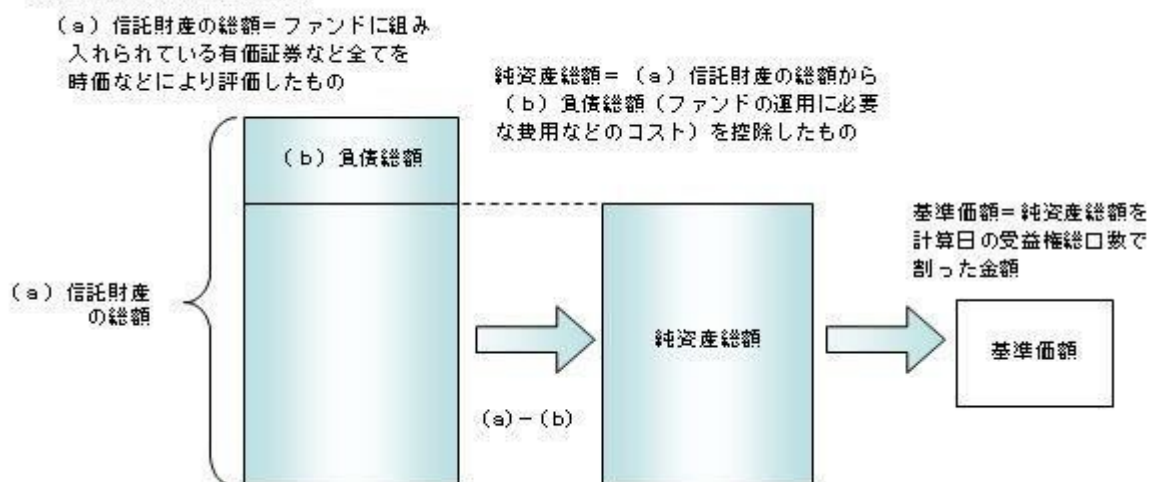
基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

・基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

す。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

- 信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 - 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
 - 価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（平成11年10月29日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年10月27日から翌年10月26日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
 - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

 - ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
 - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

 - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
 - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

 - 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行いません。
 - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(平成25年10月29日から平成26年10月27日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成25年10月28日現在	第15期 平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,820,062	7,964,763
親投資信託受益証券	188,989,358	142,585,795
未収入金	4,306,774	-
未収利息	18	10
流動資産合計	204,116,212	150,550,568
資産合計	204,116,212	150,550,568
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	181,289	127,495
未払解約金	4,362,030	-
未払受託者報酬	53,959	42,276
未払委託者報酬	767,095	601,179
その他未払費用	5,237	4,095
流動負債合計	5,369,610	775,045
負債合計	5,369,610	775,045
純資産の部		
元本等		
元本	181,289,228	127,495,366
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,457,374	22,280,157
（分配準備積立金）	30,098,302	29,785,786
元本等合計	198,746,602	149,775,523
純資産合計	198,746,602	149,775,523
負債純資産合計	204,116,212	150,550,568

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自	平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
営業収益				
受取利息		6,275		4,590
有価証券売買等損益		79,863,998		13,384,363
営業収益合計		79,870,273		13,388,953
営業費用				
受託者報酬		107,769		86,452
委託者報酬		1,532,040		1,229,339
その他費用		10,459		8,354
営業費用合計		1,650,268		1,324,145
営業利益又は営業損失（ ）		78,220,005		12,064,808
経常利益又は経常損失（ ）		78,220,005		12,064,808
当期純利益又は当期純損失（ ）		78,220,005		12,064,808
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		18,364,007		2,384,961
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		61,262,243		17,457,374
剰余金増加額又は欠損金減少額		19,577,775		1,059,006
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		19,577,775		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,059,006
剰余金減少額又は欠損金増加額		532,867		5,788,575
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		5,788,575
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		532,867		-
分配金		181,289		127,495
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,457,374		22,280,157

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成25年10月29日から平成26年10月27日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第14期 平成25年10月28日現在	第15期 平成26年10月27日現在
1.	期首元本額	246,845,047円	181,289,228円
	期中追加設定元本額	14,612,172円	7,347,662円
	期中一部解約元本額	80,167,991円	61,141,524円
2.	受益権の総数	181,289,228口	127,495,366口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日		第15期 自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	5,170円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 3,774円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	16,087,056円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 9,676,073円
C	信託約款に定める収益調整金	24,660,636円	C 信託約款に定める収益調整金 18,412,114円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	14,187,365円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 20,233,434円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	54,940,227円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 48,325,395円
F	分配対象収益(1万口当たり)	3,030円	F 分配対象収益(1万口当たり) 3,790円
G	分配金額	181,289円	G 分配金額 127,495円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	第15期 自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第14期 平成25年10月28日現在	第15期 平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第14期（平成25年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	58,976,399
合計	58,976,399

第15期（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	10,672,501
合計	10,672,501

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第14期 平成25年10月28日現在		第15期 平成26年10月27日現在	
1口当たり純資産額	1.0963円	1口当たり純資産額	1.1748円
(1万口当たり純資産額)	(10,963円)	(1万口当たり純資産額)	(11,748円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	8,709,856	15,144,697	
	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	12,816,904	15,070,115	
	日本債券インデックスマザーファンド	5,673,295	7,431,449	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	3,413,105	7,411,557	
	海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド	5,193,282	7,407,178	
	日本株式インデックストOPIXマザーファンド	86,579,690	90,120,799	
合計		122,386,132	142,585,795	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本株式インデックストOPIX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、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。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

日本株式インデックストOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位: 円)		
	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	82,932,319	199,737,855
株式	27,515,161,350	26,552,269,460
派生商品評価勘定	876,162	2,624,875
未収入金	22,182,500	-
未収配当金	203,445,922	205,942,225

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
未収利息	139	275
前払金	5,040,000	13,160,000
流動資産合計	27,829,638,392	26,973,734,690
資産合計	27,829,638,392	26,973,734,690
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,712,158	13,013,526
未払金	-	87,710,100
未払解約金	22,587,405	6,618,756
流動負債合計	24,299,563	107,342,382
負債合計	24,299,563	107,342,382
純資産の部		
元本等		
元本	28,535,557,496	25,810,439,886
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	730,218,667	1,055,952,422
元本等合計	27,805,338,829	26,866,392,308
純資産合計	27,805,338,829	26,866,392,308
負債純資産合計	27,829,638,392	26,973,734,690

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式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 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>
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 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
1. 期首	平成24年10月27日	平成25年10月29日
期首元本額	40,986,230,601円	28,535,557,496円
期首からの追加設定元本額	1,271,459,203円	1,614,921,276円
期首からの一部解約元本額	13,722,132,308円	4,340,038,886円
元本の内訳		

DCインデックスバランス(株式20)	165,248,170円	199,050,793円
DCインデックスバランス(株式40)	634,585,909円	746,489,090円
DCインデックスバランス(株式60)	1,220,047,095円	1,375,400,721円
DCインデックスバランス(株式80)	1,461,068,741円	1,622,735,239円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,058,995,323円	1,102,978,773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	9,629,648,475円	7,701,764,892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	10,879,626円	6,818,156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)	28,627,449円	32,558,972円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	122,665,512円	86,579,690円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	90,261,923円	70,644,917円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	143,937,380円	105,571,690円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	180,700,510円	132,571,175円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	9,907,936,510円	8,728,480,826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)	59,733,916円	35,523,870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)	74,653,904円	56,560,448円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	55,661,438円	52,235,800円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	310,402,328円	325,131,480円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	895,072,288円	915,340,940円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,226,663,814円	1,270,208,834円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,258,767,185円	1,243,793,580円
計	28,535,557,496円	25,810,439,886円
2. 受益権の総数	28,535,557,496口	25,810,439,886口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	730,218,667円	-円
4. 担保資産 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とおりであります。 株式	362,072,000円	374,734,600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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
--	--------------------------------	--------------------------------

金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,131,056,774
合計	10,131,056,774

(平成26年10月27日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,154,246,609
合計	1,154,246,609

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(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)

(平成25年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	300,120,000	-	299,375,000	745,000
合計		300,120,000	-	299,375,000	745,000

(平成26年10月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	324,285,000	-	314,000,000	10,285,000
合計		324,285,000	-	314,000,000	10,285,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末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おります。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成25年10月28日現在		平成26年10月27日現在	
1口当たり純資産額	0.9744円	1口当たり純資産額	1.0409円
(1万口当たり純資産額)	(9,744円)	(1万口当たり純資産額)	(10,409円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	7,000	249.00	1,743,000	
日本水産	20,500	324.00	6,642,000	
マルハニチロ	3,200	1,544.00	4,940,800	
サカタのタネ	2,400	1,576.00	3,782,400	
ホクト	1,800	2,012.00	3,621,600	
住石ホールディングス	4,900	116.00	568,400	
日鉄鉱業	4,000	398.00	1,592,000	
三井松島産業	11,000	129.00	1,419,000	
国際石油開発帝石	80,600	1,331.00	107,278,600	
日本海洋掘削	400	4,185.00	1,674,000	
石油資源開発	2,400	3,560.00	8,544,000	
K & O エナジーグループ	1,100	1,302.00	1,432,200	
ショーボンドホールディングス	1,500	4,275.00	6,412,500	
ミライト・ホールディングス	4,700	1,229.00	5,776,300	
タマホーム	1,100	592.00	651,200	
サンヨーホームズ	100	688.00	68,800	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,700.00	340,000	

安藤・間	11,100	715.00	7,936,500
東急建設	5,900	554.00	3,268,600
コムシスホールディングス	8,000	1,831.00	14,648,000
ミサワホーム	1,800	1,092.00	1,965,600
高松コンストラクショングループ	1,300	2,076.00	2,698,800
東建コーポレーション	600	4,845.00	2,907,000
ヤマウラ	800	389.00	311,200
大成建設	84,000	605.00	50,820,000
大林組	50,000	742.00	37,100,000
清水建設	51,000	794.00	40,494,000
飛島建設	10,800	305.00	3,294,000
長谷工コーポレーション	22,100	754.00	16,663,400
松井建設	2,000	519.00	1,038,000
銭高組	3,000	310.00	930,000
鹿島建設	73,000	513.00	37,449,000
不動テトラ	11,800	275.00	3,245,000
大末建設	700	863.00	604,100
鉄建建設	10,000	488.00	4,880,000
日鉄住金テックスエンジ	3,000	543.00	1,629,000
西松建設	22,000	533.00	11,726,000
三井住友建設	44,800	129.00	5,779,200
大豊建設	5,000	514.00	2,570,000
前田建設工業	10,000	965.00	9,650,000
ナカノフドー建設	1,300	357.00	464,100
奥村組	15,000	608.00	9,120,000
大和小田急建設	900	840.00	756,000
東鉄工業	2,000	2,387.00	4,774,000
イチケン	2,000	293.00	586,000
浅沼組	5,000	173.00	865,000
戸田建設	19,000	484.00	9,196,000
熊谷組	24,000	404.00	9,696,000
青木あすなる建設	1,000	786.00	786,000
北野建設	4,000	332.00	1,328,000
植木組	2,000	266.00	532,000
三井ホーム	2,000	478.00	956,000
矢作建設工業	2,300	714.00	1,642,200
ピーエス三菱	1,400	474.00	663,600
東日本ハウス	2,100	497.00	1,043,700
大東建託	6,300	12,945.00	81,553,500
新日本建設	2,000	379.00	758,000
N I P P O	4,000	1,957.00	7,828,000
東亜道路工業	3,000	407.00	1,221,000

前田道路	5,000	1,658.00	8,290,000
日本道路	4,000	606.00	2,424,000
東亜建設工業	15,000	194.00	2,910,000
若築建設	9,000	225.00	2,025,000
東洋建設	5,200	495.00	2,574,000
五洋建設	19,600	340.00	6,664,000
大林道路	2,000	734.00	1,468,000
福田組	3,000	1,175.00	3,525,000
住友林業	11,400	1,130.00	12,882,000
日本基礎技術	1,900	391.00	742,900
日成ビルド工業	4,000	274.00	1,096,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	101.00	808,000
巴コーポレーション	2,100	415.00	871,500
パナホーム	6,000	716.00	4,296,000
大和ハウス工業	45,500	1,945.50	88,520,250
ライト工業	3,500	1,060.00	3,710,000
積水ハウス	44,600	1,304.50	58,180,700
日特建設	2,000	559.00	1,118,000
北陸電気工事	1,000	551.00	551,000
ユアテック	3,000	532.00	1,596,000
西部電気工業	2,000	461.00	922,000
四電工	2,000	388.00	776,000
中電工	2,400	1,669.00	4,005,600
関電工	8,000	523.00	4,184,000
きんでん	11,000	1,087.00	11,957,000
東京エネシス	2,000	686.00	1,372,000
トーエネック	2,000	533.00	1,066,000
住友電設	1,200	1,379.00	1,654,800
日本電設工業	2,700	1,620.00	4,374,000
協和エクシオ	6,500	1,311.00	8,521,500
新日本空調	1,400	858.00	1,201,200
N D S	3,000	309.00	927,000
九電工	3,000	1,158.00	3,474,000
三機工業	3,400	754.00	2,563,600
日揮	17,000	2,649.50	45,041,500
中外炉工業	4,000	209.00	836,000
ヤマト	1,000	391.00	391,000
太平電業	2,000	832.00	1,664,000
高砂熱学工業	4,600	1,347.00	6,196,200
三晃金属工業	2,000	255.00	510,000
朝日工業社	2,000	390.00	780,000
明星工業	3,000	681.00	2,043,000

大気社	2,200	2,406.00	5,293,200
ダイダン	2,000	609.00	1,218,000
日比谷総合設備	1,800	1,623.00	2,921,400
東芝プラントシステム	2,700	1,788.00	4,827,600
東洋エンジニアリング	9,000	550.00	4,950,000
千代田化工建設	13,000	1,067.00	13,871,000
新興プランテック	3,400	803.00	2,730,200
日本製粉	10,000	540.00	5,400,000
日清製粉グループ本社	18,000	1,033.00	18,594,000
日東富士製粉	2,000	314.00	628,000
昭和産業	7,000	414.00	2,898,000
鳥越製粉	1,300	745.00	968,500
中部飼料	1,600	631.00	1,009,600
フィード・ワンホールディングス	10,200	106.00	1,081,200
東洋精糖	3,000	98.00	294,000
日本甜菜製糖	9,000	182.00	1,638,000
三井製糖	6,000	381.00	2,286,000
塩水港精糖	1,300	273.00	354,900
森永製菓	16,000	228.00	3,648,000
中村屋	4,000	410.00	1,640,000
江崎グリコ	2,900	3,665.00	10,628,500
名糖産業	800	1,078.00	862,400
不二家	9,000	194.00	1,746,000
山崎製パン	12,000	1,429.00	17,148,000
第一屋製パン	3,000	130.00	390,000
モロゾフ	3,000	348.00	1,044,000
亀田製菓	900	3,260.00	2,934,000
寿スピリッツ	300	2,180.00	654,000
カルビー	6,100	3,650.00	22,265,000
森永乳業	14,000	344.00	4,816,000
六甲バター	700	1,149.00	804,300
ヤクルト本社	9,700	5,670.00	54,999,000
明治ホールディングス	4,900	8,700.00	42,630,000
雪印メグミルク	3,600	1,424.00	5,126,400
プリマハム	8,000	262.00	2,096,000
日本ハム	10,000	2,486.00	24,860,000
伊藤ハム	9,000	554.00	4,986,000
林兼産業	6,000	74.00	444,000
丸大食品	8,000	413.00	3,304,000
米久	600	1,519.00	911,400
S Foods	1,000	2,112.00	2,112,000
サッポロホールディングス	27,000	441.00	11,907,000

アサヒグループホールディングス	33,300	3,263.50	108,674,550
キリンホールディングス	70,900	1,388.00	98,409,200
宝ホールディングス	13,000	798.00	10,374,000
オエノンホールディングス	4,000	227.00	908,000
養命酒製造	1,000	833.00	833,000
コカ・コーラウエスト	5,600	1,517.00	8,495,200
コカ・コーライーストジャパン	5,000	1,889.00	9,445,000
サントリー食品インターナショナル	9,900	3,885.00	38,461,500
ダイトードリンコ	800	4,565.00	3,652,000
伊藤園	4,500	2,154.00	9,693,000
キーコーヒー	1,600	1,595.00	2,552,000
ユニカフェ	500	661.00	330,500
ジャパンフーズ	200	1,080.00	216,000
日清オイリオグループ	7,000	401.00	2,807,000
不二製油	4,000	1,808.00	7,232,000
かどや製油	100	2,546.00	254,600
J - オイルミルズ	7,000	355.00	2,485,000
キッコーマン	14,000	2,264.00	31,696,000
味の素	38,000	1,972.50	74,955,000
キューピー	8,400	1,837.00	15,430,800
ハウス食品グループ本社	5,700	1,874.00	10,681,800
カゴメ	6,400	1,723.00	11,027,200
焼津水産化学工業	700	959.00	671,300
アリアケジャパン	1,500	2,388.00	3,582,000
ニチレイ	18,000	431.00	7,758,000
東洋水産	8,100	3,560.00	28,836,000
イトアンド	100	1,658.00	165,800
日清食品ホールディングス	6,500	5,760.00	37,440,000
永谷園	1,000	1,039.00	1,039,000
フジッコ	2,000	1,648.00	3,296,000
ロック・フィールド	900	1,895.00	1,705,500
日本たばこ産業	91,900	3,559.00	327,072,100
ケンコーマヨネーズ	600	1,181.00	708,600
わらべや日洋	1,000	1,914.00	1,914,000
なとり	800	1,124.00	899,200
ミヨシ油脂	6,000	134.00	804,000
片倉工業	1,900	1,223.00	2,323,700
ゲンゼ	12,000	297.00	3,564,000
東洋紡	65,000	149.00	9,685,000
ユニチカ	43,000	46.00	1,978,000
富士紡ホールディングス	8,000	287.00	2,296,000
日清紡ホールディングス	10,000	822.00	8,220,000

倉敷紡績	16,000	178.00	2,848,000
シキボウ	9,000	120.00	1,080,000
日本毛織	5,000	747.00	3,735,000
大東紡織	3,000	72.00	216,000
トーア紡コーポレーション	8,000	74.00	592,000
ダイドーリミテッド	1,800	499.00	898,200
帝国繊維	1,600	2,633.00	4,212,800
帝人	63,000	253.00	15,939,000
東レ	112,000	705.60	79,027,200
サカイオーベックス	4,000	152.00	608,000
住江織物	4,000	282.00	1,128,000
日本フェルト	900	473.00	425,700
イチカワ	1,000	273.00	273,000
日本バイリーン	2,000	604.00	1,208,000
日東製網	2,000	151.00	302,000
芦森工業	4,000	184.00	736,000
アツギ	13,000	113.00	1,469,000
ダイニック	3,000	169.00	507,000
セーレン	4,200	970.00	4,074,000
東海染工	2,000	117.00	234,000
小松精練	2,600	515.00	1,339,000
ワコールホールディングス	9,000	1,103.00	9,927,000
ホギメディカル	1,000	5,420.00	5,420,000
レナウン	3,800	113.00	429,400
クラウディア	200	1,201.00	240,200
T S Iホールディングス	7,400	643.00	4,758,200
三陽商会	8,000	251.00	2,008,000
ナイガイ	6,000	58.00	348,000
オンワードホールディングス	10,000	648.00	6,480,000
ルック	3,000	229.00	687,000
キムラタン	71,000	9.00	639,000
ゴールドウイン	4,000	593.00	2,372,000
デサント	3,000	896.00	2,688,000
キング	800	422.00	337,600
ヤマトインターナショナル	1,000	387.00	387,000
特種東海製紙	9,000	240.00	2,160,000
王子ホールディングス	68,000	368.00	25,024,000
日本製紙	8,000	1,527.00	12,216,000
三菱製紙	23,000	84.00	1,932,000
北越紀州製紙	10,500	423.00	4,441,500
中越パルプ工業	6,000	173.00	1,038,000
巴川製紙所	3,000	185.00	555,000

大王製紙	6,000	944.00	5,664,000
レンゴー	12,000	467.00	5,604,000
トーモク	5,000	291.00	1,455,000
ザ・パックス	1,100	2,181.00	2,399,100
クラレ	24,600	1,247.00	30,676,200
旭化成	97,000	863.00	83,711,000
共和レザー	1,000	777.00	777,000
コープケミカル	3,000	103.00	309,000
昭和電工	103,000	137.00	14,111,000
住友化学	114,000	363.00	41,382,000
日本化成	3,000	140.00	420,000
住友精化	3,000	642.00	1,926,000
日産化学工業	10,300	1,839.00	18,941,700
ラサ工業	6,000	129.00	774,000
クレハ	11,000	509.00	5,599,000
多木化学	1,000	712.00	712,000
テイカ	3,000	431.00	1,293,000
石原産業	28,000	82.00	2,296,000
片倉チッカリン	1,000	261.00	261,000
日本曹達	10,000	580.00	5,800,000
東ソー	41,000	432.00	17,712,000
トクヤマ	24,000	314.00	7,536,000
セントラル硝子	15,000	348.00	5,220,000
東亜合成	19,000	458.00	8,702,000
ダイソー	6,000	344.00	2,064,000
関東電化工業	4,000	393.00	1,572,000
電気化学工業	30,000	346.00	10,380,000
信越化学工業	27,800	6,898.00	191,764,400
日本カーバイド工業	5,000	221.00	1,105,000
堺化学工業	6,000	319.00	1,914,000
エア・ウォーター	13,000	1,676.00	21,788,000
大陽日酸	20,000	960.00	19,200,000
日本化学工業	6,000	158.00	948,000
日本パーカライジング	3,600	2,442.00	8,791,200
高圧ガス工業	2,000	567.00	1,134,000
四国化成工業	2,000	756.00	1,512,000
戸田工業	3,000	350.00	1,050,000
ステラ ケミファ	800	1,502.00	1,201,600
保土谷化学工業	5,000	191.00	955,000
日本触媒	13,000	1,262.00	16,406,000
大日精化工業	6,000	585.00	3,510,000
カネカ	19,000	579.00	11,001,000

三菱瓦斯化学	25,000	625.00	15,625,000
三井化学	70,000	308.00	21,560,000
J S R	14,200	1,875.00	26,625,000
東京応化工業	3,000	2,836.00	8,508,000
大阪有機化学工業	1,100	468.00	514,800
三菱ケミカルホールディングス	96,900	519.40	50,329,860
日本合成化学工業	3,000	701.00	2,103,000
ダイセル	20,000	1,207.00	24,140,000
住友ベークライト	12,000	419.00	5,028,000
積水化学工業	32,000	1,251.00	40,032,000
日本ゼオン	12,000	965.00	11,580,000
アイカ工業	4,300	2,190.00	9,417,000
宇部興産	78,000	161.00	12,558,000
積水樹脂	2,200	1,398.00	3,075,600
タキロン	4,000	522.00	2,088,000
旭有機材工業	5,000	245.00	1,225,000
日立化成	6,700	1,849.00	12,388,300
ニチバン	1,000	379.00	379,000
リケンテクノス	2,500	466.00	1,165,000
大倉工業	4,000	352.00	1,408,000
積水化成成品工業	5,000	291.00	1,455,000
群栄化学工業	4,000	325.00	1,300,000
タイガースポリマー	800	658.00	526,400
ミライアル	500	1,568.00	784,000
ダイキョーニシカワ	400	2,586.00	1,034,400
日本化薬	11,000	1,270.00	13,970,000
カーリットホールディングス	1,300	563.00	731,900
日本精化	1,300	772.00	1,003,600
A D E K A	6,700	1,343.00	8,998,100
日油	13,000	714.00	9,282,000
新日本理化	2,500	220.00	550,000
ハリマ化成グループ	1,300	499.00	648,700
花王	42,700	4,168.50	177,994,950
第一工業製薬	3,000	396.00	1,188,000
三洋化成工業	5,000	710.00	3,550,000
大日本塗料	9,000	149.00	1,341,000
日本ペイントホールディングス	13,000	2,219.00	28,847,000
関西ペイント	19,000	1,556.00	29,564,000
神東塗料	1,000	197.00	197,000
中国塗料	5,000	830.00	4,150,000
日本特殊塗料	1,200	681.00	817,200
藤倉化成	2,000	535.00	1,070,000

太陽ホールディングス	1,300	3,435.00	4,465,500
D I C	62,000	218.00	13,516,000
サカティンクス	3,200	1,061.00	3,395,200
東洋インキ S C ホールディングス	14,000	478.00	6,692,000
T & K T O K A	500	2,324.00	1,162,000
富士フィルムホールディングス	35,400	3,691.00	130,661,400
資生堂	27,600	1,791.50	49,445,400
ライオン	18,000	594.00	10,692,000
高砂香料工業	6,000	496.00	2,976,000
マンダム	1,500	3,650.00	5,475,000
ミルボン	900	3,395.00	3,055,500
ファンケル	3,600	1,512.00	5,443,200
コーセー	2,500	4,170.00	10,425,000
コタ	500	1,256.00	628,000
ドクターシーラボ	1,100	3,420.00	3,762,000
シーボン	100	2,311.00	231,100
ポーラ・オルビスホールディングス	1,800	4,385.00	7,893,000
ノエビアホールディングス	1,000	1,929.00	1,929,000
アジュバンコスメジャパン	300	881.00	264,300
エステー	1,000	993.00	993,000
コニシ	1,100	1,977.00	2,174,700
長谷川香料	2,000	1,530.00	3,060,000
星光 P M C	900	888.00	799,200
小林製薬	2,500	6,510.00	16,275,000
荒川化学工業	1,300	1,074.00	1,396,200
メック	1,200	1,042.00	1,250,400
日本高純度化学	400	2,344.00	937,600
J C U	500	4,395.00	2,197,500
新田ゼラチン	1,000	834.00	834,000
アース製薬	1,100	4,020.00	4,422,000
イハラケミカル工業	2,400	1,059.00	2,541,600
北興化学工業	2,000	363.00	726,000
大成ラミック	400	2,672.00	1,068,800
クミアイ化学工業	3,000	643.00	1,929,000
日本農薬	3,500	1,090.00	3,815,000
アキレス	12,000	145.00	1,740,000
有沢製作所	2,600	718.00	1,866,800
日東電工	12,800	5,775.00	73,920,000
レック	500	1,133.00	566,500
きもと	2,300	299.00	687,700
藤森工業	1,300	2,890.00	3,757,000
前澤化成工業	1,100	1,060.00	1,166,000

J S P	1,000	1,785.00	1,785,000	
エフピコ	1,500	3,025.00	4,537,500	
天馬	1,200	1,470.00	1,764,000	
信越ポリマー	3,000	546.00	1,638,000	
東リ	4,000	233.00	932,000	
ニフコ	3,400	3,295.00	11,203,000	
日本バルカー工業	6,000	295.00	1,770,000	
ユニ・チャーム	28,500	2,491.00	70,993,500	
協和発酵キリン	19,000	1,211.00	23,009,000	
武田薬品工業	58,000	4,579.50	265,611,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	176,500	1,626.50	287,077,250	
大日本住友製薬	11,000	1,284.00	14,124,000	
塩野義製薬	24,200	2,649.00	64,105,800	
田辺三菱製薬	12,900	1,651.00	21,297,900	
わかもと製薬	2,000	271.00	542,000	
あすか製薬	1,800	1,228.00	2,210,400	
日本新薬	4,000	3,260.00	13,040,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,756.00	826,800	
中外製薬	15,400	3,220.00	49,588,000	
科研製薬	5,000	2,658.00	13,290,000	
エーザイ	19,100	4,244.00	81,060,400	
ロート製薬	6,500	1,548.00	10,062,000	
小野薬品工業	7,000	10,020.00	70,140,000	
久光製薬	4,800	3,540.00	16,992,000	
有機合成薬品工業	1,000	248.00	248,000	
持田製薬	1,100	6,340.00	6,974,000	
参天製薬	5,700	6,110.00	34,827,000	
扶桑薬品工業	5,000	308.00	1,540,000	
日本ケミファ	2,000	557.00	1,114,000	
ツムラ	4,500	2,368.00	10,656,000	
日医工	3,600	1,805.00	6,498,000	
キッセイ薬品工業	2,900	2,732.00	7,922,800	
生化学工業	3,200	1,724.00	5,516,800	
栄研化学	1,200	1,917.00	2,300,400	
日水製薬	600	1,222.00	733,200	
鳥居薬品	1,100	2,982.00	3,280,200	
J C R ファーマ	1,200	2,385.00	2,862,000	
東和薬品	800	4,910.00	3,928,000	
富士製薬工業	400	1,966.00	786,400	
沢井製薬	2,500	6,540.00	16,350,000	
ゼリア新薬工業	2,400	2,167.00	5,200,800	

第一三共	48,800	1,685.00	82,228,000
キョーリン製薬ホールディングス	4,100	2,227.00	9,130,700
大幸薬品	700	1,900.00	1,330,000
ダイト	600	1,968.00	1,180,800
大塚ホールディングス	30,700	3,728.50	114,464,950
大正製薬ホールディングス	3,700	7,460.00	27,602,000
日本コークス工業	12,800	105.00	1,344,000
昭和シェル石油	13,800	908.00	12,530,400
コスモ石油	43,000	165.00	7,095,000
ニチレキ	2,000	851.00	1,702,000
東燃ゼネラル石油	23,000	943.00	21,689,000
ユシロ化学工業	800	1,377.00	1,101,600
ビーピー・カストロール	600	1,054.00	632,400
富士石油	4,000	313.00	1,252,000
MORESCO	500	1,684.00	842,000
出光興産	7,300	2,079.00	15,176,700
JXホールディングス	171,900	452.20	77,733,180
横浜ゴム	17,000	923.00	15,691,000
東洋ゴム工業	7,000	1,722.00	12,054,000
ブリヂストン	48,600	3,532.50	171,679,500
住友ゴム工業	12,100	1,449.00	17,532,900
藤倉ゴム工業	1,000	776.00	776,000
オカモト	5,000	435.00	2,175,000
フコク	700	1,121.00	784,700
ニッタ	1,500	2,420.00	3,630,000
住友理工	2,900	890.00	2,581,000
三ツ星ベルト	4,000	711.00	2,844,000
バンドー化学	6,000	413.00	2,478,000
日東紡績	11,000	360.00	3,960,000
旭硝子	76,000	538.70	40,941,200
日本板硝子	75,000	96.00	7,200,000
石塚硝子	2,000	162.00	324,000
日本山村硝子	6,000	162.00	972,000
日本電気硝子	32,000	481.00	15,392,000
オハラ	600	580.00	348,000
住友大阪セメント	29,000	338.00	9,802,000
太平洋セメント	91,000	395.00	35,945,000
デイ・シイ	1,600	487.00	779,200
日本ヒューム	1,500	854.00	1,281,000
日本コンクリート工業	2,900	611.00	1,771,900
三谷セキサン	800	1,786.00	1,428,800
ジャパンパイル	1,900	828.00	1,573,200

東海カーボン	13,000	274.00	3,562,000
日本カーボン	8,000	179.00	1,432,000
東洋炭素	900	1,912.00	1,720,800
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	247.00	2,223,000
TOTO	23,000	1,126.00	25,898,000
日本碍子	20,000	2,465.00	49,300,000
日本特殊陶業	13,300	3,095.00	41,163,500
ダントーホールディングス	2,000	140.00	280,000
MARUWA	400	3,125.00	1,250,000
品川リフラクトリーズ	4,000	267.00	1,068,000
黒崎播磨	3,000	229.00	687,000
ヨータイ	1,000	375.00	375,000
イソライト工業	800	193.00	154,400
東京窯業	2,000	199.00	398,000
ニッカトー	500	400.00	200,000
フジインコーポレーテッド	1,400	1,500.00	2,100,000
エーアンドエーマテリアル	3,000	102.00	306,000
ニチアス	7,000	648.00	4,536,000
ニチハ	1,900	923.00	1,753,700
新日鐵住金	655,000	260.70	170,758,500
神戸製鋼所	247,000	166.00	41,002,000
合同製鐵	8,000	149.00	1,192,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	39,500	1,965.00	77,617,500
日新製鋼	6,600	918.00	6,058,800
東京製鐵	8,600	554.00	4,764,400
共英製鋼	1,500	1,855.00	2,782,500
大和工業	3,200	3,415.00	10,928,000
東京鐵鋼	3,000	500.00	1,500,000
大阪製鐵	800	1,912.00	1,529,600
淀川製鋼所	11,000	402.00	4,422,000
東洋鋼鈑	4,000	553.00	2,212,000
丸一鋼管	5,200	2,555.00	13,286,000
モリ工業	2,000	403.00	806,000
大同特殊鋼	26,000	412.00	10,712,000
日本高周波鋼業	7,000	106.00	742,000
日本冶金工業	12,200	244.00	2,976,800
山陽特殊製鋼	8,000	354.00	2,832,000
愛知製鋼	8,000	377.00	3,016,000
日立金属	14,000	1,940.00	27,160,000
日本金属	4,000	148.00	592,000
大太平洋金属	11,000	342.00	3,762,000
新日本電工	9,500	260.00	2,470,000

栗本鐵工所	8,000	220.00	1,760,000
虹技	2,000	224.00	448,000
日本鑄鉄管	2,000	231.00	462,000
三菱製鋼	9,000	221.00	1,989,000
日亜鋼業	2,000	316.00	632,000
日本精線	1,000	711.00	711,000
シンニッタン	1,500	549.00	823,500
新家工業	3,000	167.00	501,000
大紀アルミニウム工業所	3,000	299.00	897,000
日本軽金属ホールディングス	35,200	146.00	5,139,200
三井金属鉱業	40,000	269.00	10,760,000
東邦亜鉛	9,000	361.00	3,249,000
三菱マテリアル	97,000	321.00	31,137,000
住友金属鉱山	40,000	1,419.50	56,780,000
D O W Aホールディングス	17,000	862.00	14,654,000
古河機械金属	26,000	210.00	5,460,000
エス・サイエンス	7,200	47.00	338,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	2,026.00	3,444,200
東邦チタニウム	2,700	629.00	1,698,300
U A C J	20,000	394.00	7,880,000
古河電気工業	49,000	187.00	9,163,000
住友電気工業	58,300	1,449.00	84,476,700
フジクラ	25,000	484.00	12,100,000
昭和電線ホールディングス	20,000	99.00	1,980,000
タツタ電線	2,300	585.00	1,345,500
沖電線	2,000	281.00	562,000
カナレ電気	200	1,671.00	334,200
平河ヒューテック	300	1,001.00	300,300
リョービ	9,000	297.00	2,673,000
アーレスティ	1,300	687.00	893,100
アサヒホールディングス	2,300	1,765.00	4,059,500
稲葉製作所	700	1,330.00	931,000
宮地エンジニアリンググループ	5,000	203.00	1,015,000
トーカロ	1,000	1,939.00	1,939,000
アルファC o	500	1,047.00	523,500
S U M C O	10,700	1,293.00	13,835,100
川田テクノロジーズ	300	4,795.00	1,438,500
東洋製罐グループホールディングス	11,000	1,210.00	13,310,000
ホッカンホールディングス	4,000	272.00	1,088,000
コロナ	800	1,145.00	916,000
横河ブリッジホールディングス	3,000	1,436.00	4,308,000
駒井ハルテック	3,000	264.00	792,000

高田機工	1,000	214.00	214,000
三和ホールディングス	12,600	727.00	9,160,200
文化シャッター	4,000	919.00	3,676,000
三協立山	1,900	1,883.00	3,577,700
東洋シャッター	400	694.00	277,600
LIXILグループ	21,600	2,200.00	47,520,000
日本ファイルコン	1,200	498.00	597,600
ノーリツ	3,000	1,984.00	5,952,000
長府製作所	1,600	2,972.00	4,755,200
リンナイ	2,400	9,370.00	22,488,000
ダイニチ工業	800	733.00	586,400
日東精工	2,000	355.00	710,000
三洋工業	2,000	195.00	390,000
岡部	3,000	1,016.00	3,048,000
中国工業	300	777.00	233,100
東プレ	3,000	1,503.00	4,509,000
高周波熱錬	2,300	772.00	1,775,600
東京製綱	11,000	164.00	1,804,000
サンコール	1,000	641.00	641,000
モリテック スチール	800	324.00	259,200
パイオラックス	700	4,655.00	3,258,500
日本発條	12,300	949.00	11,672,700
中央発條	2,000	305.00	610,000
アドバネクス	3,000	160.00	480,000
三益半導体工業	1,300	933.00	1,212,900
日本ドライケミカル	200	2,296.00	459,200
日本製鋼所	22,000	371.00	8,162,000
三浦工業	6,900	1,192.00	8,224,800
タクマ	5,000	662.00	3,310,000
ツガミ	5,000	554.00	2,770,000
オークマ	10,000	748.00	7,480,000
東芝機械	9,000	427.00	3,843,000
アマダ	23,100	908.00	20,974,800
アイダエンジニアリング	3,400	1,009.00	3,430,600
滝澤鉄工所	5,000	214.00	1,070,000
富士機械製造	4,700	964.00	4,530,800
牧野フライス製作所	8,000	709.00	5,672,000
オーエスジー	7,100	1,703.00	12,091,300
ダイジェット工業	2,000	241.00	482,000
旭ダイヤモンド工業	4,000	1,285.00	5,140,000
D M G 森精機	9,200	1,208.00	11,113,600
ディスコ	1,700	7,350.00	12,495,000

