

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年 1月26日
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	犬伏 貴民
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	継続募集額 上限5兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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60）（以下「ファンド」といいます。）
- ・愛称として「Aナビ60」、「ステージ2」、「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。）
- ・格付は取得しておりません。

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1.05%（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22年1月27日から平成23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。

(10) 【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。

(11) 【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。

(12) 【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

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。

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	グローバル (含む日本)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
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)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
不動産投信		アフリカ		
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)))		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ないます。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）

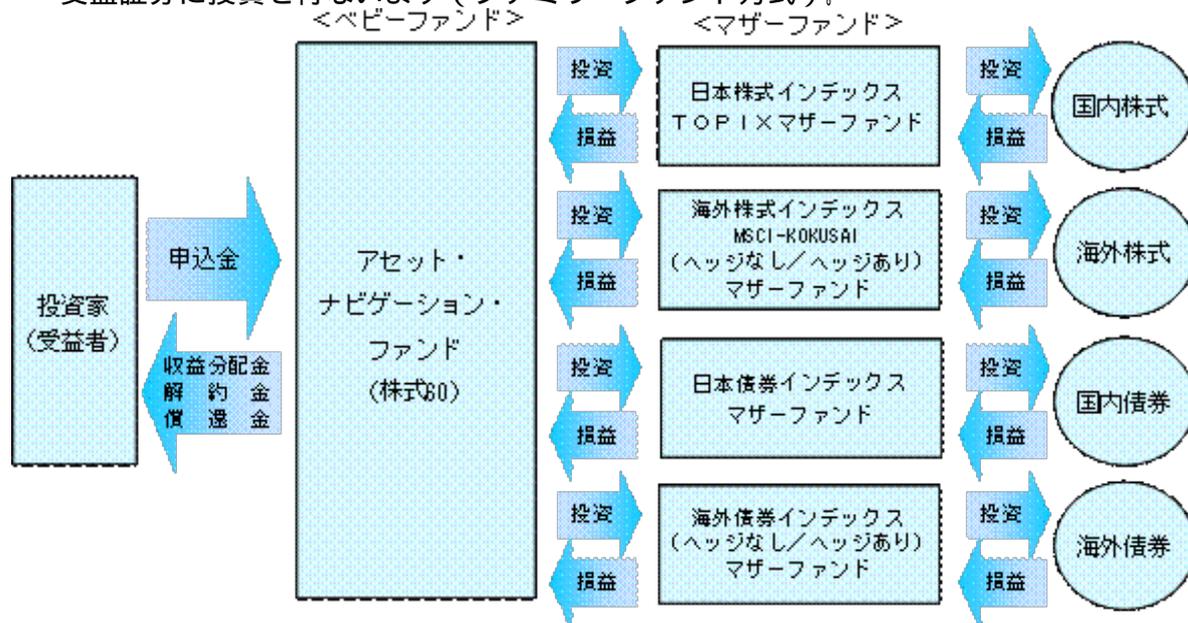
目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。

上記は、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、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。

- ・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。
- ・主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資するマザーファンド受益証券に投資を行ないます（ファミリーファンド方式）。



ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンド受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

2) 株式に60%、債券などに40%投資します。

- ・標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%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受益証券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。

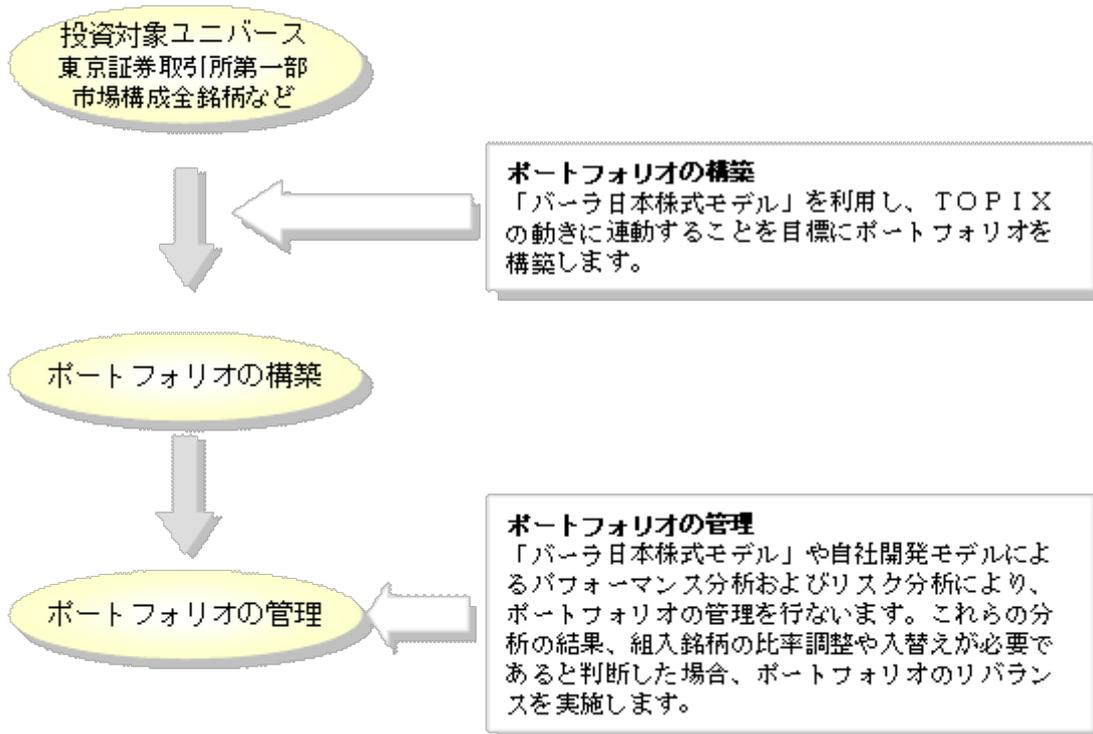
投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	7.5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	7.5%
日本債券インデックスマザーファンド	25%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	5%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

- ・なお、上記の基本投資比率からカイ離した場合は、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。

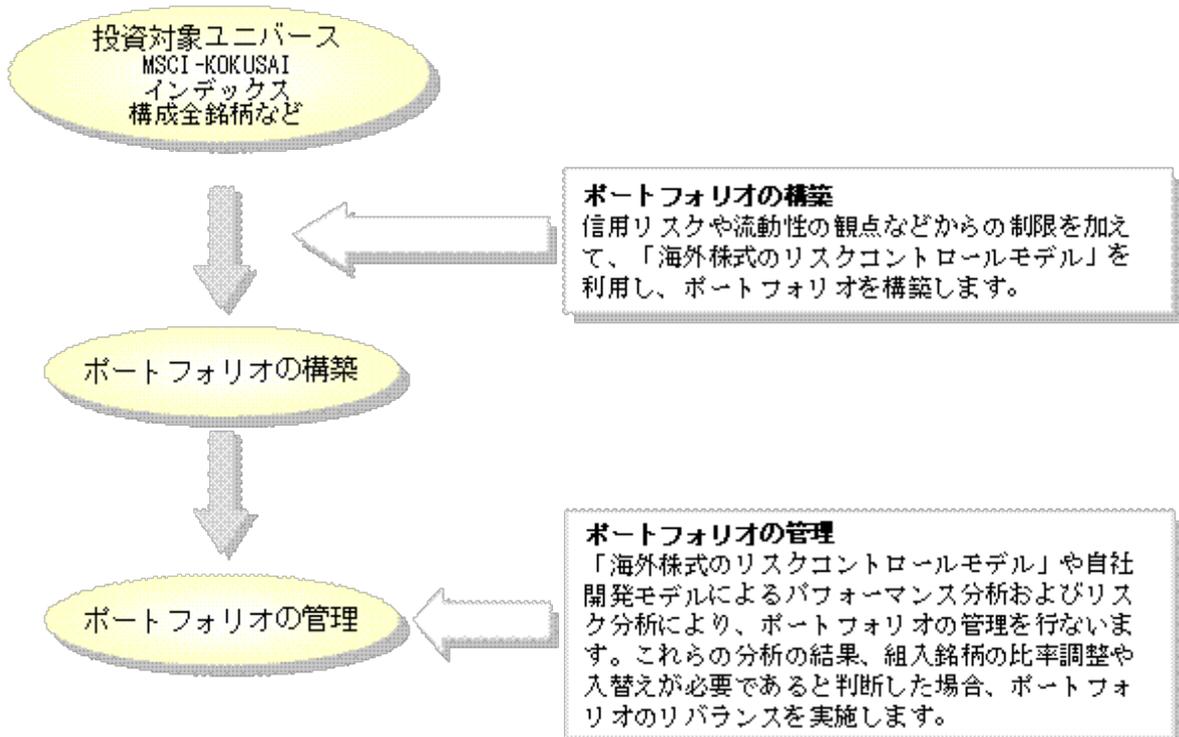
市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の運用プロセス



上記は本書提出日現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

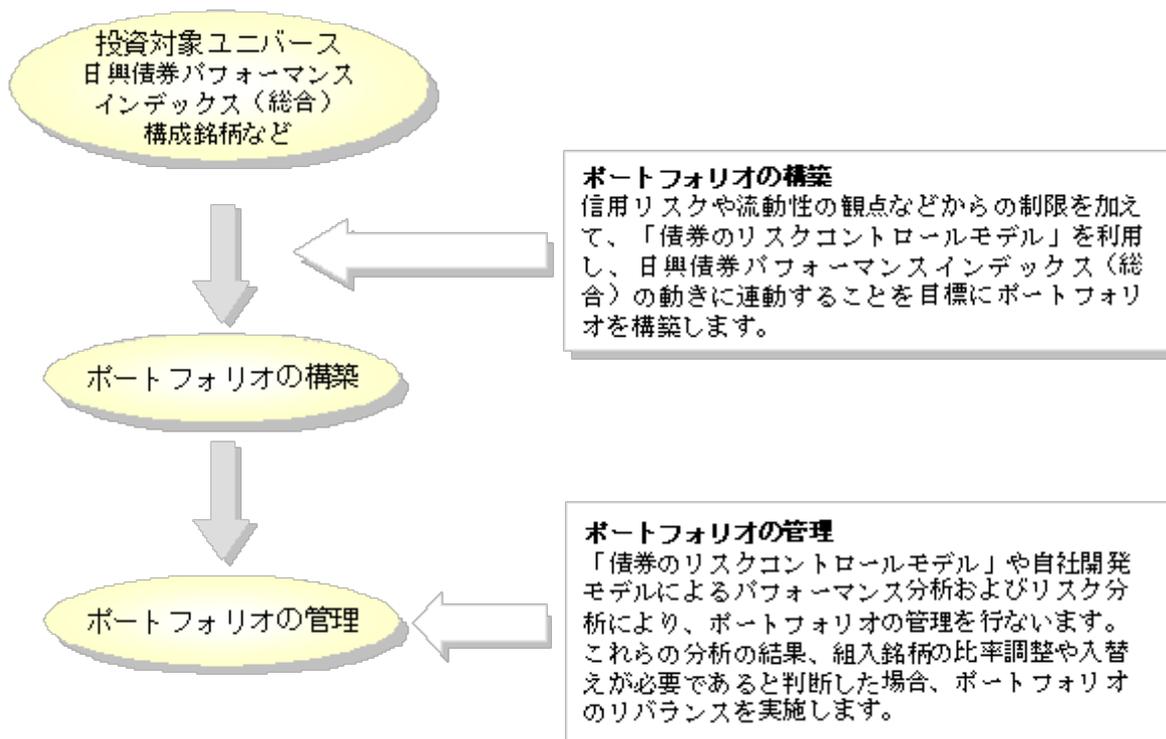
「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」の運用プロセス



※「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」において、外貨建資産については、原則フルヘッジとします。

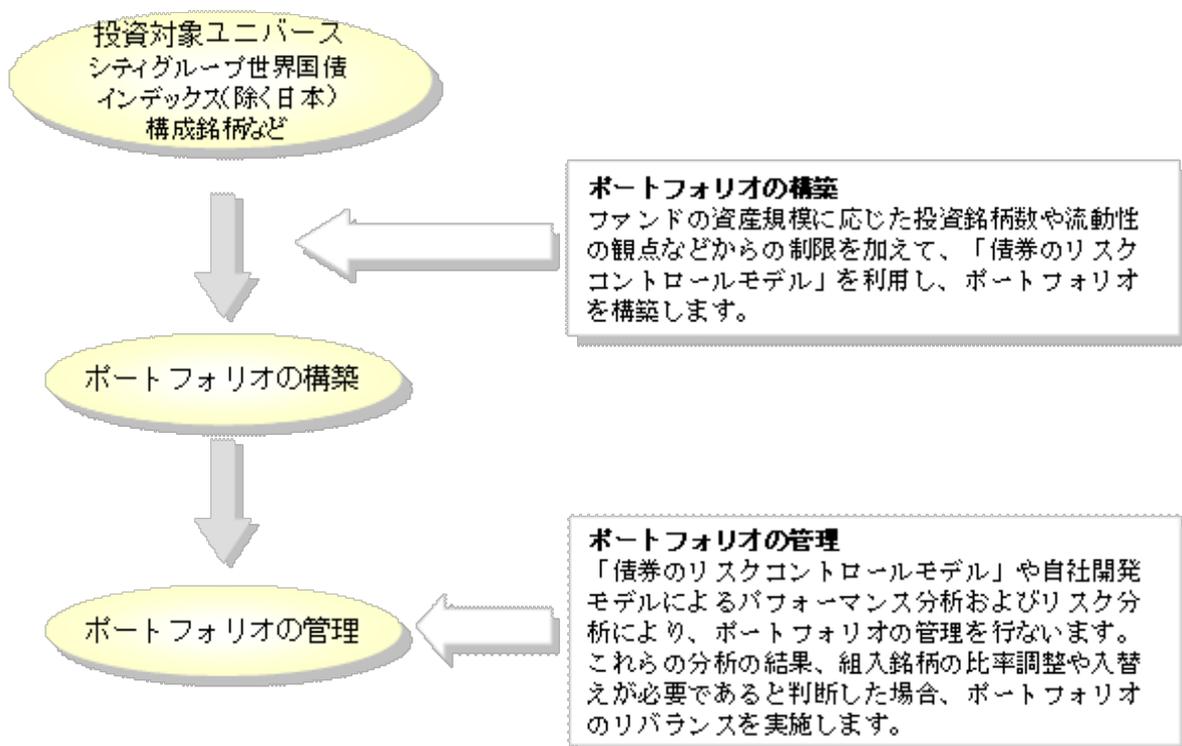
上記は本書提出日現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