日東工器	900	2,111.00	1,899,900
パンチ工業	300	1,495.00	448,500
豊和工業	900	729.00	656,100
大阪機工	6,000	147.00	882,000
東洋機械金属	1,200	464.00	556,800
津田駒工業	4,000	136.00	544,000
島精機製作所	2,000	1,747.00	3,494,000
日阪製作所	2,000	951.00	1,902,000
やまびこ	600	4,025.00	2,415,000
ペガサスマシン製造	1,400	760.00	1,064,000
ナブテスコ	7,100	2,583.00	18,339,300
三井海洋開発	1,600	2,567.00	4,107,200
レオン自動機	2,000	507.00	1,014,000
S M C	4,400	28,405.00	124,982,000
新川	1,300	519.00	674,700
ホソカワミクロン	3,000	585.00	1,755,000
ユニオンツール	800	2,688.00	2,150,400
オイレス工業	1,800	2,056.00	3,700,800
日精エー・エス・ビー機械	500	2,118.00	1,059,000
サトーホールディングス	1,700	2,676.00	4,549,200
日本エアテック	500	1,152.00	576,000
日精樹脂工業	1,100	880.00	968,000
ワイエイシイ	600	578.00	346,800
小松製作所	72,300	2,447.00	176,918,100
住友重機械工業	42,000	565.00	23,730,000
日立建機	7,900	2,041.00	16,123,900
日工	2,000	402.00	804,000
巴工業	600	1,795.00	1,077,000
井関農機	16,000	243.00	3,888,000
T O W A	1,300	631.00	820,300
丸山製作所	4,000	242.00	968,000
北川鉄工所	7,000	191.00	1,337,000
クボタ	80,000	1,617.50	129,400,000
荏原実業	500	1,403.00	701,500
三菱化工機	5,000	403.00	2,015,000
月島機械	2,500	1,106.00	2,765,000
帝国電機製作所	1,100	1,140.00	1,254,000
新東工業	3,600	711.00	2,559,600
澁谷工業	1,300	2,536.00	3,296,800
アイチ コーポレーション	2,200	505.00	1,111,000
小森コーポレーション	3,800	1,170.00	4,446,000
鶴見製作所	1,200	1,655.00	1,986,000

住友精密工業	3,000	409.00	1,227,000	
酒井重工業	3,000	265.00	795,000	
荏原製作所	34,000	571.00	19,414,000	
石井鐵工所	2,000	229.00	458,000	
西島製作所	1,700	809.00	1,375,300	
北越工業	1,000	1,034.00	1,034,000	
ダイキン工業	20,200	6,341.00	128,088,200	
オルガノ	2,000	489.00	978,000	
トーヨーカネツ	8,000	250.00	2,000,000	
栗田工業	9,300	2,273.00	21,138,900	
椿本チエイン	8,000	812.00	6,496,000	
大同工業	3,000	255.00	765,000	
日本コンベヤ	5,000	263.00	1,315,000	
木村化工機	1,500	450.00	675,000	
アネスト岩田	2,500	763.00	1,907,500	
ダイフク	6,300	1,120.00	7,056,000	
サムコ	200	981.00	196,200	
加藤製作所	3,000	746.00	2,238,000	
油研工業	3,000	238.00	714,000	
タダノ	7,000	1,620.00	11,340,000	
フジテック	4,300	1,130.00	4,859,000	
C K D	4,100	936.00	3,837,600	
キトー	1,700	1,218.00	2,070,600	
平和	3,200	2,172.00	6,950,400	
理想科学工業	1,100	3,050.00	3,355,000	
SANKYO	4,500	3,855.00	17,347,500	
日本金銭機械	1,400	1,726.00	2,416,400	
マースエンジニアリング	800	1,980.00	1,584,000	
福島工業	800	2,120.00	1,696,000	
オーイズミ	500	879.00	439,500	
ダイコク電機	600	1,885.00	1,131,000	
アマノ	4,200	1,139.00	4,783,800	
JUKI	11,000	338.00	3,718,000	
サンデン	8,000	619.00	4,952,000	
蛇の目マシン工業	14,000	174.00	2,436,000	
マックス	2,000	1,179.00	2,358,000	
グローリー	4,400	2,784.00	12,249,600	
新晃工業	1,000	988.00	988,000	
大和冷機工業	2,000	801.00	1,602,000	
セガサミーホールディングス	15,900	1,645.00	26,155,500	
日本ピストンリング	6,000	229.00	1,374,000	
リケン	6,000	416.00	2,496,000	

T P R	1,700	2,262.00	3,845,400
ホシザキ電機	3,200	5,010.00	16,032,000
大豊工業	1,100	1,107.00	1,217,700
日本精工	33,000	1,385.00	45,705,000
N T N	34,000	443.00	15,062,000
ジェイテクト	15,700	1,596.00	25,057,200
不二越	14,000	659.00	9,226,000
日本トムソン	5,000	476.00	2,380,000
T H K	9,200	2,559.00	23,542,800
ユーシン精機	700	2,095.00	1,466,500
前澤給装工業	600	1,327.00	796,200
イーグル工業	1,800	1,990.00	3,582,000
前澤工業	1,100	332.00	365,200
日本ピラー工業	1,600	858.00	1,372,800
キッツ	6,700	509.00	3,410,300
日立工機	4,000	937.00	3,748,000
マキタ	9,700	5,660.00	54,902,000
日立造船	11,700	549.00	6,423,300
三菱重工業	264,000	644.70	170,200,800
I H I	107,000	537.00	57,459,000
イビデン	9,000	1,696.00	15,264,000
コニカミノルタ	37,600	1,124.00	42,262,400
ブラザー工業	19,100	1,819.00	34,742,900
ミネベア	20,000	1,452.00	29,040,000
日立製作所	356,000	804.60	286,437,600
東芝	292,000	450.40	131,516,800
三菱電機	148,000	1,328.50	196,618,000
富士電機	41,000	465.00	19,065,000
東洋電機製造	3,000	373.00	1,119,000
安川電機	16,200	1,323.00	21,432,600
シンフォニアテクノロジー	9,000	156.00	1,404,000
明電舎	14,000	384.00	5,376,000
オリジン電気	2,000	409.00	818,000
山洋電気	3,000	828.00	2,484,000
デンヨー	1,500	1,361.00	2,041,500
東芝テック	9,000	680.00	6,120,000
芝浦メカトロニクス	3,000	292.00	876,000
マブチモーター	2,300	9,120.00	20,976,000
日本電産	16,100	6,920.00	111,412,000
東光高岳	800	1,442.00	1,153,600
宮越ホールディングス	500	546.00	273,000
ダイヘン	9,000	364.00	3,276,000

ヤーマン	200	1,322.00	264,400
JVCケンウッド	10,300	223.00	2,296,900
第一精工	500	1,999.00	999,500
日新電機	3,000	572.00	1,716,000
大崎電気工業	2,000	599.00	1,198,000
オムロン	16,700	4,630.00	77,321,000
日東工業	2,200	1,862.00	4,096,400
I D E C	1,900	890.00	1,691,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	29,000	529.00	15,341,000
サクサホールディングス	4,000	156.00	624,000
メルコホールディングス	700	1,542.00	1,079,400
テクノメディカ	300	2,233.00	669,900
日本電気	203,000	368.00	74,704,000
富士通	143,000	696.50	99,599,500
沖電気工業	66,000	242.00	15,972,000
岩崎通信機	7,000	86.00	602,000
電気興業	4,000	537.00	2,148,000
サンケン電気	8,000	815.00	6,520,000
ナカヨ	1,000	395.00	395,000
アイホン	800	1,814.00	1,451,200
ルネサスエレクトロニクス	7,600	780.00	5,928,000
セイコーエプソン	10,100	4,865.00	49,136,500
ワコム	11,700	397.00	4,644,900
アルバック	2,700	1,280.00	3,456,000
アクセル	700	1,464.00	1,024,800
E I Z O	1,300	2,313.00	3,006,900
ジャパンディスプレイ	24,800	326.00	8,084,800
日本信号	4,100	1,031.00	4,227,100
京三製作所	4,000	351.00	1,404,000
能美防災	1,900	1,536.00	2,918,400
ホーチキ	1,000	893.00	893,000
エレコム	500	2,385.00	1,192,500
日本無線	4,000	342.00	1,368,000
パナソニック	169,000	1,219.50	206,095,500
シャープ	107,000	265.00	28,355,000
アンリツ	8,600	758.00	6,518,800
富士通ゼネラル	3,000	1,301.00	3,903,000
日立国際電気	3,000	1,581.00	4,743,000
ソニー	84,800	1,883.50	159,720,800
T D K	8,900	5,850.00	52,065,000
帝国通信工業	4,000	171.00	684,000
ミツミ電機	5,600	644.00	3,606,400

タムラ製作所	6,000	385.00	2,310,000
アルプス電気	10,800	1,789.00	19,321,200
池上通信機	5,000	116.00	580,000
パイオニア	20,600	269.00	5,541,400
日本電波工業	1,400	834.00	1,167,600
鈴木	200	887.00	177,400
日本トリム	300	2,704.00	811,200
ローランド ディー . ジー .	600	4,350.00	2,610,000
フォスター電機	1,500	1,729.00	2,593,500
クラリオン	9,000	383.00	3,447,000
S M K	4,000	410.00	1,640,000
ヨコオ	1,300	556.00	722,800
東光	4,000	295.00	1,180,000
ティアック	8,000	53.00	424,000
ホシデン	4,400	560.00	2,464,000
ヒロセ電機	2,600	12,560.00	32,656,000
日本航空電子工業	4,000	2,297.00	9,188,000
T O A	1,600	1,070.00	1,712,000
日立マクセル	2,600	1,680.00	4,368,000
古野電気	1,900	867.00	1,647,300
ユニデン	5,000	222.00	1,110,000
アルパイン	3,200	1,785.00	5,712,000
スミダコーポレーション	1,400	725.00	1,015,000
アイコム	800	2,500.00	2,000,000
リオン	400	1,368.00	547,200
船井電機	1,500	1,054.00	1,581,000
横河電機	16,000	1,405.00	22,480,000
新電元工業	5,000	642.00	3,210,000
アズビル	4,500	2,463.00	11,083,500
東亜ディーケーケー	600	571.00	342,600
日本光電工業	3,100	5,510.00	17,081,000
チノー	600	1,186.00	711,600
共和電業	2,000	439.00	878,000
日本電子材料	700	550.00	385,000
堀場製作所	2,700	3,865.00	10,435,500
アドバンテスト	10,100	1,225.00	12,372,500
小野測器	800	916.00	732,800
エスベック	1,500	953.00	1,429,500
パナソニック デバイス S U N X	1,300	521.00	677,300
キーエンス	3,400	46,055.00	156,587,000
日置電機	800	1,679.00	1,343,200
シスメックス	12,400	4,360.00	54,064,000

メガチップス	1,300	1,400.00	1,820,000
O B A R A G R O U P	1,000	3,890.00	3,890,000
澤藤電機	1,000	225.00	225,000
コーセル	2,100	1,213.00	2,547,300
新日本無線	1,000	507.00	507,000
オブテックス	1,000	1,892.00	1,892,000
千代田インテグレ	700	1,691.00	1,183,700
レーザーテック	1,500	1,368.00	2,052,000
スタンレー電気	10,600	2,136.00	22,641,600
岩崎電気	6,000	223.00	1,338,000
ウシオ電機	9,000	1,102.00	9,918,000
岡谷電機産業	800	382.00	305,600
ヘリオス テクノ ホールディング	1,300	322.00	418,600
日本セラミック	900	1,524.00	1,371,600
遠藤照明	800	1,241.00	992,800
日本デジタル研究所	1,100	1,943.00	2,137,300
古河電池	1,000	932.00	932,000
双信電機	700	392.00	274,400
山一電機	1,600	791.00	1,265,600
図研	1,000	940.00	940,000
日本電子	6,000	497.00	2,982,000
カシオ計算機	14,800	1,748.00	25,870,400
ファナック	16,500	17,910.00	295,515,000
日本シイエムケイ	3,500	265.00	927,500
エンプラス	500	4,915.00	2,457,500
大真空	3,000	327.00	981,000
ローム	7,800	6,340.00	49,452,000
浜松ホトニクス	6,100	4,805.00	29,310,500
三井ハイテック	1,900	620.00	1,178,000
新光電気工業	5,000	633.00	3,165,000
京セラ	26,000	4,633.50	120,471,000
太陽誘電	7,200	1,062.00	7,646,400
村田製作所	15,500	11,755.00	182,202,500
ユーシン	2,100	676.00	1,419,600
双葉電子工業	2,700	1,426.00	3,850,200
北陸電気工業	6,000	160.00	960,000
ニチコン	4,700	689.00	3,238,300
日本ケミコン	10,000	304.00	3,040,000
K O A	1,800	962.00	1,731,600
市光工業	4,000	233.00	932,000
小糸製作所	8,100	2,910.00	23,571,000
ミツバ	2,700	1,619.00	4,371,300

スター精密	2,800	1,643.00	4,600,400	
S C R E E Nホールディングス	14,000	566.00	7,924,000	
キヤノン電子	1,300	1,913.00	2,486,900	
キヤノン	85,800	3,275.50	281,037,900	代用有価証券 10,000株
リコー	44,500	1,093.50	48,660,750	
M U T O Hホールディングス	2,000	513.00	1,026,000	
東京エレクトロン	13,300	6,463.00	85,957,900	
トヨタ紡織	5,200	1,187.00	6,172,400	
鬼怒川ゴム工業	3,000	446.00	1,338,000	
ユニプレス	2,400	2,122.00	5,092,800	
豊田自動織機	13,500	4,970.00	67,095,000	
モリタホールディングス	2,600	1,017.00	2,644,200	
三櫻工業	1,900	679.00	1,290,100	
デンソー	36,500	4,909.50	179,196,750	
東海理化電機製作所	3,900	2,121.00	8,271,900	
三井造船	57,000	229.00	13,053,000	
川崎重工業	115,000	405.00	46,575,000	
名村造船所	4,100	970.00	3,977,000	
サノヤスホールディングス	1,900	216.00	410,400	
日本車輛製造	5,000	336.00	1,680,000	
ニチュ三菱フォークリフト	1,700	781.00	1,327,700	
近畿車輛	3,000	292.00	876,000	
日産自動車	207,600	945.60	196,306,560	
いすゞ自動車	42,900	1,338.00	57,400,200	
トヨタ自動車	204,100	6,195.00	1,264,399,500	代用有価証券 35,000株
日野自動車	18,500	1,501.00	27,768,500	
三菱自動車工業	52,900	1,127.00	59,618,300	
エフテック	700	1,142.00	799,400	
レシップホールディングス	500	831.00	415,500	
G M B	200	1,325.00	265,000	
武蔵精密工業	1,600	2,117.00	3,387,200	
日産車体	7,200	1,372.00	9,878,400	
新明和工業	6,000	943.00	5,658,000	
極東開発工業	2,500	1,503.00	3,757,500	
日信工業	3,000	1,585.00	4,755,000	
トピー工業	12,000	191.00	2,292,000	
ティラド	6,000	253.00	1,518,000	
曙ブレーキ工業	6,900	418.00	2,884,200	
タチエス	2,200	1,360.00	2,992,000	
N O K	7,100	2,603.00	18,481,300	

フタバ産業	4,500	584.00	2,628,000
カヤバ工業	14,000	457.00	6,398,000
シロキ工業	3,000	217.00	651,000
大同メタル工業	2,000	1,212.00	2,424,000
プレス工業	6,000	431.00	2,586,000
カルソニックカンセイ	10,000	589.00	5,890,000
太平洋工業	3,000	751.00	2,253,000
ケーヒン	3,400	1,300.00	4,420,000
河西工業	2,000	934.00	1,868,000
アイシン精機	13,500	3,720.00	50,220,000
富士機工	2,000	519.00	1,038,000
マツダ	44,100	2,358.00	103,987,800
ダイハツ工業	15,700	1,555.00	24,413,500
今仙電機製作所	1,200	1,830.00	2,196,000
本田技研工業	133,100	3,330.50	443,289,550
スズキ	30,900	3,320.00	102,588,000
富士重工業	50,300	3,310.50	166,518,150
安永	500	566.00	283,000
ヤマハ発動機	22,500	1,954.00	43,965,000
ショーワ	3,500	1,061.00	3,713,500
T B K	1,600	675.00	1,080,000
エクセディ	1,800	2,674.00	4,813,200
豊田合成	4,800	2,029.00	9,739,200
愛三工業	2,000	820.00	1,640,000
ヨロズ	1,200	1,803.00	2,163,600
エフ・シー・シー	2,400	1,722.00	4,132,800
シマノ	6,400	12,830.00	82,112,000
タカタ	2,700	1,490.00	4,023,000
テイ・エス テック	3,100	2,336.00	7,241,600
テルモ	22,700	2,531.00	57,453,700
クリエートメディック	500	1,007.00	503,500
日機装	4,800	1,085.00	5,208,000
島津製作所	19,000	926.00	17,594,000
J M S	3,000	288.00	864,000
ショットモリテックス	400	270.00	108,000
長野計器	900	646.00	581,400
ブイ・テクノロジー	300	2,539.00	761,700
東京計器	5,000	273.00	1,365,000
愛知時計電機	2,000	310.00	620,000
オーバル	1,100	307.00	337,700
東京精密	2,600	1,701.00	4,422,600
マニー	400	6,570.00	2,628,000

ニコン	27,600	1,394.00	38,474,400
トプコン	4,000	2,440.00	9,760,000
オリンパス	22,000	3,690.00	81,180,000
理研計器	1,300	1,039.00	1,350,700
タムロン	1,100	2,041.00	2,245,100
HOYA	35,200	3,426.50	120,612,800
ノーリツ鋼機	1,300	583.00	757,900
エー・アンド・デイ	1,400	496.00	694,400
シチズンホールディングス	18,300	670.00	12,261,000
リズム時計工業	7,000	152.00	1,064,000
大研医器	500	2,080.00	1,040,000
松風	700	1,173.00	821,100
セイコーホールディングス	10,000	521.00	5,210,000
ニプロ	7,900	883.00	6,975,700
パラマウントベッドホールディングス	1,400	3,095.00	4,333,000
SHO-BI	500	405.00	202,500
前田工織	1,500	1,291.00	1,936,500
永大産業	2,000	440.00	880,000
アートネイチャー	500	2,930.00	1,465,000
ダンロップスポーツ	1,000	1,270.00	1,270,000
バンダイナムコホールディングス	16,300	2,610.00	42,543,000
共立印刷	2,700	284.00	766,800
フランスベッドホールディングス	9,000	175.00	1,575,000
パイロットコーポレーション	1,300	5,910.00	7,683,000
萩原工業	300	1,607.00	482,100
トッパン・フォームズ	2,600	994.00	2,584,400
フジシールインターナショナル	1,800	3,200.00	5,760,000
タカラトミー	4,900	577.00	2,827,300
廣済堂	1,400	409.00	572,600
アーク	4,500	145.00	652,500
タカノ	700	608.00	425,600
プロネクサス	1,500	721.00	1,081,500
ホクシン	1,200	128.00	153,600
ウッドワン	3,000	280.00	840,000
大建工業	6,000	243.00	1,458,000
凸版印刷	42,000	708.00	29,736,000
大日本印刷	45,000	1,018.00	45,810,000
図書印刷	3,000	365.00	1,095,000
共同印刷	5,000	383.00	1,915,000
日本写真印刷	2,500	1,665.00	4,162,500
光村印刷	2,000	257.00	514,000
宝印刷	900	769.00	692,100

アシックス	14,700	2,424.00	35,632,800
ツツミ	700	2,516.00	1,761,200
小松ウオール工業	500	2,609.00	1,304,500
ヤマハ	10,900	1,370.00	14,933,000
河合楽器製作所	500	1,993.00	996,500
クリナップ	1,500	939.00	1,408,500
ピジョン	2,400	6,390.00	15,336,000
兼松日産農林	3,000	142.00	426,000
キングジム	1,200	758.00	909,600
リンテック	3,500	2,192.00	7,672,000
T A S A K I	300	1,091.00	327,300
イトーキ	3,100	599.00	1,856,900
任天堂	9,100	11,180.00	101,738,000
三菱鉛筆	1,200	3,345.00	4,014,000
タカラスタANDARD	6,000	850.00	5,100,000
コクヨ	7,700	830.00	6,391,000
ナカバヤシ	3,000	199.00	597,000
岡村製作所	5,700	760.00	4,332,000
美津濃	7,000	549.00	3,843,000
アデランス	1,800	1,241.00	2,233,800
東京電力	125,500	395.00	49,572,500
中部電力	48,700	1,236.50	60,217,550
関西電力	60,400	1,019.50	61,577,800
中国電力	20,400	1,363.00	27,805,200
北陸電力	14,500	1,402.00	20,329,000
東北電力	36,900	1,198.00	44,206,200
四国電力	13,300	1,358.00	18,061,400
九州電力	32,700	1,112.00	36,362,400
北海道電力	13,900	899.00	12,496,100
沖縄電力	1,000	3,335.00	3,335,000
電源開発	9,200	3,810.00	35,052,000
東京瓦斯	169,000	606.00	102,414,000
大阪瓦斯	153,000	432.00	66,096,000
東邦瓦斯	38,000	576.00	21,888,000
北海道瓦斯	3,000	284.00	852,000
西部瓦斯	17,000	254.00	4,318,000
静岡瓦斯	4,200	708.00	2,973,600
S B S ホールディングス	1,100	916.00	1,007,600
東武鉄道	84,000	517.00	43,428,000
相鉄ホールディングス	25,000	390.00	9,750,000
東京急行電鉄	87,000	658.00	57,246,000
京浜急行電鉄	38,000	846.00	32,148,000

小田急電鉄	47,000	951.00	44,697,000
京王電鉄	41,000	768.00	31,488,000
京成電鉄	22,000	1,216.00	26,752,000
富士急行	4,000	1,030.00	4,120,000
東日本旅客鉄道	27,100	8,274.00	224,225,400
西日本旅客鉄道	13,400	5,049.00	67,656,600
東海旅客鉄道	13,200	14,970.00	197,604,000
西武ホールディングス	11,800	1,939.00	22,880,200
鴻池運輸	1,100	2,080.00	2,288,000
西日本鉄道	19,000	423.00	8,037,000
ハマキョウレックス	400	3,315.00	1,326,000
サカイ引越センター	300	3,400.00	1,020,000
近畿日本鉄道	149,000	361.00	53,789,000
阪急阪神ホールディングス	99,000	618.00	61,182,000
南海電気鉄道	31,000	498.00	15,438,000
京阪電気鉄道	31,000	509.00	15,779,000
神戸電鉄	4,000	351.00	1,404,000
名糖運輸	700	671.00	469,700
名古屋鉄道	53,000	441.00	23,373,000
山陽電気鉄道	5,000	422.00	2,110,000
日本通運	59,000	446.00	26,314,000
ヤマトホールディングス	27,200	2,086.50	56,752,800
山九	18,000	523.00	9,414,000
丸運	1,100	241.00	265,100
丸全昭和運輸	5,000	334.00	1,670,000
センコー	6,000	461.00	2,766,000
トナミホールディングス	3,000	235.00	705,000
日本梱包運輸倉庫	4,500	1,697.00	7,636,500
日本石油輸送	2,000	224.00	448,000
福山通運	9,000	533.00	4,797,000
セイノーホールディングス	11,000	809.00	8,899,000
神奈川中央交通	2,000	536.00	1,072,000
日立物流	3,100	1,418.00	4,395,800
日本郵船	125,000	272.00	34,000,000
商船三井	83,000	336.00	27,888,000
川崎汽船	65,000	237.00	15,405,000
N S ユナイテッド海運	6,000	234.00	1,404,000
明治海運	1,400	367.00	513,800
飯野海運	6,100	588.00	3,586,800
共栄タンカー	1,000	199.00	199,000
日本航空	25,000	2,948.00	73,700,000
A N A ホールディングス	291,000	252.60	73,506,600

スカイマーク	4,300	225.00	967,500
パスコ	2,000	346.00	692,000
トランコム	400	4,440.00	1,776,000
日新	6,000	258.00	1,548,000
三菱倉庫	10,000	1,471.00	14,710,000
三井倉庫ホールディングス	8,000	388.00	3,104,000
住友倉庫	10,000	574.00	5,740,000
澁澤倉庫	3,000	327.00	981,000
東陽倉庫	3,000	262.00	786,000
乾汽船	800	957.00	765,600
日本トランスシティ	3,000	358.00	1,074,000
ケイヒン	3,000	153.00	459,000
中央倉庫	900	860.00	774,000
安田倉庫	1,200	942.00	1,130,400
東洋埠頭	4,000	198.00	792,000
宇徳	1,200	492.00	590,400
上組	18,000	975.00	17,550,000
サンリツ	500	512.00	256,000
キムラユニティー	400	954.00	381,600
キューソー流通システム	400	1,275.00	510,000
郵船ロジスティクス	1,400	1,003.00	1,404,200
近鉄エクスプレス	1,300	3,700.00	4,810,000
東海運	900	263.00	236,700
エーアイティー	600	809.00	485,400
NEC ネットエスアイ	1,600	2,329.00	3,726,400
システナ	1,400	791.00	1,107,400
デジタルアーツ	500	1,058.00	529,000
新日鉄住金ソリューションズ	1,200	3,120.00	3,744,000
キューブシステム	700	555.00	388,500
コア	500	791.00	395,500
ソフトクリエイトホールディングス	500	900.00	450,000
ITホールディングス	5,200	1,747.00	9,084,400
ネオス	300	749.00	224,700
電算システム	500	1,452.00	726,000
グリー	8,800	749.00	6,591,200
コーエーテックモホールディングス	2,900	1,658.00	4,808,200
三菱総合研究所	600	2,489.00	1,493,400
ボルテージ	300	1,424.00	427,200
電算	100	2,180.00	218,000
AGS	300	899.00	269,700
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,663.00	332,600
ブレインパッド	100	1,227.00	122,700

K L a b	1,500	1,530.00	2,295,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	900	831.00	747,900
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,245.00	373,500
ネクソン	13,800	884.00	12,199,200
アイスタイル	500	491.00	245,500
エムアップ	400	734.00	293,600
エイチーム	200	4,760.00	952,000
e n i s h	400	2,285.00	914,000
コロプラ	2,600	3,445.00	8,957,000
モバイルクリエイト	600	798.00	478,800
オルトプラス	300	810.00	243,000
ブロードリーフ	1,200	1,658.00	1,989,600
ハーツユナイテッドグループ	400	1,900.00	760,000
ベリサーブ	200	862.00	172,400
ティーガイア	1,500	1,055.00	1,582,500
豆蔵ホールディングス	1,200	682.00	818,400
テクマトリックス	700	648.00	453,600
GMOペイメントゲートウェイ	1,300	2,169.00	2,819,700
ザッパラス	900	595.00	535,500
インターネットイニシアティブ	2,200	1,902.00	4,184,400
ビットアイル	1,700	475.00	807,500
S R Aホールディングス	700	1,490.00	1,043,000
システムインテグレータ	200	532.00	106,400
パイブドビッツ	100	1,471.00	147,100
朝日ネット	1,400	502.00	702,800
コムチュア	200	1,963.00	392,600
パナソニック インフォメーションシステムズ	300	2,906.00	871,800
フェイス	400	1,001.00	400,400
野村総合研究所	8,300	3,525.00	29,257,500
サイバネットシステム	1,200	497.00	596,400
インテージホールディングス	800	1,333.00	1,066,400
東邦システムサイエンス	200	1,003.00	200,600
ソースネクスト	700	768.00	537,600
ティー・ワイ・オー	1,600	171.00	273,600
クレスコ	300	1,462.00	438,600
フジ・メディア・ホールディングス	14,100	1,475.00	20,797,500
オービック	5,000	3,700.00	18,500,000
ジャストシステム	2,000	853.00	1,706,000
TDCソフトウェアエンジニアリング	300	900.00	270,000
ヤフー	104,600	402.00	42,049,200
トレンドマイクロ	7,700	3,430.00	26,411,000

日本オラクル	2,300	4,200.00	9,660,000	
アルファシステムズ	500	1,425.00	712,500	
フューチャーアーキテクト	1,500	618.00	927,000	
C A C Holdings	1,000	1,169.00	1,169,000	
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,298.00	519,200	
トーセ	400	711.00	284,400	
オービックビジネスコンサルタント	700	3,320.00	2,324,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	4,330.00	6,928,000	
アイティフォー	1,600	456.00	729,600	
東計電算	200	1,577.00	315,400	
エクスネット	100	1,383.00	138,300	
大塚商会	3,900	4,350.00	16,965,000	
サイボウズ	2,000	346.00	692,000	
ソフトブレーン	2,100	201.00	422,100	
アグレックス	400	1,061.00	424,400	
電通国際情報サービス	900	1,117.00	1,005,300	
E Mシステムズ	200	1,719.00	343,800	
ウェザーニューズ	400	2,973.00	1,189,200	
C I J	1,200	480.00	576,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	100	1,340.00	134,000	
日本エンタープライズ	1,000	483.00	483,000	
WOWOW	500	4,455.00	2,227,500	
日本コロムビア	800	498.00	398,400	
イマジカ・ロボット ホールディングス	800	462.00	369,600	
ネットワンシステムズ	5,500	653.00	3,591,500	
アルゴグラフィックス	500	1,970.00	985,000	
マーベラス	2,200	1,142.00	2,512,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,700	1,558.00	4,206,600	
日本ユニシス	3,500	917.00	3,209,500	
兼松エレクトロニクス	900	1,418.00	1,276,200	
東京放送ホールディングス	7,900	1,151.00	9,092,900	
日本テレビホールディングス	14,500	1,587.00	23,011,500	
テレビ朝日ホールディングス	3,700	1,623.00	6,005,100	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,100	624.00	6,926,400	
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,215.00	2,658,000	
コネクシオ	1,300	1,160.00	1,508,000	
クロップス	100	539.00	53,900	
日本電信電話	57,400	6,452.00	370,344,800	代用有価証券 12,300株
K D D I	45,300	6,771.00	306,726,300	
光通信	1,300	6,870.00	8,931,000	
N T T ドコモ	120,300	1,739.50	209,261,850	

GMOインターネット	4,900	878.00	4,302,200
KADOKAWA・DWANGO	3,400	1,978.00	6,725,200
学研ホールディングス	5,000	242.00	1,210,000
ゼンリン	1,900	1,298.00	2,466,200
昭文社	900	737.00	663,300
インプレスホールディングス	1,200	124.00	148,800
アイネット	600	868.00	520,800
松竹	10,000	996.00	9,960,000
東宝	10,400	2,327.00	24,200,800
東映	6,000	557.00	3,342,000
AOI Pro.	700	680.00	476,000
エヌ・ティ・ティ・データ	10,300	3,935.00	40,530,500
DTS	1,400	2,257.00	3,159,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,300	2,223.00	11,781,900
シーイーシー	900	1,054.00	948,600
カブコン	3,700	1,608.00	5,949,600
ジャステック	900	844.00	759,600
SCSK	3,500	2,776.00	9,716,000
日本システムウエア	600	607.00	364,200
アイネス	2,000	863.00	1,726,000
TKC	1,200	2,069.00	2,482,800
富士ソフト	2,000	2,604.00	5,208,000
NSD	3,100	1,611.00	4,994,100
コナミ	6,600	2,108.00	13,912,800
福井コンピュータホールディングス	400	797.00	318,800
JBCホールディングス	1,200	722.00	866,400
ミロク情報サービス	900	606.00	545,400
ソフトバンク	71,700	7,422.00	532,157,400
ハウスイ	1,000	127.00	127,000
高千穂交易	600	995.00	597,000
伊藤忠食品	300	3,615.00	1,084,500
エレマテック	700	2,279.00	1,595,300
JALUX	400	1,283.00	513,200
あらた	3,000	303.00	909,000
トーメンデバイス	200	1,736.00	347,200
東京エレクトロン デバイス	300	1,457.00	437,100
双日	98,000	159.00	15,582,000
アルフレッサ ホールディングス	17,300	1,338.00	23,147,400
横浜冷凍	3,600	794.00	2,858,400
神栄	2,000	206.00	412,000
山下医科器械	100	1,688.00	168,800
ラサ商事	700	508.00	355,600

アルコニックス	900	1,368.00	1,231,200
神戸物産	200	4,830.00	966,000
あい ホールディングス	2,300	2,055.00	4,726,500
ダイワボウホールディングス	13,000	193.00	2,509,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	894.00	2,413,800
八洲電機	1,100	525.00	577,500
U K Cホールディングス	1,000	1,729.00	1,729,000
T O K A Iホールディングス	7,100	503.00	3,571,300
三洋貿易	900	1,255.00	1,129,500
ミタチ産業	400	735.00	294,000
シップヘルスケアホールディングス	2,400	2,491.00	5,978,400
スターティア	100	1,700.00	170,000
富士興産	600	629.00	377,400
協栄産業	2,000	206.00	412,000
小野建	1,300	1,092.00	1,419,600
佐島電機	1,200	678.00	813,600
エコートレーディング	400	652.00	260,800
伯東	900	1,057.00	951,300
コンドーテック	1,200	707.00	848,400
中山福	900	779.00	701,100
ナガイレーベン	2,100	1,930.00	4,053,000
三菱食品	1,600	2,289.00	3,662,400
松田産業	1,100	1,193.00	1,312,300
メディバルホールディングス	14,600	1,162.00	16,965,200
アドヴァン	700	1,167.00	816,900
S P K	400	1,906.00	762,400
アズワン	900	3,265.00	2,938,500
スズデン	500	649.00	324,500
シモジマ	1,000	937.00	937,000
ドウシシャ	1,500	1,772.00	2,658,000
小津産業	300	1,785.00	535,500
高速	900	865.00	778,500
黒田電気	2,400	1,512.00	3,628,800
丸文	1,300	669.00	869,700
ハビネット	900	1,819.00	1,637,100
トーメンエレクトロニクス	600	1,645.00	987,000
エクセル	700	1,072.00	750,400
マルカキカイ	500	1,319.00	659,500
ガリバーインターナショナル	4,900	892.00	4,370,800
日本エム・ディ・エム	1,200	494.00	592,800
進和	900	1,229.00	1,106,100
エスケイジャパン	500	237.00	118,500

ダイトエレクトロン	600	468.00	280,800
シークス	900	1,832.00	1,648,800
田中商事	500	653.00	326,500
オーハシテクニカ	800	1,231.00	984,800
マクニカ	700	3,210.00	2,247,000
白銅	500	1,006.00	503,000
伊藤忠商事	116,400	1,271.50	148,002,600
丸紅	127,700	678.70	86,669,990
高島	3,000	229.00	687,000
長瀬産業	8,200	1,335.00	10,947,000
蝶理	900	1,556.00	1,400,400
豊田通商	16,200	2,467.00	39,965,400
三共生興	2,400	386.00	926,400
兼松	31,000	161.00	4,991,000
ツカモトコーポレーション	3,000	125.00	375,000
三井物産	132,000	1,585.00	209,220,000
日本紙パルプ商事	8,000	314.00	2,512,000
日立ハイテクノロジーズ	4,400	3,155.00	13,882,000
カメイ	1,900	747.00	1,419,300
東都水産	3,000	186.00	558,000
OUGホールディングス	2,000	223.00	446,000
スターゼン	5,000	307.00	1,535,000
山善	5,600	813.00	4,552,800
椿本興業	2,000	286.00	572,000
住友商事	86,200	1,133.00	97,664,600
内田洋行	4,000	341.00	1,364,000
三菱商事	111,900	2,044.50	228,779,550
第一実業	3,000	548.00	1,644,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,200	2,110.00	8,862,000
西華産業	5,000	249.00	1,245,000
佐藤商事	1,300	667.00	867,100
菱洋エレクトロ	1,700	1,021.00	1,735,700
東京産業	1,400	398.00	557,200
ユアサ商事	1,500	1,988.00	2,982,000
神鋼商事	4,000	262.00	1,048,000
小林産業	1,100	280.00	308,000
阪和興業	15,000	374.00	5,610,000
カナデン	2,000	744.00	1,488,000
菱電商事	2,000	780.00	1,560,000
フルサト工業	800	1,596.00	1,276,800
岩谷産業	16,000	719.00	11,504,000
すてきナイスグループ	6,000	200.00	1,200,000

昭光通商	5,000	156.00	780,000
ニチモウ	3,000	180.00	540,000
極東貿易	2,000	246.00	492,000
イワキ	2,000	227.00	454,000
三愛石油	3,000	739.00	2,217,000
稲畑産業	3,500	995.00	3,482,500
G S Iクレオス	4,000	137.00	548,000
明和産業	1,400	391.00	547,400
ワキタ	2,900	1,109.00	3,216,100
東邦ホールディングス	4,700	1,521.00	7,148,700
サンゲツ	2,600	2,693.00	7,001,800
ミツウロコグループホールディングス	2,300	510.00	1,173,000
シナネン	3,000	420.00	1,260,000
伊藤忠エネクス	3,200	645.00	2,064,000
サンリオ	3,700	3,015.00	11,155,500
サンワテクノス	800	1,152.00	921,600
リョーサン	2,200	2,275.00	5,005,000
新光商事	1,600	1,032.00	1,651,200
トーホー	3,000	415.00	1,245,000
三信電気	1,700	770.00	1,309,000
東陽テクニカ	2,100	1,003.00	2,106,300
モスフードサービス	1,900	2,116.00	4,020,400
加賀電子	1,300	1,203.00	1,563,900
ソーダニッカ	2,000	456.00	912,000
立花エレテック	900	1,356.00	1,220,400
P a l t a c	2,000	1,298.00	2,596,000
太平洋興発	7,000	88.00	616,000
ヤマタネ	7,000	164.00	1,148,000
丸紅建材リース	1,000	313.00	313,000
日鉄住金物産	10,000	389.00	3,890,000
トラスコ中山	1,700	2,765.00	4,700,500
オートバックスセブン	5,000	1,658.00	8,290,000
加藤産業	2,100	2,204.00	4,628,400
イノテック	1,400	527.00	737,800
イエローハット	1,300	2,387.00	3,103,100
富士エレクトロニクス	700	1,294.00	905,800
J Kホールディングス	1,300	549.00	713,700
日伝	700	2,302.00	1,611,400
北沢産業	1,300	179.00	232,700
杉本商事	800	1,053.00	842,400
因幡電機産業	2,000	3,740.00	7,480,000
バイテック	500	716.00	358,000

ミスミグループ本社	5,900	3,115.00	18,378,500
江守グループホールディングス	600	1,064.00	638,400
アルテック	1,200	217.00	260,400
タキヒヨー	2,000	399.00	798,000
スズケン	6,000	2,842.00	17,052,000
ジェコス	1,000	1,614.00	1,614,000
ローソン	6,000	7,080.00	42,480,000
サンエー	1,100	3,780.00	4,158,000
ダイユーエイト	300	692.00	207,600
カワチ薬品	1,000	1,876.00	1,876,000
エービーシー・マート	2,100	6,120.00	12,852,000
ハードオフコーポレーション	700	889.00	622,300
アスクル	1,500	2,084.00	3,126,000
ゲオホールディングス	2,500	953.00	2,382,500
アダストリアホールディングス	1,100	2,462.00	2,708,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	142.00	284,000
くらコーポレーション	900	2,998.00	2,698,200
キャンドウ	700	1,597.00	1,117,900
パル	900	3,215.00	2,893,500
エディオン	6,700	770.00	5,159,000
サーラコーポレーション	1,300	576.00	748,800
ワッツ	600	837.00	502,200
あみやき亭	300	3,910.00	1,173,000
ひらまつ	1,800	604.00	1,087,200
ゲンキー	200	5,800.00	1,160,000
サッポロドラッグストアー	100	1,716.00	171,600
大黒天物産	400	3,105.00	1,242,000
ハニーズ	1,200	995.00	1,194,000
アルペン	1,300	1,646.00	2,139,800
クオール	1,100	689.00	757,900
ジェイアイエヌ	1,000	2,245.00	2,245,000
ビックカメラ	6,300	954.00	6,010,200
D C Mホールディングス	7,000	715.00	5,005,000
Monotaro	2,800	2,602.00	7,285,600
きちり	300	721.00	216,300
アークランドサービス	200	3,425.00	685,000
J.フロント リテイリング	17,200	1,355.00	23,306,000
ドトール・日レスホールディングス	2,600	1,626.00	4,227,600
マツモトキヨシホールディングス	3,000	3,065.00	9,195,000
ブロンコビリー	200	2,973.00	594,600
スタートトゥデイ	4,500	2,292.00	10,314,000
物語コーポレーション	300	3,510.00	1,053,000

ココカラファイン	1,500	2,546.00	3,819,000
三越伊勢丹ホールディングス	29,000	1,384.00	40,136,000
ウエルシアホールディングス	1,300	3,610.00	4,693,000
クリエイトSDホールディングス	600	3,760.00	2,256,000
丸善CHIホールディングス	1,300	359.00	466,700
エー・ピーカンパニー	200	1,642.00	328,400
チムニー	300	2,199.00	659,700
ジョイフル本田	800	3,935.00	3,148,000
キリン堂ホールディングス	600	675.00	405,000
ブックオフコーポレーション	800	834.00	667,200
あさひ	800	1,143.00	914,400
日本調剤	200	2,903.00	580,600
コスモス薬品	800	15,030.00	12,024,000
トーエル	800	678.00	542,400
一六堂	300	441.00	132,300
セブン&アイ・ホールディングス	61,100	3,991.00	243,850,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	700	1,342.00	939,400
ツルハホールディングス	2,900	6,230.00	18,067,000
サンマルクホールディングス	500	5,720.00	2,860,000
フェリシモ	400	1,076.00	430,400
トリドール	1,300	1,325.00	1,722,500
クスリのアオキ	700	4,825.00	3,377,500
メディカルシステムネットワーク	1,200	331.00	397,200
総合メディカル	400	5,110.00	2,044,000
はるやま商事	600	686.00	411,600
カッパ・クリエイトホールディングス	2,200	1,026.00	2,257,200
ライトオン	1,100	723.00	795,300
ジーンズメイト	500	207.00	103,500
良品計画	1,600	14,400.00	23,040,000
三城ホールディングス	1,800	468.00	842,400
コナカ	1,700	594.00	1,009,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,394.00	278,800
G-7ホールディングス	500	905.00	452,500
イオン北海道	1,800	622.00	1,119,600
コジマ	2,200	298.00	655,600
ヒマラヤ	400	951.00	380,400
コーナン商事	1,900	1,224.00	2,325,600
エコス	500	798.00	399,000
ワタミ	1,700	1,260.00	2,142,000
マルシェ	400	848.00	339,200
ドンキホーテホールディングス	5,000	6,440.00	32,200,000

西松屋チェーン	2,900	955.00	2,769,500
ゼンショーホールディングス	6,700	985.00	6,599,500
幸楽苑	900	1,390.00	1,251,000
ハークスレイ	400	867.00	346,800
サイゼリヤ	2,200	1,606.00	3,533,200
ポプラ	400	531.00	212,400
ユナイテッドアローズ	1,900	3,895.00	7,400,500
ハイデイ日高	900	3,065.00	2,758,500
京都きもの友禅	900	1,009.00	908,100
コロワイド	4,800	1,318.00	6,326,400
壱番屋	600	5,170.00	3,102,000
トップカルチャー	600	505.00	303,000
P L A N T	400	1,160.00	464,000
スギホールディングス	2,600	4,395.00	11,427,000
スクロール	1,900	254.00	482,600
ヨンドシーホールディングス	1,100	1,965.00	2,161,500
ファミリーマート	4,900	4,195.00	20,555,500
木曽路	1,800	1,862.00	3,351,600
サトレストランシステムズ	1,400	813.00	1,138,200
千趣会	2,600	853.00	2,217,800
タカキュー	1,200	203.00	243,600
ケーヨー	2,500	505.00	1,262,500
上新電機	3,000	911.00	2,733,000
日本瓦斯	2,200	2,646.00	5,821,200
ベスト電器	4,900	132.00	646,800
マルエツ	3,000	529.00	1,587,000
ロイヤルホールディングス	2,400	1,714.00	4,113,600
東天紅	1,000	175.00	175,000
いなげや	1,600	1,071.00	1,713,600
島忠	3,500	2,657.00	9,299,500
チヨダ	1,700	2,109.00	3,585,300
ライフコーポレーション	1,100	1,694.00	1,863,400
カスミ	3,000	1,013.00	3,039,000
リンガーハット	1,400	1,695.00	2,373,000
さが美	1,000	93.00	93,000
MrMax	1,500	301.00	451,500
テンアライド	1,200	345.00	414,000
AOKIホールディングス	2,500	1,201.00	3,002,500
オークワ	2,000	876.00	1,752,000
コメリ	2,200	2,372.00	5,218,400
青山商事	3,700	2,554.00	9,449,800
しまむら	1,700	9,200.00	15,640,000

CF Sコーポレーション	1,000	640.00	640,000
はせがわ	500	558.00	279,000
高島屋	20,000	875.00	17,500,000
松屋	2,900	1,426.00	4,135,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,000	1,788.00	10,728,000
近鉄百貨店	6,000	297.00	1,782,000
丸栄	3,000	137.00	411,000
ニッセンホールディングス	3,100	345.00	1,069,500
パルコ	1,400	882.00	1,234,800
丸井グループ	19,000	839.00	15,941,000
アクシアル リテイリング	800	2,290.00	1,832,000
ダイエー	18,300	118.00	2,159,400
イオン	58,300	1,022.50	59,611,750
ユニーグループ・ホールディングス	14,100	552.00	7,783,200
イズミ	3,300	3,475.00	11,467,500
東武ストア	2,000	279.00	558,000
平和堂	3,000	1,977.00	5,931,000
フジ	1,600	2,000.00	3,200,000
ヤオコー	700	6,770.00	4,739,000
ゼビオ	1,800	1,593.00	2,867,400
ケーズホールディングス	3,100	3,100.00	9,610,000
O l y m p i cグループ	900	920.00	828,000
日産東京販売ホールディングス	2,100	266.00	558,600
アインファーマシーズ	1,600	2,839.00	4,542,400
元気寿司	500	1,891.00	945,500
ヤマダ電機	57,800	338.00	19,536,400
アークランドサカモト	1,000	2,367.00	2,367,000
ニトリホールディングス	5,800	6,720.00	38,976,000
愛眼	1,300	258.00	335,400
ケーユーホールディングス	600	569.00	341,400
吉野家ホールディングス	3,800	1,247.00	4,738,600
松屋フーズ	700	2,122.00	1,485,400
サガミチェーン	2,000	1,028.00	2,056,000
関西スーパーマーケット	1,100	781.00	859,100
王将フードサービス	1,000	4,030.00	4,030,000
プレナス	1,600	1,978.00	3,164,800
ミニストップ	1,100	1,540.00	1,694,000
アークス	2,500	2,295.00	5,737,500
パロー	3,100	1,714.00	5,313,400
藤久	100	1,669.00	166,900
ベルク	700	3,035.00	2,124,500
大庄	800	1,258.00	1,006,400

ファーストリテイリング	2,900	36,905.00	107,024,500	
サンドラッグ	3,100	4,890.00	15,159,000	
サックスパー ホールディングス	1,000	1,539.00	1,539,000	
ヤマザワ	400	1,583.00	633,200	
やまや	300	1,518.00	455,400	
ベルーナ	3,600	464.00	1,670,400	
島根銀行	300	1,337.00	401,100	
じもとホールディングス	10,400	210.00	2,184,000	
足利ホールディングス	7,600	394.00	2,994,400	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1,600	3,200.00	5,120,000	
新生銀行	126,000	224.00	28,224,000	
あおぞら銀行	76,000	378.00	28,728,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,106,400	587.10	649,567,440	
りそなホールディングス	138,800	594.80	82,558,240	
三井住友トラスト・ホールディングス	285,000	401.70	114,484,500	
三井住友フィナンシャルグループ	110,400	4,018.50	443,642,400	
第四銀行	18,000	360.00	6,480,000	
北越銀行	16,000	204.00	3,264,000	
西日本シティ銀行	51,000	267.00	13,617,000	
千葉銀行	56,000	705.00	39,480,000	
横浜銀行	95,000	570.20	54,169,000	
常陽銀行	53,000	518.00	27,454,000	
群馬銀行	32,000	616.00	19,712,000	
武蔵野銀行	2,300	3,325.00	7,647,500	
千葉興業銀行	3,000	719.00	2,157,000	
筑波銀行	6,000	357.00	2,142,000	
七十七銀行	23,000	547.00	12,581,000	
青森銀行	11,000	312.00	3,432,000	
秋田銀行	10,000	285.00	2,850,000	
山形銀行	9,000	499.00	4,491,000	
岩手銀行	1,000	4,645.00	4,645,000	
東邦銀行	13,000	366.00	4,758,000	
東北銀行	7,000	150.00	1,050,000	
みちのく銀行	8,000	203.00	1,624,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	59,000	498.00	29,382,000	
静岡銀行	43,000	1,008.00	43,344,000	
十六銀行	18,000	388.00	6,984,000	
スルガ銀行	14,200	2,005.00	28,471,000	
八十二銀行	26,000	607.00	15,782,000	
山梨中央銀行	9,000	450.00	4,050,000	
大垣共立銀行	18,000	281.00	5,058,000	
福井銀行	13,000	240.00	3,120,000	

北國銀行	16,000	348.00	5,568,000	
清水銀行	500	2,704.00	1,352,000	
滋賀銀行	14,000	549.00	7,686,000	
南都銀行	14,000	409.00	5,726,000	
百五銀行	13,000	426.00	5,538,000	
京都銀行	28,000	849.00	23,772,000	
紀陽銀行	5,700	1,484.00	8,458,800	
三重銀行	6,000	238.00	1,428,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	99,000	198.00	19,602,000	
広島銀行	43,000	495.00	21,285,000	
山陰合同銀行	9,000	783.00	7,047,000	
中国銀行	10,500	1,455.00	15,277,500	
鳥取銀行	5,000	207.00	1,035,000	
伊予銀行	15,600	1,054.00	16,442,400	
百十四銀行	16,000	331.00	5,296,000	
四国銀行	11,000	218.00	2,398,000	
阿波銀行	12,000	610.00	7,320,000	
鹿児島銀行	10,000	644.00	6,440,000	
大分銀行	9,000	396.00	3,564,000	
宮崎銀行	10,000	311.00	3,110,000	
肥後銀行	12,000	566.00	6,792,000	
佐賀銀行	9,000	234.00	2,106,000	
十八銀行	9,000	285.00	2,565,000	
沖縄銀行	1,100	4,470.00	4,917,000	
琉球銀行	2,800	1,629.00	4,561,200	
セブン銀行	54,700	418.00	22,864,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,898,700	189.70	360,183,390	
高知銀行	6,000	134.00	804,000	
山口フィナンシャルグループ	15,000	961.00	14,415,000	
長野銀行	5,000	187.00	935,000	
名古屋銀行	13,000	386.00	5,018,000	
北洋銀行	22,000	398.00	8,756,000	
愛知銀行	500	4,940.00	2,470,000	
第三銀行	8,000	171.00	1,368,000	
中京銀行	6,000	193.00	1,158,000	
東日本銀行	6,000	256.00	1,536,000	
大光銀行	5,000	205.00	1,025,000	
愛媛銀行	9,000	234.00	2,106,000	
トマト銀行	6,000	171.00	1,026,000	
みなと銀行	13,000	202.00	2,626,000	
京葉銀行	12,000	520.00	6,240,000	
関西アーバン銀行	2,000	1,148.00	2,296,000	

栃木銀行	7,000	409.00	2,863,000
北日本銀行	400	2,447.00	978,800
東和銀行	18,000	92.00	1,656,000
福島銀行	18,000	82.00	1,476,000
大東銀行	10,000	131.00	1,310,000
トモニホールディングス	11,200	437.00	4,894,400
フィデアホールディングス	8,300	208.00	1,726,400
池田泉州ホールディングス	10,900	531.00	5,787,900
F P G	1,300	963.00	1,251,900
S B Iホールディングス	17,600	1,055.00	18,568,000
ジャフコ	2,000	3,855.00	7,710,000
大和証券グループ本社	145,000	775.50	112,447,500
野村ホールディングス	298,500	606.30	180,980,550
岡三証券グループ	11,000	748.00	8,228,000
丸三証券	4,300	739.00	3,177,700
東洋証券	6,000	271.00	1,626,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15,500	671.00	10,400,500
光世証券	4,000	193.00	772,000
水戸証券	4,300	360.00	1,548,000
いちよし証券	2,900	1,157.00	3,355,300
松井証券	7,400	934.00	6,911,600
だいこう証券ビジネス	700	608.00	425,600
マネックスグループ	16,000	240.00	3,840,000
カブドットコム証券	5,700	496.00	2,827,200
極東証券	1,800	1,685.00	3,033,000
岩井コスモホールディングス	1,400	1,078.00	1,509,200
マネースクウェアHD	400	1,200.00	480,000
マネーパートナーズグループ	1,600	373.00	596,800
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	32,400	2,509.50	81,307,800
アニコムホールディングス	600	1,185.00	711,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	43,600	2,186.00	95,309,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	14,000	1,626.00	22,764,000
第一生命保険	87,100	1,504.00	130,998,400
東京海上ホールディングス	56,600	3,253.00	184,119,800
T & Dホールディングス	50,100	1,275.00	63,877,500
全国保証	3,500	3,145.00	11,007,500
クレディセゾン	11,900	2,001.00	23,811,900
芙蓉総合リース	1,500	4,020.00	6,030,000
興銀リース	2,600	2,432.00	6,323,200
東京センチュリーリース	3,400	2,566.00	8,724,400
日本証券金融	6,500	579.00	3,763,500

アイフル	26,700	368.00	9,825,600
ポケットカード	1,500	558.00	837,000
リコーリース	1,000	2,819.00	2,819,000
イオンフィナンシャルサービス	8,600	2,051.00	17,638,600
アコム	29,400	317.00	9,319,800
ジャックス	9,000	590.00	5,310,000
オリエントコーポレーション	34,000	195.00	6,630,000
日立キャピタル	2,900	2,505.00	7,264,500
アプラスフィナンシャル	7,200	124.00	892,800
オリックス	91,200	1,326.00	120,931,200
三菱UFJリース	37,100	521.00	19,329,100
日本取引所グループ	21,500	2,345.00	50,417,500
イー・ギャランティ	500	1,851.00	925,500
アサックス	300	1,251.00	375,300
NECキャピタルソリューション	500	1,936.00	968,000
日本駐車場開発	16,000	115.00	1,840,000
ヒューリック	24,600	1,059.00	26,051,400
東京建物不動産販売	800	366.00	292,800
三栄建築設計	500	853.00	426,500
野村不動産ホールディングス	9,600	1,671.00	16,041,600
プレサンスコーポレーション	300	2,937.00	881,100
常和ホールディングス	500	3,695.00	1,847,500
エストラスト	100	657.00	65,700
フージャースホールディングス	2,200	467.00	1,027,400
オープンハウス	900	1,799.00	1,619,100
東急不動産ホールディングス	32,400	669.00	21,675,600
飯田グループホールディングス	6,400	1,138.00	7,283,200
エコナックホールディングス	5,000	43.00	215,000
パーク24	7,700	1,671.00	12,866,700
パラカ	500	784.00	392,000
三井不動産	77,000	3,056.00	235,312,000
三菱地所	102,000	2,329.00	237,558,000
平和不動産	3,000	1,615.00	4,845,000
東京建物	32,000	816.00	26,112,000
ダイビル	4,300	1,147.00	4,932,100
京阪神ビルディング	2,400	573.00	1,375,200
住友不動産	35,000	3,530.00	123,550,000
大京	25,000	180.00	4,500,000
テーオーシー	5,000	674.00	3,370,000
東京楽天地	2,000	489.00	978,000
レオパレス21	16,800	598.00	10,046,400
フジ住宅	1,800	620.00	1,116,000

空港施設	1,800	720.00	1,296,000
明和地所	800	503.00	402,400
住友不動産販売	1,000	2,347.00	2,347,000
ゴールドクレスト	1,100	1,822.00	2,004,200
日本エスリード	600	970.00	582,000
日神不動産	1,900	452.00	858,800
タカラレーベン	4,800	413.00	1,982,400
サンヨーハウジング名古屋	800	1,156.00	924,800
イオンモール	9,400	1,845.00	17,343,000
ファースト住建	500	1,219.00	609,500
トーセイ	2,000	637.00	1,274,000
穴吹興産	1,000	236.00	236,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	9,100	1,036.00	9,427,600
サンフロンティア不動産	1,400	1,049.00	1,468,600
エフ・ジェー・ネクスト	800	439.00	351,200
ランドビジネス	800	388.00	310,400
グランディハウス	1,100	279.00	306,900
日本空港ビルデング	5,000	4,035.00	20,175,000
日本工営	5,000	453.00	2,265,000
ネクスト	1,300	616.00	800,800
日本M&Aセンター	2,400	3,225.00	7,740,000
ノバレーゼ	400	870.00	348,000
アコーディア・ゴルフ	6,300	1,122.00	7,068,600
タケエイ	1,100	1,001.00	1,101,100
トラスト・テック	200	1,890.00	378,000
パソナグループ	1,200	529.00	634,800
CDS	400	953.00	381,200
リンクアンドモチベーション	2,100	150.00	315,000
GCAサヴィアン	1,200	1,039.00	1,246,800
エス・エム・エス	900	2,977.00	2,679,300
テンプホールディングス	3,400	3,390.00	11,526,000
リニカル	400	842.00	336,800
クックパッド	700	3,515.00	2,460,500
エスクリ	600	1,313.00	787,800
アイ・ケイ・ケイ	400	904.00	361,600
学情	600	1,022.00	613,200
スタジオアリス	700	1,408.00	985,600
シミックホールディングス	600	1,626.00	975,600
総合警備保障	5,600	2,432.00	13,619,200
カカコム	9,200	1,469.00	13,514,800
ルネサンス	700	953.00	667,100
ディップ	300	3,715.00	1,114,500

オプト	700	731.00	511,700
新日本科学	1,300	792.00	1,029,600
ツクイ	1,700	986.00	1,676,200
総合臨床ホールディングス	700	463.00	324,100
キャリアデザインセンター	500	1,004.00	502,000
エムスリー	10,400	1,801.00	18,730,400
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	868.00	954,800
アウトソーシング	600	1,480.00	888,000
ディー・エヌ・エー	8,300	1,385.00	11,495,500
博報堂D Yホールディングス	21,400	1,007.00	21,549,800
ぐるなび	2,100	1,374.00	2,885,400
一休	1,100	1,427.00	1,569,700
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	295.00	383,500
ファンコミュニケーションズ	2,700	973.00	2,627,100
ジェイコムホールディングス	300	769.00	230,700
P G Mホールディングス	2,200	1,076.00	2,367,200
W D Bホールディングス	200	1,737.00	347,400
ティア	400	689.00	275,600
バリューコマース	1,300	639.00	830,700
J Pホールディングス	3,400	385.00	1,309,000
イーピーエス	1,800	1,256.00	2,260,800
プレステージ・インターナショナル	1,100	993.00	1,092,300
アミューズ	400	3,045.00	1,218,000
ドリームインキュベータ	400	1,744.00	697,600
T A C	1,000	246.00	246,000
ケネディクス	22,000	417.00	9,174,000
電通	14,600	3,825.00	55,845,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,046.00	732,200
ぴあ	500	1,847.00	923,500
イオンファンタジー	500	1,459.00	729,500
みらかホールディングス	4,100	4,350.00	17,835,000
アルプス技研	600	1,223.00	733,800
サニックス	2,300	513.00	1,179,900
ダイオーズ	300	895.00	268,500
日本空調サービス	700	746.00	522,200
オリエンタルランド	4,200	22,215.00	93,303,000
ダスキン	4,100	1,763.00	7,228,300
明光ネットワークジャパン	1,500	1,183.00	1,774,500
ファルコホールディングス	800	1,177.00	941,600
秀英予備校	300	300.00	90,000
田谷	300	755.00	226,500
ラウンドワン	4,400	691.00	3,040,400

リゾートトラスト	5,200	2,533.00	13,171,600
ピー・エム・エル	1,000	3,075.00	3,075,000
ワタベウェディング	500	551.00	275,500
もしもしホットライン	2,900	1,058.00	3,068,200
リソー教育	1,800	229.00	412,200
早稲田アカデミー	200	783.00	156,600
ユー・エス・エス	18,700	1,612.00	30,144,400
東京個別指導学院	800	402.00	321,600
楽天	67,100	1,178.00	79,043,800
テー・オー・ダブリュー	500	721.00	360,500
セントラルスポーツ	500	1,744.00	872,000
フルキャストホールディングス	1,600	514.00	822,400
リゾートソリューション	2,000	239.00	478,000
リブセンス	900	791.00	711,900
ジャパンマテリアル	200	4,470.00	894,000
サクセスホールディングス	100	1,297.00	129,700
アサンテ	300	1,300.00	390,000
E R Iホールディングス	400	1,109.00	443,600
リロ・ホールディング	600	7,320.00	4,392,000
東祥	300	2,178.00	653,400
エイチ・アイ・エス	2,500	2,803.00	7,007,500
共立メンテナンス	800	4,495.00	3,596,000
イチネンホールディングス	1,600	884.00	1,414,400
建設技術研究所	900	1,764.00	1,587,600
スペース	800	1,298.00	1,038,400
燦ホールディングス	300	1,491.00	447,300
スバル興業	1,000	412.00	412,000
東京テアトル	6,000	139.00	834,000
よみうりランド	3,000	447.00	1,341,000
東京都競馬	11,000	295.00	3,245,000
常磐興産	5,000	140.00	700,000
カナモト	2,100	3,930.00	8,253,000
東京ドーム	11,000	420.00	4,620,000
西尾レントオール	1,300	3,840.00	4,992,000
トランス・コスモス	2,000	1,981.00	3,962,000
乃村工藝社	3,000	1,007.00	3,021,000
藤田観光	6,000	361.00	2,166,000
K N T - C Tホールディングス	7,000	157.00	1,099,000
日本管財	700	2,824.00	1,976,800
トーカイ	700	3,290.00	2,303,000
白洋舎	1,000	244.00	244,000
セコム	16,100	6,205.00	99,900,500

セントラル警備保障	700	1,148.00	803,600	
丹青社	1,900	943.00	1,791,700	
メイテック	2,100	3,265.00	6,856,500	
アサツー ディ・ケイ	2,900	2,596.00	7,528,400	
応用地質	1,600	1,869.00	2,990,400	
船井総研ホールディングス	1,700	977.00	1,660,900	
進学会	600	394.00	236,400	
ベネッセホールディングス	5,200	3,450.00	17,940,000	
イオンディライト	1,500	2,592.00	3,888,000	
ナック	800	1,217.00	973,600	
ニチイ学館	3,300	804.00	2,653,200	
ダイセキ	2,300	1,825.00	4,197,500	
ステップ	500	831.00	415,500	
合 計	23,966,000		26,552,269,460	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	130,877,687	167,090,090
コール・ローン	738,559,756	1,292,481,877
株式	75,381,119,201	74,933,360,854
投資証券	1,627,991,309	1,794,169,065
派生商品評価勘定	18,347,447	20,329,083
未収入金	587,146	5,731,444
未収配当金	66,368,075	73,303,010
未収利息	1,245	1,784
差入委託証拠金	285,711,080	263,956,662
流動資産合計	78,249,562,946	78,550,423,869
資産合計	78,249,562,946	78,550,423,869
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,479,375	48,776,936

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
未払金	7,426,210	-
未払解約金	288,691,891	14,693,756
流動負債合計	299,597,476	63,470,692
負債合計	299,597,476	63,470,692
純資産の部		
元本等		
元本	53,121,420,340	45,139,625,708
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	24,828,545,130	33,347,327,469
元本等合計	77,949,965,470	78,486,953,177
純資産合計	77,949,965,470	78,486,953,177
負債純資産合計	78,249,562,946	78,550,423,869

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券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。</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 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>
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>
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 「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>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
1. 期首	平成24年10月27日	平成25年10月29日
期首元本額	66,445,318,652円	53,121,420,340円
期首からの追加設定元本額	2,064,048,909円	2,095,102,985円
期首からの一部解約元本額	15,387,947,221円	10,076,897,617円

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）	13,892,180,524円	14,416,020,567円
DCインデックスバランス（株式20）	37,234,680円	40,405,838円
DCインデックスバランス（株式40）	143,469,943円	150,299,341円
DCインデックスバランス（株式60）	275,922,594円	277,980,724円
DCインデックスバランス（株式80）	327,852,003円	327,220,138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	6,484,482,909円	4,694,129,197円
日興五大陸株式ファンド	13,462,485,251円	9,846,288,041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	56,923,858円	38,205,791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）	24,231,305円	14,998,528円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	13,478,586円	8,709,856円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	9,964,615円	7,136,125円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	15,992,156円	10,620,750円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	19,891,518円	13,298,188円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	11,190,881,578円	8,908,454,732円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	15,230,756円	12,570,328円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	35,107,086円	32,442,318円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	100,461,569円	92,482,195円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	136,553,155円	128,381,599円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	141,468,831円	125,941,100円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	6,737,607,423円	5,994,040,352円
計	53,121,420,340円	45,139,625,708円
2. 受益権の総数	53,121,420,340口	45,139,625,708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

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	13,846,367,644
投資証券	107,821,874
合計	13,954,189,518

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,892,510,673
投資証券	146,834,232
合計	5,039,344,905

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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）

（平成25年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	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	849,067,883	-	867,415,330	18,347,447
合計		849,067,883	-	867,415,330	18,347,447

（平成26年10月27日現在）

（単位：円）

区分	種類	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	1,787,545,829	-	1,747,703,244	39,842,585
合計		1,787,545,829	-	1,747,703,244	39,842,585

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末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おります。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成25年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	495,936,395	-	492,457,020	3,479,375
	米ドル	393,478,530	-	390,159,000	3,319,530
	ユーロ	102,457,865	-	102,298,020	159,845
合計		495,936,395	-	492,457,020	3,479,375

(平成26年10月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	1,370,033,968	-	1,381,428,700	11,394,732
	米ドル	991,104,850	-	1,003,488,500	12,383,650
	ユーロ	378,929,118	-	377,940,200	988,918
合計		1,370,033,968	-	1,381,428,700	11,394,732

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年10月28日現在		平成26年10月27日現在	
1口当たり純資産額	1.4674円	1口当たり純資産額	1.7388円
(1万口当たり純資産額)	(14,674円)	(1万口当たり純資産額)	(17,388円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	12,263	90.98	1,115,687.74	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,060	48.91	51,844.60	
	APACHE CORP	9,254	75.81	701,545.74	
	BAKER HUGHES INC	10,615	53.49	567,796.35	
	CABOT OIL & GAS CORP	9,950	31.23	310,738.50	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	5,361	59.84	320,802.24	
	CHENIERE ENERGY INC	5,580	72.90	406,782.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	13,880	21.60	299,808.00	
	CHEVRON CORP	45,841	115.91	5,313,430.31	
	CIMAREX ENERGY CO	2,005	109.16	218,865.80	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	8,000	11.16	89,280.00	
	CONCHO RESOURCES INC	2,885	108.99	314,436.15	
	CONOCOPHILLIPS	29,670	70.07	2,078,976.90	

CONSOL ENERGY INC	5,288	34.68	183,387.84
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,960	56.73	111,190.80
CORE LABORATORIES N.V.	1,240	128.97	159,922.80
DENBURY RESOURCES INC	7,335	12.41	91,027.35
DEVON ENERGY CORPORATION	9,751	59.91	584,182.41
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,525	39.07	59,581.75
ENERGEN CORP	1,520	61.68	93,753.60
ENSCO PLC-CL A	5,990	38.88	232,891.20
EOG RESOURCES INC	13,252	92.10	1,220,509.20
EQT CORP	3,735	88.90	332,041.50
EXXON MOBIL CORP	103,271	94.49	9,758,076.79
FMC TECHNOLOGIES INC	5,645	54.51	307,708.95
HALLIBURTON CO	20,427	55.78	1,139,418.06
HELMERICH & PAYNE	2,800	86.98	243,544.00
HESS CORP	7,120	82.35	586,332.00
HOLLYFRONTIER CORP	4,520	44.68	201,953.60
KINDER MORGAN INC	19,510	39.03	761,475.30
MARATHON OIL CORP	16,157	34.50	557,416.50
MARATHON PETROLEUM CORP	7,236	85.79	620,776.44
MURPHY OIL CORP	4,295	52.15	223,984.25
NABORS INDUSTRIES LTD	7,671	18.73	143,677.83
NATIONAL OILWELL VARCO INC	9,981	73.52	733,803.12
NOBLE CORP PLC	5,872	20.58	120,845.76
NOBLE ENERGY INC	8,662	57.43	497,458.66
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	19,021	89.52	1,702,759.92
OCEANEERING INTL INC	2,060	65.44	134,806.40
ONEOK INC	5,160	61.01	314,811.60
PEABODY ENERGY CORP	7,060	10.40	73,424.00
PHILLIPS 66	13,945	76.49	1,066,653.05
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	181.11	651,996.00
QEP RESOURCES INC	4,290	24.32	104,332.80
RANGE RESOURCES CORP	4,050	66.62	269,811.00
SCHLUMBERGER LTD	31,239	97.24	3,037,680.36
SOUTHWESTERN ENERGY CO	8,835	31.64	279,539.40
SPECTRA ENERGY CORP	16,934	38.90	658,732.60

SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	3,820	25.58	97,715.60
TESORO CORP	3,190	65.68	209,519.20
VALERO ENERGY CORP	13,022	48.62	633,129.64
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	16,939	17.16	290,673.24
WHITING PETROLEUM CORP	3,115	61.66	192,070.90
WILLIAMS COS INC	16,994	53.24	904,760.56
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,125	131.50	673,937.50
AIRGAS INC	1,430	110.02	157,328.60
ALBEMARLE CORP	1,630	57.20	93,236.00
ALCOA INC	26,179	16.55	433,262.45
ASHLAND INC	2,050	107.31	219,985.50
AVERY DENNISON CORP	2,260	46.37	104,796.20
BALL CORP	3,133	66.75	209,127.75
CELANESE CORP-SERIES A	3,900	58.35	227,565.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,130	260.41	294,263.30
CROWN HOLDINGS INC	4,035	47.55	191,864.25
DOW CHEMICAL CO/THE	28,953	48.21	1,395,824.13
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	21,978	69.00	1,516,482.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,705	77.56	287,359.80
ECOLAB INC	6,710	112.72	756,351.20
FMC CORP	3,270	58.12	190,052.40
FREEPORT-MCMORAN INC	24,558	30.80	756,386.40
INTERNATIONAL PAPER CO	10,390	49.92	518,668.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,664	97.31	161,923.84
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,050	92.39	1,020,909.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,045	122.93	128,461.85
MEADWESTVACO CORP	4,879	42.87	209,162.73
MONSANTO CO	12,541	113.28	1,420,644.48
MOSAIC CO/THE	7,850	43.36	340,376.00
NEWMONT MINING CORP	12,230	21.95	268,448.50
NUCOR CORP	7,849	52.79	414,348.71
OWENS-ILLINOIS INC	3,885	25.76	100,077.60
PPG INDUSTRIES INC	3,477	195.85	680,970.45
PRAXAIR INC	7,060	127.72	901,703.20
ROCK-TENN COMPANY-CL A	3,660	50.49	184,793.40

SEALED AIR CORP	4,356	33.50	145,926.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,167	228.91	496,047.97
SIGMA-ALDRICH	2,705	135.07	365,364.35
VULCAN MATERIALS CO	3,643	61.25	223,133.75
WESTLAKE CHEMICAL CORP	960	74.28	71,308.80
3M CO	14,896	148.59	2,213,396.64
AGCO CORP	1,670	45.30	75,651.00
AMETEK INC	6,343	51.33	325,586.19
B/E AEROSPACE INC	2,570	75.44	193,880.80
BOEING CO/THE	16,602	122.24	2,029,428.48
CATERPILLAR INC	14,196	99.44	1,411,650.24
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	2,410	53.68	129,368.80
CUMMINS INC	4,045	137.25	555,176.25
DANAHER CORP	14,889	77.96	1,160,746.44
DEERE & CO	8,180	85.43	698,817.40
DOVER CORP	3,640	79.09	287,887.60
EATON CORP PLC	11,306	63.06	712,956.36
EMERSON ELECTRIC CO	17,080	62.39	1,065,621.20
FASTENAL CO	6,153	42.67	262,548.51
FLOWSERVE CORP	3,325	64.31	213,830.75
FLUOR CORP	4,223	64.95	274,283.85
GENERAL DYNAMICS CORP	6,922	132.50	917,165.00
GENERAL ELECTRIC CO.	240,513	25.64	6,166,753.32
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	17,816	94.70	1,687,175.20
ILLINOIS TOOL WORKS	9,800	87.98	862,204.00
INGERSOLL-RAND PLC	6,866	60.26	413,745.16
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,330	47.36	157,708.80
JOY GLOBAL INC	1,945	53.25	103,571.25
KBR INC	4,120	18.93	77,991.60
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	2,051	114.56	234,962.56
LOCKHEED MARTIN CORP	6,561	181.33	1,189,706.13
MASCO CORP	8,569	23.08	197,772.52
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,184	130.79	678,015.36
PACCAR INC	8,364	61.40	513,549.60
PALL CORP	2,596	87.84	228,032.64