「日本債券インデックスマザーファンド」の運用プロセス



上記は本書提出日現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」の運用プロセス



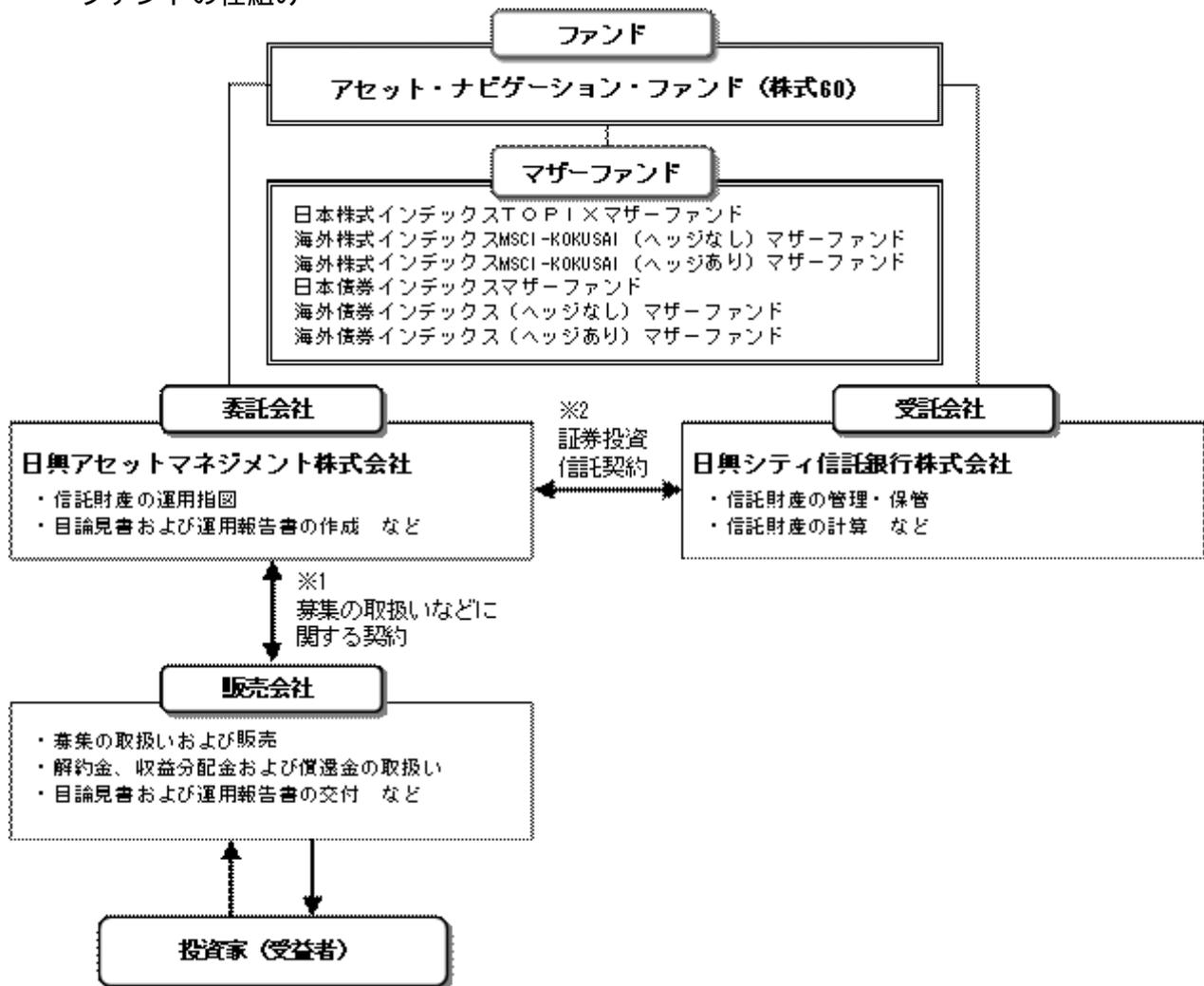
※「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」において、外貨建資産については、原則フルヘッジとします。

上記は本書提出日現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

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。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。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21年12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
住友信託銀行株式会社	大阪府大阪市中央区北浜四丁目5番33号	194,152,500株	98.54%

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.....60%
 - 公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....40%
- ・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。
- ・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60）＞

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、）
- 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。）

- 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
 - 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) 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、)。
- 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、)。
- 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、)。
- 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、)。
- 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せん。)

- 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せん。）
- 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) 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券（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せん。）
- 15) 預託証券（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券
- 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、）
- 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、）
- 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す。）
- 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ません。)
- 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。)

- 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。))に限りません。)
- 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せん。)
- 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、）
- 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、）
 - 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、）
 - 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、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。 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。
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	日興シティ信託銀行株式会社
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）

* TOPIX（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。

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。

< 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（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。
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	日興シティ信託銀行株式会社
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（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。
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	日興シティ信託銀行株式会社
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す。
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。
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	日興シティ信託銀行株式会社
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、格付機関から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日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル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、シティグループ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、シティグループ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。
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	日興シティ信託銀行株式会社
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）

*シティグループ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 >

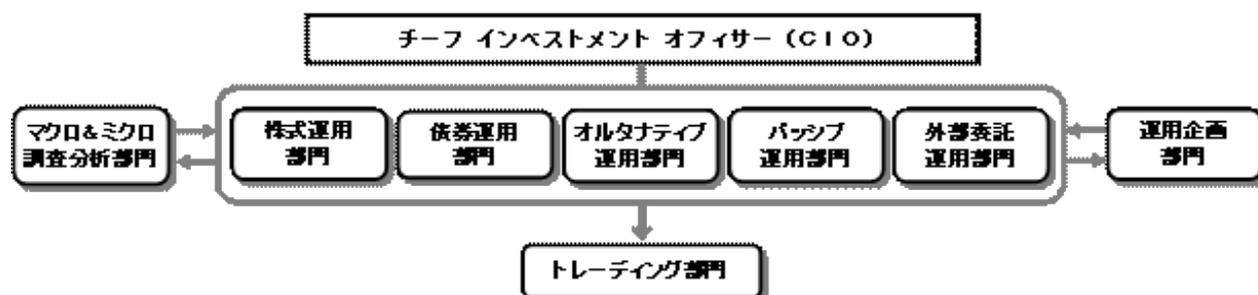
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債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割合には、制限を設けません。
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	日興シティ信託銀行株式会社
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）

^{*}シティグループ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。

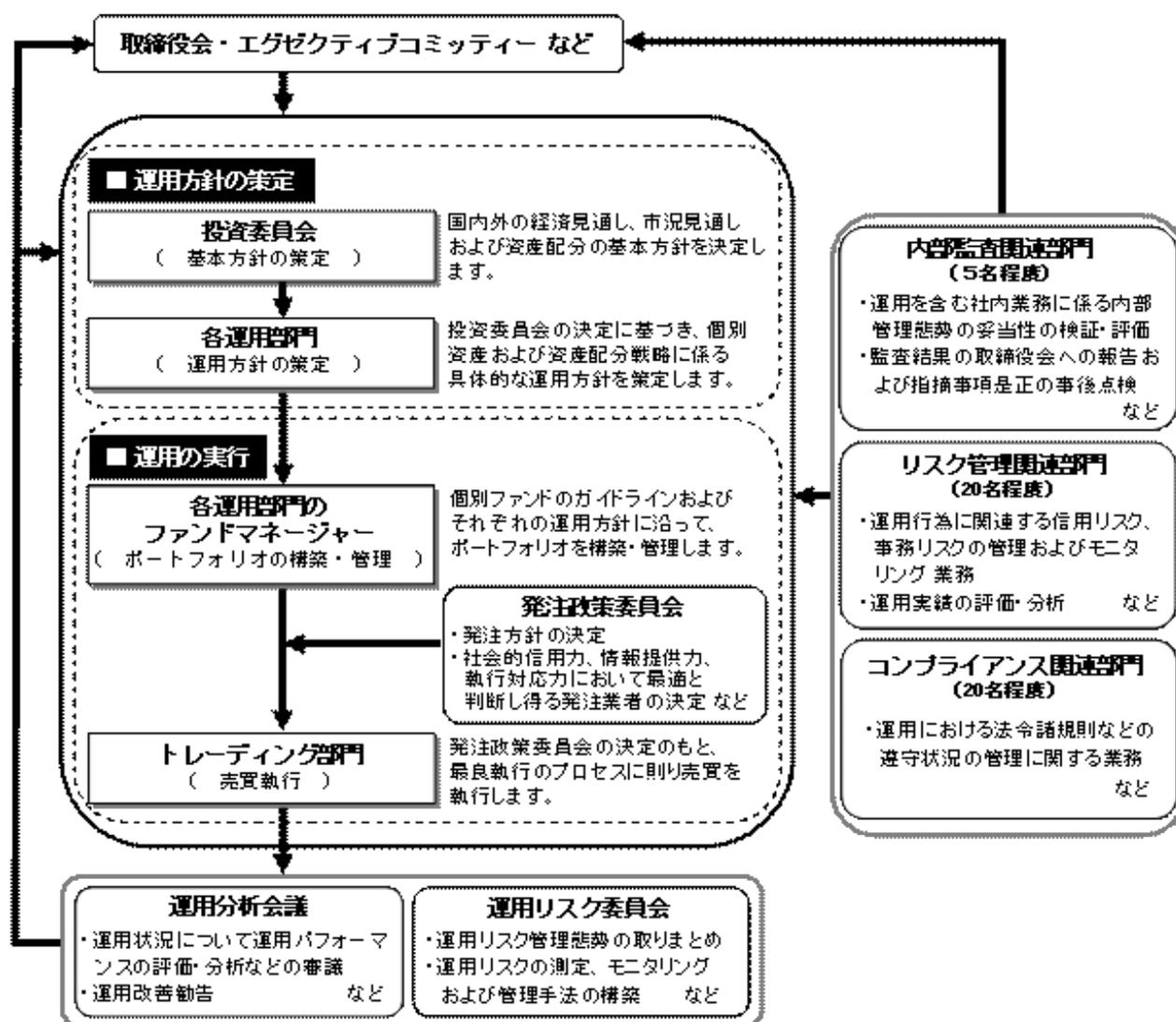
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、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ないます。

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60）>

- 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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- 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、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 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
 - ニ) 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支弁される日からその翌営業日までとします。

<日本株式インデックストップIX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。

< 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。

< 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。

< 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。

< 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。

< 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。

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（マザーファンドを含みます。）は、主に株式および債券など値動きのある証券（外貨建証券は為替変動リスクもあります。）を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・当ファンドは、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ありません。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りません。
- ・信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

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、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。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、その価格変動は、残存期間・発行条件などによりばらつきがあります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、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。
- ・一般に公社債および短期金融資産にデフォルト（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は下落（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。

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いませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、ヘッジコストが発生します。また、為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。なお、ヘッジコストとは、為替ヘッジを行なう通貨の金利と円の金利の差に相当し、円の金利の方が低い場合には、この金利差の分だけ収益が低下することになります。

<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閉鎖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。また、一時的に取得・換金ができなくなることもあります。

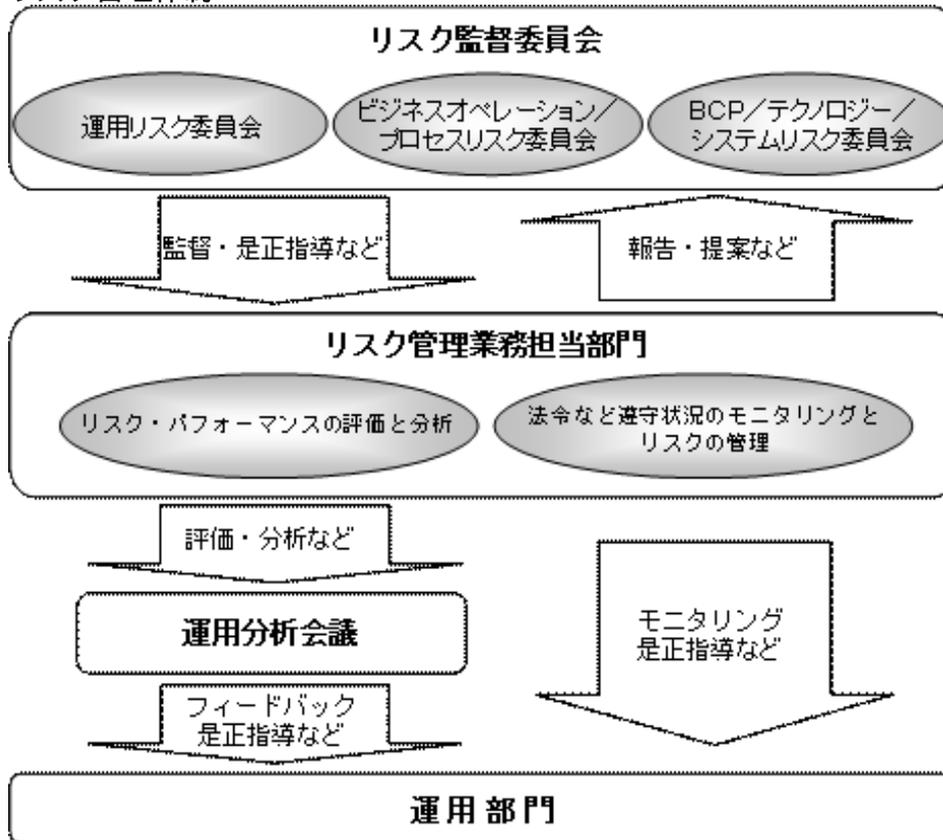
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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証券を大量に売却することがあります。その際に基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・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

**全体的リスク管理**

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

リスク・パフォーマンスの評価と分析

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

法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

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

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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1.05%（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ことができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(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0.25%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0.71925%（税抜0.685%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.71925% (0.685%)	0.25200% (0.240%)	0.42000% (0.400%)	0.04725% (0.045%)

括弧内は税抜です。

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0.0084%（税抜0.008%）以内の率を乗じて得た額とします。

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

* 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】

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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）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のいずれかを選択することもできます。

- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。
- 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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）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、10%（所得税7%および地方税3%）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す。）を控除した利益
 - ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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、）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、）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。

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、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、7%（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。
 - ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の7%の税率は15%（所得税のみ）となる予定です。
- 2) 益金不算入制度の適用
 - 益金不算入制度は適用されません。

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

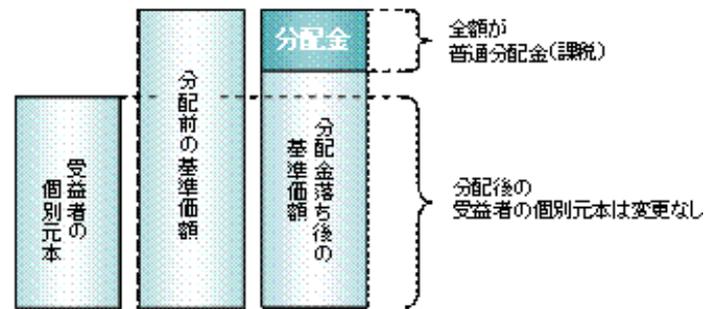
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と特別分配金

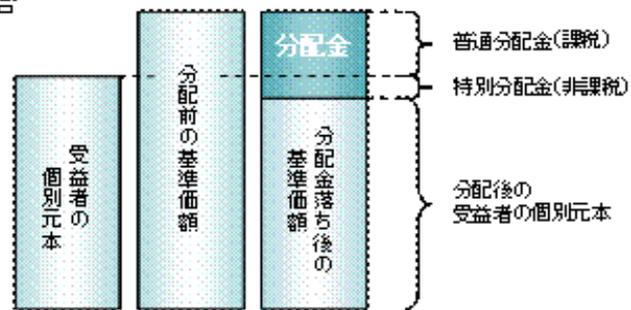
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
 - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本か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



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。

5【運用状況】

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

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

(1)【投資状況】

投資資産の種類	時価（千円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	247,394	95.15
日本	247,394	95.15
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	12,609	4.85
純資産総額	260,004	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

<親投資信託受益証券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	日本株式インデックスTOPIX マザーファンド	176,600,194	0.6773 0.6656	119,611,312 117,545,089	45.21
日本円 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	55,149,932	1.1683 1.1694	64,431,647 64,492,330	24.80
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA1（ヘッ ジなし）マザーファンド	23,048,148	0.8835 0.8592	20,363,039 19,802,968	7.62
日本円 日本	親投資信託受益証券 -	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA1（ヘッ ジあり）マザーファンド	28,600,875	0.6943 0.6818	19,857,587 19,500,076	7.50
日本円 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	8,251,975	1.6139 1.5962	13,317,862 13,171,802	5.07
日本円 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	10,919,833	1.1780 1.1797	12,863,593 12,882,126	4.95

ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.15
合計	95.15

【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	1口当たりの純資産額（円）		純資産総額（百万円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
設 定 時（1999年10月29日）	1.0000	1.0000	10	10
第1計算期間末（2000年10月26日）	0.9659	0.9659	10	10
第2計算期間末（2001年10月26日）	0.8739	0.8739	33	33
第3計算期間末（2002年10月28日）	0.7783	0.7783	100	100
第4計算期間末（2003年10月27日）	0.8557	0.8557	156	156
第5計算期間末（2004年10月26日）	0.8948	0.8948	215	215
第6計算期間末（2005年10月26日）	1.0450	1.0460	254	254
第7計算期間末（2006年10月26日）	1.1655	1.1665	349	349
第8計算期間末（2007年10月26日）	1.1685	1.1695	307	307
第9計算期間末（2008年10月27日）	0.7633	0.7633	209	209
第10計算期間末（2009年10月26日）	0.8967	0.8967	263	263

	1口当たりの純資産額（円）	純資産総額（百万円）
2008年10月末日	0.8334	227
2008年11月末日	0.8146	222
2008年12月末日	0.8268	229
2009年1月末日	0.7869	219
2009年2月末日	0.7675	213
2009年3月末日	0.7858	220
2009年4月末日	0.8287	234
2009年5月末日	0.8607	245
2009年6月末日	0.8792	252
2009年7月末日	0.8971	259
2009年8月末日	0.9097	265
2009年9月末日	0.8920	261
2009年10月末日	0.8862	260

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間（1999年10月29日～2000年10月26日）	3.41
第2計算期間（2000年10月27日～2001年10月26日）	9.52
第3計算期間（2001年10月27日～2002年10月28日）	10.94
第4計算期間（2002年10月29日～2003年10月27日）	9.94
第5計算期間（2003年10月28日～2004年10月26日）	4.57
第6計算期間（2004年10月27日～2005年10月26日）	16.90
第7計算期間（2005年10月27日～2006年10月26日）	11.63
第8計算期間（2006年10月27日～2007年10月26日）	0.34
第9計算期間（2007年10月27日～2008年10月27日）	34.68
第10計算期間（2008年10月28日～2009年10月26日）	17.48

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

[次へ](#)

(参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	31,433,496	99.01
日本	31,433,496	99.01
新株予約権証券	108	0.00
日本	108	0.00
有価証券指数等先物取引(買建)	(321,840)	(1.01)
日本	(321,840)	(1.01)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	314,169	0.99
純資産総額	31,747,774	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

< 株式 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	株式 輸送用機器	トヨタ自動車	368,300	3,646 3,660	1,342,643,200 1,347,978,000	4.25
日本円 日本	株式 銀行業	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,658,800	471 495	781,124,900 821,106,000	2.59
日本円 日本	株式 輸送用機器	ホンダ	228,600	2,900 2,880	662,923,772 658,368,000	2.07
日本円 日本	株式 電気機器	キヤノン	166,200	3,640 3,530	605,005,600 586,686,000	1.85
日本円 日本	株式 銀行業	三井住友フィナンシャルグループ	145,000	3,140 3,160	455,290,063 458,200,000	1.44
日本円 日本	株式 銀行業	みずほフィナンシャルグループ	2,297,000	173 183	396,592,400 420,351,000	1.32
日本円 日本	株式 情報・通信業	日本電信電話	111,500	3,770 3,750	420,351,468 418,125,000	1.32
日本円 日本	株式 卸売業	三菱商事	211,400	2,066 1,977	436,739,500 417,937,800	1.32
日本円 日本	株式 電気機器	ソニー	143,100	2,715 2,785	388,514,518 398,533,500	1.26
日本円 日本	株式 医薬品	武田薬品工業	105,500	3,605 3,650	380,372,200 385,075,000	1.21
日本円 日本	株式 電気・ガス業	東京電力	168,600	2,235 2,225	376,813,625 375,135,000	1.18
日本円 日本	株式 その他製品	任天堂	15,100	24,456 23,180	369,292,000 350,018,000	1.10
日本円 日本	株式 電気機器	パナソニック	262,000	1,257 1,292	329,327,625 338,504,000	1.07
日本円 日本	株式 証券・商品先物取引業	野村ホールディングス	512,500	654 655	335,152,400 335,687,500	1.06
日本円 日本	株式 電気機器	東芝	604,000	554 530	334,824,000 320,120,000	1.01
日本円 日本	株式 情報・通信業	NTTドコモ	2,347	132,498 131,900	310,973,429 309,569,300	0.98
日本円 日本	株式 陸運業	東日本旅客鉄道	49,900	6,230 5,810	310,866,154 289,919,000	0.91
日本円 日本	株式 卸売業	三井物産	227,900	1,307 1,223	297,846,361 278,721,700	0.88
日本円 日本	株式 鉄鋼	新日本製鐵	788,000	353 353	278,229,000 278,164,000	0.88
日本円 日本	株式 不動産業	三菱地所	186,000	1,424 1,404	264,818,500 261,144,000	0.82
日本円 日本	株式 保険業	東京海上ホールディングス	107,500	2,380 2,385	255,843,046 256,387,500	0.81
日本円 日本	株式 情報・通信業	ソフトバンク	115,700	2,209 2,175	255,546,100 251,647,500	0.79
日本円 日本	株式 小売業	セブン&アイ・ホールディングス	113,000	2,047 2,005	231,269,000 226,565,000	0.71
日本円 日本	株式 機械	コマツ	124,500	1,878 1,818	233,800,362 226,341,000	0.71
日本円 日本	株式 化学	信越化学工業	46,200	5,310 4,890	245,322,000 225,918,000	0.71

日本円 日本	株式 輸送用機器	日産自動車	321,900	676 672	217,598,320 216,316,800	0.68
日本円 日本	株式 電気・ガス業	関西電力	110,500	1,986 1,957	219,448,688 216,248,500	0.68
日本円 日本	株式 電気機器	ファナック	27,700	8,135 7,710	225,344,000 213,567,000	0.67
日本円 日本	株式 情報・通信業	KDDI	439	481,908 484,000	211,557,491 212,476,000	0.67
日本円 日本	株式 医薬品	アステラス製薬	59,400	3,580 3,370	212,628,320 200,178,000	0.63

<新株予約権証券>

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	新株予約権証券 -	DOWAホールディングス(新株予約 権)	4,000	28 27	112,000 108,000	0.00

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
株式	99.01
電気機器	14.30
輸送用機器	10.11
銀行業	9.48
化学	5.72
情報・通信業	5.54
電気・ガス業	4.96
卸売業	4.82
機械	4.56
医薬品	4.30
陸運業	3.89
小売業	3.58
食料品	3.39
鉄鋼	2.61
不動産業	2.39
その他製品	2.23
保険業	2.09
建設業	1.99
証券、商品先物取引業	1.89
サービス業	1.62
精密機器	1.53
非鉄金属	1.25
ガラス・土石製品	1.17
繊維製品	0.92
石油・石炭製品	0.71
金属製品	0.67
ゴム製品	0.59
その他金融業	0.57
海運業	0.50
空運業	0.45
鉱業	0.45
パルプ・紙	0.40
倉庫・運輸関連業	0.23
水産・農林業	0.11
新株予約権証券	0.00
合計	99.01

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
< 有価証券指数等先物取引 >

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
日本	東証株価指数先物 2009 - 12	買建	36	330,279,778	321,840,000	1.01
	合計		-	330,279,778	321,840,000	1.01

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

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	67,684,659	96.85
アメリカ	35,473,638	50.76
イギリス	7,548,449	10.80
フランス	3,702,460	5.30
カナダ	3,441,300	4.92
スイス	3,008,904	4.31
ドイツ	2,941,909	4.21
オーストラリア	2,770,401	3.96
スペイン	1,750,733	2.51
イタリア	1,297,477	1.86
スウェーデン	936,284	1.34
オランダ	901,179	1.29
香港	834,293	1.19
シンガポール	476,079	0.68
フィンランド	430,061	0.62
ベルギー	354,408	0.51
アイルランド	319,255	0.46
デンマーク	318,950	0.46
ノルウェー	253,930	0.36
ギリシャ	234,873	0.34
ルクセンブルグ	188,608	0.27
オーストリア	121,741	0.17
バミューダ諸島	111,945	0.16
ポルトガル	104,483	0.15
ジャージー	94,904	0.14
ニュージーランド	28,489	0.04
キプロス	17,591	0.03
ケイマン諸島	16,949	0.02
中国	5,353	0.01
新株予約権証券	0	0.00
イタリア	0	0.00
投資証券	932,399	1.33
アメリカ	440,905	0.63
オーストラリア	140,635	0.20
イギリス	109,267	0.16
フランス	99,173	0.14
カナダ	96,569	0.14
香港	19,246	0.03
オランダ	13,949	0.02
シンガポール	12,652	0.02
有価証券指数等先物取引(買建)	(1,268,095)	(1.81)
アメリカ	(752,313)	(1.08)
ドイツ	(515,781)	(0.74)
為替予約取引(買建)	(638,367)	(0.91)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	1,267,024	1.81
純資産総額	69,884,084	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

< 株式 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカ アメリカ	株式 石油・ガス	EXXON MOBIL CORPORATION	194,921	6,727 6,763	1,311,280,504 1,318,231,699	1.89
アメリカ アメリカ	株式 ソフトウェア	MICROSOFT CORP	319,859	2,562 2,580	819,526,353 825,375,934	1.18
イギリス イギリス	株式 銀行	HSBC HOLDINGS PLC	691,641	1,058 1,031	731,535,129 713,210,101	1.02
イギリス イギリス	株式 石油・ガス	BP PLC	749,103	855 888	640,790,197 665,174,248	0.95
アメリカ アメリカ	株式 コンピューター	APPLE INC	35,601	18,648 17,954	663,897,188 639,189,041	0.91
アメリカ アメリカ	株式 化粧品/パーソナルケア	PROCTER & GAMBLE COMPANY	116,429	5,271 5,444	613,650,874 633,878,782	0.91
スイス スイス	株式 食品	NESTLE SA	145,448	4,170 4,310	606,554,464 626,920,907	0.90
アメリカ アメリカ	株式 銀行	JPMORGAN CHASE & CO	150,160	4,136 4,055	621,036,413 608,953,458	0.87
アメリカ アメリカ	株式 ヘルスケア製品	JOHNSON & JOHNSON	110,074	5,536 5,474	609,345,184 602,500,870	0.86
アメリカ アメリカ	株式 コンピューター	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	52,782	11,006 11,235	580,903,829 593,018,058	0.85
アメリカ アメリカ	株式 その他製造	GENERAL ELECTRIC COMPANY	422,453	1,390 1,360	587,162,355 574,414,751	0.82
アメリカ アメリカ	株式 石油・ガス	CHEVRON CORPORATION	80,131	7,012 7,128	561,848,058 571,153,575	0.82
アメリカ アメリカ	株式 通信	AT&T INC	235,586	2,353 2,398	554,275,244 565,046,236	0.81
アメリカ アメリカ	株式 医薬品	PFIZER INC	322,065	1,577 1,605	508,006,007 516,840,894	0.74
ユーロ スペイン	株式 銀行	BANCO SANTANDER SA	326,021	1,546 1,539	503,976,303 501,765,880	0.72
アメリカ アメリカ	株式 銀行	BANK OF AMERICA CORP	345,464	1,483 1,438	512,377,281 496,898,559	0.71
アメリカ アメリカ	株式 通信	CISCO SYSTEMS INC	230,400	2,210 2,151	509,208,146 495,514,092	0.71
ユーロ フランス	株式 石油・ガス	TOTAL SA	85,332	5,740 5,695	489,801,243 485,982,806	0.70
アメリカ アメリカ	株式 インターネット	GOOGLE INC-CL A	9,606	50,629 50,388	486,346,147 484,027,243	0.69
アメリカ アメリカ	株式 銀行	WELLS FARGO & COMPANY	174,875	2,681 2,612	468,843,512 456,850,585	0.65
イギリス イギリス	株式 通信	VODAFONE GROUP PLC	2,097,815	208 210	436,712,637 441,317,971	0.63
ユーロ スペイン	株式 通信	TELEFONICA S.A.	169,273	2,583 2,602	437,262,628 440,476,107	0.63
アメリカ アメリカ	株式 小売り	WAL-MART STORES INC	94,082	4,612 4,609	433,928,162 433,584,047	0.62
アメリカ アメリカ	株式 コンピューター	HEWLETT-PACKARD CO	96,240	4,440 4,421	427,337,013 425,488,974	0.61
オーストラリア オーストラリア	株式 鉱業	BHP BILLITON LTD	134,161	3,365 3,108	451,416,883 416,943,007	0.60
スイス スイス	株式 医薬品	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,083	14,460 14,828	406,089,616 416,424,609	0.60
アメリカ アメリカ	株式 飲料	COCA-COLA COMPANY	83,276	4,868 4,946	405,409,686 411,882,230	0.59
スイス スイス	株式 医薬品	NOVARTIS AG-REG SHS	84,543	4,703 4,793	397,641,575 405,230,155	0.58
イギリス イギリス	株式 石油・ガス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	141,738	2,883 2,810	408,581,896 398,281,512	0.57
イギリス イギリス	株式 医薬品	GLAXOSMITHKLINE PLC	207,396	1,872 1,899	388,257,963 393,752,920	0.56

< 新株予約権証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
ユーロ イタリア	新株予約権証券 -	MEDIOBANCA SPA-CW11 WARRANT	20,400	0 0	2,766 0	0.00

< 投資証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
オーストラリア オーストラリア	投資証券 -	WESTFIELD GROUP	80,625	1,102 1,014	88,875,276 81,722,064	0.12
アメリカ アメリカ	投資証券 -	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	11,444	6,295 6,233	72,036,886 71,335,771	0.10

ユーロ フランス	投資証券 -	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,255	20,448 20,564	66,559,802 66,934,974	0.10
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VORNADO REALTY TRUST	5,726	5,556 5,527	31,813,051 31,645,504	0.05
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PUBLIC STORAGE	4,609	6,835 6,828	31,503,160 31,469,445	0.05
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	LAND SECURITIES GROUP PLC	31,634	1,013 990	32,041,003 31,322,595	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HCP INC	10,850	2,740 2,771	29,724,035 30,061,357	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,170	2,649 2,657	29,589,518 29,681,442	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	BOSTON PROPERTIES INC	5,282	5,730 5,586	30,263,908 29,505,620	0.04
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	BRITISH LAND COMPANY PLC	37,816	730 710	27,601,875 26,851,856	0.04
カナダドル カナダ	投資証券 -	CANADIAN OIL SANDS TRUST	10,095	2,711 2,521	27,372,504 25,445,714	0.04
カナダドル カナダ	投資証券 -	PENN WEST ENERGY TRUST	15,498	1,589 1,545	24,619,354 23,942,852	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VENTAS INC	6,200	3,664 3,733	22,716,805 23,147,670	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,575	6,688 6,417	23,909,320 22,941,702	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PLUM CREEK TIMBER CO	7,618	3,028 2,921	23,064,092 22,249,082	0.03
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	STOCKLAND	71,210	338 296	24,079,519 21,099,381	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HEALTH CARE REIT INC	4,910	4,068 4,157	19,974,693 20,410,194	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HOST HOTELS & RESORTS INC	20,198	967 964	19,521,787 19,466,380	0.03
香港ドル 香港	投資証券 -	LINK REIT	94,500	211 204	19,915,686 19,246,626	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PROLOGIS	17,681	1,146 1,081	20,257,886 19,109,993	0.03
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	HAMMERSON PLC	28,610	640 614	18,305,147 17,577,446	0.03
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	SEGRO PLC	30,873	568 550	17,546,842 16,981,266	0.02
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	23,320	754 709	17,582,627 16,534,025	0.02
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	MIRVAC GROUP	137,930	136 118	18,760,204 16,278,085	0.02
カナダドル カナダ	投資証券 -	ENERPLUS RESOURCES FUND	7,630	2,159 2,088	16,469,964 15,934,461	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AMB PROPERTY CORPORATION	7,440	2,121 2,048	15,783,276 15,239,025	0.02
ユーロ フランス	投資証券 -	KLEPIERRE	3,895	4,044 3,774	15,752,431 14,698,748	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	LIBERTY PROPERTY TRUST	5,398	2,809 2,709	15,163,181 14,625,164	0.02
ユーロ オランダ	投資証券 -	CORIO NV	2,210	6,383 6,312	14,105,749 13,949,918	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	DUKE REALTY CORPORATION	12,420	1,091 1,077	13,548,720 13,378,367	0.02