PARKER HANNIFIN CORP	3,260	116.57	380,018.20
PENTAIR PLC	5,148	66.93	344,555.64
PRECISION CASTPARTS CORP	3,490	223.47	779,910.30
QUANTA SERVICES INC	6,025	32.82	197,740.50
RAYTHEON COMPANY	7,792	98.12	764,551.04
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,383	109.31	369,795.73
ROCKWELL COLLINS INC.	3,315	79.12	262,282.80
ROPER INDUSTRIES INC	2,310	151.18	349,225.80
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	46.33	143,623.00
SPX CORP	887	91.68	81,320.16
STANLEY BLACK & DECKER INC	3,776	90.12	340,293.12
TEXTRON INC	6,606	38.76	256,048.56
TRANSDIGM GROUP INC	1,190	182.84	217,579.60
UNITED RENTALS INC	2,250	107.96	242,910.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	20,875	103.82	2,167,242.50
WW GRAINGER INC	1,577	237.78	374,979.06
XYLEM INC	4,368	35.34	154,365.12
ADT CORP/THE	4,917	34.50	169,636.50
CINTAS CORP	2,037	71.22	145,075.14
DUN & BRADSTREET CORP	872	119.48	104,186.56
EQUIFAX INC	2,634	73.89	194,626.26
IHS INC-CLASS A	1,710	129.53	221,496.30
MANPOWERGROUP INC	1,937	64.40	124,742.80
NIELSEN NV	6,945	42.30	293,773.50
REPUBLIC SERVICES INC	7,000	39.24	274,680.00
ROBERT HALF INTL INC	3,425	50.84	174,127.00
STERICYCLE INC	2,285	123.05	281,169.25
TOWERS WATSON & CO-CL-A	1,630	106.01	172,796.30
TYCO INTERNATIONAL LTD	10,845	41.59	451,043.55
VERISK ANALYTICS INC	4,000	61.87	247,480.00
WASTE MANAGEMENT INC	10,754	47.96	515,761.84
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	4,080	39.82	162,465.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,250	71.15	231,237.50
CSX CORP	24,953	35.30	880,840.90
DELTA AIR LINES INC	5,335	39.44	210,412.40

EXPEDITORS INTL WASH INC	4,747	40.92	194,247.24
FEDEX CORP	6,668	163.88	1,092,751.84
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	21.29	208,216.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	77.34	178,655.40
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	158,000	0.69	109,020.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,910	120.26	349,956.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,390	109.39	808,392.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	33.87	141,915.30
UNION PACIFIC CORP	21,796	114.58	2,497,385.68
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	49.62	123,801.90
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	16,907	100.59	1,700,675.13
AUTOLIV INC	2,610	90.33	235,761.30
BORGWARNER INC	5,230	56.30	294,449.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,140	66.78	476,809.20
FORD MOTOR COMPANY	88,145	13.78	1,214,638.10
GENERAL MOTORS CORP	30,545	30.04	917,571.80
HARLEY-DAVIDSON INC	5,619	63.35	355,963.65
JOHNSON CONTROLS INC	15,358	43.57	669,148.06
TESLA MOTORS INC	2,200	235.24	517,528.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	2,955	100.75	297,716.25
COACH INC	5,876	35.97	211,359.72
DR HORTON INC	6,906	22.96	158,561.76
FOSSIL GROUP INC	1,165	100.76	117,385.40
GARMIN LTD	2,865	55.26	158,319.90
HASBRO INC	3,368	57.60	194,013.64
LEGGETT & PLATT INC	2,648	37.91	100,385.68
LENNAR CORP-CL A	3,660	43.76	160,161.60
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	41.40	115,506.00
MATTEL INC	8,499	30.31	257,604.69
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,100	75.74	386,274.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,378	134.92	185,919.76
NEWELL RUBBERMAID INC	5,800	34.89	202,362.00
NIKE INC -CL B	16,754	90.90	1,522,938.60
POLARIS INDUSTRIES INC	1,580	146.18	230,964.40
PULTE GROUP INC	9,270	19.54	181,135.80

PVH CORP	2,030	117.00	237,510.00
RALPH LAUREN CORP	1,365	160.25	218,741.25
TOLL BROTHERS INC	4,501	32.47	146,147.47
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,280	64.25	274,990.00
VF CORP	7,950	66.50	528,675.00
WHIRLPOOL CORP	1,814	158.62	287,736.68
CARNIVAL CORP	10,117	38.52	389,706.84
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	755	615.78	464,913.90
DARDEN RESTAURANTS INC	2,853	51.05	145,645.65
H&R BLOCK INC	7,080	30.93	218,984.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	6,350	24.24	153,924.00
LAS VEGAS SANDS CORP	10,260	62.75	643,815.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	5,966	69.29	413,384.14
MCDONALD'S CORP	23,691	91.67	2,171,753.97
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,790	22.58	221,058.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,538	64.55	228,377.90
STARBUCKS CORP	17,962	75.81	1,361,699.22
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,037	80.02	403,060.74
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	2,980	76.32	227,433.60
WYNN RESORTS LTD	2,000	184.72	369,440.00
YUM! BRANDS INC	10,844	69.88	757,778.72
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	18.59	106,427.75
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	12,038	53.52	644,273.76
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	157.81	220,934.00
COMCAST CORP-CLASS A	51,186	54.26	2,777,352.36
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	11,221	54.16	607,729.36
DIRECTV	11,554	84.15	972,269.10
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,320	36.61	121,545.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	7,690	36.19	278,301.10
DISH NETWORK CORP-A	5,829	62.20	362,563.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,796	18.66	220,113.36
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	44.92	240,546.60
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,941	43.51	519,552.91
LIBERTY MEDIA CORP-A	2,465	46.46	114,523.90
LIBERTY MEDIA CORP-C	4,930	45.83	225,941.90

NEWS CORP - CLASS A	7,570	15.73	119,076.10
OMNICOM GROUP	6,427	70.19	451,111.13
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,320	76.18	176,737.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	80,330	3.37	270,712.10
THE WALT DISNEY CO.	39,753	88.61	3,522,513.33
TIME WARNER CABLE	6,937	142.98	991,852.26
TIME WARNER INC	21,338	78.77	1,680,794.26
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	10,729	32.24	345,902.96
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	34,132	33.35	1,138,302.20
VIACOM INC-CLASS B	8,958	71.61	641,482.38
ADVANCE AUTO PARTS INC	1,848	142.04	262,489.92
AMAZON.COM INC	9,355	287.06	2,685,446.30
AUTONATION INC	1,650	52.56	86,724.00
AUTOZONE INC	822	536.05	440,633.10
BED BATH & BEYOND INC	5,282	65.24	344,597.68
BEST BUY CO INC	6,504	33.11	215,347.44
CARMAX INC	5,869	53.58	314,461.02
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	44.56	123,431.20
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,780	62.25	484,305.00
DOLLAR TREE INC	5,264	58.94	310,260.16
EXPEDIA INC	2,232	81.53	181,974.96
FAMILY DOLLAR STORES	2,623	77.95	204,462.85
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,440	42.03	144,583.20
GAP INC/THE	5,936	36.89	218,979.04
GENUINE PARTS CO	4,011	93.19	373,785.09
HOME DEPOT INC	32,810	94.99	3,116,621.90
KOHL'S CORP	5,202	59.09	307,386.18
L BRANDS INC	6,408	70.01	448,624.08
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	11,400	25.31	288,534.00
LKQ CORP	6,990	27.23	190,337.70
LOWE'S COS INC	24,202	55.33	1,339,096.66
MACY'S INC	9,009	58.98	531,350.82
NETFLIX INC	1,390	385.02	535,177.80
NORDSTROM INC	3,690	71.20	262,728.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,675	170.48	456,034.00

PETSMART INC	2,240	69.45	155,568.00
PRICELINE GROUP INC/THE	1,255	1,138.43	1,428,729.65
ROSS STORES INC	4,616	80.50	371,588.00
STAPLES INC	17,384	12.50	217,386.92
TARGET CORP	14,050	61.57	865,058.50
TIFFANY & CO	3,360	94.44	317,318.40
TJX COMPANIES INC	16,223	62.08	1,007,123.84
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,600	71.67	258,012.00
TRIPADVISOR INC	2,830	88.25	249,747.50
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	117.35	207,709.50
URBAN OUTFITTERS INC	2,040	30.29	61,791.60
COSTCO WHOLESALE CORP	10,519	130.44	1,372,098.36
CVS HEALTH CORP	28,317	84.29	2,386,839.93
KROGER CO	11,755	54.19	637,003.45
SAFEWAY INC	5,633	34.12	192,197.96
SYSCO CORP	13,076	38.04	497,411.04
WAL-MART STORES INC	38,712	76.38	2,956,822.56
WALGREEN CO	21,932	62.65	1,374,039.80
WHOLE FOODS MARKET INC	8,610	37.71	324,683.10
ALTRIA GROUP INC	47,948	47.49	2,277,050.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,683	45.58	714,831.14
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,867	89.00	255,163.00
BUNGE LTD	3,647	84.67	308,791.49
CAMPBELL SOUP CO	4,215	43.17	181,961.55
COCA-COLA CO/THE	94,962	41.03	3,896,290.86
COCA-COLA ENTERPRISES	5,530	42.38	234,361.40
CONAGRA FOODS INC	9,730	34.20	332,766.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,990	88.28	352,237.20
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	5,129	66.80	342,617.20
GENERAL MILLS INC	14,949	51.03	762,847.47
HERSHEY CO/THE	3,485	94.13	328,043.05
HORMEL FOODS CORP	3,770	52.54	198,075.80
JM SMUCKER CO/THE	2,680	102.34	274,271.20
KELLOGG CO	6,618	61.94	409,918.92
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	3,185	145.24	462,589.40

KRAFT FOODS GROUP INC	14,681	56.83	834,321.23
LORILLARD INC	9,250	60.67	561,197.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,365	69.02	232,252.30
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,141	103.39	531,527.99
MOLSON COORS BREWING CO -B	3,760	73.23	275,344.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	40,885	34.37	1,405,217.45
MONSTER BEVERAGE CORP	3,710	97.89	363,171.90
PEPSICO INC	36,541	94.60	3,456,778.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	37,748	88.06	3,324,088.88
REYNOLDS AMERICAN INC	7,920	61.55	487,476.00
TYSON FOODS INC-CL A	6,456	38.74	250,105.44
AVON PRODUCTS	10,013	11.48	114,949.24
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,255	71.22	231,821.10
CLOROX COMPANY	3,246	99.47	322,879.62
COLGATE-PALMOLIVE CO	21,900	65.35	1,431,165.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,571	120.60	189,462.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,740	74.35	426,769.00
HERBALIFE LTD	1,850	51.60	95,460.00
KIMBERLY-CLARK CORP	8,953	113.10	1,012,584.30
PROCTER & GAMBLE CO	64,999	85.16	5,535,314.84
ABBOTT LABORATORIES	35,997	42.46	1,528,432.62
AETNA INC	8,809	78.69	693,180.21
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,444	78.28	426,156.32
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,039	69.83	910,513.37
BECTON DICKINSON AND CO	4,946	125.73	621,860.58
BOSTON SCIENTIFIC CORP	32,668	12.99	424,357.32
CARDINAL HEALTH INC	8,305	77.10	640,315.50
CAREFUSION CORP	4,525	56.96	257,744.00
CERNER CORP	7,420	61.12	453,510.40
CIGNA CORP	6,580	92.83	610,821.40
COVIDIEN PLC	10,805	89.64	968,560.20
CR BARD INC	1,854	156.97	291,022.38
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	3,938	76.73	302,162.74
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	2,972	46.14	137,128.08
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,520	116.76	294,235.20

EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	18,544	73.65	1,365,765.60
HCA HOLDINGS INC	7,535	72.07	543,047.45
HENRY SCHEIN INC	2,170	117.82	255,669.40
HOLOGIC INC	5,928	24.94	147,844.32
HUMANA INC	3,735	133.11	497,165.85
INTUITIVE SURGICAL INC	910	478.01	434,989.10
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,155	103.73	223,538.15
MCKESSON CORP	5,664	200.83	1,137,501.12
MEDTRONIC INC	23,902	66.56	1,590,917.12
OMNICARE INC	2,710	66.45	180,079.50
PATTERSON COS INC	2,042	41.84	85,437.28
QUEST DIAGNOSTICS	3,656	63.76	233,106.56
RESMED INC	3,370	52.02	175,307.40
ST JUDE MEDICAL INC	7,400	60.47	447,478.00
STRYKER CORP	7,533	84.22	634,429.26
UNITEDHEALTH GROUP INC	23,670	91.64	2,169,118.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,250	108.59	244,327.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,474	80.74	199,750.76
WELLPOINT INC	7,036	120.21	845,797.56
ZIMMER HOLDINGS INC	4,122	105.29	434,005.38
ABBVIE INC	38,207	60.29	2,303,500.03
ACTAVIS PLC	6,296	240.33	1,513,117.68
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,010	54.05	432,940.50
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4,850	190.29	922,906.50
ALLERGAN INC	7,185	184.21	1,323,548.85
AMGEN INC	18,101	147.26	2,665,553.26
BIOGEN IDEC INC	5,693	321.67	1,831,267.31
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	81.03	283,605.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	39,651	53.63	2,126,483.13
CELGENE CORP	19,244	103.24	1,986,750.56
ELI LILLY & CO	24,083	66.05	1,590,682.15
ENDO INTERNATIONAL PLC	3,310	65.04	215,282.40
GILEAD SCIENCES INC	36,924	110.71	4,087,856.04
HOSPIRA INC	3,921	52.25	204,872.25
ILLUMINA INC	3,195	189.12	604,238.40

JOHNSON & JOHNSON	67,741	103.13	6,986,129.33
MALLINCKRODT PLC	2,400	90.97	218,328.00
MERCK & CO. INC.	70,163	57.61	4,042,090.43
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	740	252.00	186,480.00
MYLAN INC	9,655	51.22	494,529.10
PERRIGO CO PLC	3,039	155.15	471,500.85
PFIZER INC	152,980	29.11	4,453,247.80
PHARMACYCLICS INC	1,550	123.68	191,704.00
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	1,150	57.56	66,194.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,920	402.50	772,800.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,554	117.90	1,126,416.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,810	109.91	638,577.10
WATERS CORP	2,276	108.21	246,285.96
ZOETIS INC	12,480	36.58	456,518.40
BANK OF AMERICA CORP	252,459	16.72	4,221,114.48
BB&T CORP	17,778	36.66	651,741.48
CIT GROUP INC	4,465	46.63	208,202.95
CITIGROUP INC	73,067	51.80	3,784,870.60
COMERICA INC	4,300	45.51	195,693.00
FIFTH THIRD BANCORP	20,029	19.12	382,954.48
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	47.58	110,861.40
HUDSON CITY BANCORP INC	14,060	9.14	128,508.40
JPMORGAN CHASE & CO	90,820	58.74	5,334,766.80
KEYCORP	20,968	12.79	268,180.72
M & T BANK CORP	2,953	116.37	343,640.61
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	9,654	15.55	150,119.70
OCWEN FINANCIAL CORP	2,820	19.27	54,341.40
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	6,370	14.34	91,345.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,670	82.52	1,045,528.40
REGIONS FINANCIAL CORP	29,784	9.44	281,160.96
SUNTRUST BANKS INC	12,787	37.41	478,361.67
US BANCORP	43,581	40.91	1,782,898.71
WELLS FARGO & CO	120,490	51.20	6,169,088.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,220	191.58	233,727.60
ALLY FINANCIAL INC	6,720	21.69	145,756.80

AMERICAN EXPRESS CO	22,954	86.40	1,983,225.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,840	117.65	569,426.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	27,532	37.12	1,021,987.84
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,910	139.40	3,751,254.00
BLACKROCK INC	3,235	324.87	1,050,954.45
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,925	79.27	1,103,834.75
CME GROUP INC	7,500	82.31	617,325.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,130	62.34	693,844.20
EATON VANCE CORP	2,880	36.41	104,860.80
FRANKLIN RESOURCES INC	10,445	53.41	557,867.45
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,208	183.35	1,871,636.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,636	206.59	544,571.24
INVESCO LTD	10,087	38.06	383,911.22
LEGG MASON INC	2,185	50.83	111,063.55
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	23.11	168,818.55
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	6,582	84.05	553,217.10
MOODY'S CORP	4,807	96.94	465,990.58
MORGAN STANLEY	35,775	34.32	1,227,798.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	40.88	124,888.40
NAVIENT CORP	10,792	18.90	203,968.80
NORTHERN TRUST CORP	5,440	63.64	346,201.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,380	53.20	179,816.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	29,244	26.69	780,522.36
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,225	37.06	119,518.50
STATE STREET CORP	10,157	71.88	730,085.16
T ROWE PRICE GROUP INC	6,755	77.84	525,809.20
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	31.31	158,115.50
VOYA FINANCIAL INC	3,050	37.87	115,503.50
ACE LTD	8,323	106.90	889,728.70
AFLAC INC	10,542	58.54	617,128.68
ALLEGHANY CORP	400	433.30	173,320.00
ALLSTATE CORP	10,913	62.57	682,826.41
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	33,025	52.16	1,722,584.00
AON PLC	7,067	82.38	582,179.46
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,115	55.68	173,443.20

ASSURANT INC	1,530	65.59	100,352.70
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	47.38	141,903.10
CHUBB CORP	5,603	96.43	540,297.29
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,940	48.74	192,035.60
EVEREST RE GROUP LTD	1,014	165.43	167,746.02
FNF GROUP	5,881	29.31	172,372.11
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	11,470	13.38	153,468.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,292	37.55	386,464.60
LINCOLN NATIONAL CORP	6,703	50.60	339,171.80
LOEWS CORP	8,005	42.50	340,212.50
MARSH & MCLENNAN COS	13,683	51.63	706,453.29
METLIFE INC	22,875	50.79	1,161,821.25
PARTNERRE LTD	1,052	114.16	120,096.32
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6,780	50.35	341,373.00
PROGRESSIVE CORP	12,350	25.87	319,494.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,902	84.58	922,091.16
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	887	101.05	89,631.35
TORCHMARK CORP	3,106	51.25	159,182.50
TRAVELERS COS INC/THE	8,024	97.73	784,185.52
UNUM GROUP	6,098	33.92	206,844.16
WILLIS GROUP HOLDING	2,990	40.58	121,334.20
WR BERKLEY CORP	2,573	50.94	131,068.62
XL GROUP PLC	6,310	32.75	206,652.50
CBRE GROUP INC	6,610	30.57	202,067.70
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	39.69	125,420.40
ACCENTURE PLC-CL A	15,138	78.35	1,186,062.30
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,200	19.17	195,534.00
ADOBE SYSTEMS INC	11,379	67.01	762,506.79
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	4,220	55.28	233,281.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	273.50	348,712.50
ANSYS INC	2,090	75.37	157,523.30
AUTODESK INC	5,210	54.45	283,684.50
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,626	76.20	885,901.20
CA INC	8,520	28.43	242,223.60
CITRIX SYSTEMS INC	3,628	63.59	230,704.52

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,378	45.10	693,547.80
COMPUTER SCIENCES CORP	3,453	59.55	205,626.15
EBAY INC	27,297	51.12	1,395,422.64
ELECTRONIC ARTS INC	6,984	36.35	253,868.40
EQUINIX INC	1,150	194.87	224,100.50
FACEBOOK INC-A	48,050	80.67	3,876,193.50
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	6,805	55.77	379,514.85
FISERV INC	5,998	66.04	396,107.92
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,740	139.10	242,034.00
GOOGLE INC-CL A	6,775	548.90	3,718,797.50
GOOGLE INC-CL C	6,860	539.78	3,702,890.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	23,092	162.08	3,742,751.36
INTUIT INC	6,846	84.96	581,636.16
LINKEDIN CORP - A	2,580	202.10	521,418.00
MASTERCARD INC-CLASS A	24,340	74.00	1,801,160.00
MICROSOFT CORP	188,584	46.13	8,699,379.92
NETSUITE INC	740	103.61	76,671.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,980	14.86	103,722.80
ORACLE CORP	85,613	38.73	3,315,791.49
PAYCHEX INC	7,962	45.49	362,191.38
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	36.10	115,881.00
RED HAT INC	4,630	56.02	259,372.60
SALESFORCE.COM INC	13,900	59.57	828,023.00
SERVICENOW INC	3,030	65.45	198,313.50
SYMANTEC CORP	15,945	23.98	382,361.10
SYNOPSYS INC	3,207	39.93	128,055.51
TERADATA CORP	4,175	40.69	169,880.75
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	30.92	139,325.52
TWITTER INC	7,440	49.95	371,628.00
VANTIV INC - CL-A	2,410	32.08	77,312.80
VERISIGN INC	2,720	58.55	159,256.00
VISA INC-CLASS A SHARES	11,985	213.48	2,558,557.80
VMWARE INC	2,405	83.84	201,635.20
WESTERN UNION CO	13,031	16.47	214,620.57
WORKDAY INC-CLASS A	1,580	89.51	141,425.80

XEROX CORP	27,074	12.55	339,778.70
YAHOO! INC	23,835	43.50	1,036,822.50
AMPHENOL CORP-CL A	8,080	48.83	394,546.40
APPLE INC	144,952	105.22	15,251,849.44
ARROW ELECTRONICS INC	2,310	52.94	122,291.40
AVNET INC	3,460	41.78	144,558.80
CISCO SYSTEMS INC	123,030	23.78	2,925,653.40
CORNING INC	30,858	18.80	580,130.40
EMC CORP/MASS	49,269	28.17	1,387,907.73
F5 NETWORKS INC	1,775	114.90	203,947.50
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	9.33	137,020.38
FLIR SYSTEMS INC	3,195	32.04	102,367.80
HARRIS CORP	3,080	67.33	207,376.40
HEWLETT-PACKARD CO	45,645	34.93	1,594,379.85
JUNIPER NETWORKS INC	9,373	19.00	178,087.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,765	62.57	360,716.05
NETAPP INC	8,356	40.72	340,256.32
QUALCOMM INC	40,552	76.00	3,081,952.00
SANDISK CORP	5,293	88.76	469,806.68
SEAGATE TECHNOLOGY	7,724	58.36	450,772.64
TE CONNECTIVITY LTD	10,025	56.27	564,106.75
TRIMBLE NAVIGATION LTD	6,050	29.60	179,110.25
WESTERN DIGITAL CORP	5,255	91.68	481,778.40
AT&T INC	124,686	33.87	4,223,114.82
CENTURYLINK INC	13,716	39.93	547,679.88
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	27,924	6.28	175,362.72
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	3,400	42.22	143,548.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,010	111.57	335,825.70
SPRINT CORP	21,150	6.08	128,592.00
T-MOBILE US INC	4,362	28.12	122,659.44
VERIZON COMMUNICATIONS INC	99,627	48.77	4,858,808.79
WINDSTREAM HOLDINGS INC	17,485	10.21	178,521.85
AES CORP	17,438	13.73	239,423.74
ALLIANT ENERGY CORP	2,160	60.36	130,377.60
AMEREN CORPORATION	6,522	41.24	268,967.28

AMERICAN ELECTRIC POWER	11,428	56.47	645,339.16
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	51.91	212,571.45
CALPINE CORP	9,640	21.96	211,694.40
CENTERPOINT ENERGY INC	11,092	24.00	266,208.00
CMS ENERGY CORP	5,290	32.09	169,756.10
CONSOLIDATED EDISON INC	7,056	62.50	441,000.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	14,297	70.72	1,011,083.84
DTE ENERGY COMPANY	4,478	80.20	359,135.60
DUKE ENERGY CORP	16,966	80.30	1,362,369.80
EDISON INTERNATIONAL	7,059	60.65	428,128.35
ENERGY CORP	4,147	82.14	340,634.58
EXELON CORP	20,166	35.73	720,531.18
FIRSTENERGY CORP	9,905	36.27	359,254.35
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,000	70.05	140,100.00
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	27.72	146,361.60
NEXTERA ENERGY INC	10,545	98.36	1,037,206.20
NISOURCE INC	8,025	41.76	335,124.00
NORTHEAST UTILITIES	6,900	48.59	335,271.00
NRG ENERGY INC	7,670	29.72	227,952.40
OGE ENERGY CORP	5,180	36.82	190,727.60
P G & E CORP	10,391	47.17	490,143.47
PINNACLE WEST CAPITAL	2,199	59.17	130,114.83
PPL CORPORATION	15,848	34.53	547,231.44
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11,758	39.57	465,264.06
SCANA CORP	3,443	53.33	183,615.19
SEMPRA ENERGY	5,877	107.86	633,893.22
SOUTHERN CO	21,615	47.41	1,024,767.15
WISCONSIN ENERGY CORP	5,774	48.62	280,731.88
XCEL ENERGY INC	11,814	32.90	388,680.60
ALTERA CORPORATION	7,436	33.15	246,540.58
ANALOG DEVICES INC	7,491	46.85	350,953.35
APPLIED MATERIALS INC	29,583	20.99	620,947.17
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,260	81.85	512,381.00
BROADCOM CORP-CL A	12,686	39.70	503,634.20
CREE INC	3,160	29.67	93,757.20

	INTEL CORP	119,182	33.18	3,954,458.76	
	KLA-TENCOR CORPORATION	3,779	75.90	286,826.10	
	LAM RESEARCH CORP	4,167	75.56	314,858.52	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	40.89	228,738.66	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9,254	13.03	120,579.62	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,570	28.74	217,561.80	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,124	41.04	210,288.96	
	MICRON TECHNOLOGY INC	26,237	31.06	814,921.22	
	NVIDIA CORP	11,505	18.48	212,612.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	25,812	47.57	1,227,876.84	
	XILINX INC	6,125	43.20	264,600.00	
米ドル小計		7,602,796		430,073,326.78 (46,422,114,892)	
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	47.00	143,350.00	
	ARC RESOURCES LTD	7,925	26.95	213,578.75	
	ATHABASCA OIL CORP	8,020	4.17	33,443.40	
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	35.61	120,183.75	
	CAMECO CORP	10,492	18.84	197,669.28	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,794	38.94	1,043,358.36	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	11,160	17.80	198,648.00	
	CENOVUS ENERGY INC	17,463	27.50	480,232.50	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	10,045	38.18	383,518.10	
	ENBRIDGE INC	19,625	52.56	1,031,490.00	
	ENCANA CORP	17,968	20.63	370,679.84	
	ENERPLUS CORP	4,690	16.90	79,261.00	
	HUSKY ENERGY INC	9,069	27.56	249,941.64	
	IMPERIAL OIL LTD	6,942	51.48	357,374.16	
	INTER PIPELINE LTD	7,180	35.42	254,315.60	
	KEYERA CORP	2,060	92.11	189,746.60	
	MEG ENERGY CORP	2,710	27.49	74,497.90	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	6,650	18.31	121,761.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,085	47.38	383,067.30	
	PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	4.61	58,915.80	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	10,703	5.34	57,154.02	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	32.73	120,446.40	

SUNCOR ENERGY INC	35,445	38.87	1,377,747.15
TALISMAN ENERGY INC	25,922	7.32	189,749.04
TOURMALINE OIL CORP	4,005	41.23	165,126.15
TRANSCANADA CORP	16,903	54.31	918,001.93
VERMILION ENERGY INC	1,830	66.11	120,981.30
AGNICO EAGLE MINES LTD	4,695	32.81	154,042.95
AGRIUM INC	3,765	104.33	392,802.45
BARRICK GOLD CORP	28,214	15.18	428,288.52
ELDORADO GOLD CORP	20,510	7.82	160,388.20
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,590	18.99	239,084.10
FRANCO-NEVADA CORP	2,925	60.27	176,289.75
GOLDCORP INC	20,487	25.01	512,379.87
KINROSS GOLD CORP	25,015	3.02	75,545.30
METHANEX CORP	2,330	64.13	149,422.90
NEW GOLD INC	9,550	4.82	46,031.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	19,467	38.14	742,471.38
SILVER WHEATON CORP	8,645	22.17	191,659.65
TECK RESOURCES LTD-CLS B	13,885	17.85	247,847.25
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	3.52	47,234.88
YAMANA GOLD INC	19,626	6.31	123,840.06
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	3.83	133,077.18
CAE INC	6,315	14.85	93,777.75
FINNING INTERNATIONAL INC	4,625	29.01	134,171.25
SNC-LAVALIN GROUP INC	3,195	48.85	156,075.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	19,698	77.27	1,522,064.46
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,215	230.28	970,630.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,509	108.38	597,065.42
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,070	65.21	200,194.70
TIM HORTONS INC	3,275	89.12	291,868.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	27.95	298,925.25
THOMSON REUTERS CORP	8,834	41.49	366,522.66
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,040	125.36	255,734.40
DOLLARAMA INC	1,660	100.15	166,249.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,730	37.71	366,918.30
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	76.50	76,500.00

LOBLAW COMPANIES LTD	4,519	56.71	256,272.49
METRO INC	1,930	77.32	149,227.60
WESTON (GEORGE) LTD	942	90.77	85,505.34
SAPUTO INC	7,040	31.68	223,027.20
CATAMARAN CORP	4,320	48.06	207,619.20
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	7,914	145.21	1,149,191.94
BANK OF MONTREAL	15,461	81.51	1,260,226.11
BANK OF NOVA SCOTIA	29,069	67.99	1,976,401.31
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,385	100.66	944,694.10
NATIONAL BANK OF CANADA	7,340	52.28	383,735.20
ROYAL BANK OF CANADA	34,539	79.28	2,738,251.92
TORONTO-DOMINION BANK	44,100	54.28	2,393,748.00
CI FINANCIAL CORP	3,410	32.24	109,938.40
IGM FINANCIAL INC	2,535	43.46	110,171.10
ONEX CORPORATION	1,905	61.35	116,871.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	490	510.68	250,233.20
GREAT-WEST LIFECO INC	7,724	30.93	238,903.32
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	43.72	127,006.60
INTACT FINANCIAL CORP	3,045	74.15	225,786.75
MANULIFE FINANCIAL CORP	46,211	20.54	949,173.94
POWER CORP OF CANADA	7,800	29.18	227,604.00
POWER FINANCIAL CORP	5,715	32.45	185,451.75
SUN LIFE FINANCIAL INC	13,864	39.16	542,914.24
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	13,642	52.76	719,751.92
CGI GROUP INC - CL A	5,870	37.47	219,948.90
OPEN TEXT CORP	3,070	59.69	183,248.30
BLACKBERRY LTD	13,928	11.51	160,311.28
BCE INC	6,470	48.59	314,377.30
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9,235	43.22	399,136.70
TELUS CORP	4,366	39.56	172,718.96
ATCO LTD -CLASS I	1,920	48.01	92,179.20
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	40.16	104,014.40
FORTIS INC	4,785	35.04	167,666.40
TRANSALTA CORP	7,950	11.02	87,609.00
	954,290		35,724,259.87

加ドル小計				(3,434,173,101)
ユーロ	ENI SPA	60,826	16.40	997,546.40
	FUGRO NV-CVA	1,660	19.51	32,394.90
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	11.35	105,725.25
	NESTE OIL OYJ	3,590	16.99	60,994.10
	OMV AG	3,490	24.78	86,482.20
	REPSOL SA	24,031	17.43	418,860.33
	SAIPEM SPA	7,220	14.94	107,866.80
	TECHNIP SA	2,468	55.63	137,294.84
	TENARIS SA	12,625	15.33	193,541.25
	TOTAL SA	51,417	44.85	2,306,309.53
	VOPAK	1,890	39.99	75,590.55
	AIR LIQUIDE SA	7,984	92.66	739,797.44
	AKZO NOBEL NV	5,768	51.14	294,975.52
	ARCELORMITTAL	26,441	10.16	268,640.56
	ARKEMA	1,615	49.23	79,506.45
	BASF SE	21,995	68.78	1,512,816.10
	CRH PLC	18,570	17.45	324,046.50
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	1,720	29.60	50,912.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,245	53.03	172,082.35
	IMERYS SA	910	55.58	50,577.80
	K+S AG	3,880	20.86	80,936.80
	KONINKLIJKE DSM NV	3,442	47.14	162,273.09
	LAFARGE SA	4,738	52.90	250,640.20
	LANXESS AG	1,935	39.87	77,158.12
	LINDE AG	4,585	149.85	687,062.25
	SOLVAY ET CIE SA -A	1,271	108.15	137,458.65
	STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	6.42	77,646.12
	THYSSENKRUPP AG	9,395	18.87	177,330.62
	UMICORE	2,120	31.30	66,356.00
	UPM-KYMMENE OYJ	12,618	10.92	137,788.56
	VOESTALPINE AG	2,509	30.89	77,503.01
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	29.17	121,834.80
	AIRBUS GROUP NV	13,718	45.29	621,288.22
	ALSTOM	5,800	27.08	157,064.00

ANDRITZ AG	1,980	38.65	76,527.00
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	41.77	70,800.15
BOUYGUES SA	4,210	26.18	110,238.85
BRENTAG AG	3,765	37.54	141,356.92
CNH INDUSTRIAL NV	24,730	6.24	154,438.85
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,846	33.40	362,256.40
FERROVIAL SA	9,975	15.96	159,201.00
FINMECCANICA SPA	9,630	7.21	69,432.30
GEA GROUP AG	5,040	34.89	175,845.60
HOCHTIEF AG	625	58.33	36,456.25
KONE OYJ-B	7,854	32.66	256,511.64
KONINKLIJKE PHILIPS NV	23,851	21.23	506,356.73
LEGRAND SA	6,498	40.17	261,024.66
MAN SE	1,054	90.65	95,545.10
METSO OYJ	3,260	26.21	85,444.60
OCI NV	2,300	26.16	60,168.00
OSRAM LICHT AG	2,332	26.86	62,649.18
PRYSMIAN SPA	5,635	13.40	75,509.00
REXEL SA	4,200	13.96	58,632.00
SAFRAN SA	6,190	48.01	297,212.85
SCHNEIDER ELECTRIC SE	12,858	57.89	744,349.62
SIEMENS AG-REG	18,996	86.09	1,635,365.64
THALES SA	2,345	38.00	89,110.00
VALLOUREC	2,495	30.59	76,334.52
VINCI SA	12,010	44.08	529,460.85
WARTSILA OYJ ABP	3,660	34.82	127,441.20
ZARDOYA OTIS SA	4,249	9.02	38,325.98
ZODIAC AEROSPACE	4,550	23.37	106,356.25
BUREAU VERITAS SA	5,650	18.14	102,519.25
EDENRED	6,096	21.47	130,911.60
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	33.89	97,109.17
SOCIETE BIC SA	735	94.85	69,714.75
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	10,531	15.31	161,229.61
ADP	650	92.10	59,865.00
ATLANTIA SPA	9,360	18.01	168,573.60

BOLLORE	110	366.60	40,326.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	12.19	69,267.60
DEUTSCHE POST AG-REG	22,413	23.92	536,118.96
FRAPORT AG	980	48.98	48,000.40
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	13,280	9.57	127,142.72
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	23,442	4.86	113,951.56
TNT EXPRESS NV	9,060	4.82	43,732.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8,085	82.29	665,314.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,190	62.88	74,827.20
CONTINENTAL AG	2,725	151.30	412,292.50
DAIMLER AG	23,072	60.18	1,388,472.96
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	23,867	7.48	178,644.49
MICHELIN (CGDE)-B	4,149	66.77	277,028.73
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	24.10	70,251.50
PEUGEOT SA	7,500	9.20	69,000.00
PIRELLI & C.	5,506	10.45	57,537.70
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	3,490	62.31	217,461.90
RENAULT SA	4,597	55.15	253,524.55
VALEO SA	1,880	85.70	161,116.00
VOLKSWAGEN AG	771	161.65	124,632.15
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,853	160.45	618,213.85
ADIDAS AG	5,361	57.72	309,436.92
CHRISTIAN DIOR	1,420	135.70	192,694.00
HUGO BOSS AG -ORD	900	103.90	93,510.00
KERING	1,807	145.70	263,279.90
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	38.60	153,473.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,679	128.25	856,581.75
ACCOR SA	3,686	31.72	116,938.35
SODEXO	2,330	74.03	172,489.90
ALTICE SA	1,280	45.00	57,600.00
AXEL SPRINGER SE	995	42.26	42,048.70
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	25.43	96,525.82
JC DECAUX SA .	1,910	24.63	47,043.30
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	460	108.40	49,864.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	19.21	57,260.70

PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	4,805	31.15	149,675.75
PUBLICIS GROUPE	4,725	51.34	242,581.50
REED ELSEVIER NV	17,968	17.34	311,654.96
RTL GROUP	920	73.19	67,334.80
SES	7,690	27.68	212,859.20
SKY DEUTSCHLAND AG	10,300	6.75	69,525.00
TELENET GROUP HOLDING NV	1,440	46.05	66,319.20
WOLTERS KLUWER	7,557	20.37	153,973.87
INDITEX	26,975	21.31	574,972.12
CARREFOUR SA	14,353	22.64	325,023.68
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	79.14	106,364.16
COLRUYT SA	2,035	34.65	70,522.92
DELHAIZE GROUP	2,426	51.58	125,133.08
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	16,598	4.85	80,550.09
JERONIMO MARTINS	5,075	8.10	41,107.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	23,791	12.50	297,506.45
METRO AG	3,260	24.83	80,945.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	19,301	85.35	1,647,340.35
DANONE	13,904	50.60	703,542.40
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	49.40	128,193.00
HEINEKEN NV	5,563	56.90	316,534.70
KERRY GROUP PLC-A	3,750	52.10	195,375.00
PERNOD-RICARD SA	4,796	87.84	421,280.64
REMY COINTREAU	470	55.86	26,254.20
UNILEVER NV-CVA	38,975	29.25	1,140,018.75
BEIERSDORF AG	2,655	62.72	166,521.60
HENKEL AG & CO KGAA	2,920	69.10	201,772.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,463	75.26	335,885.38
L'OREAL	5,996	119.70	717,721.20
CELESIO AG	960	26.50	25,440.00
ESSILOR INTERNATIONAL	5,205	84.10	437,740.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	4,683	56.68	265,432.44
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,345	38.77	362,305.65
BAYER AG	19,830	105.75	2,097,022.50
GRIFOLS SA	3,810	31.90	121,539.00