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
株式	96.85
銀行	13.23
石油・ガス	10.48
通信	6.44
医薬品	5.65
保険	4.24
小売り	4.11
食品	3.80
電力	3.62
コンピューター	3.50
鉱業	3.34
化学	2.51
ソフトウェア	2.50
その他製造	2.44
ヘルスケア製品	2.35
飲料	2.14
メディア	2.04
農業	1.49
その他金融	1.45
半導体	1.43
商業サービス	1.41
インターネット	1.40
運輸関連	1.39
化粧品パーソナルケア	1.37
航空宇宙・防衛	1.30
石油・ガス サービス	1.13
バイオテクノロジー	1.00
自動車 製造	0.90
エンジニアリング建設	0.87
ヘルスケア・サービス	0.66
建築資材	0.59
不動産	0.59
電子機器	0.52
生活用品	0.51
多角産業	0.50
鉄鋼	0.48
電気部品・電気機械	0.47
機械 その他	0.45
繊維製品	0.42
ガス	0.38
パイプライン	0.37
機械 建設・鉱業用	0.28
金属 加工・鉱業用	0.24
木材・紙	0.24
自動車 部品・機器	0.22
宿泊施設	0.22
流通・卸売業	0.18
レジャー	0.17
水道	0.16
包装・容器	0.16
石炭	0.15
環境ビジネス	0.14
投資会社	0.14
工具・工作機械	0.14
広告	0.12
エンターテインメント	0.11
航空	0.11

その他資源	0.09
貯蓄貸付（S & L）	0.09
OA機器	0.08
食品サービス	0.08
家具・家電製品	0.06
玩具・娯楽	0.05
住宅建設	0.05
繊維	0.03
ベンチャーキャピタル	0.02
家庭用品	0.02
造船	0.01
新株予約権証券	0.00
投資証券	1.33
合計	98.18

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
< 有価証券指数等先物取引 >

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	S&P 500 FUTURES 2009-12	買建	31	748,555,272	752,313,456	1.08
ドイツ	DJ STOXX 50 FUTURES 2009-12	買建	155	513,015,480	515,781,720	0.74
合計			-	1,261,570,752	1,268,095,176	1.81

< 為替予約取引 >

名称	種類	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
ユーロ	買建	331,312,053	327,082,150	0.47
アメリカドル	買建	312,644,924	311,285,100	0.45
合計		643,956,977	638,367,250	0.91

[次へ](#)

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

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	1,058,890	96.07
アメリカ	554,689	50.33
イギリス	118,297	10.73
フランス	57,356	5.20
カナダ	51,512	4.67
スイス	46,698	4.24
ドイツ	46,430	4.21
オーストラリア	45,111	4.09
スペイン	28,631	2.60
イタリア	21,112	1.92
オランダ	14,457	1.31
スウェーデン	14,362	1.30
香港	12,667	1.15
フィンランド	7,081	0.64
シンガポール	6,423	0.58
ベルギー	6,400	0.58
アイルランド	6,083	0.55
ノルウェー	5,798	0.53
デンマーク	4,303	0.39
ギリシャ	3,298	0.30
ルクセンブルグ	2,476	0.22
オーストリア	1,728	0.16
ジャージー	1,528	0.14
バミューダ諸島	1,462	0.13
ポルトガル	977	0.09
新株予約権証券	0	0.00
イタリア	0	0.00
投資証券	12,413	1.13
アメリカ	5,985	0.54
カナダ	1,963	0.18
フランス	1,583	0.14
オーストラリア	1,175	0.11
イギリス	1,093	0.10
香港	611	0.06
有価証券指数等先物取引(買建)	(40,906)	(3.71)
アメリカ	(24,268)	(2.20)
ドイツ	(16,638)	(1.51)
為替予約取引(売建)	(1,092,383)	(99.11)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	30,868	2.80
純資産総額	1,102,171	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

< 株式 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率(%)
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	EXXON MOBIL CORPORATION	3,039	6,727 6,763	20,444,085 20,552,460	1.86
アメリカドル アメリカ	株式 ソフトウェア	MICROSOFT CORP	4,987	2,562 2,580	12,777,436 12,868,638	1.17
イギリスポンド イギリス	株式 銀行	HSBC HOLDINGS PLC	10,780	1,058 1,031	11,401,795 11,116,179	1.01
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	BP PLC	11,664	855 888	9,977,502 10,357,177	0.94
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	APPLE INC	557	18,648 17,954	10,387,088 10,000,514	0.91
アメリカドル アメリカ	株式 化粧品/パーソナルケア	PROCTER & GAMBLE COMPANY	1,814	5,271 5,444	9,560,871 9,876,028	0.90
スイスフラン スイス	株式 食品	NESTLE SA	2,265	4,170 4,310	9,445,615 9,762,773	0.89
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	JPMORGAN CHASE & CO	2,345	4,136 4,055	9,698,524 9,509,829	0.86
アメリカドル アメリカ	株式 ヘルスケア製品	JOHNSON & JOHNSON	1,715	5,536 5,474	9,493,859 9,387,221	0.85
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	823	11,006 11,235	9,057,706 9,246,597	0.84
アメリカドル アメリカ	株式 その他製造	GENERAL ELECTRIC COMPANY	6,592	1,390 1,360	9,162,142 8,963,227	0.81
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	CHEVRON CORPORATION	1,248	7,012 7,128	8,750,501 8,895,430	0.81
アメリカドル アメリカ	株式 通信	AT&T INC	3,672	2,353 2,398	8,639,302 8,807,186	0.80
アメリカドル アメリカ	株式 医薬品	PFIZER INC	5,020	1,577 1,605	7,918,247 8,055,955	0.73
ユーロ スペイン	株式 銀行	BANCO SANTANDER SA	5,090	1,546 1,539	7,868,326 7,833,815	0.71
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	BANK OF AMERICA CORP	5,392	1,483 1,438	7,997,181 7,755,590	0.70
アメリカドル アメリカ	株式 通信	CISCO SYSTEMS INC	3,590	2,210 2,151	7,934,276 7,720,901	0.70
ユーロ フランス	株式 石油・ガス	TOTAL SA	1,328	5,740 5,695	7,622,651 7,563,226	0.69
アメリカドル アメリカ	株式 インターネット	GOOGLE INC-CL A	150	50,629 50,388	7,594,412 7,558,202	0.69
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	WELLS FARGO & COMPANY	2,730	2,681 2,612	7,319,187 7,131,963	0.65
ユーロ スペイン	株式 通信	TELEFONICA S.A.	2,643	2,583 2,602	6,827,345 6,877,519	0.62
イギリスポンド イギリス	株式 通信	VODAFONE GROUP PLC	32,655	208 210	6,797,954 6,869,642	0.62
アメリカドル アメリカ	株式 小売り	WAL-MART STORES INC	1,461	4,612 4,609	6,738,473 6,733,130	0.61
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	HEWLETT-PACKARD CO	1,493	4,440 4,421	6,629,407 6,600,738	0.60
オーストラリアドル オーストラリア	株式 鉱業	BHP BILLITON LTD	2,095	3,365 3,108	7,049,130 6,510,801	0.59
スイスフラン スイス	株式 医薬品	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	437	14,460 14,828	6,319,167 6,479,990	0.59
アメリカドル アメリカ	株式 飲料	COCA-COLA COMPANY	1,296	4,868 4,946	6,309,272 6,410,003	0.58
スイスフラン スイス	株式 医薬品	NOVARTIS AG-REG SHS	1,316	4,703 4,793	6,189,706 6,307,830	0.57
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,206	2,883 2,810	6,359,139 6,198,825	0.56
イギリスポンド イギリス	株式 医薬品	GLAXOSMITHKLINE PLC	3,228	1,872 1,899	6,043,013 6,128,539	0.56

< 新株予約権証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率(%)
ユーロ イタリア	新株予約権証券 -	MEDIOBANCA SPA-CW11 WARRANT	574	0 0	77 0	0.00

< 投資証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率(%)
ユーロ フランス	投資証券 -	UNIBAIL-RODAMCO SE	77	20,448 20,564	1,574,533 1,583,408	0.14

アメリカドル アメリカ	投資証券 -	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	196	6,295 6,233	1,233,767 1,221,759	0.11
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	WESTFIELD GROUP	1,160	1,102 1,014	1,278,702 1,175,784	0.11
カナダドル カナダ	投資証券 -	PENN WEST ENERGY TRUST	517	1,589 1,545	821,281 798,713	0.07
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VORNADO REALTY TRUST	129	5,556 5,527	716,710 712,936	0.06
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PUBLIC STORAGE	104	6,835 6,828	710,855 710,094	0.06
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	BOSTON PROPERTIES INC	113	5,730 5,586	647,448 631,226	0.06
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	236	2,649 2,657	625,168 627,110	0.06
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HOST HOTELS & RESORTS INC	638	967 964	616,640 614,890	0.06
香港ドル 香港	投資証券 -	LINK REIT	3,000	211 204	632,244 611,004	0.06
カナダドル カナダ	投資証券 -	CANADIAN OIL SANDS TRUST	241	2,711 2,521	653,469 607,471	0.06
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	BRITISH LAND COMPANY PLC	814	730 710	594,138 577,994	0.05
カナダドル カナダ	投資証券 -	ENERPLUS RESOURCES FUND	267	2,159 2,088	576,341 557,602	0.05
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AVALONBAY COMMUNITIES INC	83	6,688 6,417	555,097 532,633	0.05
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	LAND SECURITIES GROUP PLC	521	1,013 990	527,703 515,871	0.05
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	REGENCY CENTERS CORPORATION	156	3,296 3,176	514,240 495,411	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	KIMCO REALTY CORPORATION	370	1,249 1,187	462,156 439,150	0.04

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率（％）
株式	96.07
銀行	13.30
石油・ガス	10.41
通信	6.25
医薬品	5.67
小売り	4.33
保険	3.95
電力	3.59
コンピューター	3.43
食品	3.31
鉱業	3.29
その他製造	2.54
ソフトウェア	2.54
化学	2.47
ヘルスケア製品	2.31
メディア	2.14
飲料	2.10
半導体	1.61
運輸関連	1.55
農業	1.52
その他金融	1.51
商業サービス	1.51
化粧品パーソナルケア	1.37
インターネット	1.28
航空宇宙・防衛	1.26
石油・ガス サービス	1.17
エンジニアリング建設	1.00
自動車 製造	0.92
バイオテクノロジー	0.89
ヘルスケア・サービス	0.81
不動産	0.63
鉄鋼	0.56
機械 その他	0.49
生活用品	0.48
建築資材	0.44
電気部品・電気機械	0.44
繊維製品	0.44
宿泊施設	0.43
多角産業	0.42
電子機器	0.38
ガス	0.34
機械 建設・鉱業用	0.31
金属 加工・鉱業用	0.30
パイプライン	0.29
水道	0.23
自動車 部品・機器	0.21
工具・工作機械	0.18
流通・卸売業	0.18
レジャー	0.17
石炭	0.15
食品サービス	0.14
貯蓄貸付（S & L）	0.13
木材・紙	0.12
エンターテインメント	0.09
広告	0.09
環境ビジネス	0.08
OA機器	0.07

家具・家電製品	0.06
投資会社	0.06
家庭用品	0.05
玩具・娯楽	0.05
繊維	0.03
造船	0.02
新株予約権証券	0.00
投資証券	1.13
合計	97.20

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
<有価証券指数等先物取引>

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	E-MINI S&P 500 FUTURES 2009-12	買建	5	24,036,147	24,268,176	2.20
ドイツ	DJ STOXX 50 FUTURES 2009-12	買建	5	16,521,504	16,638,120	1.51
合計			-	40,557,651	40,906,296	3.71

<為替予約取引>

名称	種類	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカドル	売建	585,569,922	581,661,250	52.77
ユーロ	売建	204,201,900	200,565,260	18.20
イギリスポンド	売建	120,011,834	121,338,160	11.01
カナダドル	売建	53,980,708	52,877,410	4.80
オーストラリアドル	売建	46,846,736	46,208,150	4.19
スイスフラン	売建	46,052,560	45,325,540	4.11
スウェーデンクローナ	売建	14,806,840	14,350,710	1.30
香港ドル	売建	13,578,928	13,487,400	1.22
シンガポールドル	売建	6,524,620	6,474,950	0.59
ノルウェークローネ	売建	5,907,530	5,782,700	0.52
デンマーククローネ	売建	4,387,658	4,311,940	0.39
合計		1,101,869,236	1,092,383,470	99.11

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	27,641,897	73.65
日本	27,641,897	73.65
地方債証券	2,376,591	6.33
日本	2,376,591	6.33
特殊債券	4,006,890	10.68
日本	3,908,462	10.41
韓国	98,427	0.26
社債券	3,375,973	8.99
日本	3,078,732	8.20
アメリカ	198,435	0.53
ドイツ	98,806	0.26
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	132,432	0.35
純資産総額	37,533,784	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

< 国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第299回	1.30000 2019-03-20	735,000,000	99.71 99.63	732,846,450 732,243,750	1.95
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第64回	1.50000 2012-06-20	657,000,000	102.97 103.04	676,506,330 676,979,370	1.80
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第227回	1.60000 2011-03-21	538,000,000	101.89 101.89	548,184,340 548,157,440	1.46
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(20年)第60回	1.40000 2022-12-20	545,000,000	96.00 96.11	523,216,350 523,799,500	1.40
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(2年)第283回	0.30000 2011-08-15	510,000,000	100.06 100.11	510,316,200 510,581,400	1.36
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第282回	1.70000 2016-09-20	479,000,000	104.82 104.87	502,078,220 502,341,670	1.34
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第256回	1.40000 2013-12-20	410,000,000	103.34 103.43	423,685,800 424,050,700	1.13
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第290回	1.40000 2018-03-20	416,000,000	101.59 101.56	422,632,860 422,485,440	1.13
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第240回	1.30000 2012-06-20	401,000,000	102.46 102.53	410,860,590 411,161,340	1.10
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第268回	1.50000 2015-03-20	386,000,000	103.94 104.01	401,200,680 401,459,300	1.07
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第57回	1.40000 2011-06-20	390,000,000	101.86 101.88	397,261,800 397,339,800	1.06
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第287回	1.90000 2017-06-20	370,000,000	105.94 105.92	391,966,900 391,915,100	1.04
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第58回	1.50000 2011-06-20	382,000,000	102.03 102.04	389,739,320 389,804,260	1.04
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第284回	1.70000 2016-12-20	371,000,000	104.70 104.69	388,432,940 388,396,190	1.03
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第233回	1.40000 2011-06-20	368,000,000	101.85 101.87	374,822,720 374,896,320	1.00
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第264回	1.50000 2014-09-20	351,000,000	103.91 103.99	364,713,570 365,008,410	0.97
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第261回	1.80000 2014-06-20	340,000,000	105.23 105.30	357,775,200 358,023,400	0.95
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第66回	1.10000 2012-09-20	340,000,000	102.02 102.10	346,854,400 347,153,600	0.92
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第297回	1.40000 2018-12-20	333,000,000	100.86 100.77	335,857,140 335,577,420	0.89
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第295回	1.50000 2018-06-20	317,000,000	102.19 102.10	323,935,960 323,669,680	0.86
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第285回	1.70000 2017-03-20	308,000,000	104.60 104.59	322,168,000 322,134,120	0.86
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第72回	1.50000 2013-06-20	307,000,000	103.59 103.67	318,033,580 318,260,760	0.85
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(20年)第88回	2.30000 2026-06-20	300,000,000	104.33 104.52	312,993,000 313,572,000	0.84

日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第60回	1.20000 2011-09-20	295,000,000	101.74 101.77	300,138,900 300,224,450	0.80
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第234回	1.40000 2011-09-20	282,000,000	102.11 102.14	287,946,720 288,020,700	0.77
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第239回	1.40000 2012-06-20	275,000,000	102.72 102.79	282,480,000 282,683,500	0.75
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第296回	1.50000 2018-09-20	276,000,000	101.92 101.87	281,296,440 281,172,240	0.75
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第301回	1.50000 2019-06-20	277,000,000	101.19 101.15	280,304,610 280,179,960	0.75
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第52回	0.80000 2010-12-20	270,000,000	100.68 100.68	271,844,100 271,844,100	0.72
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第288回	1.70000 2017-09-20	255,000,000	104.28 104.27	265,916,550 265,893,600	0.71

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
国債証券	73.65
地方債証券	6.33
特殊債券	10.68
社債券	8.99
合計	99.65

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	707,199,029	98.63
アメリカ	226,537,164	31.59
イタリア	86,734,899	12.10
ドイツ	80,187,068	11.18
フランス	74,048,680	10.33
イギリス	56,437,806	7.87
スペイン	33,637,992	4.69
ベルギー	22,169,569	3.09
ギリシャ	19,474,555	2.72
オランダ	19,186,293	2.68
カナダ	18,851,767	2.63
オーストリア	14,044,527	1.96
ポルトガル	8,849,855	1.23
ポーランド	6,560,175	0.91
デンマーク	6,524,098	0.91
アイルランド	6,262,939	0.87
スウェーデン	5,128,470	0.72
オーストラリア	4,949,317	0.69
スイス	4,488,313	0.63
フィンランド	4,237,055	0.59
マレーシア	3,861,938	0.54
シンガポール	2,774,329	0.39
ノルウェー	2,252,211	0.31
為替予約取引(買建)	(190,204)	(0.03)
為替予約取引(売建)	(232,139)	(0.03)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	9,848,534	1.37
純資産総額	717,047,564	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

< 国債証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカ アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	3.12500 2019-05-15	48,000,000	8,890.40 8,874.68	4,267,390,390 4,259,846,371	0.59
アメリカ アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	3.75000 2018-11-15	39,300,000	9,365.46 9,353.31	3,680,624,127 3,675,851,477	0.51
アメリカ アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	2.75000 2019-02-15	42,200,000	8,632.51 8,617.50	3,642,918,164 3,636,587,084	0.51
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	6.00000 2031-05-01	22,500,000	15,466.85 15,560.05	3,480,040,773 3,501,010,296	0.49
イギリス イギリス	国債証券 -	イギリス国債	5.00000 2012-03-07	20,200,000	16,309.28 16,302.90	3,294,474,023 3,293,186,487	0.46
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	6.50000 2027-11-01	19,500,000	16,337.89 16,430.01	3,185,888,168 3,203,852,863	0.45
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	5.00000 2012-02-01	21,350,000	14,495.71 14,497.73	3,094,833,615 3,095,264,979	0.43
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	4.25000 2019-04-25	21,500,000	14,332.85 14,350.75	3,081,563,223 3,085,411,551	0.43
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	5.25000 2029-11-01	20,450,000	14,304.55 14,396.15	2,925,280,982 2,944,012,732	0.41
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2014-08-01	20,100,000	14,409.66 14,415.76	2,896,340,864 2,897,567,366	0.40
イギリス イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.50000 2013-03-07	17,800,000	16,234.73 16,229.55	2,889,781,580 2,888,859,918	0.40
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	3.75000 2016-08-01	20,500,000	13,948.98 13,956.30	2,859,541,343 2,861,042,435	0.40
アメリカ アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	3.62500 2019-08-15	30,500,000	9,263.18 9,237.58	2,825,271,256 2,817,462,644	0.39

イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.25000 2011-03-07	17,800,000	15,826.45 15,820.68	2,817,107,673 2,816,080,908	0.39
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.00000 2012-07-04	19,150,000	14,686.70 14,690.63	2,812,503,127 2,813,256,181	0.39
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.00000 2012-01-04	19,200,000	14,554.12 14,557.23	2,794,391,862 2,794,988,068	0.39
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.25000 2014-07-04	18,850,000	14,603.02 14,608.31	2,752,669,579 2,753,666,443	0.38
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2013-08-01	18,950,000	14,403.09 14,411.62	2,729,386,124 2,731,002,414	0.38
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	2.25000 2014-03-07	18,300,000	14,890.30 14,873.16	2,724,924,164 2,721,787,823	0.38
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	4.00000 2015-02-15	27,300,000	9,798.37 9,811.94	2,674,954,326 2,678,659,602	0.37
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	3.75000 2015-08-01	19,000,000	14,031.17 14,045.95	2,665,922,171 2,668,730,447	0.37
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.50000 2013-01-04	18,100,000	14,590.84 14,597.07	2,640,942,902 2,642,069,453	0.37
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.50000 2019-03-07	16,290,000	16,128.76 16,136.33	2,627,375,512 2,628,608,665	0.37
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.00000 2011-07-04	18,250,000	14,389.02 14,391.58	2,625,995,734 2,626,463,452	0.37
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2019-02-01	18,500,000	13,992.08 14,030.06	2,588,534,030 2,595,560,619	0.36
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.25000 2014-01-04	17,800,000	14,576.55 14,580.20	2,594,626,349 2,595,275,628	0.36
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	3.00000 2015-10-25	19,000,000	13,634.47 13,651.01	2,590,549,589 2,593,692,797	0.36
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	1.12500 2011-06-30	28,000,000	9,189.72 9,200.08	2,573,121,600 2,576,021,930	0.36
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	3.75000 2015-01-04	18,000,000	14,306.04 14,310.51	2,575,087,934 2,575,890,958	0.36
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	0.87500 2010-12-31	28,000,000	9,180.43 9,183.29	2,570,521,083 2,571,321,183	0.36

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
国債証券	98.63
合計	98.63

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
< 為替予約取引 >

名称	種類	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
ユーロ	買建	109,099,770	111,183,800	0.02
アメリカドル	買建	45,265,000	45,715,000	0.01
イギリスポンド	買建	32,573,200	33,305,800	0.00
合計		186,937,970	190,204,600	0.03
スイスフラン	売建	109,660,222	111,751,200	0.02
ポーランドズロチ	売建	68,180,370	70,373,370	0.01
カナダドル	売建	38,420,750	38,425,420	0.01
スウェーデンクローナ	売建	11,309,012	11,589,240	0.00
合計		227,570,354	232,139,230	0.03

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド

以下の運用状況は平成21年10月30日現在です。

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

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	28,404,450	99.94
アメリカ	9,095,417	32.00
イタリア	3,443,655	12.12
ドイツ	3,171,159	11.16
フランス	2,925,946	10.29
イギリス	2,272,880	8.00
スペイン	1,358,188	4.78
ベルギー	908,594	3.20
オランダ	796,974	2.80
ギリシャ	791,565	2.78
カナダ	766,239	2.70
オーストリア	562,051	1.98
ポルトガル	358,355	1.26
デンマーク	278,946	0.98
ポーランド	275,872	0.97
アイルランド	242,130	0.85
スウェーデン	216,941	0.76
オーストラリア	200,347	0.70
スイス	179,292	0.63
フィンランド	167,371	0.59
マレーシア	164,407	0.58
シンガポール	125,502	0.44
ノルウェー	102,609	0.36
為替予約取引(売建)	(28,488,564)	(100.23)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	18,350	0.06
純資産総額	28,422,801	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

< 国債証券 >

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2014-08-01	1,870,000	14,409.66 14,415.76	269,460,568 269,574,675	0.95
イギリス イギリス	国債証券 -	イギリス国債	5.00000 2012-03-07	1,500,000	16,309.28 16,302.90	244,639,160 244,543,551	0.86
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	5.25000 2011-08-01	1,670,000	14,429.92 14,425.52	240,979,669 240,906,205	0.85
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2019-02-01	1,610,000	13,992.08 14,030.06	225,272,421 225,883,924	0.79
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.50000 2013-01-04	1,520,000	14,590.84 14,597.07	221,780,840 221,875,446	0.78
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	2.37500 2014-08-31	2,400,000	9,133.28 9,141.14	219,198,820 219,387,420	0.77
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.25000 2014-07-04	1,440,000	14,603.02 14,608.31	210,283,512 210,359,665	0.74
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	5.00000 2012-02-01	1,440,000	14,495.71 14,497.73	208,738,192 208,767,287	0.73
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	5.00000 2011-10-25	1,430,000	14,477.77 14,489.84	207,032,081 207,204,659	0.73
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	4.75000 2012-10-25	1,410,000	14,641.84 14,647.53	206,449,999 206,530,110	0.73
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	3.75000 2013-07-04	1,440,000	14,299.98 14,306.90	205,919,752 206,019,336	0.72
ユーロ ベルギー	国債証券 -	ベルギー国債	4.25000 2013-09-28	1,420,000	14,487.41 14,493.50	205,721,209 205,807,665	0.72
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	3.00000 2011-01-12	1,450,000	13,889.62 13,890.32	201,399,561 201,409,663	0.71
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	4.75000 2012-05-31	2,000,000	9,944.81 9,954.46	198,896,281 199,089,166	0.70

ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	4.00000 2014-04-25	1,380,000	14,382.79 14,393.90	198,482,553 198,635,811	0.70
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	6.50000 2027-11-01	1,200,000	16,337.89 16,430.01	196,054,656 197,160,176	0.69
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	4.00000 2014-02-15	2,000,000	9,836.94 9,847.66	196,738,866 196,953,182	0.69
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.75000 2038-12-07	1,170,000	16,539.54 16,622.90	193,512,596 194,487,959	0.68
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2012-10-15	1,350,000	14,353.23 14,354.03	193,768,644 193,779,444	0.68
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	3.37500 2013-06-30	2,000,000	9,629.06 9,634.06	192,581,199 192,681,216	0.68
ユーロ スペイン	国債証券 -	スペイン国債	6.15000 2013-01-31	1,260,000	15,220.52 15,221.47	191,778,513 191,790,473	0.67
ユーロ スペイン	国債証券 -	スペイン国債	4.75000 2014-07-30	1,270,000	14,778.37 14,783.10	187,685,248 187,745,350	0.66
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.62500 2028-01-04	1,160,000	16,036.76 16,138.77	186,026,429 187,209,767	0.66
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.50000 2013-03-07	1,150,000	16,234.73 16,229.55	186,699,372 186,639,826	0.66
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	1.50000 2010-10-31	2,000,000	9,241.33 9,242.58	184,826,666 184,851,666	0.65
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2013-08-01	1,280,000	14,403.09 14,411.62	184,359,590 184,468,765	0.65
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.50000 2018-02-01	1,280,000	14,354.83 14,407.19	183,741,862 184,412,008	0.65
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	4.00000 2018-04-25	1,300,000	14,181.17 14,181.29	184,355,211 184,356,797	0.65
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	1.12500 2011-06-30	2,000,000	9,189.72 9,200.08	183,794,400 184,001,566	0.65
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	1.50000 2012-07-15	2,000,000	9,170.43 9,179.72	183,408,633 183,594,366	0.65

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
国債証券	99.94
合計	99.94

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
< 為替予約取引 >

名称	種類	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
ユーロ	売建	15,057,864,482	14,788,253,730	52.03
アメリカドル	売建	9,134,418,344	9,073,612,290	31.92
イギリスポンド	売建	2,239,391,000	2,264,661,360	7.97
カナダドル	売建	794,776,420	778,211,830	2.74
デンマーククローネ	売建	295,843,970	290,496,020	1.02
ポーランドズロチ	売建	294,634,847	285,846,970	1.01
スウェーデンクローナ	売建	230,876,877	223,291,720	0.79
オーストラリアドル	売建	206,614,581	203,739,820	0.72
スイスフラン	売建	184,971,616	181,930,610	0.64
マレーシアリングgit	売建	169,681,840	167,383,920	0.59
シンガポールドル	売建	127,351,664	126,355,620	0.44
ノルウェークローネ	売建	107,149,139	104,780,430	0.37
合計		28,843,574,780	28,488,564,320	100.23

6【手続等の概要】

(1) 申込（販売）手続等

申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

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。

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。

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。

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。

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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

(2) 換金（解約）手続等

< 解約請求による換金 >

解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

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。

解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基つき、運用上の支障をきたさないようにするため、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。

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0.25%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。

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。

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。

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。

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。

7【管理及び運営の概要】

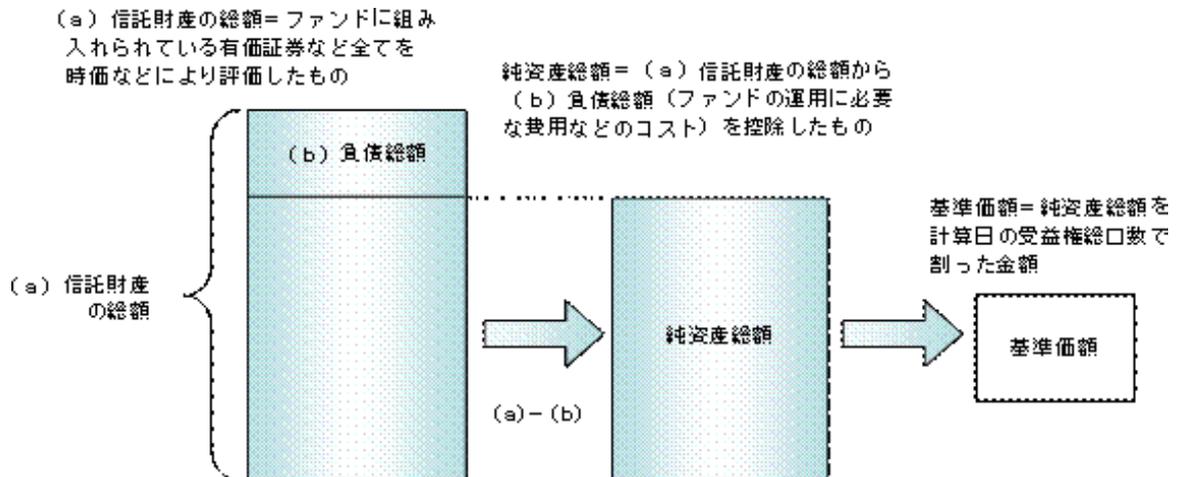
(1) 資産管理等の概要

資産の評価

1) 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。

< 基準価額算出の流れ >



2) 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。

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b) 金融商品取引業者（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。）

c) 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。

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。

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。

その他

1) 信託の終了（繰上償還）

イ) 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。

a) 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

b) 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

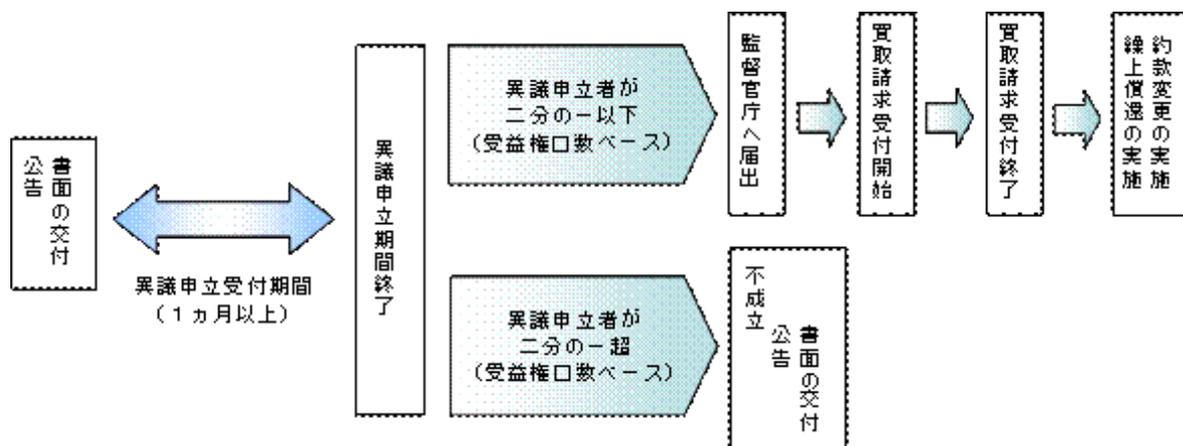
c) やむを得ない事情が発生したとき

ロ) 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ないません。

- 八) 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。）
- 二) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときなどには、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。
- ホ) 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。
- 2) 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。
- 3) 信託約款の変更
- イ) 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。
- ロ) 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ないません。
- ハ) この信託約款の変更に関する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。）
- 二) 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。
- 4) 異議の申立て
- イ) 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ないません。
- ロ) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、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ないません。
- ハ) 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 >