MERCK KGAA	2,930	70.95	207,883.50
ORION OYJ-CLASS B	2,590	26.79	69,386.10
QIAGEN N.V.	5,145	18.05	92,867.25
SANOFI	28,466	84.60	2,408,223.60
UCB SA	2,798	65.61	183,576.78
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	97,234	1.00	97,234.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	142,213	9.23	1,313,479.26
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	750,000	0.09	70,500.00
BANCO DE SABADELL SA	84,803	2.35	200,050.27
BANCO POPOLARE SC	5,500	12.32	67,760.00
BANCO POPULAR ESPANOL	39,339	5.00	196,734.33
BANCO SANTANDER SA	289,517	7.04	2,038,489.19
BANCO SANTANDER SA-RTS	289,517	0.15	44,296.10
BANK OF IRELAND	558,550	0.31	176,501.80
BANKIA SA	95,000	1.46	138,700.00
BNP PARIBAS	25,332	49.50	1,254,060.66
CAIXABANK S.A	42,940	4.60	197,652.82
COMMERZBANK AG	23,524	11.77	276,995.10
CREDIT AGRICOLE SA	26,092	11.72	305,798.24
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	18.89	134,459.02
ING GROEP NV-CVA	92,195	11.28	1,040,420.57
INTESA SANPAOLO	293,243	2.35	690,880.50
KBC GROEP NV	6,119	41.68	255,070.51
NATIXIS	27,130	5.55	150,680.02
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,770	16.99	47,062.30
SOCIETE GENERALE	17,819	38.83	692,000.86
UBI BANCA SCPA	22,584	6.30	142,392.12
UNICREDIT SPA	110,413	5.88	649,780.50
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	32,225	25.09	808,686.37
DEUTSCHE BOERSE AG	4,720	52.90	249,688.00
EURAZEO	870	50.73	44,135.10
EXOR SPA	1,714	28.88	49,500.32
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	69.55	130,893.10
MEDIOBANCA SPA	11,670	6.86	80,114.55
WENDEL	750	84.65	63,487.50

AEGON NV	44,779	6.20	277,674.57
AGEAS	5,954	26.05	155,101.70
ALLIANZ SE-REG	10,908	123.05	1,342,229.40
ASSICURAZIONI GENERALI	27,848	16.00	445,568.00
AXA	44,392	17.91	795,282.68
CNP ASSURANCES	3,530	14.81	52,296.95
DELTA LLOYD NV	3,600	17.63	63,468.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,355	63.46	85,988.30
MAPFRE SA	20,814	2.73	57,009.54
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3,976	150.25	597,394.00
SAMPO OYJ-A SHS	10,779	37.27	401,733.33
SCOR SE	4,142	23.60	97,751.20
UNIPOLSAI SPA	23,000	2.13	49,036.00
VIENNA INSURANCE GROUP	1,120	36.20	40,544.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	7,800	17.16	133,887.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150	-	-
IMMOFINANZ AG	25,580	2.32	59,524.66
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000	-	-
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	27.03	271,972.10
ATOS	1,650	54.12	89,298.00
CAP GEMINI SA	3,209	51.21	164,332.89
DASSAULT SYSTEMES SA	3,530	48.36	170,728.45
GEMALTO	1,850	60.00	111,000.00
SAP SE	22,042	51.64	1,138,248.88
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2,930	31.15	91,284.15
ALCATEL-LUCENT	70,000	2.02	141,470.00
NOKIA OYJ	90,536	6.63	600,253.68
BELGACOM SA	3,780	29.49	111,472.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	76,166	11.17	851,155.05
ELISA OYJ	4,205	20.67	86,917.35
ILIAD SA	730	179.35	130,925.50
KONINKLIJKE KPN NV	80,906	2.39	193,527.15
ORANGE S.A.	45,434	11.58	526,125.72
TELECOM ITALIA SPA	266,883	0.83	223,781.39
TELECOM ITALIA-RSP	125,887	0.66	83,777.79

	TELEFONICA SA	98,058	11.44	1,122,273.81	
	VIVENDI	29,610	18.64	552,078.45	
	ZIGGO NV	4,030	38.10	153,563.15	
	E.ON SE	48,539	13.17	639,258.63	
	EDF	6,885	22.36	153,983.02	
	ENAGAS	4,190	25.51	106,907.85	
	ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.86	81,363.60	
	ENEL SPA	165,284	3.85	636,673.96	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	3.28	161,543.32	
	FORTUM OYJ	9,825	17.84	175,278.00	
	GAS NATURAL SDG SA	9,162	22.09	202,434.39	
	GDF SUEZ	35,164	18.17	639,105.70	
	IBERDROLA SA	115,162	5.48	632,009.05	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,040	67.68	205,747.20	
	RWE AG	12,505	27.09	338,822.97	
	SNAM SPA	47,520	4.17	198,158.40	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	6,199	13.13	81,423.86	
	TERNA SPA	43,127	3.92	169,144.09	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	13.15	120,815.52	
	ASML HOLDING NV	8,542	74.68	637,916.56	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,335	7.56	221,919.27	
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	5.50	92,390.41	
ユーロ小計		6,106,651		69,975,160.98 (9,582,398,544)	
英ポンド	AMEC PLC	8,850	10.09	89,296.50	
	BG GROUP PLC	82,014	10.43	855,406.02	
	BP PLC	444,378	4.32	1,923,490.17	
	PETROFAC LTD	6,995	10.68	74,706.60	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	94,808	21.97	2,082,931.76	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	58,524	22.87	1,338,443.88	
	TULLOW OIL PLC	19,950	4.94	98,672.70	
	ANGLO AMERICAN PLC	33,914	13.08	443,595.12	
	ANTOFAGASTA PLC	11,360	6.93	78,724.80	
	BHP BILLITON PLC	51,031	16.27	830,274.37	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	21.91	85,449.00	

FRESNILLO PLC	5,160	7.66	39,551.40
GLENCORE PLC	256,733	3.16	813,715.24
JOHNSON MATTHEY PLC	5,517	28.81	158,944.77
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	40.11	90,247.50
REXAM PLC	19,752	4.66	92,202.33
RIO TINTO PLC	30,745	30.12	926,193.12
BAE SYSTEMS PLC ORD	71,015	4.41	313,531.22
BUNZL PLC	7,276	16.48	119,908.48
COBHAM PLC	23,225	2.76	64,101.00
IMI PLC	6,116	11.89	72,719.24
MEGGITT PLC	20,865	4.42	92,348.49
MELROSE INDUSTRIES PLC	22,516	2.51	56,672.77
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	45,385	7.95	360,810.75
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF-C(N)	4,084,650	0.00	4,084.65
SMITHS GROUP PLC	8,813	11.52	101,525.76
TRAVIS PERKINS PLC	6,600	15.86	104,676.00
WEIR GROUP PLC/THE	5,660	22.50	127,350.00
WOLSELEY PLC	6,074	32.10	194,975.40
AGGREKO PLC	6,006	15.36	92,252.16
BABCOCK INTL GROUP PLC	6,275	10.73	67,330.75
CAPITA PLC	15,309	11.49	175,900.41
EXPERIAN PLC	23,618	9.22	217,757.96
G4S PLC	42,539	2.51	106,772.89
INTERTEK GROUP PLC	3,545	25.66	90,964.70
EASYJET PLC	3,840	14.38	55,219.20
ROYAL MAIL PLC	14,990	4.57	68,624.22
GKN PLC	33,065	3.07	101,707.94
BURBERRY GROUP PLC	11,004	14.95	164,509.80
PERSIMMON PLC	8,190	13.96	114,332.40
CARNIVAL PLC	5,300	23.49	124,497.00
COMPASS GROUP PLC	40,967	9.67	396,150.89
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	5,768	22.17	127,876.56
TUI TRAVEL PLC	8,505	3.65	31,094.28
WHITBREAD PLC	4,140	43.10	178,434.00
WILLIAM HILL PLC	23,300	3.52	82,202.40

BRITISH SKY BROADCASTING GRO	25,734	8.61	221,698.41
ITV PLC	89,555	1.97	176,960.68
PEARSON PLC	20,339	11.39	231,661.21
REED ELSEVIER PLC	29,206	9.78	285,634.68
WPP PLC	33,094	11.78	389,847.32
ASOS PLC	1,250	21.07	26,337.50
DIXONS CARPHONE PLC	22,000	3.77	83,050.00
KINGFISHER PLC	62,157	2.92	181,995.69
MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,080	4.14	174,295.36
NEXT PLC	3,697	65.00	240,305.00
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	5,460	6.30	34,398.00
SAINSBURY (J) PLC	34,011	2.38	81,014.20
TESCO PLC	201,304	1.68	339,700.50
WM MORRISON SUPERMARKETS	37,925	1.52	57,835.62
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8,695	27.11	235,721.45
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	44,927	33.62	1,510,670.37
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	13.20	66,000.00
DIAGEO PLC	60,162	17.71	1,065,769.83
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	23,832	25.83	615,580.56
SABMILLER PLC	23,061	33.57	774,273.07
TATE & LYLE PLC	12,180	5.80	70,644.00
UNILEVER PLC	30,697	24.06	738,569.82
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	15,555	49.81	774,794.55
SMITH & NEPHEW PLC	22,326	9.81	219,129.69
ASTRAZENECA PLC	30,263	43.27	1,309,631.32
GLAXOSMITHKLINE PLC	116,461	14.15	1,648,505.45
SHIRE PLC	13,785	40.50	558,292.50
BARCLAYS PLC	392,411	2.26	888,222.29
HSBC HOLDINGS PLC	456,481	6.29	2,874,917.33
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,370,516	0.76	1,051,459.87
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.64	208,431.66
STANDARD CHARTERED PLC	58,899	11.15	656,723.85
3I GROUP PLC	20,499	3.79	77,814.20
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.11	93,533.95
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	9.43	53,939.60

	ICAP PLC	12,270	4.12	50,626.02	
	INVESTEC PLC	13,185	5.34	70,473.82	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,177	19.16	99,191.32	
	SCHRODERS PLC	2,231	23.09	51,513.79	
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	12.76	62,843.00	
	AVIVA PLC	71,090	5.07	360,426.30	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	32,000	2.76	88,480.00	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	37,353	3.01	112,619.29	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	136,881	2.22	304,697.10	
	OLD MUTUAL PLC	120,149	1.84	221,915.20	
	PRUDENTIAL PLC	61,362	13.74	843,113.88	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	24,738	4.66	115,501.72	
	STANDARD LIFE PLC	60,295	3.87	233,341.65	
	SAGE GROUP PLC/THE	27,620	3.66	101,310.16	
	BT GROUP PLC	191,592	3.70	708,890.40	
	INMARSAT PLC	10,010	6.86	68,668.60	
	VODAFONE GROUP PLC	633,078	2.00	1,269,321.39	
	CENTRICA PLC	114,215	2.92	334,307.30	
	NATIONAL GRID PLC	89,325	8.91	795,885.75	
	SEVERN TRENT PLC	6,283	19.88	124,906.04	
	SSE PLC	22,937	15.36	352,312.32	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,525	8.38	155,239.50	
	ARM HOLDINGS PLC	34,530	8.17	282,110.10	
英債券小計		10,829,450		38,655,230.78	(6,719,438,766)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	7,955	28.58	227,353.90	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	240	345.75	82,980.00	
	GIVAUDAN-REG	213	1,540.00	328,020.00	
	HOLCIM LTD-REG	5,743	65.45	375,879.35	
	SIKA AG-BR	47	3,244.00	152,468.00	
	SYNGENTA AG-REG	2,188	290.20	634,957.60	
	ABB LTD-REG	52,525	20.31	1,066,782.75	
	GEBERIT AG-REG	925	308.90	285,732.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	620	127.90	79,298.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	131.50	143,335.00	

	SULZER AG-REG	520	104.70	54,444.00	
	ADECCO SA-REG	3,557	62.05	220,711.85	
	SGS SA-REG	133	2,001.00	266,133.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,020	121.00	123,420.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	12,469	78.85	983,180.65	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	740	449.50	332,630.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	81.75	76,027.50	
	ARYZTA AG	2,110	79.15	167,006.50	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	4,590.00	114,750.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	55,400.00	166,200.00	
	NESTLE SA-REG	77,633	67.95	5,275,162.35	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,510	143.10	216,081.00	
	ACTELION LTD-REG	2,560	112.10	286,976.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,250	108.30	135,375.00	
	NOVARTIS AG-REG	55,333	85.75	4,744,804.75	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16,868	278.00	4,689,304.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	37,468	24.59	921,338.12	
	JULIUS BAER GROUP LTD	5,960	40.15	239,294.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	655	74.20	48,601.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	247.50	123,750.00	
	UBS AG-REG	87,412	15.58	1,361,878.96	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	117.30	163,047.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	214.20	182,070.00	
	SWISS RE AG	8,669	74.70	647,574.30	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,711	282.10	1,046,873.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,370	72.45	99,256.50	
	SWISSCOM AG-REG	584	537.50	313,900.00	
	スイスフラン小計	396,776		26,376,596.68	(2,993,743,723)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,180	100.10	618,618.00	
	BOLIDEN AB	7,620	115.00	876,300.00	
	ALFA LAVAL AB	7,470	155.20	1,159,344.00	
	ASSA ABLOY AB-B	8,310	378.10	3,142,011.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	15,265	202.60	3,092,689.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	8,620	184.50	1,590,390.00	

	SANDVIK AB	25,500	80.85	2,061,675.00	
	SKANSKA AB-B SHS	10,520	144.10	1,515,932.00	
	SKF AB-B SHARES-B	10,209	146.00	1,490,514.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	35,630	83.45	2,973,323.50	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	78.05	565,784.45	
	ELECTROLUX AB - B	6,765	201.50	1,363,147.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	52.65	446,472.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	22,808	280.60	6,399,924.80	
	SWEDISH MATCH AB	4,860	227.50	1,105,650.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	13,015	167.10	2,174,806.50	
	ELEKTA AB-B SHS	10,440	72.00	751,680.00	
	GETINGE AB-B SHS	5,730	161.00	922,530.00	
	NORDEA BANK AB	71,288	91.50	6,522,852.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	39,350	90.60	3,565,110.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	12,750	343.70	4,382,175.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	20,930	189.10	3,957,863.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	123.90	325,857.00	
	INVESTOR AB-B SHS	11,795	245.30	2,893,313.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	5,505	216.80	1,193,484.00	
	ERICSSON LM-B SHS	73,075	82.75	6,046,956.25	
	HEXAGON AB-B SHS	6,960	237.60	1,653,696.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	582.00	797,340.00	
	TELE2 AB-B SHS	8,705	90.50	787,802.50	
	TELIASONERA AB	59,180	48.03	2,842,415.40	
	スウェーデンクローナ小計	528,209		67,219,656.40	(1,000,900,683)
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS HOLDING ASA	4,430	47.33	209,671.90	
	SEADRILL LTD	9,735	154.80	1,506,978.00	
	STATOIL ASA	27,274	155.00	4,227,470.00	
	SUBSEA 7 SA	7,505	76.30	572,631.50	
	NORSK HYDRO A S	20,410	36.42	743,332.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	302.10	1,377,576.00	
	ORKLA ASA	19,380	52.20	1,011,636.00	
	DNB ASA	24,335	121.20	2,949,402.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	123.10	517,020.00	

	TELENOR ASA	17,535	142.70	2,502,244.50	
ノルウェークローネ小計		139,364		15,617,962.10 (255,822,219)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	261.80	1,477,861.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS AS	5,260	190.50	1,002,030.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	65	12,840.00	834,600.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	165	13,230.00	2,182,950.00	
	DSV A/S	5,060	162.80	823,768.00	
	PANDORA A/S	2,660	472.40	1,256,584.00	
	CARLSBERG AS-B	2,390	512.50	1,224,875.00	
	COLOPLAST-B	2,545	481.00	1,224,145.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	438.60	263,160.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	48,155	267.10	12,862,200.50	
	DANSKE BANK A/S	16,385	157.10	2,574,083.50	
	TRYG A/S	615	629.00	386,835.00	
	TDC A/S	14,545	44.55	647,979.75	
デンマーククローネ小計		104,090		26,761,071.75 (492,136,109)	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	2,735	30.39	83,116.65	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,670	14.32	381,914.40	
	SANTOS LTD	23,715	12.78	303,077.70	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	16,528	40.05	661,946.40	
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	13.67	59,327.80	
	ALUMINA LTD	68,742	1.68	115,830.27	
	AMCOR LIMITED	29,730	11.28	335,354.40	
	BHP BILLITON LTD	77,466	33.74	2,613,702.84	
	BORAL LTD	17,115	4.95	84,719.25	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	3.47	160,574.25	
	ILUKA RESOURCES LTD	12,115	7.54	91,347.10	
	INCITEC PIVOT LTD	31,550	2.84	89,602.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	10,985	12.07	132,588.95	
	NEWCREST MINING LTD	20,969	10.03	210,319.07	
	ORICA LIMITED	10,785	19.37	208,905.45	
	RIO TINTO LTD	10,718	60.05	643,615.90	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	1,867	21.07	39,337.69		

ALS LTD	8,301	5.57	46,236.57
BRAMBLES LTD	37,828	9.43	356,718.04
SEEK LTD	8,040	16.22	130,408.80
ASCIANO LTD	24,833	6.03	149,742.99
AURIZON HOLDINGS LTD	46,150	4.57	210,905.50
QANTAS AIRWAYS LTD	19,655	1.42	28,008.37
SYDNEY AIRPORT	13,366	4.30	57,473.80
TOLL HOLDINGS LTD	16,805	5.54	93,099.70
TRANSURBAN GROUP	43,195	8.05	347,719.75
CROWN RESORTS LTD	10,705	14.07	150,619.35
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	1,640	42.04	68,945.60
TABCORP HOLDINGS LTD	14,157	3.94	55,778.58
TATTS GROUP LTD	42,460	3.26	138,419.60
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	3.59	56,865.60
METCASH LTD	18,890	2.78	52,514.20
WESFARMERS LTD	27,013	42.50	1,148,052.50
WOOLWORTHS LTD	31,312	34.83	1,090,596.96
COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	8.71	131,956.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	14,070	4.55	64,018.50
COCHLEAR LTD	1,277	72.23	92,237.71
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	51.60	151,446.00
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	18.35	180,380.50
CSL LTD	11,932	75.66	902,775.12
AUST AND NZ BANKING GROUP	66,239	33.02	2,187,211.78
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	8,120	12.49	101,418.80
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	12.06	126,364.68
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	39,067	78.77	3,077,307.59
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56,843	34.27	1,948,009.61
WESTPAC BANKING CORP	75,001	34.21	2,565,784.21
ASX LTD	4,995	35.35	176,573.25
MACQUARIE GROUP LTD	7,574	59.75	452,546.50
AMP LTD	70,127	5.56	389,906.12
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	50,298	6.12	307,823.76
QBE INSURANCE GROUP LTD	31,820	11.14	354,474.80
SUNCORP GROUP LTD	33,060	14.31	473,088.60

	COMPUTERSHARE LTD	11,490	11.95	137,305.50	
	TELSTRA CORPORATION LTD	110,214	5.50	606,177.00	
	AGL ENERGY LTD	15,301	13.51	206,716.51	
	AUSNET SERVICES	49,750	1.34	66,665.00	
豪ドル小計		1,488,066		25,097,574.07 (2,389,038,075)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	19,060	8.53	162,581.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	27,855	3.82	106,545.37	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	45,157	3.11	140,438.27	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	6.20	58,466.00	
ニュージーランドドル小計		101,502		468,031.44 (39,726,508)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	52,823	97.35	5,142,319.05	
	NWS HOLDINGS LTD	28,500	14.16	403,560.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	25,000	14.04	351,000.00	
	MTR CORP	39,500	30.90	1,220,550.00	
	LI & FUNG LTD	138,000	9.36	1,291,680.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	29,000	22.75	659,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	14,500	25.00	362,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	50,000	48.60	2,430,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,000	23.00	644,000.00	
	SANDS CHINA LTD	60,600	45.15	2,736,090.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	28,000	11.06	309,680.00	
	SJM HOLDINGS LTD	57,000	15.72	896,040.00	
	WYNN MACAU LTD	44,600	27.15	1,210,890.00	
	BANK OF EAST ASIA	36,440	31.45	1,146,038.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	93,000	25.15	2,338,950.00	
	HANG SENG BANK LTD	19,700	129.20	2,545,240.00	
	FIRST PACIFIC CO	44,250	8.27	365,947.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	26,800	174.40	4,673,920.00	
	AIA GROUP LTD	290,200	41.95	12,173,890.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	32,682	133.40	4,359,778.80	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	23.05	1,313,850.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	22,184	52.30	1,160,223.20		
HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	36.20	543,000.00		

	KERRY PROPERTIES LTD	16,950	26.20	444,090.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	134,666	9.50	1,279,327.00	
	SINO LAND CO	63,050	12.96	817,128.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	40,480	114.30	4,626,864.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,017	102.10	1,839,535.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,200	25.35	588,120.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	35,800	55.75	1,995,850.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	19,600	36.90	723,240.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	9.10	609,700.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	56.55	848,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	48,000	65.35	3,136,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	146,881	17.96	2,637,982.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS	34,000	72.60	2,468,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	75.25	489,125.00	
香港ドル小計		1,901,923		70,783,309.01	(985,303,661)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	34,660	9.67	335,162.20	
	NOBLE GROUP LTD	82,854	1.26	104,810.31	
	SEBPCORP INDUSTRIES LTD	21,000	4.86	102,060.00	
	SEBPCORP MARINE LTD	16,000	3.66	58,560.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	3.61	119,130.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	42,010	1.14	47,891.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	2.47	113,620.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	15,800	9.62	151,996.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	172,000	1.05	180,600.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	45,050	4.19	188,759.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	39.79	79,580.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	12,000	2.06	24,720.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	130,000	0.48	63,050.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.13	165,890.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	39,215	18.28	716,850.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	62,240	9.81	610,574.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	31,700	22.04	698,668.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	6.98	139,600.00	
	CAPITALAND LTD	71,000	3.05	216,550.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,000	9.63	96,300.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.72	163,200.00	
	KEPPEL LAND LTD	18,000	3.28	59,040.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	6.44	78,890.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	188,280	3.70	696,636.00	
シンガポールドル小計		1,218,059		5,212,138.01 (441,572,332)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	26.62	260,077.40	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,940.00	151,320.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	21,270	201.80	4,292,286.00	
	BANK HAPOALIM BM	27,725	19.72	546,737.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	14.06	412,731.30	
	NICE SYSTEMS LTD	1,385	152.20	210,797.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	48,790	6.67	325,429.30	
イスラエルシュケル小計		138,373		6,199,378.00 (176,992,241)	
合 計		31,509,549		74,933,360,854 (74,933,360,854)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	8,720	200,734.40	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	18,644	230,253.40	
		AMERICAN TOWER CORP	9,879	950,063.43	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	227,427.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,005	454,446.15	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,747	456,571.95	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	162,756.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,060	683,085.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	247,630.50	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	126,431.25	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,110	549,371.40	

		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	271,754.00
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,825	233,581.75
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,315	278,914.75
		HCP INC	11,005	471,784.35
		HEALTH CARE REIT INC	6,990	481,331.40
		HOST HOTELS & RESORTS INC	17,919	406,582.11
		IRON MOUNTAIN INC	3,064	109,078.40
		KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	211,695.65
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	106,526.86
		MACERICH CO/THE	3,250	221,975.00
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	187,605.00
		PROLOGIS INC	11,862	483,139.26
		PUBLIC STORAGE	3,669	645,633.93
		RAYONIER INC	3,507	114,889.32
		REALTY INCOME CORP	5,400	242,838.00
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	138,332.70
		SIMON PROPERTY GROUP INC	7,554	1,305,784.44
		SL GREEN REALTY CORP	2,260	253,504.20
		UDR INC	5,820	170,700.60
		VENTAS INC	7,205	482,518.85
		VORNADO REALTY TRUST	3,941	423,342.22
		WEYERHAEUSER CO	11,876	402,477.64
米ドル小計			231,668	11,932,761.11 (1,288,022,234)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	88,720.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	89,502.40
加ドル小計			7,380	178,222.40 (17,132,519)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	74,485.44
		FONCIERE DES REGIONS	595	42,834.05
		GECINA SA	580	60,958.00
		ICADE	685	43,853.70
		KLEPIERRE	2,445	81,528.52
		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,440	475,922.00
			8,743	779,581.71

ユーロ小計				(106,755,919)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	154,945.14
		HAMMERSON PLC	15,295	90,699.35
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	65,736.60
		LAND SECURITIES GROUP PLC	18,919	205,081.96
		SEGRO PLC	20,223	74,279.07
英ポンド小計			95,998	590,742.12 (102,688,702)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	152,102.40
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	44,830	91,901.50
		DEXUS PROPERTY GROUP	110,925	132,000.75
		FEDERATION CENTRES	35,990	96,813.10
		GOODMAN GROUP	43,442	237,627.74
		GPT GROUP	47,615	191,412.30
		LEND LEASE GROUP	12,197	187,223.95
		MIRVAC GROUP	108,455	187,627.15
		SCENTRE GROUP	116,381	391,040.16
		STOCKLAND	55,310	224,558.60
		WESTFIELD CORP	48,945	371,492.55
豪ドル小計			643,895	2,263,800.20 (215,491,141)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	59,500	2,808,400.00
香港ドル小計			59,500	2,808,400.00 (39,092,928)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	89,310.00
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	40,000	65,600.00
		CAPITAMALL TRUST	71,800	140,010.00
シンガポールドル小計			150,800	294,920.00 (24,985,622)
合計				1,794,169,065 (1,794,169,065)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 584銘柄	97.3%		60.5%
	投資証券 33銘柄		2.7%	1.7%
加ドル	株式 91銘柄	99.5%		4.5%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	98.9%		12.5%
	投資証券 6銘柄		1.1%	0.1%
英ポンド	株式 104銘柄	98.5%		8.8%
	投資証券 5銘柄		1.5%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		3.9%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%		1.3%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.3%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	100.0%		0.6%
豪ドル	株式 56銘柄	91.7%		3.1%
	投資証券 11銘柄		8.3%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 4銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 37銘柄	96.2%		1.3%
	投資証券 1銘柄		3.8%	0.1%
シンガポールドル	株式 24銘柄	94.6%		0.6%
	投資証券 3銘柄		5.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%		0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,092,296	4,503,191
コール・ローン	46,198,669	126,763,079
株式	1,479,373,496	1,701,802,775
投資証券	32,576,567	39,974,456
派生商品評価勘定	17,006,577	5,365,583
未収入金	12,445	8,687
未収配当金	1,338,300	1,692,134
未収利息	77	175
差入委託証拠金	20,342,641	40,678,834
流動資産合計	1,599,941,068	1,920,788,914
資産合計	1,599,941,068	1,920,788,914
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,857,989	32,551,015
未払解約金	7,859,187	2,358,164
流動負債合計	21,717,176	34,909,179
負債合計	21,717,176	34,909,179
純資産の部		
元本等		
元本	1,469,650,974	1,603,941,396
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	108,572,918	281,938,339
元本等合計	1,578,223,892	1,885,879,735
純資産合計	1,578,223,892	1,885,879,735
負債純資産合計	1,599,941,068	1,920,788,914

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券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。</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 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>
--------------------	--

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>
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 「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>

(貸借対照表に関する注記)

		平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
1.	期首	平成24年10月27日	平成25年10月29日
	期首元本額	1,423,095,784円	1,469,650,974円
	期首からの追加設定元本額	334,092,349円	388,409,868円
	期首からの一部解約元本額	287,537,159円	254,119,446円
	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)	160,724,977円	417,033,345円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	18,538,040円	12,816,904円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	13,685,300円	10,471,331円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	21,949,046円	15,567,280円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	27,353,237円	19,496,244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)	168,133,801円	98,307,055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)	105,013,841円	78,259,728円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	48,064,250円	47,439,659円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	137,038,067円	135,447,065円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	187,531,493円	187,856,619円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	193,522,968円	186,700,421円
	インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	388,095,954円	394,545,745円
	計	1,469,650,974円	1,603,941,396円
2.	受益権の総数	1,469,650,974口	1,603,941,396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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
--	--------------------------------	--------------------------------

金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年10月28日現在)

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	256,748,934
投資証券	2,490,172
合計	259,239,106

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	98,083,993
投資証券	4,267,214
合計	102,351,207

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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）

（平成25年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	59,426,027	-	61,958,237	2,532,210
合計		59,426,027	-	61,958,237	2,532,210

（平成26年10月27日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	160,758,275	-	160,206,129	552,146
	合計	160,758,275	-	160,206,129	552,146

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末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おります。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成25年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	1,526,784,858	-	1,526,168,480	616,378
	米ドル	911,852,281	-	899,117,780	12,734,501
	加ドル	69,045,274	-	68,221,210	824,064
	ユーロ	208,698,184	-	214,411,910	5,713,726
	英ポンド	149,076,781	-	152,085,810	3,009,029
	スイスフラン	62,680,082	-	64,068,950	1,388,868
	スウェーデンクローナ	20,320,996	-	20,810,040	489,044
	ノルウェークローネ	7,210,407	-	7,317,820	107,413
	デンマーククローネ	7,472,594	-	7,679,750	207,156
	豪ドル	55,433,102	-	57,420,970	1,987,868
	香港ドル	21,463,543	-	21,323,100	140,443
	シンガポールドル	11,186,644	-	11,365,200	178,556
	イスラエルシェケル	2,344,970	-	2,345,940	970
合計		1,526,784,858	-	1,526,168,480	616,378

(平成26年10月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	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	1,746,548,694	-	1,773,181,980	26,633,286
	米ドル	1,091,054,418	-	1,115,504,570	24,450,152
	加ドル	75,014,079	-	75,919,470	905,391
	ユーロ	226,963,298	-	227,026,290	62,992
	英ポンド	153,058,408	-	154,053,680	995,272
	スイスフラン	73,559,801	-	73,776,550	216,749
	スウェーデンクローナ	11,163,341	-	11,041,540	121,801
	ノルウェークローネ	8,447,801	-	8,276,900	170,901
	デンマーククローネ	10,142,400	-	10,132,890	9,510
	豪ドル	57,887,586	-	57,919,580	31,994
	香港ドル	25,005,193	-	25,350,070	344,877
	シンガポールドル	10,489,515	-	10,497,930	8,415
	イスラエルシェケル	3,762,854	-	3,682,510	80,344
合計		1,746,548,694	-	1,773,181,980	26,633,286

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額	1.0739円	1口当たり純資産額	1.1758円
(1万口当たり純資産額)	(10,739円)	(1万口当たり純資産額)	(11,758円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	280	90.98	25,474.40	
	APACHE CORP	219	75.81	16,602.39	
	BAKER HUGHES INC	290	53.49	15,512.10	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	229	59.84	13,703.36	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	438	21.60	9,460.80	
	CHEVRON CORP	1,034	115.91	119,850.94	
	CONOCOPHILLIPS	662	70.07	46,386.34	
	CONSOL ENERGY INC	243	34.68	8,427.24	
	DEVON ENERGY CORPORATION	254	59.91	15,217.14	
	ENSCO PLC-CL A	227	38.88	8,825.76	
	EOG RESOURCES INC	306	92.10	28,182.60	
	EQT CORP	143	88.90	12,712.70	
	EXXON MOBIL CORP	2,334	94.49	220,539.66	
	FMC TECHNOLOGIES INC	229	54.51	12,482.79	
	HALLIBURTON CO	534	55.78	29,786.52	
	HESS CORP	203	82.35	16,717.05	
	KINDER MORGAN INC	416	39.03	16,236.48	
	MARATHON OIL CORP	467	34.50	16,111.50	
	MARATHON PETROLEUM CORP	212	85.79	18,187.48	
	MURPHY OIL CORP	174	52.15	9,074.10	
	NABORS INDUSTRIES LTD	405	18.73	7,585.65	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	239	73.52	17,571.28	
	NOBLE CORP PLC	245	20.58	5,042.10	
NOBLE ENERGY INC	236	57.43	13,553.48		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	410	89.52	36,703.20		
PHILLIPS 66	282	76.49	21,570.18		

PIONEER NATURAL RESOURCES CO	86	181.11	15,575.46
QEP RESOURCES INC	262	24.32	6,371.84
RANGE RESOURCES CORP	181	66.62	12,058.22
SCHLUMBERGER LTD	710	97.24	69,040.40
SOUTHWESTERN ENERGY CO	328	31.64	10,377.92
SPECTRA ENERGY CORP	432	38.90	16,804.80
VALERO ENERGY CORP	313	48.62	15,218.06
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	710	17.16	12,183.60
WILLIAMS COS INC	444	53.24	23,638.56
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	119	131.50	15,648.50
ALCOA INC	1,100	16.55	18,205.00
DOW CHEMICAL CO/THE	627	48.21	30,227.67
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	522	69.00	36,018.00
ECOLAB INC	196	112.72	22,093.12
FMC CORP	145	58.12	8,427.40
FREEPORT-MCMORAN INC	532	30.80	16,385.60
INTERNATIONAL PAPER CO	327	49.92	16,323.84
LYONDELLBASELL INDU-CL A	238	92.39	21,988.82
MONSANTO CO	297	113.28	33,644.16
MOSAIC CO/THE	216	43.36	9,365.76
NEWMONT MINING CORP	272	21.95	5,970.40
NUCOR CORP	268	52.79	14,147.72
PPG INDUSTRIES INC	92	195.85	18,018.20
PRAXAIR INC	167	127.72	21,329.24
SIGMA-ALDRICH	95	135.07	12,831.65
VULCAN MATERIALS CO	174	61.25	10,657.50
3M CO	330	148.59	49,034.70
BOEING CO/THE	364	122.24	44,495.36
CATERPILLAR INC	300	99.44	29,832.00
CUMMINS INC	121	137.25	16,607.25
DANAHER CORP	331	77.96	25,804.76
DEERE & CO	208	85.43	17,769.44
DOVER CORP	132	79.09	10,439.88
EATON CORP PLC	356	63.06	22,449.36
EMERSON ELECTRIC CO	408	62.39	25,455.12

FASTENAL CO	242	42.67	10,326.14
FLUOR CORP	183	64.95	11,885.85
GENERAL DYNAMICS CORP	199	132.50	26,367.50
GENERAL ELECTRIC CO.	5,450	25.64	139,738.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	404	94.70	38,258.80
ILLINOIS TOOL WORKS	236	87.98	20,763.28
INGERSOLL-RAND PLC	283	60.26	17,053.58
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	130	47.36	6,156.80
JOY GLOBAL INC	127	53.25	6,762.75
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	115	114.56	13,174.40
LOCKHEED MARTIN CORP	152	181.33	27,562.16
NORTHROP GRUMMAN CORP	144	130.79	18,833.76
PACCAR INC	322	61.40	19,770.80
PARKER HANNIFIN CORP	103	116.57	12,006.71
PENTAIR PLC	195	66.93	13,051.35
PRECISION CASTPARTS CORP	80	223.47	17,877.60
RAYTHEON COMPANY	203	98.12	19,918.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	151	109.31	16,505.81
ROCKWELL COLLINS INC.	158	79.12	12,500.96
ROPER INDUSTRIES INC	85	151.18	12,850.30
STANLEY BLACK & DECKER INC	139	90.12	12,526.68
TEXTRON INC	317	38.76	12,286.92
UNITED TECHNOLOGIES CORP	473	103.82	49,106.86
XYLEM INC	218	35.34	7,704.12
ADT CORP/THE	183	34.50	6,313.50
TYCO INTERNATIONAL LTD	447	41.59	18,590.73
WASTE MANAGEMENT INC	352	47.96	16,881.92
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	71.15	11,028.25
CSX CORP	575	35.30	20,297.50
EXPEDITORS INTL WASH INC	230	40.92	9,411.60
FEDEX CORP	167	163.88	27,367.96
NORFOLK SOUTHERN CORP	175	109.39	19,143.25
UNION PACIFIC CORP	472	114.58	54,081.76
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	364	100.59	36,614.76
AUTOLIV INC	134	90.33	12,104.22