- 5) 公告
公告は日本経済新聞に掲載します。
- 6) 運用報告書の作成
委託会社は、每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、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けします。

(2) 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。

- ・ 収益分配金・償還金受領権
- ・ 解約請求権
- ・ 帳簿閲覧権

第2【財務ハイライト情報】

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

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）

1【貸借対照表】

（単位：円）

科目	期別	第9期	第10期
		平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		8,019,259	13,747,183
親投資信託受益証券		197,915,179	251,300,237
未収入金		4,726,894	445,864
流動資産合計		210,661,332	265,493,284
資産合計			
		210,661,332	265,493,284
負債の部			
流動負債			
未払解約金		449,938	643,775
未払受託者報酬		65,176	59,806
未払委託者報酬		927,813	851,418
その他未払費用		11,540	10,584
流動負債合計		1,454,467	1,565,583
負債合計			
		1,454,467	1,565,583
純資産の部			
元本等			
元本		274,067,632	294,325,004
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,860,767	30,397,303
（分配準備積立金）		31,928,170	29,588,374
元本等合計		209,206,865	263,927,701
純資産合計			
		209,206,865	263,927,701
負債純資産合計			
		210,661,332	265,493,284

2【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

科目	期別	第9期 自平成19年10月27日 至平成20年10月27日	第10期 自平成20年10月28日 至平成21年10月26日
		金額	金額
営業収益			
受取利息		68,190	14,435
有価証券売買等損益		107,741,456	39,155,613
営業収益合計		107,673,266	39,170,048
営業費用			
受託者報酬		132,999	112,047
委託者報酬		1,893,277	1,595,261
その他費用		23,544	19,821
営業費用合計		2,049,820	1,727,129
営業利益又は営業損失（ ）		109,723,086	37,442,919
経常利益又は経常損失（ ）		109,723,086	37,442,919
当期純利益又は当期純損失（ ）		109,723,086	37,442,919
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（ ）		3,715,364	1,153,509
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		44,281,166	64,860,767
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,725,164	5,075,590
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-	5,075,590
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,725,164	-
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,859,375	6,901,536
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,859,375	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-	6,901,536
分配金		-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,860,767	30,397,303

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	期別	第9期 自平成19年10月27日 至平成20年10月27日	第10期 自平成20年10月28日 至平成21年10月26日
	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いたしますので、当計算期間は平成19年10月27日から平成20年10月27日までとなっております。	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いたしますので、当計算期間は平成20年10月28日から平成21年10月26日までとなっております。

第3【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な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4【ファンドの詳細情報の項目】

有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」（投資信託説明書（請求目論見書））の記載項目は以下の通りです。

第1 ファンドの沿革**第2 手続等**

- 1 申込（販売）手続等
- 2 換金（解約）手続等

第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
 - (1) 資産の評価
 - (2) 保管
 - (3) 信託期間
 - (4) 計算期間
 - (5) その他
- 2 受益者の権利等

第4 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
 - (1) 貸借対照表
 - (2) 損益及び剰余金計算書
 - (3) 注記表
 - (4) 附属明細表
- 2 ファンドの現況

純資産額計算書

第5 設定及び解約の実績

第三部【ファンドの詳細情報】

第1【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60）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ2）

第2【手続等】

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号口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にするため、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0.25%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。
- (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。

第3【管理及び運営】

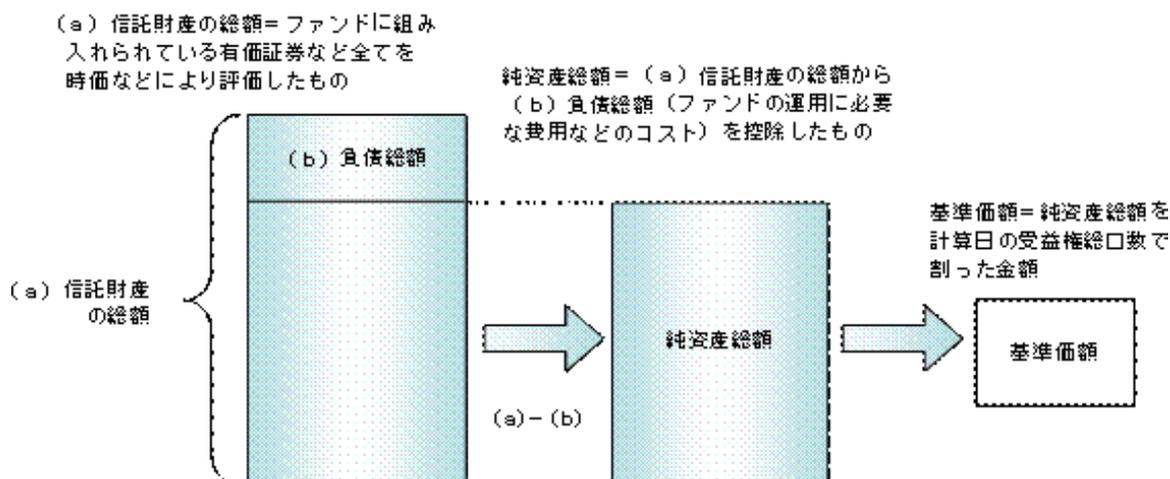
1【資産管理等の概要】

(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。

< 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。

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b) 金融商品取引業者（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。）

c) 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。）
 - ニ) 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。

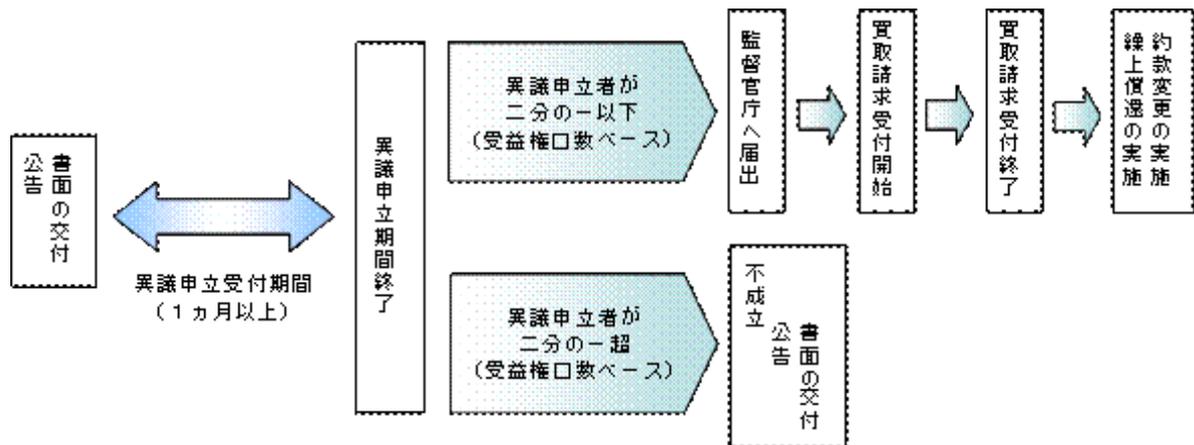
信託約款の変更

 - 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ないません。
 - 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、每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、あらかじめ届出を受けた住所に販売会社よりお届けします。

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。

2【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4【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。その後の改正を含みます。）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。その後の改正を含みます。）に基づき作成しております。

なお、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9期計算期間（平成19年10月27日から平成20年10月27日まで）及び第10期計算期間（平成20年10月28日から平成21年10月26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60）

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 平成20年10月27日現在	第10期 平成21年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,019,259	13,747,183
親投資信託受益証券	197,915,179	251,300,237
未収入金	4,726,894	445,864
流動資産合計	210,661,332	265,493,284
資産合計	210,661,332	265,493,284
負債の部		
流動負債		
未払解約金	449,938	643,775
未払受託者報酬	65,176	59,806
未払委託者報酬	927,813	851,418
その他未払費用	11,540	10,584
流動負債合計	1,454,467	1,565,583
負債合計	1,454,467	1,565,583
純資産の部		
元本等		
元本	274,067,632	294,325,004
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,860,767	30,397,303
（分配準備積立金）	31,928,170	29,588,374
元本等合計	209,206,865	263,927,701
純資産合計	209,206,865	263,927,701
負債純資産合計	210,661,332	265,493,284

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期	第10期
	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
営業収益		
受取利息	68,190	14,435
有価証券売買等損益	107,741,456	39,155,613
営業収益合計	107,673,266	39,170,048
営業費用		
受託者報酬	132,999	112,047
委託者報酬	1,893,277	1,595,261
その他費用	23,544	19,821
営業費用合計	2,049,820	1,727,129
営業利益又は営業損失（ ）	109,723,086	37,442,919
経常利益又は経常損失（ ）	109,723,086	37,442,919
当期純利益又は当期純損失（ ）	109,723,086	37,442,919
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（ ）	3,715,364	1,153,509
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	44,281,166	64,860,767
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,725,164	5,075,590
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5,075,590
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,725,164	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,859,375	6,901,536
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,859,375	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,901,536
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,860,767	30,397,303

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	期別	
	第9期 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	第10期 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
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。	親投資信託受益証券 同左
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19年10月27日から平成20年10月27日までとなっております。	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20年10月28日から平成21年10月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第9期 平成20年10月27日現在		第10期 平成21年10月26日現在	
1. 期首元本額	262,814,892 円	1. 期首元本額	274,067,632 円
期中追加設定元本額	47,687,195 円	期中追加設定元本額	41,843,319 円
期中解約元本額	36,434,455 円	期中解約元本額	21,585,947 円
2. 計算期間末日における 受益権の総数	274,067,632 口	2. 計算期間末日における 受益権の総数	294,325,004 口
3. 元本の欠損		3. 元本の欠損	
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は64,860,767円であります。		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は30,397,303円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日		第10期 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26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	0 円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益	13,387 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	0 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	0 円
C 信託約款に定める収益調整金	37,769,786 円	C 信託約款に定める収益調整金	45,284,571 円
D 信託約款に定める分配準備積立金	31,928,170 円	D 信託約款に定める分配準備積立金	29,574,987 円
E 分配対象収益(A + B + C + D)	69,697,956 円	E 分配対象収益(A + B + C + D)	74,872,945 円
F 分配対象収益(1口当たり)	0.2543 円	F 分配対象収益(1口当たり)	0.2543 円
(1万口当たり)	2,543 円	(1万口当たり)	2,543 円
G 分配金額	0 円	G 分配金額	0 円
H 分配金額(1口当たり)	0 円	H 分配金額(1口当たり)	0 円
(1万口当たり)	0 円	(1万口当たり)	0 円

(有価証券に関する注記)

第9期(自平成19年10月27日至平成20年10月27日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	197,915,179	97,350,808
合計	197,915,179	97,350,808

第10期(自平成20年10月28日至平成21年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	251,300,237	34,383,474
合計	251,300,237	34,383,474

(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9期 平成20年10月27日現在		第10期 平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.7633 円	1口当たり純資産額	0.8967 円
(1万口当たり純資産額)	(7,633 円)	(1万口当たり純資産額)	(8,967 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

(親投資信託受益証券)

(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	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	177,358,372	120,124,825	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	23,345,864	20,626,070	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	28,677,076	19,910,493	
	日本債券インデックスマザーファンド	55,121,412	64,398,345	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	8,293,797	13,385,358	
	海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	10,912,688	12,855,146	
合計		303,709,209	251,300,237	

(注) 親投資信託受益証券における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。

[次へ](#)

（参考）

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

1. 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		392,963,714	77,733,687
株式		24,915,465,780	31,913,941,890
新株予約権証券		-	112,000
派生商品評価勘定		292,552	1,762,783
未収配当金		321,973,314	214,808,277
前払金		112,860,000	6,405,000
流動資産合計		25,743,555,360	32,214,763,637
資産合計			
		25,743,555,360	32,214,763,637
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		142,345,016	5,716,113
未払金		105,390,915	2,222,700
未払解約金		197,447,761	692,891
流動負債合計		445,183,692	8,631,704
負債合計			
		445,183,692	8,631,704
純資産の部			
元本等			
元本		46,500,062,239	47,548,685,652
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		21,201,690,571	15,342,553,719
元本等合計		25,298,371,668	32,206,131,933
純資産合計			
		25,298,371,668	32,206,131,933
負債純資産合計			
		25,743,555,360	32,214,763,637

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引</p> <p>個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>	<p>デリバティブ取引</p> <p>同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成20年10月27日現在			平成21年10月26日現在		
1.	期首	平成19年10月27日	1.	期首	平成20年10月28日
	期首元本額	35,958,901,917 円		期首元本額	46,500,062,239 円
	期首からの追加設定元本額	18,982,543,528 円		期首からの追加設定元本額	12,242,918,816 円
	期首からの解約元本額	8,441,383,206 円		期首からの解約元本額	11,194,295,403 円
	平成20年10月27日現在の元本の内訳			平成21年10月26日現在の元本の内訳	
	DCインデックスバランス （株式20）	131,783,483 円		DCインデックスバランス （株式20）	147,167,770 円
	DCインデックスバランス （株式40）	458,277,323 円		DCインデックスバランス （株式40）	534,061,559 円
	DCインデックスバランス （株式60）	835,367,112 円		DCインデックスバランス （株式60）	1,027,464,097 円
	DCインデックスバランス （株式80）	919,573,280 円		DCインデックスバランス （株式80）	1,144,679,021 円
	インデックスファンド日本 株式（DC専用）	803,475,706 円		インデックスファンド日本 株式（DC専用）	728,834,132 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	25,429,686,953 円		世界の財産3分法ファンド （不動産・債券・株式）毎月 分配型	24,372,022,948 円
	グローバルコレクション （債券/株式/不動産・資 源・食料等）隔月分配型	26,559,699 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	14,959,395 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	7,865,538 円		日興ストラテジック・アロ ケーション・ファンド（株 式資産）	235,652,756 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）	135,837,736 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式80）	195,922,324 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式80）	176,029,754 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式60）	177,358,372 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式60）	160,285,015 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式40）	307,268,792 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式40）	297,486,574 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式20）	389,728,520 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式20）	458,820,553 円		国際分散型ファンド40（適 格機関投資家向け）	14,430,288,268 円
	国際分散型ファンド40（適 格機関投資家向け）	12,856,999,415 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）	107,118,906 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）	147,816,952 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）	148,047,400 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）	317,551,035 円		3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	221,335,460 円
	3資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	554,551,304 円		グローバルバランスファン ド35（適格機関投資家向 け）	98,710,505 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20）	273,913,758 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20）	303,509,655 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40）	731,633,972 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40）	827,430,205 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60）	909,346,566 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60）	1,058,119,013 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80）	867,200,511 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80）	1,079,006,554 円
	（合計）	46,500,062,239 円		（合計）	47,548,685,652 円
2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	46,500,062,239 口	2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	47,548,685,652 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は21,201,690,571円であります。		3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は15,342,553,719円であります。	
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通りであります。 株式	64,160,000 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通りであります。 株式	248,216,000 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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	24,915,465,780	23,971,234,466
合計	24,915,465,780	23,971,234,466

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	31,913,941,890	5,166,944,296
新株予約権証券	112,000	112,000
合計	31,914,053,890	5,167,056,296

（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報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引および金利先渡取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	546,345,000	-	404,460,000	141,885,000
		合計	546,345,000	-	404,460,000

(単位:円)

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	313,425,000	-	309,570,000	3,855,000
		合計	313,425,000	-	309,570,000

(注)時価の算定方法

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

(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20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.5441円	1口当たり純資産額	0.6773円
(1万口当たり純資産額)	(5,441円)	(1万口当たり純資産額)	(6,773円)

[次へ](#)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:株,円)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
1301	極洋	13,000	187	2,431,000	
1332	日本水産	35,000	268	9,380,000	
1334	マルハニチロホールディングス	56,000	136	7,616,000	
1352	ハウスイ	2,000	123	246,000	
1377	サカタのタネ	5,600	1,433	8,024,800	
1379	ホクト	2,800	2,015	5,642,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,700	1,630	4,401,000	
1514	住石ホールディングス	8,400	104	873,600	
1515	日鉄鉱業	8,000	542	4,336,000	
1518	三井松島産業	10,000	171	1,710,000	
1605	国際石油開発帝石	139	791,000	109,949,000	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	574	1,722,000	
1662	石油資源開発	4,300	4,870	20,941,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	145,100	435,300	
1719	ハザマ	12,600	100	1,260,000	
1720	東急建設	10,790	254	2,740,660	
1721	コムシスホールディングス	14,700	949	13,950,300	
1722	ミサワホーム	3,600	354	1,274,400	
1762	高松コンストラクショングループ	2,300	1,318	3,031,400	
1766	東建コーポレーション	1,130	2,980	3,367,400	
1780	ヤマウラ	1,500	196	294,000	
1801	大成建設	138,000	187	25,806,000	
1802	大林組	85,000	363	30,855,000	
1803	清水建設	86,000	367	31,562,000	
1808	長谷工コーポレーション	149,000	77	11,473,000	
1810	松井建設	3,000	343	1,029,000	
1812	鹿島	125,000	228	28,500,000	
1813	不動テトラ	21,500	65	1,397,500	
1814	大末建設	11,000	38	418,000	
1815	鉄建	15,000	82	1,230,000	
1816	安藤建設	10,000	124	1,240,000	
1819	太平工業	3,000	322	966,000	
1820	西松建設	35,000	147	5,145,000	
1821	三井住友建設	16,200	79	1,279,800	
1822	大豊建設	8,000	70	560,000	
1824	前田建設工業	19,000	256	4,864,000	
1827	ナカノフード建設	2,500	173	432,500	
1833	奥村組	29,000	328	9,512,000	
1834	大和小田急建設	1,500	251	376,500	
1835	東鉄工業	4,000	555	2,220,000	
1852	浅沼組	9,000	73	657,000	
1860	戸田建設	33,000	317	10,461,000	
1861	熊谷組	20,000	68	1,360,000	
1865	青木あすなる建設	2,000	505	1,010,000	
1866	北野建設	7,000	227	1,589,000	
1867	植木組	4,000	119	476,000	
1868	三井ホーム	4,000	515	2,060,000	
1870	矢作建設工業	4,000	600	2,400,000	
1871	ピーエス三菱	1,900	340	646,000	
1878	大東建託	13,200	3,880	51,216,000	
1879	新日本建設	4,200	166	697,200	
1881	N I P P O	6,000	705	4,230,000	
1882	東亜道路工業	6,000	131	786,000	
1883	前田道路	9,000	751	6,759,000	

1884	日本道路	10,000	171	1,710,000	
1885	東亜建設工業	26,000	103	2,678,000	
1888	若築建設	17,000	52	884,000	
1890	東洋建設	41,000	49	2,009,000	
1893	五洋建設	35,000	108	3,780,000	
1896	大林道路	4,000	163	652,000	
1899	福田組	4,000	179	716,000	
1911	住友林業	20,900	686	14,337,400	
1914	日本基礎技術	3,900	207	807,300	
1916	日成ビルド工業	9,000	60	540,000	
1919	エス・バイ・エル	16,000	56	896,000	
1921	巴コーポレーション	4,100	222	910,200	
1924	パナホーム	11,000	562	6,182,000	
1925	大和ハウス工業	76,000	985	74,860,000	
1926	ライト工業	6,300	188	1,184,400	
1928	積水ハウス	85,000	810	68,850,000	
1929	日特建設	8,000	44	352,000	
1930	北陸電気工事	2,000	298	596,000	
1932	コミュニチュア	3,000	571	1,713,000	
1934	ユアテック	5,000	596	2,980,000	
1937	西部電気工業	3,000	394	1,182,000	
1939	四電工	3,000	489	1,467,000	
1941	中電工	4,400	1,381	6,076,400	
1942	関電工	14,000	562	7,868,000	
1943	大明	4,100	785	3,218,500	
1944	きんでん	18,000	760	13,680,000	
1945	東京エネシス	3,000	738	2,214,000	
1946	トーエネック	4,000	547	2,188,000	
1949	住友電設	2,500	445	1,112,500	
1950	日本電設工業	6,000	785	4,710,000	
1951	協和エクシオ	10,900	848	9,243,200	
1952	新日本空調	2,400	643	1,543,200	
1954	日本工営	10,000	291	2,910,000	
1955	東電通	5,000	171	855,000	
1956	日本電話施設	5,000	279	1,395,000	
1959	九電工	6,000	539	3,234,000	
1961	三機工業	7,000	671	4,697,000	
1963	日揮	31,000	1,882	58,342,000	
1964	中外炉工業	10,000	263	2,630,000	
1967	ヤマト	3,000	314	942,000	
1968	太平電業	4,000	1,105	4,420,000	
1969	高砂熱学工業	9,000	737	6,633,000	
1970	日立プラントテクノロジー	8,000	615	4,920,000	
1972	三晃金属工業	3,000	266	798,000	
1973	N E C ネットスアイ	2,500	1,139	2,847,500	
1975	朝日工業社	4,000	366	1,464,000	
1978	アタカ大機	2,000	213	426,000	
1979	大気社	4,300	1,212	5,211,600	
1980	ダイダン	4,000	476	1,904,000	
1982	日比谷総合設備	4,000	798	3,192,000	
1983	東芝プラントシステム	5,000	1,226	6,130,000	
2001	日本製粉	19,000	466	8,854,000	
2002	日清製粉グループ本社	27,500	1,275	35,062,500	
2003	日東富士製粉	3,000	334	1,002,000	
2004	昭和産業	14,000	305	4,270,000	
2009	鳥越製粉	2,600	809	2,103,400	
2052	協同飼料	11,000	125	1,375,000	
2053	中部飼料	3,000	840	2,520,000	
2056	日本配合飼料	9,000	114	1,026,000	
2059	ユニ・チャーム ペットケア	1,700	3,190	5,423,000	
2107	東洋精糖	5,000	137	685,000	
2108	日本甜菜製糖	17,000	233	3,961,000	

2109	三井製糖	12,000	345	4,140,000	
2127	日本M&Aセンター	4	414,000	1,656,000	
2131	アコーディア・ゴルフ	71	88,400	6,276,400	
2168	パソナグループ	28	71,100	1,990,800	
2170	リンクアンドモチベーション	6	47,650	285,900	
2181	テンプホールディングス	3,300	858	2,831,400	
2201	森永製菓	32,000	195	6,240,000	
2204	中村屋	7,000	497	3,479,000	
2206	江崎グリコ	11,000	1,018	11,198,000	
2207	名糖産業	1,200	1,269	1,522,800	
2211	不二家	17,000	180	3,060,000	
2212	山崎製パン	22,000	1,202	26,444,000	
2215	第一屋製パン	4,000	109	436,000	
2217	モロゾフ	5,000	314	1,570,000	
2264	森永乳業	26,000	428	11,128,000	
2267	ヤクルト本社	16,300	2,370	38,631,000	
2269	明治ホールディングス	8,600	3,870	33,282,000	
2270	雪印メグミルク	6,600	1,692	11,167,200	
2281	プリマハム	17,000	106	1,802,000	
2282	日本ハム	23,000	1,109	25,507,000	
2284	伊藤ハム	23,000	367	8,441,000	
2286	林兼産業	10,000	127	1,270,000	
2288	丸大食品	12,000	301	3,612,000	
2290	米久	3,000	925	2,775,000	
2292	S F O O D S	1,500	838	1,257,000	
2301	学情	900	324	291,600	
2305	スタジオアリス	1,300	950	1,235,000	
2309	シミック	50	23,330	1,166,500	
2317	システムプロ	18	44,700	804,600	
2322	N E C フィールドディング	2,300	1,390	3,197,000	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,800	1,715	3,087,000	
2331	総合警備保障	9,500	1,092	10,374,000	
2353	日本駐車場開発	290	4,950	1,435,500	
2359	コア	1,000	647	647,000	
2371	カカクコム	22	343,000	7,546,000	
2372	アイロムホールディングス	63	5,150	324,450	
2378	ルネサンス	1,500	320	480,000	
2392	セキュアード・キャピタル・ジャパン	8	91,000	728,000	
2395	新日本科学	1,500	749	1,123,500	
2413	ソネット・エムスリー	13	325,000	4,225,000	
2432	ディー・エヌ・エー	37	249,000	9,213,000	
2433	博報堂D Yホールディングス	3,920	4,650	18,228,000	
2440	ぐるなび	15	226,900	3,403,500	
2450	一休	20	43,900	878,000	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	5	49,000	245,000	
2462	ジェイコム	3	100,800	302,400	
2466	パシフィックゴルフグループインター ナショナルホールディングス	60	62,900	3,774,000	
2501	サッポロホールディングス	43,000	494	21,242,000	
2502	アサヒビール	52,900	1,626	86,015,400	
2503	キリンホールディングス	124,000	1,512	187,488,000	
2531	宝ホールディングス	26,000	579	15,054,000	
2533	オエノンホールディングス	8,000	195	1,560,000	
2536	メルシャン	9,000	214	1,926,000	
2540	養命酒製造	2,000	904	1,808,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	3,600	772	2,779,200	
2579	コカ・コーラウエスト	7,500	1,782	13,365,000	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,400	1,210	4,114,000	
2590	ダイトードリンコ	1,400	2,855	3,997,000	
2593	伊藤園	8,400	1,616	13,574,400	
2594	キーコーヒー	2,500	1,593	3,982,500	
2597	ユニカフェ	700	1,008	705,600	

2599	ジャパンフーズ	400	825	330,000	
2602	日清オイリオグループ	13,000	470	6,110,000	
2607	不二製油	8,100	1,320	10,692,000	
2613	J - オイルミルズ	11,000	319	3,509,000	
2651	ローソン	8,400	4,060	34,104,000	
2657	インターニックス	1,100	354	389,400	
2659	サンエー	1,000	3,230	3,230,000	
2660	キリン堂	1,100	498	547,800	
2662	ダイユーエイト	400	643	257,200	
2664	カワチ薬品	1,900	1,901	3,611,900	
2670	エービーシー・マート	2,800	2,740	7,672,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	476	571,200	
2676	高千穂交易	1,100	954	1,049,400	
2678	アスクル	2,200	1,880	4,136,000	
2681	ゲオ	49	96,700	4,738,300	
2685	ポイント	2,410	5,730	13,809,300	
2687	シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	121	242,000	
2692	伊藤忠食品	700	3,140	2,198,000	
2695	くらコーポレーション	7	326,000	2,282,000	
2698	キャンドゥ	12	99,800	1,197,600	
2715	エレマテック	2,000	939	1,878,000	
2726	パル	700	1,973	1,381,100	
2729	J A L U X	800	1,290	1,032,000	
2730	エディオン	10,700	757	8,099,900	
2734	サーラコーポレーション	2,500	594	1,485,000	
2737	トーマンデバイス	400	1,810	724,000	
2738	バルス	14	71,000	994,000	
2753	あみやき亭	5	183,500	917,500	
2768	双日	166,200	173	28,752,600	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,400	3,980	25,472,000	
2792	ハニーズ	1,880	636	1,195,680	
2801	キッコーマン	27,000	1,054	28,458,000	
2802	味の素	82,000	874	71,668,000	
2809	キューピー	15,700	1,049	16,469,300	
2810	ハウス食品	11,200	1,478	16,553,600	
2811	カゴメ	11,700	1,749	20,463,300	
2812	焼津水産化学工業	1,500	1,210	1,815,000	
2815	アリアケジャパン	2,500	1,438	3,595,000	
2871	ニチレイ	34,000	338	11,492,000	
2874	ヨコレイ	6,000	615	3,690,000	
2875	東洋水産	12,000	2,530	30,360,000	
2897	日清食品ホールディングス	9,700	3,430	33,271,000	
2899	永谷園	3,000	889	2,667,000	
2908	フジッコ	3,000	1,002	3,006,000	
2910	ロック・フィールド	1,500	1,239	1,858,500	
2914	J T	674	267,700	180,429,800	
2918	わらべや日洋	1,500	1,124	1,686,000	
2922	なとり	1,300	819	1,064,700	
3001	片倉工業	3,300	1,035	3,415,500	
3002	グンゼ	20,000	398	7,960,000	
3003	昭栄	4,500	786	3,537,000	
3004	神栄	4,000	139	556,000	
3009	川島織物セルコン	10,000	75	750,000	
3022	山下医科器械	200	1,283	256,600	
3023	ラサ商事	1,200	337	404,400	
3028	アルペン	2,100	1,674	3,515,400	
3048	ビックカメラ	65	35,650	2,317,250	
3050	D C M Japanホールディングス	13,400	599	8,026,600	
3076	あい ホールディングス	6,200	324	2,008,800	
3078	ユニバース	400	1,442	576,800	
3086	J . フロント リテイリング	68,000	472	32,096,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,800	1,349	5,126,200	