BORGWARNER INC	278	56.30	15,651.40
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	323	66.78	21,569.94
FORD MOTOR COMPANY	1,996	13.78	27,504.88
GENERAL MOTORS CORP	769	30.04	23,100.76
HARLEY-DAVIDSON INC	196	63.35	12,416.60
JOHNSON CONTROLS INC	466	43.57	20,303.62
TESLA MOTORS INC	53	235.24	12,467.72
COACH INC	190	35.97	6,834.30
MATTEL INC	345	30.31	10,456.95
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	171	75.74	12,951.54
NEWELL RUBBERMAID INC	430	34.89	15,002.70
NIKE INC -CL B	376	90.90	34,178.40
VF CORP	281	66.50	18,686.50
WHIRLPOOL CORP	73	158.62	11,579.26
CARNIVAL CORP	296	38.52	11,401.92
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	21	615.78	12,931.38
LAS VEGAS SANDS CORP	266	62.75	16,691.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	253	69.29	17,530.37
MCDONALD'S CORP	537	91.67	49,226.79
STARBUCKS CORP	413	75.81	31,309.53
STARWOOD HOTELS & RESORTS	156	80.02	12,483.12
WYNN RESORTS LTD	92	184.72	16,994.24
YUM! BRANDS INC	248	69.88	17,330.24
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	389	53.52	20,819.28
COMCAST CORP-CLASS A	1,117	54.26	60,608.42
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	328	54.16	17,764.48
DIRECTV	235	84.15	19,775.25
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	414	36.19	14,982.66
DISH NETWORK CORP-A	252	62.20	15,674.40
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	532	43.51	23,147.32
NEWS CORP - CLASS A	521	15.73	8,195.33
OMNICOM GROUP	252	70.19	17,687.88
THE WALT DISNEY CO.	923	88.61	81,787.03
TIME WARNER CABLE	180	142.98	25,736.40
TIME WARNER INC	459	78.77	36,155.43

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,081	33.35	36,051.35
VIACOM INC-CLASS B	283	71.61	20,265.63
AMAZON.COM INC	210	287.06	60,282.60
AUTOZONE INC	29	536.05	15,545.45
BED BATH & BEYOND INC	154	65.24	10,046.96
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	198	62.25	12,325.50
GAP INC/THE	227	36.89	8,374.03
GENUINE PARTS CO	189	93.19	17,612.91
HOME DEPOT INC	728	94.99	69,152.72
KOHL'S CORP	178	59.09	10,518.02
L BRANDS INC	196	70.01	13,721.96
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	566	25.31	14,325.46
LIBERTY VENTURES-SER-A	80	33.09	2,647.20
LOWE'S COS INC	535	55.33	29,601.55
MACY'S INC	324	58.98	19,109.52
NETFLIX INC	34	385.02	13,090.68
NORDSTROM INC	194	71.20	13,812.80
PRICELINE GROUP INC/THE	30	1,138.43	34,152.90
ROSS STORES INC	190	80.50	15,295.00
STAPLES INC	489	12.50	6,114.94
TARGET CORP	349	61.57	21,487.93
TIFFANY & CO	125	94.44	11,805.00
TJX COMPANIES INC	398	62.08	24,707.84
COSTCO WHOLESALE CORP	242	130.44	31,566.48
CVS HEALTH CORP	612	84.29	51,585.48
KROGER CO	348	54.19	18,858.12
SAFEWAY INC	328	34.12	11,191.36
SYSCO CORP	388	38.04	14,759.52
WAL-MART STORES INC	846	76.38	64,617.48
WALGREEN CO	495	62.65	31,011.75
WHOLE FOODS MARKET INC	230	37.71	8,673.30
ALTRIA GROUP INC	1,132	47.49	53,758.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	372	45.58	16,955.76
BUNGE LTD	139	84.67	11,769.13
COCA-COLA CO/THE	2,150	41.03	88,214.50

COCA-COLA ENTERPRISES	292	42.38	12,374.96
CONAGRA FOODS INC	463	34.20	15,834.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	154	88.28	13,595.12
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	242	66.80	16,165.60
GENERAL MILLS INC	417	51.03	21,279.51
KELLOGG CO	224	61.94	13,874.56
KRAFT FOODS GROUP INC	359	56.83	20,401.97
LORILLARD INC	258	60.67	15,652.86
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	135	103.39	13,957.65
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	946	34.37	32,514.02
MONSTER BEVERAGE CORP	126	97.89	12,334.14
PEPSICO INC	824	94.60	77,950.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	823	88.06	72,473.38
REYNOLDS AMERICAN INC	258	61.55	15,879.90
TYSON FOODS INC-CL A	262	38.74	10,149.88
AVON PRODUCTS	330	11.48	3,788.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	554	65.35	36,203.90
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	157	74.35	11,672.95
KIMBERLY-CLARK CORP	185	113.10	20,923.50
PROCTER & GAMBLE CO	1,470	85.16	125,185.20
ABBOTT LABORATORIES	762	42.46	32,354.52
AETNA INC	237	78.69	18,649.53
AMERISOURCEBERGEN CORP	257	78.28	20,117.96
BAXTER INTERNATIONAL INC	302	69.83	21,088.66
BECTON DICKINSON AND CO	134	125.73	16,847.82
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,188	12.99	15,432.12
CARDINAL HEALTH INC	229	77.10	17,655.90
CAREFUSION CORP	265	56.96	15,094.40
CIGNA CORP	186	92.83	17,266.38
COVIDIEN PLC	267	89.64	23,933.88
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	226	76.73	17,340.98
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	391	73.65	28,797.15
HUMANA INC	122	133.11	16,239.42
INTUITIVE SURGICAL INC	22	478.01	10,516.22
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	108	103.73	11,202.84

MCKESSON CORP	114	200.83	22,894.62
MEDTRONIC INC	520	66.56	34,611.20
QUEST DIAGNOSTICS	187	63.76	11,923.12
ST JUDE MEDICAL INC	263	60.47	15,903.61
STRYKER CORP	242	84.22	20,381.24
UNITEDHEALTH GROUP INC	517	91.64	47,377.88
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	141	80.74	11,384.34
WELLPOINT INC	171	120.21	20,555.91
ZIMMER HOLDINGS INC	157	105.29	16,530.53
ABBVIE INC	845	60.29	50,945.05
ACTAVIS PLC	142	240.33	34,126.86
AGILENT TECHNOLOGIES INC	248	54.05	13,404.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	123	190.29	23,405.67
ALLERGAN INC	178	184.21	32,789.38
AMGEN INC	398	147.26	58,609.48
BIOGEN IDEC INC	123	321.67	39,565.41
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	900	53.63	48,267.00
CELGENE CORP	437	103.24	45,115.88
ELI LILLY & CO	525	66.05	34,676.25
GILEAD SCIENCES INC	860	110.71	95,210.60
HOSPIRA INC	209	52.25	10,920.25
ILLUMINA INC	91	189.12	17,209.92
JOHNSON & JOHNSON	1,542	103.13	159,026.46
MERCK & CO. INC.	1,588	57.61	91,484.68
MYLAN INC	352	51.22	18,029.44
PERRIGO CO PLC	102	155.15	15,825.30
PFIZER INC	3,463	29.11	100,807.93
REGENERON PHARMACEUTICALS	54	402.50	21,735.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	257	117.90	30,300.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	145	109.91	15,936.95
WATERS CORP	120	108.21	12,985.20
ZOETIS INC	451	36.58	16,497.58
BANK OF AMERICA CORP	5,837	16.72	97,594.64
BB&T CORP	462	36.66	16,936.92
CITIGROUP INC	1,702	51.80	88,163.60

COMERICA INC	247	45.51	11,240.97
FIFTH THIRD BANCORP	883	19.12	16,882.96
JPMORGAN CHASE & CO	2,057	58.74	120,828.18
KEYCORP	1,033	12.79	13,212.07
M & T BANK CORP	105	116.37	12,218.85
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	888	15.55	13,808.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	297	82.52	24,508.44
SUNTRUST BANKS INC	356	37.41	13,317.96
US BANCORP	935	40.91	38,250.85
WELLS FARGO & CO	2,719	51.20	139,212.80
AMERICAN EXPRESS CO	494	86.40	42,681.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	175	117.65	20,588.75
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	663	37.12	24,610.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	610	139.40	85,034.00
BLACKROCK INC	92	324.87	29,888.04
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	326	79.27	25,842.02
CME GROUP INC	220	82.31	18,108.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	310	62.34	19,325.40
FRANKLIN RESOURCES INC	252	53.41	13,459.32
GOLDMAN SACHS GROUP INC	248	183.35	45,470.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	85	206.59	17,560.15
INVESCO LTD	383	38.06	14,576.98
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	208	84.05	17,482.40
MOODY'S CORP	165	96.94	15,995.10
MORGAN STANLEY	831	34.32	28,519.92
NORTHERN TRUST CORP	188	63.64	11,964.32
SCHWAB (CHARLES) CORP	811	26.69	21,645.59
STATE STREET CORP	297	71.88	21,348.36
T ROWE PRICE GROUP INC	176	77.84	13,699.84
ACE LTD	181	106.90	19,348.90
AFLAC INC	247	58.54	14,459.38
ALLSTATE CORP	272	62.57	17,019.04
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	747	52.16	38,963.52
AON PLC	204	82.38	16,805.52
CHUBB CORP	146	96.43	14,078.78

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	341	37.55	12,804.55
MARSH & MCLENNAN COS	361	51.63	18,638.43
METLIFE INC	519	50.79	26,360.01
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	359	50.35	18,075.65
PROGRESSIVE CORP	476	25.87	12,314.12
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	315	84.58	26,642.70
TRAVELERS COS INC/THE	216	97.73	21,109.68
UNUM GROUP	310	33.92	10,515.20
WR BERKLEY CORP	252	50.94	12,836.88
ACCENTURE PLC-CL A	356	78.35	27,892.60
ADOBE SYSTEMS INC	311	67.01	20,840.11
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	196	55.28	10,834.88
AUTODESK INC	212	54.45	11,543.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	274	76.20	20,878.80
CA INC	302	28.43	8,585.86
CITRIX SYSTEMS INC	145	63.59	9,220.55
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	386	45.10	17,408.60
COMPUTER SCIENCES CORP	169	59.55	10,063.95
EBAY INC	626	51.12	32,001.12
FACEBOOK INC-A	1,114	80.67	89,866.38
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	306	55.77	17,065.62
FISERV INC	314	66.04	20,736.56
GOOGLE INC-CL A	153	548.90	83,981.70
GOOGLE INC-CL C	155	539.78	83,665.90
INTL BUSINESS MACHINES CORP	522	162.08	84,605.76
INTUIT INC	205	84.96	17,416.80
LINKEDIN CORP - A	79	202.10	15,965.90
MASTERCARD INC-CLASS A	549	74.00	40,626.00
MICROSOFT CORP	4,274	46.13	197,159.62
ORACLE CORP	1,947	38.73	75,407.31
PAYCHEX INC	323	45.49	14,693.27
SALESFORCE.COM INC	344	59.57	20,492.08
SYMANTEC CORP	676	23.98	16,210.48
VISA INC-CLASS A SHARES	258	213.48	55,077.84
WESTERN UNION CO	725	16.47	11,940.75

XEROX CORP	1,249	12.55	15,674.95
YAHOO! INC	633	43.50	27,535.50
AMPHENOL CORP-CL A	266	48.83	12,988.78
APPLE INC	3,301	105.22	347,331.22
CISCO SYSTEMS INC	2,797	23.78	66,512.66
CORNING INC	799	18.80	15,021.20
EMC CORP/MASS	1,178	28.17	33,184.26
F5 NETWORKS INC	66	114.90	7,583.40
HARRIS CORP	186	67.33	12,523.38
HEWLETT-PACKARD CO	1,020	34.93	35,628.60
JUNIPER NETWORKS INC	445	19.00	8,455.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	185	62.57	11,575.45
NETAPP INC	302	40.72	12,297.44
QUALCOMM INC	886	76.00	67,336.00
SANDISK CORP	200	88.76	17,752.00
SEAGATE TECHNOLOGY	338	58.36	19,725.68
TE CONNECTIVITY LTD	283	56.27	15,924.41
AT&T INC	2,821	33.87	95,547.27
CENTURYLINK INC	408	39.93	16,291.44
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	129	111.57	14,392.53
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,251	48.77	109,781.27
AES CORP	673	13.73	9,240.29
AMERICAN ELECTRIC POWER	298	56.47	16,828.06
CENTERPOINT ENERGY INC	442	24.00	10,608.00
CONSOLIDATED EDISON INC	194	62.50	12,125.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	321	70.72	22,701.12
DUKE ENERGY CORP	395	80.30	31,718.50
EDISON INTERNATIONAL	295	60.65	17,891.75
ENTERGY CORP	134	82.14	11,006.76
EXELON CORP	474	35.73	16,936.02
FIRSTENERGY CORP	277	36.27	10,046.79
NEXTERA ENERGY INC	259	98.36	25,475.24
NISOURCE INC	405	41.76	16,912.80
P G & E CORP	280	47.17	13,207.60
PINNACLE WEST CAPITAL	151	59.17	8,934.67

	PPL CORPORATION	384	34.53	13,259.52	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	336	39.57	13,295.52	
	SEMPRA ENERGY	174	107.86	18,767.64	
	SOUTHERN CO	491	47.41	23,278.31	
	WISCONSIN ENERGY CORP	282	48.62	13,710.84	
	XCEL ENERGY INC	545	32.90	17,930.50	
	ALTERA CORPORATION	339	33.15	11,239.54	
	ANALOG DEVICES INC	191	46.85	8,948.35	
	APPLIED MATERIALS INC	848	20.99	17,799.52	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	186	81.85	15,224.10	
	BROADCOM CORP-CL A	364	39.70	14,450.80	
	INTEL CORP	2,705	33.18	89,751.90	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	249	40.89	10,181.61	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	279	41.04	11,450.16	
	MICRON TECHNOLOGY INC	518	31.06	16,089.08	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	638	47.57	30,349.66	
	XILINX INC	216	43.20	9,331.20	
米ドル小計		169,025		9,867,801.74	(1,065,130,519)
加ドル	CAMECO CORP	350	18.84	6,594.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	614	38.94	23,909.16	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	466	17.80	8,294.80	
	CENOVUS ENERGY INC	666	27.50	18,315.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	456	38.18	17,410.08	
	ENBRIDGE INC	592	52.56	31,115.52	
	ENCANA CORP	487	20.63	10,046.81	
	ENERPLUS CORP	346	16.90	5,847.40	
	HUSKY ENERGY INC	279	27.56	7,689.24	
	IMPERIAL OIL LTD	196	51.48	10,090.08	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	679	5.34	3,625.86	
	SUNCOR ENERGY INC	943	38.87	36,654.41	
	TALISMAN ENERGY INC	920	7.32	6,734.40	
	TRANSCANADA CORP	398	54.31	21,615.38	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	152	32.81	4,987.12	
	AGRIUM INC	83	104.33	8,659.39	

	BARRICK GOLD CORP	561	15.18	8,515.98	
	ELDORADO GOLD CORP	598	7.82	4,676.36	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	496	18.99	9,419.04	
	GOLDCORP INC	452	25.01	11,304.52	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	482	38.14	18,383.48	
	SILVER WHEATON CORP	234	22.17	5,187.78	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	382	17.85	6,818.70	
	BOMBARDIER INC 'B'	1,631	3.83	6,246.73	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	138	48.85	6,741.30	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	534	77.27	41,262.18	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	125	230.28	28,785.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	181	108.38	19,616.78	
	TIM HORTONS INC	188	89.12	16,754.56	
	THOMSON REUTERS CORP	422	41.49	17,508.78	
	LOBLAW COMPANIES LTD	103	56.71	5,841.13	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	193	145.21	28,025.53	
	BANK OF MONTREAL	363	81.51	29,588.13	
	BANK OF NOVA SCOTIA	639	67.99	43,445.61	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	227	100.66	22,849.82	
	NATIONAL BANK OF CANADA	372	52.28	19,448.16	
	ROYAL BANK OF CANADA	783	79.28	62,076.24	
	TORONTO-DOMINION BANK	962	54.28	52,217.36	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,351	20.54	27,749.54	
	POWER CORP OF CANADA	445	29.18	12,985.10	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	562	39.16	22,007.92	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	395	52.76	20,840.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	353	43.22	15,256.66	
	TELUS CORP	200	39.56	7,912.00	
	TRANSALTA CORP	508	11.02	5,598.16	
加ドル小計		21,507		798,651.40	(76,774,359)
ユーロ	ENI SPA	1,420	16.40	23,288.00	
	REPSOL SA	807	17.43	14,066.01	
	SAIPEM SPA	337	14.94	5,034.78	
	TECHNIP SA	63	55.63	3,504.69	

TENARIS SA	298	15.33	4,568.34
TOTAL SA	1,168	44.85	52,390.64
AIR LIQUIDE SA	192	92.66	17,790.72
AKZO NOBEL NV	155	51.14	7,926.70
ARCELORMITTAL	647	10.16	6,573.52
BASF SE	501	68.78	34,458.78
CRH PLC	832	17.45	14,518.40
K+S AG	190	20.86	3,963.40
KONINKLIJKE DSM NV	112	47.14	5,280.24
LAFARGE SA	188	52.90	9,945.20
LANXESS AG	140	39.87	5,582.50
LINDE AG	107	149.85	16,033.95
SOLVAY ET CIE SA -A	57	108.15	6,164.55
THYSSENKRUPP AG	421	18.87	7,946.37
UMICORE	187	31.30	5,853.10
UPM-KYMMENE OYJ	507	10.92	5,536.44
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	250	29.17	7,293.75
AIRBUS GROUP NV	352	45.29	15,942.08
ALSTOM	186	27.08	5,036.88
CNH INDUSTRIAL NV	875	6.24	5,464.37
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	261	33.40	8,717.40
FERROVIAL SA	863	15.96	13,773.48
KONE OYJ-B	264	32.66	8,622.24
KONINKLIJKE PHILIPS NV	583	21.23	12,377.09
LEGRAND SA	288	40.17	11,568.96
MAN SE	83	90.65	7,523.95
SCHNEIDER ELECTRIC SE	295	57.89	17,077.55
SIEMENS AG-REG	431	86.09	37,104.79
VALLOUREC	105	30.59	3,212.47
VINCI SA	305	44.08	13,445.92
WARTSILA OYJ ABP	177	34.82	6,163.14
EDENRED	362	21.47	7,773.95
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	814	15.31	12,462.34
ATLANTIA SPA	492	18.01	8,860.92
DEUTSCHE POST AG-REG	698	23.92	16,696.16

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	187	82.29	15,388.23
CONTINENTAL AG	107	151.30	16,189.10
DAIMLER AG	509	60.18	30,631.62
MICHELIN (CGDE)-B	119	66.77	7,945.63
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	87	62.31	5,420.97
RENAULT SA	154	55.15	8,493.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	81	160.45	12,996.45
ADIDAS AG	187	57.72	10,793.64
KERING	70	145.70	10,199.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	142	128.25	18,211.50
ACCOR SA	243	31.72	7,709.17
SODEXO	105	74.03	7,773.15
LAGARDERE S.C.A.	396	19.21	7,609.14
SES	366	27.68	10,130.88
WOLTERS KLUWER	514	20.37	10,472.75
INDITEX	660	21.31	14,067.90
CARREFOUR SA	401	22.64	9,080.64
KONINKLIJKE AHOLD NV	504	12.50	6,302.52
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	439	85.35	37,468.65
DANONE	325	50.60	16,445.00
HEINEKEN NV	152	56.90	8,648.80
PERNOD-RICARD SA	131	87.84	11,507.04
UNILEVER NV-CVA	885	29.25	25,886.25
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	189	75.26	14,224.14
L'OREAL	152	119.70	18,194.40
ESSILOR INTERNATIONAL	132	84.10	11,101.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	160	56.68	9,068.80
FRESENIUS SE & CO KGAA	318	38.77	12,328.86
BAYER AG	445	105.75	47,058.75
SANOFI	621	84.60	52,536.60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,226	9.23	29,795.33
BANCO SANTANDER SA	6,362	7.04	44,794.84
BANCO SANTANDER SA-RTS	6,362	0.15	973.38
BNP PARIBAS	623	49.50	30,841.61
CREDIT AGRICOLE SA	708	11.72	8,297.76

ERSTE GROUP BANK AG	241	18.89	4,552.49
ING GROEP NV-CVA	2,150	11.28	24,262.75
INTESA SANPAOLO	9,448	2.35	22,259.48
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782	-	-
KBC GROEP NV	268	41.68	11,171.58
SOCIETE GENERALE	433	38.83	16,815.55
UNICREDIT SPA	3,245	5.88	19,096.82
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	862	25.09	21,631.89
DEUTSCHE BOERSE AG	216	52.90	11,426.40
MEDIOBANCA SPA	857	6.86	5,883.30
AGEAS	414	26.05	10,784.70
ALLIANZ SE-REG	237	123.05	29,162.85
ASSICURAZIONI GENERALI	773	16.00	12,368.00
AXA	992	17.91	17,771.68
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	97	150.25	14,574.25
SAMPO OYJ-A SHS	317	37.27	11,814.59
AMADEUS IT HOLDING SA	435	27.03	11,760.22
CAP GEMINI SA	173	51.21	8,859.33
SAP SE	490	51.64	25,303.60
NOKIA OYJ	1,802	6.63	11,947.26
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,815	11.17	20,282.62
ORANGE S.A.	1,247	11.58	14,440.26
TELECOM ITALIA SPA	11,938	0.83	10,010.01
TELEFONICA SA	2,334	11.44	26,712.63
VIVENDI	801	18.64	14,934.64
E.ON SE	1,311	13.17	17,265.87
ENEL SPA	3,724	3.85	14,344.84
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,376	3.28	11,080.03
FORTUM OYJ	342	17.84	6,101.28
GDF SUEZ	805	18.17	14,630.87
IBERDROLA SA	2,807	5.48	15,404.81
RWE AG	324	27.09	8,778.78
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	597	13.13	7,841.59
VEOLIA ENVIRONNEMENT	518	13.15	6,814.29
ASML HOLDING NV	207	74.68	15,458.76

	INFINEON TECHNOLOGIES AG	968	7.56	7,322.92
	STMICROELECTRONICS NV	664	5.50	3,655.32
ユーロ小計		102,085		1,564,656.83 (214,264,106)
英ポンド	BG GROUP PLC	1,985	10.43	20,703.55
	BP PLC	10,067	4.32	43,575.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,083	21.97	45,763.51
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,277	22.87	29,204.99
	TULLOW OIL PLC	596	4.94	2,947.81
	ANGLO AMERICAN PLC	780	13.08	10,202.40
	ANTOFAGASTA PLC	612	6.93	4,241.16
	BHP BILLITON PLC	1,039	16.27	16,904.53
	GLENCORE PLC	5,598	3.16	17,742.86
	RANDGOLD RESOURCES LTD	93	40.11	3,730.23
	RIO TINTO PLC	674	30.12	20,304.25
	BAE SYSTEMS PLC ORD	1,945	4.41	8,587.17
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,174	7.95	9,333.30
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF-C(N)	105,660	0.00	105.66
	SMITHS GROUP PLC	404	11.52	4,654.08
	WOLSELEY PLC	261	32.10	8,378.10
	CAPITA PLC	748	11.49	8,594.52
	EXPERIAN PLC	658	9.22	6,066.76
	CARNIVAL PLC	202	23.49	4,744.98
	COMPASS GROUP PLC	1,163	9.67	11,246.21
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	352	22.17	7,803.84
	WHITBREAD PLC	255	43.10	10,990.50
	BRITISH SKY BROADCASTING GRO	1,034	8.61	8,907.91
	PEARSON PLC	514	11.39	5,854.46
	REED ELSEVIER PLC	1,234	9.78	12,068.52
	WPP PLC	1,046	11.78	12,321.88
	KINGFISHER PLC	2,100	2.92	6,148.80
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,326	4.14	5,492.29
	NEXT PLC	166	65.00	10,790.00
	TESCO PLC	4,514	1.68	7,617.37
	WM MORRISON SUPERMARKETS	1,579	1.52	2,407.97

	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,018	33.62	34,230.25	
	DIAGEO PLC	1,365	17.71	24,180.97	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	556	25.83	14,361.48	
	SABMILLER PLC	541	33.57	18,164.07	
	UNILEVER PLC	720	24.06	17,323.20	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	356	49.81	17,732.36	
	SMITH & NEPHEW PLC	824	9.81	8,087.56	
	ASTRAZENECA PLC	709	43.27	30,681.97	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	2,530	14.15	35,812.15	
	SHIRE PLC	294	40.50	11,907.00	
	BARCLAYS PLC	9,647	2.26	21,835.98	
	HSBC HOLDINGS PLC	10,366	6.29	65,285.06	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	32,647	0.76	25,046.77	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,630	3.64	5,936.46	
	STANDARD CHARTERED PLC	1,335	11.15	14,885.25	
	AVIVA PLC	2,180	5.07	11,052.60	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,932	2.22	10,978.63	
	OLD MUTUAL PLC	3,107	1.84	5,738.62	
	PRUDENTIAL PLC	1,446	13.74	19,868.04	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	1,153	4.66	5,383.35	
	STANDARD LIFE PLC	2,126	3.87	8,227.62	
	BT GROUP PLC	5,031	3.70	18,614.70	
	VODAFONE GROUP PLC	14,254	2.00	28,579.27	
	CENTRICA PLC	2,783	2.92	8,145.84	
	NATIONAL GRID PLC	2,042	8.91	18,194.22	
	SEVERN TRENT PLC	309	19.88	6,142.92	
	SSE PLC	625	15.36	9,600.00	
	ARM HOLDINGS PLC	854	8.17	6,977.18	
英ボンド小計		256,519		870,408.13	(151,303,045)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	232	28.58	6,630.56	
	GIVAUDAN-REG	11	1,540.00	16,940.00	
	HOLCIM LTD-REG	222	65.45	14,529.90	
	SYNGENTA AG-REG	52	290.20	15,090.40	
	ABB LTD-REG	1,234	20.31	25,062.54	

	GEBERIT AG-REG	50	308.90	15,445.00	
	ADECCO SA-REG	242	62.05	15,016.10	
	SGS SA-REG	9	2,001.00	18,009.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	82	121.00	9,922.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	376	78.85	29,647.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	29	449.50	13,035.50	
	NESTLE SA-REG	1,752	67.95	119,048.40	
	ACTELION LTD-REG	155	112.10	17,375.50	
	NOVARTIS AG-REG	1,250	85.75	107,187.50	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	388	278.00	107,864.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	901	24.59	22,155.59	
	JULIUS BAER GROUP LTD	338	40.15	13,570.70	
	UBS AG-REG	2,031	15.58	31,642.98	
	SWISS RE AG	221	74.70	16,508.70	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	82	282.10	23,132.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	209	72.45	15,142.05	
スイスフラン小計		9,866		652,956.22	(74,110,530)
スウェーデンクローナ	ASSA ABLOY AB-B	345	378.10	130,444.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	679	202.60	137,565.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	552	280.60	154,891.20	
	NORDEA BANK AB	1,939	91.50	177,418.50	
	ERICSSON LM-B SHS	1,708	82.75	141,337.00	
スウェーデンクローナ小計		5,223		741,656.60	(11,043,266)
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	600	155.00	93,000.00	
	NORSK HYDRO A S	1,642	36.42	59,801.64	
	YARA INTERNATIONAL ASA	199	302.10	60,117.90	
	ORKLA ASA	1,079	52.20	56,323.80	
	DNB ASA	960	121.20	116,352.00	
	TELENOR ASA	666	142.70	95,038.20	
ノルウェークローネ小計		5,146		480,633.54	(7,872,777)
デンマーククローネ	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	8	13,230.00	105,840.00	
	CARLSBERG AS-B	110	512.50	56,375.00	

	NOVO NORDISK A/S-B	1,090	267.10	291,139.00	
	DANSKE BANK A/S	622	157.10	97,716.20	
デンマーククローネ小計		1,830		551,070.20	(10,134,180)
豪ドル	ORIGIN ENERGY LTD	944	14.32	13,518.08	
	SANTOS LTD	807	12.78	10,313.46	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	520	40.05	20,826.00	
	WORLEYPARSONS LTD	285	13.67	3,895.95	
	BHP BILLITON LTD	1,672	33.74	56,413.28	
	NEWCREST MINING LTD	538	10.03	5,396.14	
	ORICA LIMITED	480	19.37	9,297.60	
	RIO TINTO LTD	244	60.05	14,652.20	
	LEIGHTON HOLDINGS LTD	219	21.07	4,614.33	
	BRAMBLES LTD	1,733	9.43	16,342.19	
	SYDNEY AIRPORT	1,475	4.30	6,342.50	
	CROWN RESORTS LTD	629	14.07	8,850.03	
	TABCORP HOLDINGS LTD	1,958	3.94	7,714.52	
	WESFARMERS LTD	557	42.50	23,672.50	
	WOOLWORTHS LTD	691	34.83	24,067.53	
	COCA-COLA AMATIL LTD	768	8.71	6,689.28	
	CSL LTD	230	75.66	17,401.80	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	1,429	33.02	47,185.58	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	868	78.77	68,372.36	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,279	34.27	43,831.33	
	WESTPAC BANKING CORP	1,654	34.21	56,583.34	
	MACQUARIE GROUP LTD	288	59.75	17,208.00	
	AMP LTD	1,916	5.56	10,652.96	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,863	6.12	11,401.56	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	853	11.14	9,502.42	
	SUNCORP GROUP LTD	1,427	14.31	20,420.37	
COMPUTERSHARE LTD	820	11.95	9,799.00		
TELSTRA CORPORATION LTD	3,665	5.50	20,157.50		
AGL ENERGY LTD	726	13.51	9,808.26		
豪ドル小計		30,538		574,930.07	(54,727,593)

香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,411	97.35	137,360.85	
	GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	4,000	1.71	6,840.00	
	LI & FUNG LTD	4,000	9.36	37,440.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,000	48.60	97,200.00	
	SANDS CHINA LTD	2,000	45.15	90,300.00	
	BANK OF EAST ASIA	1,880	31.45	59,126.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,000	25.15	50,300.00	
	HANG SENG BANK LTD	550	129.20	71,060.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	880	174.40	153,472.00	
	AIA GROUP LTD	6,600	41.95	276,870.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	920	133.40	122,728.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	23.05	69,150.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,210	52.30	63,283.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	933	114.30	106,641.90	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	754	102.10	76,983.40	
	WHARF HOLDINGS LTD	1,100	55.75	61,325.00	
CLP HOLDINGS LTD	1,194	65.35	78,027.90		
HONG KONG & CHINA GAS	7,280	17.96	130,748.80		
香港ドル小計		41,712		1,688,856.85	(23,508,887)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	1,100	9.67	10,637.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	2,000	9.62	19,240.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	4,000	1.05	4,200.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,202	18.28	21,972.56	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,708	9.81	16,755.48	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	842	22.04	18,557.68	
	CAPITALAND LTD	3,000	3.05	9,150.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	500	9.63	4,815.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,000	3.70	18,500.00	
シンガポールドル小計		19,352		123,827.72	(10,490,684)
イスラエルシュケル	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	424	201.80	85,563.20	
イスラエルシュケル小計		424		85,563.20	(2,442,829)

合 計	663,227		1,701,802,775 (1,701,802,775)	
-----	---------	--	----------------------------------	--

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	242	23,273.14	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	104	15,727.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	143	17,424.55	
		CROWN CASTLE INTL CORP	272	23,052.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	200	13,548.00	
		HCP INC	315	13,504.05	
		HEALTH CARE REIT INC	271	18,661.06	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	634	14,385.46	
		IRON MOUNTAIN INC	256	9,113.60	
		KIMCO REALTY CORPORATION	540	12,997.80	
		MACERICH CO/THE	191	13,045.30	
		PROLOGIS INC	370	15,070.10	
		PUBLIC STORAGE	79	13,901.63	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	158	27,311.88	
		VENTAS INC	159	10,648.23	
		VORNADO REALTY TRUST	157	16,864.94	
WEYERHAEUSER CO	527	17,860.03			
米ドル小計			4,618	276,389.69 (29,833,503)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	61	11,898.05	
ユーロ小計			61	11,898.05 (1,629,318)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,166	8,325.24	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	944	10,232.96	
英ポンド小計			2,110	18,558.20 (3,225,971)	
豪ドル	投資証券	LEND LEASE GROUP	919	14,106.65	

		SCENTRE GROUP	4,461	14,988.96	
		WESTFIELD CORP	1,209	9,176.31	
豪ドル小計			6,589	38,271.92	(3,643,104)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	2,500	118,000.00	
香港ドル小計			2,500	118,000.00	(1,642,560)
合計				39,974,456	(39,974,456)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 358銘柄	97.3%		61.2%
	投資証券 17銘柄		2.7%	1.7%
加ドル	株式 45銘柄	100.0%		4.4%
ユーロ	株式 111銘柄	99.2%		12.3%
	投資証券 1銘柄		0.8%	0.1%
英ポンド	株式 59銘柄	97.9%		8.7%
	投資証券 2銘柄		2.1%	0.2%
スイスフラン	株式 21銘柄	100.0%		4.3%
スウェーデンクローナ	株式 5銘柄	100.0%		0.6%
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.5%
デンマーククローネ	株式 4銘柄	100.0%		0.6%
豪ドル	株式 29銘柄	93.8%		3.1%
	投資証券 3銘柄		6.2%	0.2%
香港ドル	株式 18銘柄	93.5%		1.3%
	投資証券 1銘柄		6.5%	0.1%
シンガポールドル	株式 9銘柄	100.0%		0.6%
イスラエルシェケル	株式 1銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,393,211	49,160,167
国債証券	27,135,308,660	27,424,549,200
地方債証券	2,312,856,000	2,328,445,000
特殊債券	2,476,924,000	2,401,371,000
社債券	2,279,816,000	1,989,210,000
未収利息	95,326,764	91,166,286
前払費用	1,834,425	2,027,603
流動資産合計	34,332,459,060	34,285,929,256
資産合計		
34,332,459,060		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,951,655	30,453,951
流動負債合計	18,951,655	30,453,951
負債合計		
18,951,655		
純資産の部		
元本等		
元本	26,729,401,948	26,150,712,081
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,584,105,457	8,104,763,224
元本等合計	34,313,507,405	34,255,475,305
純資産合計		
34,313,507,405		
負債純資産合計		
34,332,459,060		

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債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</p>
-----------------	---

	<p>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</p> <p>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>
--	---

(貸借対照表に関する注記)

		平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
1.	期首	平成24年10月27日	平成25年10月29日
	期首元本額	25,106,160,065円	26,729,401,948円
	期首からの追加設定元本額	4,332,159,284円	1,823,363,124円
	期首からの一部解約元本額	2,708,917,401円	2,402,052,991円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	546,869,516円	655,257,447円
	DCインデックスバランス(株式40)	720,630,370円	861,047,402円
	DCインデックスバランス(株式60)	507,234,166円	589,961,363円
	DCインデックスバランス(株式80)	91,941,013円	105,288,919円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,167,452,017円	1,283,595,025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	7,327,590,304円	6,357,801,070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	8,143,932円	5,537,922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)	62,711,113円	49,251,969円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,733,131円	5,673,295円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	37,831,248円	30,297,443円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	163,675,666円	123,058,905円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	592,869,206円	448,156,563円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,401,918,468円	7,138,754,587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)	113,652,101円	74,882,366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)	198,662,714円	166,913,429円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	33,295,646円	32,961,745円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,015,097,125円	1,061,792,792円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	988,707,628円	1,058,427,897円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	518,126,902円	545,250,657円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	78,440,524円	85,061,352円

インデックスファンド日本債券（1年決算型）	4,983,358,152円	5,292,390,478円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	163,461,006円	179,349,455円
計	26,729,401,948円	26,150,712,081円
2. 受益権の総数	26,729,401,948口	26,150,712,081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

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（平成25年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	294,126,790
地方債証券	3,103,000
特殊債証券	19,596,000
社債証券	2,874,000
合計	268,553,790

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	214,990,830
地方債証券	12,566,000
特殊債証券	2,601,000
社債証券	8,443,000
合計	238,600,830

（注） 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成25年10月28日現在		平成26年10月27日現在	
1口当たり純資産額	1.2837円	1口当たり純資産額	1.3099円
(1万口当たり純資産額)	(12,837円)	(1万口当たり純資産額)	(13,099円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第334回利付国債（2年）	520,000,000	520,457,600	
	第341回利付国債（2年）	100,000,000	100,130,000	
	第93回利付国債（5年）	445,000,000	447,487,550	
	第94回利付国債（5年）	70,000,000	70,471,100	
	第95回利付国債（5年）	200,000,000	201,624,000	
	第96回利付国債（5年）	150,000,000	151,009,500	
	第97回利付国債（5年）	350,000,000	352,208,500	
	第98回利付国債（5年）	100,000,000	100,467,000	
	第99回利付国債（5年）	60,000,000	60,431,400	
	第100回利付国債（5年）	60,000,000	60,317,400	
	第101回利付国債（5年）	170,000,000	171,382,100	
	第102回利付国債（5年）	280,000,000	281,677,200	
	第103回利付国債（5年）	90,000,000	90,601,200	
	第104回利付国債（5年）	50,000,000	50,214,500	
	第105回利付国債（5年）	210,000,000	210,940,800	
	第106回利付国債（5年）	340,000,000	341,669,400	
第107回利付国債（5年）	705,000,000	708,644,850		

第109回利付国債(5年)	100,000,000	100,203,000	
第111回利付国債(5年)	40,000,000	40,487,200	
第112回利付国債(5年)	160,000,000	162,035,200	
第114回利付国債(5年)	90,000,000	90,820,800	
第116回利付国債(5年)	110,000,000	110,544,500	
第117回利付国債(5年)	370,000,000	371,776,000	
第118回利付国債(5年)	200,000,000	200,922,000	
第1回利付国債(40年)	25,000,000	29,513,000	
第2回利付国債(40年)	165,000,000	186,134,850	
第3回利付国債(40年)	20,000,000	22,533,200	
第4回利付国債(40年)	115,000,000	129,380,750	
第5回利付国債(40年)	35,000,000	37,443,000	
第6回利付国債(40年)	55,000,000	57,222,550	
第7回利付国債(40年)	20,000,000	19,629,400	
第274回利付国債(10年)	43,000,000	43,731,860	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	35,635,600	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	81,982,400	
第279回利付国債(10年)	30,000,000	30,826,800	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	160,823,520	
第281回利付国債(10年)	142,000,000	146,623,520	
第282回利付国債(10年)	24,000,000	24,765,360	
第283回利付国債(10年)	25,000,000	25,844,500	
第284回利付国債(10年)	462,000,000	478,618,140	
第285回利付国債(10年)	261,000,000	271,468,710	
第286回利付国債(10年)	186,000,000	194,712,240	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	36,731,800	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	18,868,860	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	208,150,020	
第290回利付国債(10年)	406,000,000	424,684,120	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	299,237,680	
第292回利付国債(10年)	331,000,000	349,595,580	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	102,105,600	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	33,918,720	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,684,970	
第296回利付国債(10年)	74,000,000	78,138,820	

第297回利付国債(10年)	148,000,000	156,097,080	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	232,178,180	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	789,840,000	
第300回利付国債(10年)	36,000,000	38,227,320	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	237,477,160	
第302回利付国債(10年)	94,000,000	99,668,200	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	617,626,240	
第304回利付国債(10年)	60,000,000	63,490,200	
第305回利付国債(10年)	673,000,000	713,952,050	
第306回利付国債(10年)	93,000,000	99,400,260	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	149,213,400	
第309回利付国債(10年)	34,000,000	35,856,740	
第310回利付国債(10年)	88,000,000	92,422,880	
第311回利付国債(10年)	23,000,000	23,887,110	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	218,033,900	
第313回利付国債(10年)	380,000,000	407,139,600	
第315回利付国債(10年)	65,000,000	69,327,700	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	37,100,700	
第317回利付国債(10年)	105,000,000	111,387,150	
第318回利付国債(10年)	205,000,000	216,076,150	
第319回利付国債(10年)	165,000,000	175,086,450	
第320回利付国債(10年)	110,000,000	115,951,000	
第321回利付国債(10年)	215,000,000	226,616,450	
第322回利付国債(10年)	105,000,000	109,910,850	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	47,104,650	
第324回利付国債(10年)	75,000,000	77,946,750	
第325回利付国債(10年)	270,000,000	280,516,500	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,916,800	
第327回利付国債(10年)	65,000,000	67,502,500	
第328回利付国債(10年)	275,000,000	280,830,000	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	217,833,000	
第330回利付国債(10年)	210,000,000	217,679,700	
第331回利付国債(10年)	80,000,000	81,513,600	
第333回利付国債(10年)	70,000,000	71,137,500	
第334回利付国債(10年)	220,000,000	223,253,800	

第335回利付国債(10年)	130,000,000	130,430,300	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	248,040,000	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	195,785,100	
第18回利付国債(30年)	140,000,000	163,751,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	66,090,750	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	189,664,780	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	35,415,600	
第27回利付国債(30年)	29,000,000	34,801,740	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	16,817,080	
第29回利付国債(30年)	276,000,000	326,289,960	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	170,741,970	
第31回利付国債(30年)	60,000,000	68,481,000	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	46,482,000	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	54,867,000	
第34回利付国債(30年)	165,000,000	187,722,150	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	131,245,200	
第36回利付国債(30年)	310,000,000	338,774,200	
第37回利付国債(30年)	70,000,000	74,843,300	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	31,354,800	
第39回利付国債(30年)	75,000,000	80,047,500	
第40回利付国債(30年)	90,000,000	93,927,600	
第41回利付国債(30年)	30,000,000	30,596,100	
第42回利付国債(30年)	65,000,000	66,233,050	
第43回利付国債(30年)	125,000,000	127,256,250	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	41,936,800	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	214,306,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	92,051,600	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	68,590,620	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	93,434,700	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,657,800	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	197,531,940	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	82,952,820	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	57,514,230	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,536,380	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	113,200,560	

第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,979,080	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	263,017,860	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,674,150	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	17,082,450	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	74,409,060	
第57回利付国債(20年)	137,000,000	153,775,650	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	151,829,100	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,657,390	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	592,175,200	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,465,020	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,799,050	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	61,192,260	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	113,480,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	38,265,640	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	38,614,820	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	44,209,580	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	123,194,240	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	48,632,640	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	129,925,140	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	136,818,640	
第76回利付国債(20年)	71,000,000	81,016,680	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	46,039,200	
第79回利付国債(20年)	90,000,000	103,743,900	
第88回利付国債(20年)	260,000,000	309,439,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	184,115,880	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	309,753,600	
第92回利付国債(20年)	110,000,000	128,601,000	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	58,480,000	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	38,212,160	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	114,665,880	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	53,202,600	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	110,017,600	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	136,878,300	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	35,487,000	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	79,734,600	

第102回利付国債(20年)	81,000,000	97,902,270	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	13,158,750	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	38,608,350	
第105回利付国債(20年)	127,000,000	148,570,950	
第106回利付国債(20年)	122,000,000	144,347,960	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	93,569,600	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	153,115,100	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	122,187,580	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	114,586,500	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	29,567,500	
第113回利付国債(20年)	240,000,000	280,214,400	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	60,679,320	
第116回利付国債(20年)	145,000,000	171,288,500	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	35,007,900	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	11,508,200	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	56,093,000	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	76,507,900	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	24,971,980	
第122回利付国債(20年)	80,000,000	89,636,800	
第123回利付国債(20年)	85,000,000	98,888,150	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	57,428,000	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	58,863,000	
第126回利付国債(20年)	25,000,000	28,681,750	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	73,503,300	
第129回利付国債(20年)	115,000,000	128,307,800	
第130回利付国債(20年)	80,000,000	89,120,000	
第131回利付国債(20年)	55,000,000	60,388,900	
第132回利付国債(20年)	90,000,000	98,641,800	
第133回利付国債(20年)	30,000,000	33,365,400	
第134回利付国債(20年)	30,000,000	33,308,400	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	32,818,800	
第136回利付国債(20年)	180,000,000	193,986,000	
第137回利付国債(20年)	140,000,000	152,861,800	
第138回利付国債(20年)	50,000,000	52,993,500	
第140回利付国債(20年)	280,000,000	304,886,400	

	第141回利付国債（20年）	195,000,000	211,892,850	
	第142回利付国債（20年）	25,000,000	27,563,250	
	第143回利付国債（20年）	115,000,000	122,761,350	
	第144回利付国債（20年）	40,000,000	42,029,200	
	第145回利付国債（20年）	125,000,000	135,137,500	
	第146回利付国債（20年）	75,000,000	80,899,500	
	第147回利付国債（20年）	110,000,000	116,485,600	
	第148回利付国債（20年）	120,000,000	124,584,000	
	第149回利付国債（20年）	130,000,000	134,594,200	
	第150回利付国債（20年）	90,000,000	91,350,000	
国債証券 合計		25,521,000,000	27,424,549,200	
地方債証券	第636回東京都公募公債	100,000,000	103,291,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	106,286,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	104,332,000	
	第1回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	119,360,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	208,886,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	104,890,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	104,447,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,954,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,740,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,537,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	103,679,000	
	平成23年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,584,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	102,816,000	
	第10回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	102,052,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,366,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,098,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,662,000	
	第4回京都市公募公債（20年）	100,000,000	120,265,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	109,354,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）	100,000,000	103,691,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,155,000		
地方債証券 合計		2,200,000,000	2,328,445,000	
特殊債券	第1回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	103,668,000	
	第2回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	104,211,000	

第5回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,227,000	
第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,359,000	
第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,707,000	
第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,433,000	
第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,482,000	
第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,844,000	
第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,095,000	
第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,358,000	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,805,000	
第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位特約）	100,000,000	103,075,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	116,841,000	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,845,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,041,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	103,248,000	
第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,707,000	
第25回国際協力銀行債券	100,000,000	102,719,000	
第29回国際協力銀行債券	200,000,000	209,802,000	
い第745号農林債	100,000,000	100,557,000	
第267回信金中金債（5年）	100,000,000	100,813,000	
第272回信金中金債（5年）	100,000,000	100,534,000	
特殊債券 合計	2,300,000,000	2,401,371,000	
社債券			
第324回東京交通債券	100,000,000	107,533,000	
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債（2012）	100,000,000	102,328,000	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債（2011）	100,000,000	100,941,000	
第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	106,232,000	
第28回東レ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,715,000	
第32回住友化学株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,613,000	
第12回武田薬品工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,720,000	
第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,348,000	

第15回ダイキン工業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,253,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,947,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,580,000	
第26回三井不動産株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,524,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債（担保提供制限等財務上特約無）	100,000,000	110,593,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	108,101,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	116,777,000	
第523回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,878,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,792,000	
第281回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,883,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,452,000	
社債券 合計	1,900,000,000	1,989,210,000	
合計	31,921,000,000	34,143,575,200	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	413,589,377	95,168,638

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
コール・ローン	31,073,541	137,073,689
国債証券	221,170,500,757	201,857,784,535
派生商品評価勘定	88,095	-
未収入金	529,441,791	-
未収利息	2,942,971,134	2,720,589,090
前払費用	74,741,747	64,324,292
流動資産合計	225,162,406,442	204,874,940,244
資産合計	225,162,406,442	204,874,940,244
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,554,025	-
未払解約金	507,270,024	57,369,444
流動負債合計	508,824,049	57,369,444
負債合計	508,824,049	57,369,444
純資産の部		
元本等		
元本	116,750,317,478	94,320,172,210
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	107,903,264,915	110,497,398,590
元本等合計	224,653,582,393	204,817,570,800
純資産合計	224,653,582,393	204,817,570,800
負債純資産合計	225,162,406,442	204,874,940,244

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、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 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>
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>
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>

(貸借対照表に関する注記)

		平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
1.	期首	平成24年10月27日	平成25年10月29日
	期首元本額	149,884,558,127円	116,750,317,478円
	期首からの追加設定元本額	2,793,364,547円	1,407,865,604円
	期首からの一部解約元本額	35,927,605,196円	23,838,010,872円
	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)	10,169,985,285円	10,603,938,147円
	DCインデックスバランス(株式20)	56,363,037円	61,052,988円
	DCインデックスバランス(株式40)	107,811,741円	115,905,774円
	DCインデックスバランス(株式60)	137,491,394円	142,887,468円
	DCインデックスバランス(株式80)	124,032,093円	127,486,785円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	35,943,492,442円	29,236,200,995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	4,917,898,995円	3,822,465,023円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	50,820,572,036円	37,799,542,855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	42,551,474円	30,945,387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)	1,255,049,496円	1,071,774,948円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	21,935,607円	66,087,080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)	34,967,614円	23,824,257円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,145,285円	3,413,105円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	5,055,566円	3,665,047円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	12,146,020円	8,276,960円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	30,358,393円	20,893,764円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	903,649,566円	830,492,705円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,672,000,815円	1,444,089,612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)	107,506,058円	62,522,243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)	153,413,933円	113,765,637円
	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	50,784,130円	44,629,924円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	52,525,183円	49,601,481円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	74,099,521円	71,162,661円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	69,148,967円	66,016,152円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	52,863,303円	51,217,745円
	インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	9,709,002,469円	8,202,400,500円
	海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	220,467,055円	245,912,967円
	計	116,750,317,478円	94,320,172,210円
2.	受益権の総数	116,750,317,478口	94,320,172,210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

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成25年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,425,422,160
合計	4,425,422,160

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,015,128,271
合計	6,015,128,271

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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）

（平成25年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	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	668,015,300	-	669,481,230	1,465,930
	米ドル	177,196,448	-	177,541,000	344,552
	加ドル	22,387,200	-	22,423,200	36,000
	ユーロ	376,353,500	-	377,384,000	1,030,500

英ポンド	28,026,100	-	28,100,860	74,760
ポーランドズロチ	21,527,357	-	21,586,070	58,713
豪ドル	42,524,695	-	42,446,100	78,595
合計	668,015,300	-	669,481,230	1,465,930

（注）1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（平成26年10月27日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成25年10月28日現在		平成26年10月27日現在	
1口当たり純資産額	1.9242円	1口当たり純資産額	2.1715円
(1万口当たり純資産額)	(19,242円)	(1万口当たり純資産額)	(21,715円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.25%-15/09/30	4,200,000.00	4,244,296.87	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	13,400,000.00	14,012,421.87	
		US TREASURY N/B-1.375%-15/11/30	9,000,000.00	9,119,531.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	14,300,000.00	14,627,335.93	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/01/31	10,000,000.00	10,227,343.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	17,700,000.00	18,685,945.31	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	8,500,000.00	8,774,921.87	
		US TREASURY N/B-2.25%-16/03/31	12,100,000.00	12,445,039.06	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	2,000,000.00	2,070,625.00	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	18,200,000.00	19,560,734.37	
		US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000.00	9,965,390.62	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	11,500,000.00	12,036,367.18	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	10,000,000.00	10,487,500.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	5,000,000.00	5,097,656.25	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000.00	4,413,937.50	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,000,000.00	8,646,250.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	10,000,000.00	10,482,031.25	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,200,000.00	5,455,937.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000.00	7,270,335.93	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,507,187.50	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	9,700,000.00	11,086,796.87	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	7,000,000.00	7,329,765.61	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	9,212,484.37	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,521,015.62	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	10,108,515.62	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,705,859.37	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,357,562.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,430,937.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	8,800,000.00	9,657,312.50	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	9,636,250.00	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,270,250.00			

US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,189,062.50	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	8,600,000.00	9,541,296.87	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	7,000,000.00	7,208,906.25	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	9,800,000.00	10,794,546.87	
US TREASURY N/B-2.25%-17/11/30	3,500,000.00	3,640,546.86	
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	8,600,000.00	9,084,421.87	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	9,800,000.00	10,591,656.25	
US TREASURY N/B-2.75%-18/02/28	9,500,000.00	10,037,343.75	
US TREASURY N/B-2.875%-18/03/31	2,500,000.00	2,653,320.31	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,282,585.93	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	7,000,000.00	7,304,062.50	
US TREASURY N/B-2.25%-18/07/31	9,600,000.00	9,973,500.00	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	2,500,000.00	2,516,601.56	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	9,700,000.00	10,721,531.25	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	3,000,000.00	3,053,906.25	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	15,200,000.00	16,685,562.50	
US TREASURY N/B-1.5%-18/12/31	11,500,000.00	11,577,265.62	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000.00	6,588,671.87	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000.00	5,921,562.50	
US TREASURY N/B-1.375%-19/02/28	3,000,000.00	2,998,593.75	
US TREASURY N/B-1.5%-19/02/28	4,000,000.00	4,021,875.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	2,000,000.00	2,019,218.75	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	5,000,000.00	5,043,750.00	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,726,906.25	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	3,000,000.00	3,296,953.12	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000.00	11,790,703.12	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,000,000.00	14,159,843.75	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	14,800,000.00	16,327,406.25	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	10,000,000.00	10,980,468.75	
US TREASURY N/B-1.375%-20/05/31	300,000.00	294,890.62	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	10,000,000.00	10,157,031.25	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	11,059,195.31	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	5,000,000.00	5,241,796.87	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	3,500,000.00	3,663,515.62	
US TREASURY N/B-2.375%-20/12/31	3,000,000.00	3,094,453.12	

US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	15,900,000.00	17,589,375.00	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	4,500,000.00	4,842,070.31	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	1,000,000.00	1,012,187.50	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	16,832,812.50	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	1,500,000.00	1,500,585.93	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	9,209,179.68	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	8,223,750.00	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,640,507.81	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	4,000,000.00	4,083,125.00	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	2,000,000.00	2,017,343.75	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,846,867.18	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,100,000.00	4,344,359.37	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,000,000.00	1,315,859.37	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	3,700,000.00	5,414,718.75	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,751,250.00	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	2,900,000.00	3,936,070.31	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	2,700,000.00	3,368,882.81	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	3,200,000.00	4,064,750.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	2,900,000.00	3,563,601.56	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	4,400,000.00	5,606,218.75	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	4,950,000.00	6,203,742.18	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	6,300,000.00	8,192,953.12	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	5,900,000.00	7,413,257.81	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000.00	5,703,523.43	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	5,900,000.00	7,287,882.81	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	2,129,875.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	4,800,000.00	6,050,250.00	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	5,100,000.00	5,821,171.87	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	2,028,125.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	5,800,000.00	5,597,000.00	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	5,700,000.00	6,339,023.43	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,000,000.00	2,274,843.75	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	3,000,000.00	3,336,796.87	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,500,000.00	2,658,007.81	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	3,000,000.00	3,042,890.62	

米ドル小計			671,300,000.00	736,933,351.29 (79,544,585,938)
加ドル	国債証券	CANADA GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	370,000.00	391,241.70
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/11/01	1,100,000.00	1,100,165.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,350,000.00	2,401,089.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-16/02/01	1,000,000.00	1,003,160.00
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	4,400,000.00	4,608,736.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-16/06/01	1,200,000.00	1,219,032.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-16/08/01	380,000.00	380,129.20
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	700,000.00	722,533.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	2,000,000.00	2,022,000.00
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	3,040,000.00	3,270,918.40
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-17/08/01	380,000.00	381,383.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/09/01	1,000,000.00	1,010,360.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	1,670,000.00	1,671,102.20
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	1,520,000.00	1,677,912.80
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	647,874.50
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/03/01	1,350,000.00	1,370,358.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,600,000.00	2,868,788.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	650,000.00	657,930.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	1,720,000.00	1,898,862.80
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,450,000.00	1,592,419.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,600,000.00	1,707,744.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	1,900,000.00	1,838,573.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,520,000.00	1,585,360.00
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	790,000.00	1,294,667.80
CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,300,000.00	1,854,827.00		
CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,350,000.00	2,020,437.00		
CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	1,720,000.00	2,452,599.60		
CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	2,010,000.00	2,567,312.70		
CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	2,070,000.00	2,488,140.00		
加ドル小計			43,790,000.00	48,705,655.90 (4,682,074,701)
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	21,100,000.00	22,245,740.55

ペソ		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%-16/06/16	12,700,000.00	13,273,926.97	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	24,500,000.00	26,302,042.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-17/06/15	9,000,000.00	9,228,464.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	17,000,000.00	18,719,101.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-4.75%-18/06/14	13,500,000.00	13,569,360.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-18/12/13	5,500,000.00	6,282,541.65	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	25,700,000.00	29,255,145.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	5,000,000.00	5,286,534.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	3,000,000.00	3,152,962.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	4,000,000.00	4,611,364.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	27,500,000.00	36,179,541.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	6,000,000.00	6,680,790.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	23,000,000.00	27,622,579.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	10,700,000.00	12,026,523.94	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	1,200,000.00	1,352,735.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	11,900,000.00	16,437,636.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	17,000,000.00	20,570,287.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	8,900,000.00	9,987,199.08		
メキシコペソ小計			247,200,000.00	282,784,476.44	(2,248,136,587)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,400,000.00	1,454,361.02	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	1,700,000.00	1,805,300.72	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	2,090,000.00	2,289,875.06	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	410,000.00	447,601.51	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	2,030,000.00	2,350,772.68	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	2,600,000.00	2,944,279.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,950,000.00	2,271,360.39	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,620,000.00	3,116,878.54	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	2,170,000.00	2,693,729.50	

BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	2,050,000.00	2,522,412.25
BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,883,208.45
BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	700,000.00	768,769.40
BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	850,000.00	954,863.90
BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,300,000.00	1,709,064.76
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	2,190,000.00	3,190,593.48
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	1,120,000.00	1,451,666.27
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	580,000.00	661,828.30
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	2,440,000.00	3,600,410.80
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,860,000.00	2,573,297.53
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	750,000.00	965,900.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%-15/10/31	2,000,000.00	2,067,526.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	3,700,000.00	3,825,818.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-16/04/30	3,350,000.00	3,490,400.51
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	3,900,000.00	4,190,863.95
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,550,000.00	2,736,093.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%-17/04/30	1,500,000.00	1,554,850.05
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	3,050,000.00	3,451,860.37
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,128,465.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,700,000.00	4,150,245.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.75%-18/10/31	1,600,000.00	1,785,953.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-19/04/30	700,000.00	756,628.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	2,900,000.00	3,389,051.07
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	3,000,000.00	3,480,005.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	800,000.00	812,074.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-	3,000,000.00	3,454,416.00

20/04/30		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	2,800,000.00	3,383,207.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	3,350,000.00	4,215,861.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,600,000.00	2,073,330.56
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,000,000.00	2,551,245.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,250,000.00	1,501,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	3,100,000.00	3,830,130.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	2,500,000.00	2,869,825.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,350,000.00	1,418,401.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,500,000.00	1,834,092.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	2,284,349.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	900,000.00	1,139,717.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	2,430,000.00	3,324,910.68
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	2,190,000.00	3,009,230.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	2,180,000.00	2,484,999.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,780,000.00	2,234,718.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,650,000.00	2,005,297.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	600,000.00	774,340.02
BUNDESobligation-1.75%-15/10/09	1,000,000.00	1,017,014.70
BUNDESobligation-2.0%-16/02/26	1,700,000.00	1,746,326.19
BUNDESobligation-2.75%-16/04/08	4,000,000.00	4,161,040.00
BUNDESobligation-1.25%-16/10/14	200,000.00	205,011.18
BUNDESobligation-1.0%-18/10/12	2,100,000.00	2,178,970.50
BUNDESobligation-1.0%-19/02/22	3,000,000.00	3,116,423.10

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 16/01/04	3,050,000.00	3,178,572.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%- 16/06/20	1,900,000.00	2,088,156.81
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	4,160,000.00	4,442,143.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,450,000.00	5,899,856.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	5,650,000.00	6,297,396.21
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	5,400,000.00	6,089,933.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	4,800,000.00	5,546,650.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	3,100,000.00	3,578,338.37
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,200,000.00	4,862,553.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	4,000,000.00	4,631,861.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	4,350,000.00	5,024,683.69
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	8,150,000.00	9,692,954.74
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	1,200,000.00	1,349,148.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,215,635.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	2,250,000.00	2,455,488.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	600,000.00	641,770.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	1,000,000.00	1,068,160.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,000,000.00	1,067,236.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	300,000.00	332,363.01
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,950,000.00	2,907,405.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 24/02/15	900,000.00	975,336.30

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	200,000.00	211,913.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,800,000.00	2,942,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,700,000.00	2,612,561.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	1,730,000.00	2,489,881.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,490,000.00	2,496,048.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	2,350,000.00	3,726,388.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	2,900,000.00	4,445,256.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	3,140,000.00	4,482,608.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	2,340,000.00	3,512,619.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	3,050,000.00	4,937,887.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	1,987,818.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,689,373.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	200,000.00	232,883.62	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-15/12/11	1,900,000.00	1,900,984.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/11/01	700,000.00	717,752.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/04/15	3,850,000.00	4,025,851.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	7,400,000.00	7,798,048.22	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 16/09/15	1,200,000.00	1,290,620.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.75%- 16/11/15	1,100,000.00	1,144,915.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	4,900,000.00	5,254,512.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 17/05/01	1,700,000.00	1,865,846.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-	1,700,000.00	1,871,999.20	

17/06/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	5,900,000.00	6,608,474.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 17/11/01	1,700,000.00	1,832,560.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,200,000.00	4,675,664.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,086,953.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	4,200,000.00	4,732,790.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/12/01	2,600,000.00	2,851,620.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	4,000,000.00	4,521,092.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	3,750,000.00	4,286,034.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 19/05/01	500,000.00	528,647.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	3,590,000.00	4,098,323.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	2,800,000.00	3,247,511.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,100,000.00	3,560,348.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	3,600,000.00	4,099,810.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	1,000,000.00	1,124,782.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/05/01	1,000,000.00	1,121,342.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	5,100,000.00	5,718,579.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	4,900,000.00	5,808,650.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,890,032.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,500,000.00	1,863,378.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	2,000,000.00	2,483,490.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	500,000.00	585,983.75

23/05/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,000,000.00	1,194,108.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	5,310,000.00	8,204,073.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,000,000.00	1,174,512.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,200,000.00	1,329,930.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	100,000.00	100,102.83
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	4,129,381.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	400,000.00	466,972.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	2,950,000.00	4,280,061.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	4,500,000.00	6,199,282.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	4,700,000.00	5,877,357.99
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	4,100,000.00	5,557,694.73
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	2,100,000.00	2,789,654.07
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	2,700,000.00	3,296,610.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	3,200,000.00	3,431,080.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	3,250,000.00	3,937,667.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	3,200,000.00	3,845,324.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,300,000.00	1,522,294.80
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	880,000.00	902,586.08
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	50,000.00	52,275.42
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,220,000.00	1,354,526.96
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-18/09/15	160,000.00	166,015.31
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	1,050,000.00	1,250,531.83
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	1,120,000.00	1,300,383.05

FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	900,000.00	1,067,746.23	
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	300,000.00	319,227.99	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	620,000.00	651,313.41	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	350,000.00	380,323.68	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	1,030,000.00	1,319,115.33	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	500,000.00	580,344.75	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	440,000.00	514,526.10	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	4,260,000.00	4,386,811.68	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-15/11/25	900,000.00	902,315.97	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	7,300,000.00	7,653,357.23	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	6,710,000.00	7,376,165.44	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	6,000,000.00	6,553,905.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	5,050,000.00	5,679,728.43	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	3,950,000.00	4,483,606.29	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	3,700,000.00	3,811,853.22	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,671,799.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/11/25	600,000.00	619,099.68	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	4,900,000.00	5,771,018.61	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,474,050.06	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,500,000.00	5,257,701.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	6,200,000.00	7,227,349.30	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	3,600,000.00	4,016,025.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	4,970,000.00	5,954,292.09	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	5,200,000.00	6,094,953.28	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	4,350,000.00	5,036,987.67	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	900,000.00	991,560.87	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	3,300,000.00	5,329,229.07	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	1,400,000.00	1,484,218.26	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	4,150,000.00	5,275,514.44	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,000,000.00	2,188,414.40	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	1,900,000.00	1,979,160.84	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,400,000.00	3,523,934.16	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	4,400,000.00	5,324,994.84	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	2,780,000.00	3,128,056.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,220,000.00	4,747,542.24	

FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	4,200,000.00	6,590,009.16	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	2,850,000.00	4,099,058.10	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	3,250,000.00	4,297,608.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	3,390,000.00	4,864,695.76	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,400,000.00	1,654,137.38	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	2,110,000.00	2,941,567.45	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,150,000.00	1,614,747.20	
FRENCH TREASURY NOTE-2.25%-16/02/25	2,100,000.00	2,162,654.76	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-16/07/25	4,100,000.00	4,277,524.26	
FRENCH TREASURY NOTE-1.75%-17/02/25	400,000.00	416,014.92	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	970,000.00	1,034,352.90	
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	800,000.00	922,119.60	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	1,100,000.00	1,270,144.26	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	1,000,000.00	1,173,434.30	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	800,000.00	1,004,296.80	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,450,000.00	1,731,620.16	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	1,100,000.00	1,357,547.29	
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	650,000.00	765,574.35	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	850,000.00	965,455.50	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,460,000.00	1,912,499.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-16/04/15	1,300,000.00	1,300,037.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	2,150,000.00	2,297,127.29	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-17/01/15	2,000,000.00	2,109,810.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	3,440,000.00	3,856,341.48	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	320,000.00	332,232.57	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	3,420,000.00	3,913,944.78	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	800,000.00	836,280.48	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,600,000.00	3,058,873.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-20/01/15	400,000.00	398,996.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	2,350,000.00	2,763,233.87	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000.00	2,470,960.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	500,000.00	556,894.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,100,000.00	2,589,085.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	1,100,000.00	1,687,305.62	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	1,000,000.00	1,070,314.30	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	380,000.00	412,881.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	2,020,000.00	3,034,891.63	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	500,000.00	569,433.55	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	2,110,000.00	2,999,092.17	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,200,000.00	3,128,356.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	380,000.00	461,591.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	1,440,000.00	1,548,159.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,200,000.00	1,288,061.64	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	960,000.00	1,077,761.56	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,520,000.00	1,743,944.03	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	600,000.00	624,274.26	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	2,120,000.00	2,503,005.13	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	320,000.00	345,113.98	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,580,000.00	1,890,515.18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	1,710,000.00	2,044,095.86	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,100,000.00	1,333,539.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,200,000.00	1,441,104.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	890,000.00	950,336.03	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	450,000.00	472,318.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	1,100,000.00	1,523,186.83	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	900,000.00	1,418,418.27	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	450,000.00	500,451.34	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,490,000.00	2,130,455.93	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	630,000.00	803,090.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	500,000.00	779,421.65	
		ユーロ小計	531,370,000.00	633,458,128.69	(86,745,756,142)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-8.0%-15/12/07	2,880,000.00	3,121,129.44	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000.00	407,000.00	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	3,640,000.00	3,863,369.69	
		UK TREASURY-1.75%-17/01/22	2,150,000.00	2,194,803.20	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	2,980,000.00	3,628,163.41	
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,150,000.00	1,149,425.00	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	3,100,000.00	3,493,304.75	
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,250,000.00	2,246,835.82	

		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	3,650,000.00	4,129,914.41	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,700,000.00	1,718,246.60	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000.00	2,376,251.59	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	3,160,000.00	3,670,160.51	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	2,200,000.00	2,453,028.38	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	2,150,000.00	2,982,965.68	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,300,000.00	2,585,272.45	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	2,500,000.00	2,863,899.50	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	1,500,000.00	1,474,162.50	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	1,800,000.00	1,820,250.00	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	1,500,000.00	1,568,452.50	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,390,000.00	3,002,926.97	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,800,000.00	2,160,356.04	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,510,000.00	2,142,584.75	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,400,000.00	3,065,968.56	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	2,800,000.00	3,402,899.64	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	2,950,000.00	3,715,754.80	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,329,321.34	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,850,000.00	2,459,829.19	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,950,000.00	2,421,392.41	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,900,000.00	3,612,619.03	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	4,110,295.77	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,220,000.00	1,291,485.29	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	2,800,000.00	3,566,166.52	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	2,170,000.00	2,801,137.33	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	1,620,000.00	1,918,476.90	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	2,660,000.00	3,514,317.78	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	2,161,803.30	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	650,000.00	748,472.59	
英債券小計			81,580,000.00	96,172,443.64	(16,717,655,877)
スイス ラン	国債証券	SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	1,200,000.00	1,242,840.00	
		SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	820,000.00	911,840.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	200,000.00	219,160.00	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	170,000.00	192,627.00	

		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	446,980.00	
		SWITZERLAND-2.0%-21/04/28	100,000.00	111,360.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,080,000.00	2,696,930.08	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	230,000.00	325,381.23	
スイスフラン小計			5,200,000.00	6,147,118.31	(697,697,928)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	6,900,000.00	7,250,899.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	7,700,000.00	8,473,503.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	12,300,000.00	14,373,780.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	7,900,000.00	9,930,458.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	9,000,000.00	10,692,945.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,550,000.00	5,730,868.95	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	3,300,000.00	3,703,956.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	6,430,000.00	8,501,488.80	
スウェーデンクローナ小計			59,080,000.00	68,657,900.05	(1,022,316,131)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	8,050,000.00	8,625,172.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	7,250,000.00	8,172,932.25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,850,000.00	8,781,795.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	5,850,000.00	5,836,521.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	4,650,000.00	4,981,326.45	
ノルウェークローネ小計			33,650,000.00	36,397,747.80	(596,195,108)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	11,050,000.00	11,517,415.00	
		KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	600,000.00	630,810.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	10,900,000.00	12,217,265.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	16,650,000.00	19,791,855.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	5,000,000.00	5,854,500.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	8,000,000.00	8,453,600.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	4,050,000.00	6,444,765.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,800,000.00	4,040,920.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	15,070,000.00	23,413,505.50	
デンマーククローネ小計			75,120,000.00	92,364,635.50	(1,698,585,646)
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	3,000,000.00	3,134,100.00	

ドズロチ		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-16/01/25	2,230,000.00	2,184,285.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	3,850,000.00	4,036,340.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-16/07/25	600,000.00	582,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,800,000.00	2,967,020.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	2,100,000.00	2,251,410.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	4,200,000.00	4,616,850.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	1,400,000.00	1,486,660.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	2,700,000.00	2,754,135.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-19/07/25	1,500,000.00	1,580,850.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	2,400,000.00	2,789,520.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	2,500,000.00	2,925,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	1,970,000.00	2,403,597.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	2,900,000.00	3,587,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	3,150,000.00	3,515,400.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	820,000.00	866,924.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,000,000.00	1,346,599.00	
ポーランドズロチ小計			39,120,000.00	43,029,490.50 (1,396,737,261)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-15/10/21	1,700,000.00	1,737,740.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	2,850,000.00	2,953,854.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	2,870,000.00	3,093,291.74	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	2,150,000.00	2,246,128.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,600,000.00	2,832,853.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-18/10/21	550,000.00	561,373.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,220,000.00	2,450,016.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-19/10/21	400,000.00	398,453.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,650,000.00	2,867,398.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,730,000.00	3,175,743.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,200,000.00	2,596,026.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,660,000.00	3,116,086.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	2,150,000.00	2,059,390.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,550,000.00	1,537,731.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,420,000.00	1,532,003.92	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,530,000.00	1,729,359.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	950,000.00	913,743.25			

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,000,000.00	1,099,383.00	
豪ドル小計			34,180,000.00	36,900,576.37	(3,512,565,864)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-1.125%-16/04/01	900,000.00	909,540.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	800,000.00	849,154.24	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	570,000.00	595,512.17	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	350,000.00	345,872.34	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	770,000.00	855,470.23	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	700,000.00	737,688.49	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	950,000.00	1,034,121.36	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	220,000.00	226,003.86	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	628,158.96	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	100,000.00	105,167.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	574,913.59	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	760,000.00	842,816.06	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	180,000.00	185,627.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	500,000.00	510,923.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	350,000.00	381,706.85	
SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	410,000.00	399,186.16			
シンガポールドル小計			8,680,000.00	9,181,863.56	(777,887,480)
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.048%-21/09/30	200,000.00	203,341.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	420,000.00	439,608.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	650,000.00	657,929.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.197%-15/10/15	1,000,000.00	998,344.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	1,800,000.00	1,792,068.68	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	2,900,000.00	2,942,013.89	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,913,596.43	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,050,000.00	3,091,133.67	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	3,500,000.00	3,575,096.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.26%-18/03/01	200,000.00	198,199.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.58%-18/09/28	500,000.00	500,169.67	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	1,700,000.00	1,854,743.66	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,800,000.00	3,923,629.46	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,700,000.00	2,755,629.23			

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	650,000.00	632,763.72	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,750,000.00	1,709,403.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	550,000.00	567,397.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	1,820,000.00	1,883,778.11	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	441,535.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,300,000.00	1,225,588.93	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	430,000.00	410,875.29	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	833,643.12	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	430,000.00	446,238.23	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	950,000.00	928,917.66	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	600,000.00	569,430.00	
		マレーシアリングット小計	34,000,000.00	34,495,074.47 (1,139,372,309)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 17/09/15	10,900,000.00	11,323,731.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 18/12/21	10,000,000.00	10,332,355.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%- 20/01/15	10,200,000.00	10,187,917.59	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%- 21/03/31	11,000,000.00	10,614,630.95	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	5,500,000.00	5,531,464.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	18,800,000.00	22,583,371.22	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	2,000,000.00	1,944,531.20	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	11,150,000.00	9,820,327.37	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	1,000,000.00	978,275.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	11,300,000.00	8,815,462.22	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,800,000.00	2,775,444.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	9,400,000.00	7,361,960.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	7,000,000.00	7,083,223.00	

南アフリカランド小計	111,050,000.00	109,352,694.07 (1,078,217,563)	
合計		201,857,784,535 (201,857,784,535)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 101銘柄	100.0%	39.4%
加ドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 240銘柄	100.0%	43.1%
英ポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	8.3%
スイスフラン	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券 17銘柄	100.0%	0.7%
豪ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 25銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
資産の部		
流動資産		
預金	114,350,875	56,630,210
コール・ローン	262,698,970	61,258,254
国債証券	29,769,919,451	29,318,465,837
派生商品評価勘定	12,760,582	137,812,070
未収入金	-	81,557,265
未収利息	324,939,556	358,135,350
前払費用	18,274,464	13,294,950
流動資産合計	30,502,943,898	30,027,153,936
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	516,618,773	45,415,548
未払金	-	3,147,253
未払解約金	6,389,181	37,282,594
流動負債合計	523,007,954	85,845,395
負債合計	523,007,954	85,845,395
純資産の部		
元本等		
元本	22,305,266,953	20,992,635,203
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,674,668,991	8,948,673,338
元本等合計	29,979,935,944	29,941,308,541
純資産合計	29,979,935,944	29,941,308,541
負債純資産合計	30,502,943,898	30,027,153,936

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、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 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>
--------------------	--

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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。
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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
1.	期首	平成24年10月27日	平成25年10月29日
	期首元本額	20,550,735,931円	22,305,266,953円
	期首からの追加設定元本額	2,831,997,112円	513,740,541円
	期首からの一部解約元本額	1,077,466,090円	1,826,372,291円
	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）	659,086,940円	839,128,908円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,402,745円	5,193,282円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	7,252,243円	5,545,352円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	17,409,276円	12,510,038円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	43,664,419円	31,576,774円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	18,889,991,185円	17,526,417,254円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	74,943,158円	74,733,201円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	105,203,040円	107,612,513円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	99,282,206円	99,698,806円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	75,260,610円	78,227,500円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	2,325,771,131円	2,211,991,575円
	計	22,305,266,953円	20,992,635,203円
2.	受益権の総数	22,305,266,953口	20,992,635,203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

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成24年10月27日 至 平成25年10月28日	自 平成25年10月29日 至 平成26年10月27日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月28日現在	平成26年10月27日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成25年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	444,705,265
合計	444,705,265

（平成26年10月27日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	920,442,760
合計	920,442,760

（注） 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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）

（平成25年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種類	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	29,632,969,789	-	30,136,827,980	503,858,191
	米ドル	11,735,659,359	-	11,820,558,830	84,899,471
	加ドル	737,785,775	-	730,149,100	7,636,675
	メキシコペソ	329,155,258	-	337,426,800	8,271,542
	ユーロ	12,743,805,368	-	13,076,076,740	332,271,372
	英ポンド	2,239,969,571	-	2,274,214,590	34,245,019
	スイスフラン	136,155,863	-	139,296,000	3,140,137
	スウェーデンクローナ	172,284,425	-	176,821,750	4,537,325
	ノルウェークローネ	107,855,188	-	109,726,710	1,871,522
	デンマーククローネ	252,258,425	-	258,906,960	6,648,535
	ポーランドズロチ	236,452,602	-	244,632,410	8,179,808
	豪ドル	449,324,773	-	463,246,420	13,921,647
	シンガポールドル	116,002,632	-	118,066,220	2,063,588

	マレーシアリン ギット	226,738,533	-	234,117,870	7,379,337
	南アフリカランド	149,522,017	-	153,587,580	4,065,563
	合計	29,632,969,789	-	30,136,827,980	503,858,191

（平成26年10月27日現在）

（単位：円）

区分	種類	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	29,898,252,212	-	29,805,855,690	92,396,522
	米ドル	11,764,156,606	-	11,682,692,630	81,463,976
	加ドル	701,610,933	-	695,008,520	6,602,413
	メキシコペソ	311,506,869	-	308,684,590	2,822,279
	ユーロ	12,723,247,605	-	12,737,451,310	14,203,705
	英ポンド	2,484,917,808	-	2,479,588,760	5,329,048
	スイスフラン	146,023,474	-	146,190,000	166,526
	スウェーデンク ローナ	173,353,548	-	171,112,360	2,241,188
	ノルウェークローネ	79,377,705	-	77,611,250	1,766,455
	デンマーククローネ	240,741,315	-	240,265,350	475,965
	ポーランドズロチ	211,353,004	-	209,153,280	2,199,724
	豪ドル	522,612,354	-	516,589,650	6,022,704
	シンガポールドル	137,904,194	-	137,653,770	250,424
	マレーシアリン ギット	255,144,103	-	254,727,360	416,743
南アフリカランド	146,302,694	-	149,126,860	2,824,166	
	合計	29,898,252,212	-	29,805,855,690	92,396,522

（注）1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成25年10月28日現在		平成26年10月27日現在	
1口当たり純資産額	1,344円	1口当たり純資産額	1,426円
(1万口当たり純資産額)	(13,441円)	(1万口当たり純資産額)	(14,263円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.25%-15/09/30	900,000.00	909,492.18	
		US TREASURY N/B-0.25%-15/10/15	700,000.00	700,875.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-15/10/31	1,650,000.00	1,668,562.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	1,250,000.00	1,307,128.90	
		US TREASURY N/B-1.375%-15/11/30	2,450,000.00	2,482,539.06	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	1,500,000.00	1,534,335.93	
		US TREASURY N/B-0.375%-16/01/15	1,000,000.00	1,002,265.62	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/01/31	650,000.00	664,777.34	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	430,000.00	453,952.34	
		US TREASURY N/B-0.375%-16/02/15	1,500,000.00	1,503,515.62	
		US TREASURY N/B-2.25%-16/03/31	1,600,000.00	1,645,625.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-16/03/31	420,000.00	420,721.87	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/04/30	1,400,000.00	1,436,312.50	

US TREASURY N/B-0.375%-16/04/30	2,500,000.00	2,503,906.25	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	220,000.00	236,448.43	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	1,500,000.00	1,660,898.43	
US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	3,000,000.00	3,058,593.75	
US TREASURY N/B-0.625%-16/07/15	1,000,000.00	1,004,843.75	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	1,460,000.00	1,577,940.62	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	2,250,000.00	2,358,457.02	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	1,000,000.00	1,053,671.87	
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	1,160,000.00	1,258,056.25	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000.00	1,047,109.37	
US TREASURY N/B-0.875%-16/11/30	700,000.00	705,742.18	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	1,250,000.00	1,323,632.81	
US TREASURY N/B-0.875%-16/12/31	1,000,000.00	1,007,656.25	
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	380,000.00	401,998.43	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	1,170,000.00	1,244,130.46	
US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	1,700,000.00	1,715,804.68	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	1,050,000.00	1,114,640.62	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	820,000.00	899,885.93	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	1,000,000.00	1,053,437.50	
US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	1,500,000.00	1,497,421.87	
US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	1,200,000.00	1,200,656.25	
US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	1,100,000.00	1,148,210.93	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	1,750,000.00	1,802,226.56	
US TREASURY N/B-0.75%-17/10/31	1,500,000.00	1,494,023.43	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	480,000.00	528,712.50	
US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	1,700,000.00	1,684,593.75	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	250,000.00	270,195.31	
US TREASURY N/B-0.75%-18/02/28	1,200,000.00	1,189,406.25	
US TREASURY N/B-0.75%-18/03/31	300,000.00	296,929.68	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	200,000.00	219,406.25	
US TREASURY N/B-1.0%-18/05/31	2,200,000.00	2,189,859.37	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	700,000.00	730,406.25	
US TREASURY N/B-1.375%-18/07/31	350,000.00	352,324.21	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	770,000.00	851,090.62	
US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	3,200,000.00	3,233,749.99	

US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	700,000.00	712,578.12	
US TREASURY N/B-1.375%-18/11/30	600,000.00	602,062.50	
US TREASURY N/B-1.375%-18/12/31	700,000.00	701,093.75	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	860,000.00	909,382.81	
US TREASURY N/B-1.5%-19/03/31	1,000,000.00	1,004,140.62	
US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	1,000,000.00	1,009,609.37	
US TREASURY N/B-1.25%-19/04/30	1,200,000.00	1,191,000.00	
US TREASURY N/B-1.625%-19/04/30	750,000.00	756,562.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	2,150,000.00	2,309,738.28	
US TREASURY N/B-1.625%-19/06/30	500,000.00	503,945.31	
US TREASURY N/B-0.875%-19/07/31	1,050,000.00	1,020,222.65	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	550,000.00	604,441.40	
US TREASURY N/B-1.25%-19/10/31	600,000.00	591,984.37	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	550,000.00	599,070.31	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	800,000.00	878,437.50	
US TREASURY N/B-2.0%-20/07/31	1,200,000.00	1,218,843.75	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000.00	542,526.56	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	310,000.00	324,482.81	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,600,000.00	1,770,000.00	
US TREASURY N/B-2.25%-21/04/30	950,000.00	970,410.15	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	2,000,000.00	2,152,031.25	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	750,000.00	759,140.62	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000.00	1,360,652.34	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,000,000.00	1,002,890.62	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	850,000.00	850,332.03	
US TREASURY N/B-1.625%-22/08/15	850,000.00	823,570.31	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	1,950,000.00	1,930,957.02	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	950,000.00	919,125.00	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,230,000.00	1,636,284.37	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	1,000,000.00	1,025,546.87	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,900,000.00	1,982,828.12	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,224,937.50	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	880,000.00	1,233,237.50	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	276,330.46	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	130,000.00	190,246.87	

		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	495,117.18	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	350,000.00	436,707.03	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	426,592.96	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	125,328.12	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	300,000.00	390,140.62	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	680,000.00	854,409.37	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	407,394.53	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	550,000.00	679,378.90	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	650,000.00	819,304.68	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	228,281.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	700,000.00	714,875.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	950,000.00	967,664.06	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	700,000.00	659,203.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	900,000.00	912,656.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	750,000.00	723,750.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	890,000.00	989,777.34	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	227,484.37	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,650,000.00	1,835,238.28	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	127,584.37	
米ドル小計			102,160,000.00	107,255,702.75	(11,577,180,554)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-16/02/01	500,000.00	501,580.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	500,000.00	523,720.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	400,000.00	412,876.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-17/03/01	300,000.00	303,300.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	300,000.00	322,788.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	500,000.00	551,945.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	350,000.00	386,183.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000.00	827,992.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	300,000.00	329,466.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	750,000.00	800,505.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	150,000.00	245,823.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	684,859.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	710,000.00	1,012,410.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	255,454.00	

加ドル小計			6,190,000.00	7,158,902.00 (688,185,249)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	4,500,000.00	4,744,352.25
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	4,000,000.00	4,404,494.40
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000.00	6,829,995.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	6,578,098.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000.00	7,205,890.20
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,809,935.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	5,445,076.05
メキシコペソ小計			32,500,000.00	38,017,841.90 (302,241,843)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	400,000.00	415,531.72
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	300,000.00	318,582.48
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	720,000.00	833,771.59
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	100,000.00	116,480.02
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	650,000.00	773,271.39
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	200,000.00	248,270.00
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	150,000.00	184,566.75
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	620,000.00	680,910.04
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	230,000.00	335,085.16
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	760,000.00	1,121,439.43
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	400,000.00	553,397.31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%- 16/01/31	1,400,000.00	1,447,607.00
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 17/01/31	600,000.00	643,786.80
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.1%- 17/04/30	1,000,000.00	1,036,566.70
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 17/07/30	580,000.00	656,419.35
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%- 18/07/30	550,000.00	616,928.40
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%- 19/07/30	560,000.00	654,437.44

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%- 19/10/31	400,000.00	464,000.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	620,000.00	749,138.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	750,000.00	943,849.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	1,200,000.00	1,482,631.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	250,000.00	305,682.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	500,000.00	671,867.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	530,000.00	725,186.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	780,000.00	889,128.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	400,000.00	486,132.68	
BUNDESobligation-1.75%-15/10/09	700,000.00	711,910.29	
BUNDESobligation-2.0%-16/02/26	150,000.00	154,087.60	
BUNDESobligation-1.25%-16/10/14	500,000.00	512,527.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	1,140,000.00	1,217,318.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	430,000.00	465,493.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	1,320,000.00	1,471,250.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	250,000.00	281,941.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	1,200,000.00	1,386,662.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	710,000.00	819,554.91	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	450,000.00	521,084.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	800,000.00	924,079.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 20/09/04	1,150,000.00	1,281,807.59	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	550,000.00	623,636.47	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	250,000.00	297,329.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	300,000.00	332,345.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	650,000.00	695,250.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	700,000.00	747,065.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	620,000.00	924,405.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	710,000.00	1,091,128.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	350,000.00	586,320.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	420,000.00	665,992.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	660,000.00	942,204.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	250,000.00	375,279.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	190,000.00	307,606.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	150,000.00	198,781.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	450,000.00	524,288.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/04/15	500,000.00	522,837.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	1,540,000.00	1,622,837.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	900,000.00	965,114.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	1,000,000.00	1,120,080.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	730,000.00	812,674.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	1,200,000.00	1,352,225.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	510,000.00	576,439.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	600,000.00	684,956.64	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	650,000.00	753,886.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	550,000.00	631,674.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	950,000.00	1,081,894.39	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	1,280,000.00	1,435,251.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,050,000.00	1,304,365.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,150,000.00	1,373,224.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	664,360.01	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	250,000.00	303,630.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,000,000.00	1,167,431.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,100,000.00	1,515,380.13	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	450,000.00	562,725.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	550,000.00	745,544.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	332,101.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	250,000.00	305,241.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	160,000.00	171,554.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	600,000.00	726,954.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	500,000.00	600,832.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	150,000.00	175,649.40	
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	300,000.00	313,652.55	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	160,000.00	190,557.23	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000.00	406,369.70	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	105,050.55	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	256,138.90	

FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	116,937.75	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	650,000.00	669,349.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-15/11/25	700,000.00	701,801.31	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	660,000.00	691,947.36	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	1,340,000.00	1,473,034.53	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	1,500,000.00	1,638,476.40	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	1,400,000.00	1,589,126.28	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	1,050,000.00	1,236,646.84	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000.00	828,275.74	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	770,000.00	899,651.06	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	700,000.00	815,991.05	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	250,000.00	278,890.62	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	530,000.00	634,964.75	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	500,000.00	586,053.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	450,000.00	521,067.69	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	400,000.00	440,693.72	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	900,000.00	954,140.31	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	1,250,000.00	1,589,010.37	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	700,000.00	1,027,814.13	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	600,000.00	726,135.66	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	660,000.00	973,098.72	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	300,000.00	470,714.94	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	530,000.00	762,280.98	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	410,000.00	542,159.89	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	358,753.37	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	450,000.00	531,687.01	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	446,114.49	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	200,000.00	280,825.60	
FRENCH TREASURY NOTE-2.25%-16/02/25	150,000.00	154,475.34	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	500,000.00	533,171.60	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	800,000.00	955,376.64	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	300,000.00	392,979.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	860,000.00	918,850.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	350,000.00	392,360.32	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	620,000.00	709,545.54	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	500,000.00	588,244.95	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	750,000.00	881,883.15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	270,000.00	332,882.46	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	150,000.00	160,547.14	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	520,000.00	781,259.23	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	650,000.00	923,890.95	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	150,000.00	213,297.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	670,000.00	768,712.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	500,000.00	590,331.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	200,000.00	239,305.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	250,000.00	298,844.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	350,000.00	484,650.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	350,000.00	551,607.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	300,000.00	428,950.86	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	150,000.00	191,211.94	
			76,610,000.00	91,472,681.09	
				(12,526,268,948)	
	ユーロ小計				
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-8.0%-15/12/07	200,000.00	216,745.10	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	1,110,000.00	1,178,115.48	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	1,110,000.00	1,250,828.47	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	830,000.00	939,131.22	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	650,000.00	656,976.64	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	590,000.00	685,251.48	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	570,000.00	790,832.76	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	450,000.00	505,814.17	
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	400,000.00	393,110.00	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	190,000.00	238,726.41	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	350,000.00	420,069.23	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	420,000.00	595,950.72	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	500,000.00	638,743.45	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	730,000.00	887,184.54	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	360,000.00	441,345.09	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	370,000.00	491,965.83	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	300,000.00	373,719.21	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	620,000.00	809,010.59	

		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	800,000.00	1,018,904.72	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	739,856.37	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	250,000.00	317,912.25	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	200,000.00	230,299.26	
英債券小計			11,560,000.00	13,820,492.99	(2,402,416,296)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	450,000.00	500,400.00	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	350,000.00	383,530.00	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000.00	181,524.14	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000.00	141,470.10	
スイスフラン小計			1,040,000.00	1,206,924.24	(136,985,901)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	3,460,000.00	3,635,958.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	1,500,000.00	1,752,900.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	3,100,000.00	3,896,762.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	500,000.00	516,294.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	1,100,000.00	1,454,376.00	
スウェーデンクローナ小計			9,660,000.00	11,256,290.80	(167,606,170)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	1,600,000.00	1,714,320.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	1,000,000.00	1,127,301.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	400,000.00	447,480.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,400,000.00	1,396,774.40	
ノルウェークローネ小計			4,400,000.00	4,685,875.40	(76,754,639)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	1,750,000.00	1,824,025.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	1,000,000.00	1,120,850.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000.00	2,139,660.00	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	1,950,000.00	2,283,255.00	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	650,000.00	1,034,345.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,750,000.00	4,272,537.50	
デンマーククローネ小計			9,900,000.00	12,674,672.50	(233,087,227)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	700,000.00	731,290.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,800,000.00	3,077,900.00	

		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	1,000,000.00	1,170,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,000,000.00	1,237,000.00	
ポーランドズロチ小計			5,500,000.00	6,216,490.00	(201,787,265)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	780,000.00	840,685.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	500,000.00	544,779.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,000,000.00	1,103,611.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000.00	1,128,377.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	300,000.00	354,003.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	300,000.00	351,438.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	400,000.00	383,142.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	400,000.00	452,120.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	250,000.00	240,458.75	
豪ドル小計			4,900,000.00	5,398,616.83	(513,894,336)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	450,000.00	477,649.26	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000.00	444,400.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000.00	102,729.03	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	443,587.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	146,043.72	
シンガポールドル小計			1,500,000.00	1,614,409.53	(136,772,775)
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	1,700,000.00	1,724,628.83	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000.00	2,196,130.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	600,000.00	619,520.44	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	600,000.00	586,081.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	550,000.00	569,273.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	600,000.00	586,684.84	
マレーシアリングット小計			6,200,000.00	6,282,319.31	(207,505,006)
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-18/12/21	1,500,000.00	1,549,853.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%-20/01/15	4,500,000.00	4,494,669.52	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	4,000,000.00	4,804,972.60	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	700,000.00	546,090.58	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	3,550,000.00	3,592,205.95	
南アフリカランド小計		14,250,000.00	14,987,791.90 (147,779,628)	
合計			29,318,465,837 (29,318,465,837)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 102銘柄	100.0%	39.5%
加ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 133銘柄	100.0%	42.6%
英ポンド	国債証券 22銘柄	100.0%	8.2%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.7%
豪ドル	国債証券 9銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 6銘柄	100.0%	0.7%
南アフリカランド	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2014年11月28日現在です。

【アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)】

【純資産額計算書】

資産総額	157,550,001円
負債総額	421,212円
純資産総額(-)	157,128,789円
発行済口数	121,542,959口
1口当たり純資産額(/)	1.2928円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	29,164,114,208円
負債総額	115,502,815円
純資産総額(-)	29,048,611,393円
発行済口数	24,809,919,570口
1口当たり純資産額(/)	1.1708円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	87,621,202,334円
負債総額	772,144,402円
純資産総額(-)	86,849,057,932円
発行済口数	43,494,121,572口
1口当たり純資産額(/)	1.9968円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,116,596,144円
負債総額	154,360,552円
純資産総額（ - ）	1,962,235,592円
発行済口数	1,576,605,512口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2446円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	35,244,615,616円
負債総額	160,061,116円
純資産総額（ - ）	35,084,554,500円
発行済口数	26,589,178,865口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3195円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	219,080,983,552円
負債総額	421,261,341円
純資産総額（ - ）	218,659,722,211円
発行済口数	91,894,055,577口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3795円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	33,249,042,566円
負債総額	2,274,273,143円
純資産総額（ - ）	30,974,769,423円
発行済口数	21,445,287,934口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4444円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(5) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成26年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000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：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成26年11月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、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3月31日（事業年度の終了）から3ヶ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

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。

・監査役会

当社の監査役会は5名以内の監査役で構成され、監査役の任期は選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会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。

(3) 運用の意思決定プロセス（平成26年11月末現在）

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】

- ・「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26年11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	546	106,167

株式投資信託		490	81,061
単位型		80	2,285
追加型		410	78,776
公社債投資信託		56	25,105
単位型		40	393
追加型		16	24,712
投資法人合計		1	41

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成していません。

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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第56期中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第54期 (平成25年3月31日)		第55期 (平成26年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	15,820	3	17,805
有価証券		-		234
前払費用	3	380	3	419
未収入金		4		37
未収委託者報酬		7,472		7,162
未収収益	3	342	3	608
関係会社短期貸付金		606		240
立替金		335		303
繰延税金資産		869		984
その他	2	30	2	30
流動資産合計		25,862		27,826
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	48	1	47
器具備品	1	124	1	134

有形固定資産合計	172	181
無形固定資産		
ソフトウェア	70	91
無形固定資産合計	70	91
投資その他の資産		
投資有価証券	7,170	7,290
関係会社株式	22,935	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	706	692
繰延税金資産	500	525
投資その他の資産合計	31,373	30,271
固定資産合計	31,616	30,544
資産合計	57,478	58,371

(単位：百万円)

	第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	305	329
未払金	3,862	3,404
未払収益分配金	6	6
未払償還金	115	112
未払手数料	3 3,195	3 2,743
その他未払金	545	542
未払費用	3 3,282	3 3,239
未払法人税等	589	2,286
未払消費税等	4 123	4 356
賞与引当金	1,770	1,935
役員賞与引当金	80	150
流動負債合計	10,012	11,702
固定負債		
退職給付引当金	1,001	1,081
その他	55	55
固定負債合計	1,057	1,137
負債合計	11,070	12,840
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	23,530	22,694
利益剰余金合計	23,530	22,694

自己株式	68	68
株主資本合計	46,045	45,209
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	362	321
評価・換算差額等合計	362	321
純資産合計	46,408	45,531
負債純資産合計	57,478	58,371

(2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,848	63,120
その他営業収益	1,922	2,557
営業収益合計	54,771	65,678
営業費用		
支払手数料	26,955	31,207
広告宣伝費	649	1,081
公告費	7	2
調査費	10,797	13,405
調査費	691	712
委託調査費	10,089	12,669
図書費	17	23
委託計算費	406	465
営業雑経費	530	558
通信費	188	186
印刷費	214	252
協会費	46	43
諸会費	16	11
その他	64	65
営業費用計	39,347	46,721
一般管理費		
給料	6,759	7,171
役員報酬	256	316
役員賞与引当金繰入額	80	150
給料・手当	4,565	4,719
賞与	87	50
賞与引当金繰入額	1,770	1,935
交際費	100	108
寄付金	66	54
旅費交通費	313	448
租税公課	188	209
不動産賃借料	753	755
退職給付費用	312	313
退職金	83	32
固定資産減価償却費	124	109
諸経費	3,061	3,364
一般管理費計	11,764	12,568
営業利益	3,659	6,388

	第54期		第55期	
	(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)		(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	
(単位：百万円)				
営業外収益				
受取利息		12		17
受取配当金	1	601	1	1,774
時効成立分配金・償還金		4		4
為替差益		64		26
その他		16		19
営業外収益合計		699		1,842
営業外費用				
支払利息		19		19
有価証券償還損		1		-
時効成立後支払分配金・償還金		15		22
支払源泉所得税		55		57
その他		2		13
営業外費用合計		93		114
経常利益		4,265		8,116
特別利益				
投資有価証券売却益		226		135
関係会社株式売却益		239		-
特別利益合計		465		135
特別損失				
投資有価証券売却損		84		12
関係会社株式評価損		-		4,500
固定資産処分損		3		0
割増退職金		-		59
役員退職一時金		75		235
特別損失合計		163		4,807
税引前当期純利益		4,568		3,445
法人税、住民税及び事業税		1,480		3,020
法人税等調整額		260		119
法人税等合計		1,740		2,900
当期純利益		2,827		544

(3) 【株主資本等変動計算書】

第54期（自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		

当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,172	22,172	68	44,687
当期変動額							
剰余金の配当				1,468	1,468		1,468
当期純利益				2,827	2,827		2,827
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	1,358	1,358	-	1,358
当期末残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	42	42	44,729
当期変動額			
剰余金の配当			1,468
当期純利益			2,827
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	320	320	320
当期変動額合計	320	320	1,678
当期末残高	362	362	46,408

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余 金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評 価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876

当期末残高	321	321	45,531
-------	-----	-----	--------

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(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</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(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とおりであります。 建物 3年～5年 器具備品 4年～20年</p> <p>(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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 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)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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>

(表示方法の変更)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。)を当事業年度より適用し(ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。)、(退職給付関係)注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、(退職給付関係)の注記の組替えは行っていません。

(貸借対照表関係)

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,054百万円 器具備品 618百万円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,091百万円 器具備品 625百万円
2 信託資産 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、野村信託銀行株式会社に信託しております。	2 信託資産 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、野村信託銀行株式会社に信託しております。
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。 (流動資産) 現金・預金 3,818百万円 前払費用 2百万円 未収収益 58百万円 (流動負債) 未払手数料 143百万円 未払費用 297百万円	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。 (流動資産) 現金・預金 6,249百万円 前払費用 2百万円 未収収益 74百万円 (流動負債) 未払手数料 98百万円 未払費用 274百万円
4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd 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87百万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243百万円に対して保証を行っております。	5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd 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65百万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159百万円に対して保証を行っております。

(損益計算書関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
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。 受取配当金 552百万円	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。 受取配当金 1,290百万円

(株主資本等変動計算書関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

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)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	6,091,800	-	161,700	5,930,100	-
合計		32,249,300	-	2,448,600	29,800,700	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23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。

2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。

3 平成21年度ストックオプション(1)13,625,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23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24年5月28日取締役会	普通株式	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19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翌事業年度となるもの

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25年5月27日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

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)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	16,978,500	-	1,075,800	15,902,700	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	59,400	1,567,500	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,930,100	-	541,200	5,388,900	-
合計		29,800,700	-	1,676,400	28,124,300	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23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。

2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。

3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株及び平成23年度ストックオプション(1)2,887,500株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

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25年5月27日取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18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翌事業年度となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
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		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	
1年内	750百万円	1年内	751百万円
1年超	807百万円	1年超	77百万円
合計	1,558百万円	合計	828百万円

（金融商品関係）

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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25年3月31日（当事業年度の決算日）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、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額

(1) 現金・預金	15,820	15,820	-
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	-
(3) 未収収益	342	342	-
(4) 投資有価証券			
其他有価証券	7,091	7,091	-
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	-
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	-

()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・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

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フロー

を見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,042百万円）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、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表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・預金	15,820	-	-	-
未収委託者報酬	7,472	-	-	-
未収収益	342	-	-	-
投資有価証券				
投資信託	-	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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せす。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26年3月31日（当事業年度の決算日）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、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金・預金	17,805	17,805	-
(2) 未収委託者報酬	7,162	7,162	-
(3) 未収収益	608	608	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,457	7,457	-
(5) 未払金	(3,404)	(3,404)	-
(6) 未払費用	(3,239)	(3,239)	-

()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・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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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。

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額66百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 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18,809百万円）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、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表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・預金	17,805	-	-	-
未収委託者報酬	7,162	-	-	-
未収収益	608	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	234	315	1,166	973
合計	25,811	315	1,166	973

（有価証券関係）

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

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	投資信託	6,366	5,708	658
	小計	6,366	5,708	658
貸借対照表計上額が 取得原価を超えない もの	投資信託	724	821	96
	小計	724	821	96
合計		7,091	6,529	561

(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 79百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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	43	35	67
投資信託	1,099	190	17
合計	1,143	226	84

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

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	投資信託	3,819	3,188	631
	小計	3,819	3,188	631
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,637	3,768	130
	小計	3,637	3,768	130
合計		7,457	6,957	500

(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 66百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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	23	11	-
投資信託	1,734	124	12
合計	1,758	135	12

(持分法損益等)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26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)	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 3,069	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,065
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 7,660
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,379

(退職給付関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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。

2 退職給付債務に関する事項

(単位：百万円)

イ 退職給付債務	1,101
ロ 未積立退職給付債務	1,101
ハ 未認識数理計算上の差異	99
ニ 退職給付引当金残高	1,001

3 退職給付費用に関する事項

(単位：百万円)

イ 勤務費用	102
ロ 利息費用	13
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171
ホ 退職給付費用合計	312

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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	0.9%
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	1,101	百万円
勤務費用	110	"
利息費用	9	"
数理計算上の差異の発生額	9	"
退職給付の支払額	56	"
退職給付債務の期末残高	1,174	"

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,174	百万円
未積立退職給付債務	1,174	"
未認識数理計算上の差異	92	"
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

退職給付引当金	1,081	百万円
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	110	百万円
利息費用	9	"
数理計算上の差異の費用処理額	16	"
確定給付制度に係る退職給付費用	137	"

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.8%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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21年度ストックオプション(1)	平成21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 271名	当社及び関係会社 の取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
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	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社 の取締役・従業員 186名

株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
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	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	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) スtock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21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,215,900	1,676,400
付与	0	0
失効	2,237,400	49,500
権利確定	0	0
権利未確定残	16,978,500	1,626,900
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22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
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) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注) 3
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

(注) 1 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。

- 2 スtock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
- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第55期(自 平成25年 4月 1日 至 平成26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21年度ストックオプション(1)	平成21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 271名	当社及び関係会社の取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
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	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
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	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	平成25年10月7日から平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtock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21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
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22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
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。

単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注)3
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

(注)1 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。

2 スtock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

3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
----------------------	----------------------

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">672</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">196</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">869</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">149</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">361</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">174</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">75</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">760</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計 1,630</p> <p>評価性引当金 61</p> <p>繰延税金資産合計 <u>1,568</u></p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">199</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">199</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額 <u>1,369</u></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>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	賞与引当金繰入超過額	672	その他	196	小計	869	投資有価証券評価損	149	退職給付引当金超過額	361	固定資産減価償却超過額	174	その他	75	小計	760	その他有価証券評価差額金	199	繰延税金負債合計	199	<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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">689</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">294</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">984</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">148</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">1,665</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">385</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">158</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">34</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,391</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計 3,375</p> <p>評価性引当金 1,665</p> <p>繰延税金資産合計 <u>1,710</u></p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">200</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">200</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額 <u>1,510</u></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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">38.0%</td> </tr> <tr> <td>(調整)</td> <td></td> </tr> <tr> <td>評価性引当金の増減</td> <td style="text-align: right;">46.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.7%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">12.9%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">1.9%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">6.9%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">84.2%</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	689	その他	294	小計	984	投資有価証券評価損	148	関係会社株式評価損	1,665	退職給付引当金超過額	385	固定資産減価償却超過額	158	その他	34	小計	2,391	その他有価証券評価差額金	200	繰延税金負債合計	200	法定実効税率	38.0%	(調整)		評価性引当金の増減	46.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%	海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%
賞与引当金繰入超過額	672																																																										
その他	196																																																										
小計	869																																																										
投資有価証券評価損	149																																																										
退職給付引当金超過額	361																																																										
固定資産減価償却超過額	174																																																										
その他	75																																																										
小計	760																																																										
その他有価証券評価差額金	199																																																										
繰延税金負債合計	199																																																										
賞与引当金繰入超過額	689																																																										
その他	294																																																										
小計	984																																																										
投資有価証券評価損	148																																																										
関係会社株式評価損	1,665																																																										
退職給付引当金超過額	385																																																										
固定資産減価償却超過額	158																																																										
その他	34																																																										
小計	2,391																																																										
その他有価証券評価差額金	200																																																										
繰延税金負債合計	200																																																										
法定実効税率	38.0%																																																										
(調整)																																																											
評価性引当金の増減	46.6%																																																										
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%																																																										
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%																																																										
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%																																																										
海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%																																																										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%																																																										

	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。</p>
--	--

(関連当事者情報)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	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)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD 8,000)	関係会社短期貸付金	606 (千SGD 8,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD 76)	未収収益	5 (千SGD 76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

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

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(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24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で円貨に換算したものであります。

資産合計	10,930百万円
負債合計	1,103百万円

純資産合計	9,826百万円
営業収益	7,917百万円
税引前当期純利益	2,801百万円
当期純利益	2,091百万円

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26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

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	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)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	398 (千 SGD 5,059) (注2)	関係会社 短期貸付金	240 (千 SGD 2,940)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	15 (千 SGD 192)	未収収益	5 (千 SGD 64)
							増資の引受(注3)	3,266 (千 SGD 40,000)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額 398百万円(5,059千 SGD)の内訳は、貸付240百万円(2,940千 SGD)及び返済 638百万円(8,000千 SGD)であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った40,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

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

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(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(ロンドン)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25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で円貨に換算したものであります。

資産合計	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円

営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しておりません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しておりません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	235円69銭	231円23銭
1株当たり当期純利益金額	14円35銭	2円76銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、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。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
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金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 16,978,500株、平成21年度ストックオプション(2) 1,626,900株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,930,100株	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	46,408	45,531

純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	46,408	45,531
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,789
有価証券		226
未収委託者報酬		6,584
未収収益		938
関係会社短期貸付金		258
繰延税金資産		487
その他	2	2,365
流動資産合計		26,649
固定資産		
有形固定資産	1	235
無形固定資産		92
投資その他の資産		
投資有価証券		9,667
関係会社株式		21,702
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		683
繰延税金資産		357
投資その他の資産合計		32,471
固定資産合計		32,799
資産合計		59,448

(単位:百万円)

		第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		3,203

未払費用		3,470
未払法人税等		871
未払消費税等	3	550
賞与引当金		875
役員賞与引当金		120
その他		671
流動負債合計		9,763
固定負債		
退職給付引当金		1,071
固定負債合計		1,071
負債合計		10,834
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		25,511
利益剰余金合計		25,511
自己株式		68
株主資本合計		48,026
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		587
評価・換算差額等合計		587
純資産合計		48,614
負債純資産合計		59,448

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		30,757
その他営業収益		1,678
営業収益合計		32,435
営業費用及び一般管理費	1	29,279
営業利益		3,156
営業外収益	2	862
営業外費用	3	86
経常利益		3,931
特別利益	4	174
特別損失	5	3
税引前中間純利益		4,102

法人税、住民税及び事業税	831
法人税等調整額	495
中間純利益	2,775

(3) 中間株主資本等変動計算書

第56期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による 累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当中間期変動額							
剰余金の配当							
中間純利益				2,775	2,775		2,775
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）							
当中間期変動額合計	-	-	-	2,775	2,775	-	2,775
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	25,511	25,511	68	48,026

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	321	321	45,531
会計方針の変更による 累積的影響額			41
会計方針の変更を反映した 当期首残高	321	321	45,572
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			2,775
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	265	265	265
当中間期変動額合計	265	265	3,041
当中間期末残高	587	587	48,614

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 中間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)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 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)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の日から費用処理しております。</p>
4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>

（会計方針の変更）

<p>第56期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)</p>

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。)を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益金額に対する影響額は、軽微であります。

(中間貸借対照表関係)

第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,750百万円
2	信託資産 その他流動資産のうち180百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd 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47百万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113百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 50百万円 無形固定資産 16百万円
2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 3百万円 受取配当金 761百万円
3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 10百万円 時効成立後支払分配金・償還金 4百万円 支払源泉所得税 71百万円
4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 174百万円
5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 3百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第56期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

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)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	-	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	-	1,567,500	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,388,900	-	330,000	5,058,900	-
合計		28,124,300	-	330,000	27,794,300	-

(注) 1 平成23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。

2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当中間会計期間末の発行済株式に基づき算出しております。

3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、平成23年度ストックオプション(1)2,887,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
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	
1年内	766百万円
1年超	3,502百万円
合計	4,268百万円

（金融商品関係）

第56期中間会計期間(平成26年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成26年9月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	15,789	15,789	-
(2) 未収委託者報酬	6,584	6,584	-
(3) 未収収益	938	938	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	9,864	9,864	-
(5) 未払金	(3,203)	(3,203)	-
(6) 未払費用	(3,470)	(3,470)	-

()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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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。

2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額30百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

（有価証券関係）

第56期中間会計期間(平成26年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	8,573	7,543	1,029
	小計	8,573	7,543	1,029
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,291	1,407	116
	小計	1,291	1,407	116
合計		9,864	8,951	913

(注) 1 減損処理にあたっては、中間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。当中間会計期間については、該当ございません。

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額 30百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(持分法損益等)

第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,075百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,780百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	762百万円

(ストックオプション等関係)

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第56期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1株当たり純資産額	246円89銭
1株当たり中間純利益金額	14円09銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等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。

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益(百万円)	2,775
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	2,775
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1)5,058,900株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第56期中間会計期間 (平成26年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	48,614

純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	48,614
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）、（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

（1）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（2）訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名 称	資本金の額 (平成26年3月末現在)	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26年3月末現在)	事業の内容
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	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。
株式会社S B I証券	47,937百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
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	22,700百万円	
ソニー銀行株式会社 1	31,000百万円	
株式会社第三銀行 1	37,461百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社もみじ銀行	87,465百万円	
株式会社琉球銀行 1	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 1	70,000百万円	

1 募集の取扱いを行いません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。

(2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

(3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法(ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど)についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用がない旨の記載。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

平成26年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
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25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年12月3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 鶴田 光夫
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、「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25年10月29日から平成26年10月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の平成26年10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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

- (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. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。