3088	マツモトキヨシホールディングス	5,000	2,075	10,375,000	
3098	ココカラファイン ホールディングス	1,500	2,240	3,360,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	49,500	918	45,441,000	
3101	東洋紡	101,000	148	14,948,000	
3103	ユニチカ	64,000	79	5,056,000	
3104	富士紡ホールディングス	12,000	164	1,968,000	
3105	日清紡ホールディングス	20,000	912	18,240,000	
3106	クラボウ	29,000	171	4,959,000	
3107	ダイワボウホールディングス	20,000	393	7,860,000	
3109	シキボウ	18,000	237	4,266,000	
3110	日東紡	27,000	171	4,617,000	
3116	トヨタ紡織	9,500	2,010	19,095,000	
3148	クリエイトSDホールディングス	900	2,050	1,845,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,300	549	1,811,700	
3156	UKCホールディングス	1,100	1,492	1,641,200	
3201	ニッケ	10,000	635	6,350,000	
3202	大東紡織	4,000	87	348,000	
3204	トーア紡コーポレーション	10,000	74	740,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,800	641	2,435,800	
3225	東京建物不動産販売	1,200	298	357,600	
3231	野村不動産ホールディングス	9,600	1,560	14,976,000	
3265	ヒューリック	7,400	636	4,706,400	
3302	帝国繊維	3,000	528	1,584,000	
3313	ブックオフコーポレーション	1,500	1,301	1,951,500	
3315	日本コークス工業	17,500	119	2,082,500	
3321	ミタチ産業	600	474	284,400	
3332	JFE商事ホールディングス	18,000	360	6,480,000	
3333	あさひ	900	1,688	1,519,200	
3337	サークルKサンクス	6,500	1,268	8,242,000	
3341	日本調剤	470	2,160	1,015,200	
3349	コスモス薬品	1,000	2,370	2,370,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	31	57,300	1,776,300	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	106,900	2,050	219,145,000	
3391	ツルハホールディングス	2,000	3,550	7,100,000	
3395	サンマルクホールディングス	900	2,700	2,430,000	
3396	フェリシモ	800	1,520	1,216,000	
3397	トリドール	7	202,800	1,419,600	
3401	帝人	116,000	282	32,712,000	
3402	東レ	189,000	542	102,438,000	
3404	三菱レイヨン	71,000	319	22,649,000	
3405	クラレ	42,000	1,008	42,336,000	
3407	旭化成	177,000	467	82,659,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	92	736,000	
3421	稲葉製作所	1,400	933	1,306,200	
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,000	80	720,000	
3432	三協・立山ホールディングス	36,000	99	3,564,000	
3433	トーカロ	1,700	1,595	2,711,500	
3434	アルファCo	1,000	539	539,000	
3436	SUMCO	15,200	1,909	29,016,800	
3443	川田テクノロジーズ	700	1,574	1,101,800	
3501	住江織物	7,000	132	924,000	
3512	日本フェルト	1,500	434	651,000	
3513	イチカワ	2,000	208	416,000	
3514	日本バイリーン	4,000	509	2,036,000	
3524	日東製網	4,000	121	484,000	
3526	芦森工業	7,000	146	1,022,000	
3529	アツギ	26,000	118	3,068,000	
3551	ダイニック	6,000	148	888,000	
3553	共和レザー	1,700	366	622,200	
3569	セーレン	7,100	578	4,103,800	
3577	東海染工	4,000	133	532,000	
3580	小松精練	5,000	358	1,790,000	

3591	ワコールホールディングス	17,000	1,100	18,700,000	
3593	ホギメディカル	1,400	4,820	6,748,000	
3605	サンエー・インターナショナル	1,400	1,121	1,569,400	
3606	レナウン	4,800	171	820,800	
3607	クラウドディア	300	1,393	417,900	
3626	I Tホールディングス	8,700	1,208	10,509,600	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,100	786	3,222,600	
3708	特種東海ホールディングス	19,000	231	4,389,000	
3715	ドワンゴ	15	206,800	3,102,000	
3724	ベリサーブ	1	215,500	215,500	
3730	マクロミル	15	143,800	2,157,000	
3738	ティーガイア	22	168,100	3,698,200	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	6	123,300	739,800	
3770	ザップラス	9	152,100	1,368,900	
3774	インターネットイニシアティブ	16	208,800	3,340,800	
3789	ソネットエンタテインメント	15	197,500	2,962,500	
3817	S R Aホールディングス	1,300	799	1,038,700	
3820	J B I Sホールディングス	3,000	349	1,047,000	
3834	朝日ネット	2,000	293	586,000	
3861	王子製紙	117,000	406	47,502,000	
3864	三菱製紙	40,000	122	4,880,000	
3865	北越紀州製紙	18,000	493	8,874,000	
3877	中越パルプ工業	11,000	190	2,090,000	
3878	巴川製紙所	4,000	236	944,000	
3880	大王製紙	12,000	781	9,372,000	
3893	日本製紙グループ本社	13,700	2,495	34,181,500	
3941	レンゴー	22,000	519	11,418,000	
3946	トーモク	9,000	212	1,908,000	
3950	ザ・パック	1,800	1,379	2,482,200	
4003	コープケミカル	4,000	169	676,000	
4004	昭和電工	170,000	179	30,430,000	
4005	住友化学	209,000	378	79,002,000	
4007	日本化成	5,000	207	1,035,000	
4008	住友精化	5,000	354	1,770,000	
4021	日産化学工業	19,000	1,275	24,225,000	
4022	ラサ工業	11,000	108	1,188,000	
4023	クレハ	18,000	498	8,964,000	
4027	テイカ	5,000	276	1,380,000	
4028	石原産業	44,000	77	3,388,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	296	592,000	
4041	日本曹達	17,000	393	6,681,000	
4042	東ソー	76,000	227	17,252,000	
4043	トクヤマ	44,000	607	26,708,000	
4044	セントラル硝子	29,000	395	11,455,000	
4045	東亜合成	31,000	316	9,796,000	
4046	ダイソー	11,000	252	2,772,000	
4047	関東電化工業	6,000	800	4,800,000	
4061	電気化学工業	60,000	364	21,840,000	
4062	イビデン	19,000	3,370	64,030,000	
4063	信越化学工業	47,300	5,310	251,163,000	
4064	日本カーバイド工業	6,000	114	684,000	
4078	堺化学工業	10,000	384	3,840,000	
4088	エア・ウォーター	20,000	1,105	22,100,000	
4091	大陽日酸	44,000	1,071	47,124,000	
4092	日本化学工業	10,000	239	2,390,000	
4095	日本パーカラライジング	7,000	1,020	7,140,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	530	2,120,000	
4099	四国化成工業	4,000	597	2,388,000	
4100	戸田工業	4,000	951	3,804,000	
4109	ステラ ケミファ	1,400	5,270	7,378,000	
4112	保土谷化学工業	7,000	241	1,687,000	
4114	日本触媒	19,000	792	15,048,000	

4116	大日精化工業	10,000	315	3,150,000	
4118	カネカ	35,000	623	21,805,000	
4151	協和発酵キリン	39,000	1,093	42,627,000	
4182	三菱ガス化学	49,000	439	21,511,000	
4183	三井化学	87,000	320	27,840,000	
4185	J S R	25,800	1,810	46,698,000	
4186	東京応化工業	5,500	1,801	9,905,500	
4188	三菱ケミカルホールディングス	165,000	357	58,905,000	
4201	日本合成化学工業	7,000	659	4,613,000	
4202	ダイセル化学工業	37,000	558	20,646,000	
4203	住友ペークライト	29,000	433	12,557,000	
4204	積水化学工業	64,000	510	32,640,000	
4205	日本ゼオン	25,000	413	10,325,000	
4206	アイカ工業	8,800	890	7,832,000	
4208	宇部興産	119,000	245	29,155,000	
4212	積水樹脂	4,000	744	2,976,000	
4215	タキロン	7,000	263	1,841,000	
4216	旭有機材工業	10,000	231	2,310,000	
4217	日立化成工業	12,300	1,941	23,874,300	
4218	ニチバン	3,000	318	954,000	
4220	リケンテクノス	5,000	219	1,095,000	
4221	大倉工業	7,000	276	1,932,000	
4228	積水化成成品工業	7,000	369	2,583,000	
4229	群栄化学工業	8,000	215	1,720,000	
4231	タイガースポリマー	1,400	408	571,200	
4271	日本カーリット	2,300	467	1,074,100	
4272	日本化薬	20,000	859	17,180,000	
4282	イーピーエス	8	362,000	2,896,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	500	2,580	1,290,000	
4295	フェイス	111	10,800	1,198,800	
4301	アミューズ	700	1,035	724,500	
4307	野村総合研究所	13,300	2,035	27,065,500	
4310	ドリームインキュベータ	9	64,800	583,200	
4312	サイバネットシステム	22	36,450	801,900	
4319	T A C	1,400	384	537,600	
4321	ケネディクス	132	35,850	4,732,200	
4324	電通	28,100	2,055	57,745,500	
4326	インテージ	700	1,700	1,190,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	76	12,460	946,960	
4337	ぴあ	700	1,261	882,700	
4340	シンプレクス・テクノロジー	45	43,600	1,962,000	
4343	イオンファンタジー	900	1,152	1,036,800	
4344	ソースネクスト	4	25,100	100,400	
4362	日本精化	2,400	899	2,157,600	
4401	A D E K A	12,200	857	10,455,400	
4403	日油	25,000	448	11,200,000	
4404	ミヨシ油脂	10,000	142	1,420,000	
4410	ハリマ化成	3,000	570	1,710,000	
4452	花王	72,800	2,160	157,248,000	
4461	第一工業製薬	5,000	281	1,405,000	
4471	三洋化成工業	9,000	491	4,419,000	
4502	武田薬品工業	99,700	3,610	359,917,000	代用有価証券 10,000株
4503	アステラス製薬	60,100	3,580	215,158,000	
4506	大日本住友製薬	20,100	953	19,155,300	
4507	塩野義製薬	41,400	2,105	87,147,000	
4508	田辺三菱製薬	28,000	1,182	33,096,000	
4512	わかもと製薬	3,000	335	1,005,000	
4514	あすか製薬	3,000	834	2,502,000	
4516	日本新薬	7,000	1,261	8,827,000	
4519	中外製薬	28,300	1,795	50,798,500	

[次へ](#)

4521	科研製薬	12,000	826	9,912,000	
4523	エーザイ	34,900	3,290	114,821,000	
4527	ロート製薬	13,000	1,147	14,911,000	
4528	小野薬品工業	14,300	4,320	61,776,000	
4530	久光製薬	8,800	3,160	27,808,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	259	518,000	
4534	持田製薬	12,000	885	10,620,000	
4535	大正製薬	25,000	1,675	41,875,000	
4536	参天製薬	8,800	3,100	27,280,000	
4537	エスエス製薬	6,000	488	2,928,000	
4538	扶桑薬品工業	10,000	288	2,880,000	
4539	日本ケミファ	5,000	299	1,495,000	
4540	ツムラ	8,300	3,130	25,979,000	
4543	テルモ	19,500	4,760	92,820,000	
4544	みらかホールディングス	5,400	2,930	15,822,000	
4547	キッセイ薬品工業	6,000	2,090	12,540,000	
4548	生化学工業	5,400	1,150	6,210,000	
4549	栄研化学	1,800	1,094	1,969,200	
4550	日水製薬	1,200	708	849,600	
4551	鳥居薬品	1,700	1,818	3,090,600	
4553	東和薬品	1,200	4,650	5,580,000	
4555	沢井製薬	1,800	5,260	9,468,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,000	4,000,000	
4568	第一三共	83,600	1,808	151,148,800	
4569	キョーリン	7,000	1,473	10,311,000	
4611	大日本塗料	16,000	109	1,744,000	
4612	日本ペイント	31,000	516	15,996,000	
4613	関西ペイント	32,000	741	23,712,000	
4614	トウペ	3,000	101	303,000	
4617	中国塗料	8,000	624	4,992,000	
4619	日本特殊塗料	2,200	339	745,800	
4620	藤倉化成	3,300	481	1,587,300	
4626	太陽インキ製造	2,100	2,185	4,588,500	
4631	D I C	93,000	143	13,299,000	
4633	サカタインクス	6,000	364	2,184,000	
4634	東洋インキ製造	28,000	330	9,240,000	
4641	アルプス技研	1,200	581	697,200	
4651	サニックス	4,100	167	684,700	
4653	ダイオーズ	500	484	242,000	
4658	日本空調サービス	700	699	489,300	
4661	オリエンタルランド	7,600	6,160	46,816,000	
4665	ダスキン	8,500	1,634	13,889,000	
4666	パーク24	14,900	1,077	16,047,300	
4668	明光ネットワークジャパン	2,400	581	1,394,400	
4671	ファルコバイオシステムズ	1,500	1,043	1,564,500	
4674	クレスコ	800	430	344,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	279	135,200	37,720,800	
4678	秀英予備校	600	556	333,600	
4679	田谷	400	689	275,600	
4680	ラウンドワン	4,800	698	3,350,400	
4681	リゾートトラスト	4,800	1,132	5,433,600	
4684	オービック	840	14,190	11,919,600	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	600	748	448,800	
4689	ヤフー	1,957	28,850	56,459,450	
4694	ビー・エム・エル	1,500	2,410	3,615,000	
4696	ワタベウェディング	800	1,180	944,000	
4704	トレンドマイクロ	10,600	3,310	35,086,000	
4708	もしもしホットライン	2,050	1,621	3,323,050	
4711	東急コミュニティー	700	1,992	1,394,400	
4714	リソー教育	287	5,530	1,587,110	
4716	日本オラクル	4,300	3,960	17,028,000	

4719	アルファシステムズ	700	1,715	1,200,500	
4722	フューチャーアーキテクト	28	37,200	1,041,600	
4724	ウェアハウス	700	453	317,100	
4725	シーエーシー	1,600	642	1,027,200	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	652	391,200	
4728	トーセ	700	611	427,700	
4732	ユー・エス・エス	3,850	5,450	20,982,500	
4733	オービックビジネスコンサルタント	850	4,430	3,765,500	
4738	日立ビジネスソリューション	900	683	614,700	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	3,300	2,580	8,514,000	
4743	アイティフォー	3,000	330	990,000	
4745	東京個別指導学院	2,200	188	413,600	
4746	東計電算	500	1,189	594,500	
4756	カルチュア・コンビニエンス・クラブ	13,000	569	7,397,000	
4762	エックスネット	3	134,300	402,900	
4767	テー・オー・ダブリュー	600	533	319,800	
4768	大塚商会	2,100	4,850	10,185,000	
4775	総合メディカル	700	2,485	1,739,500	
4776	サイボウズ	40	40,350	1,614,000	
4779	ソフトブレーン	37	5,700	210,900	
4799	アグレックス	500	797	398,500	
4801	セントラルスポーツ	800	863	690,400	
4812	I S I D	1,900	624	1,185,600	
4825	ウェザーニューズ	700	1,272	890,400	
4826	C I J	2,700	306	826,200	
4901	富士フイルムホールディングス	69,300	2,440	169,092,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	71,500	929	66,423,500	
4911	資生堂	48,300	1,627	78,584,100	
4912	ライオン	33,000	468	15,444,000	
4914	高砂香料工業	10,000	469	4,690,000	
4917	マンダム	2,900	2,360	6,844,000	
4919	ミルボン	1,300	2,300	2,990,000	
4921	ファンケル	4,900	1,602	7,849,800	
4922	コーセー	4,600	2,045	9,407,000	
4924	ドクターシーラボ	19	192,000	3,648,000	
4951	エステー	2,000	1,026	2,052,000	
4956	コニシ	2,200	880	1,936,000	
4958	長谷川香料	3,600	1,405	5,058,000	
4967	小林製薬	3,900	3,870	15,093,000	
4968	荒川化学工業	2,400	1,016	2,438,400	
4971	メック	1,900	734	1,394,600	
4973	日本高純度化学	8	354,000	2,832,000	
4975	荏原ユージライト	300	1,810	543,000	
4985	アース製薬	2,000	2,940	5,880,000	
4989	イハラケミカル工業	5,000	328	1,640,000	
4992	北興化学工業	3,000	309	927,000	
4994	大成ラミック	800	2,195	1,756,000	
4996	クミアイ化学工業	6,000	352	2,112,000	
4997	日本農薬	6,000	614	3,684,000	
5001	新日本石油	197,000	481	94,757,000	
5002	昭和シェル石油	25,400	940	23,876,000	
5007	コスモ石油	79,000	259	20,461,000	
5009	富士興産	10,000	75	750,000	
5011	ニチレキ	4,000	396	1,584,000	
5012	東燃ゼネラル石油	38,000	839	31,882,000	
5013	ユシロ化学工業	1,400	1,426	1,996,400	
5015	ビーピー・カストロール	1,300	345	448,500	
5016	新日鉱ホールディングス	117,000	432	50,544,000	
5017	A O C ホールディングス	6,600	672	4,435,200	
5019	出光興産	3,400	6,940	23,596,000	
5101	横浜ゴム	35,000	416	14,560,000	
5105	東洋ゴム工業	29,000	173	5,017,000	

5108	ブリヂストン	82,200	1,593	130,944,600	
5110	住友ゴム工業	19,900	839	16,696,100	
5121	藤倉ゴム工業	1,800	397	714,600	
5122	オカモト	12,000	350	4,200,000	
5142	アキレス	23,000	135	3,105,000	
5185	フコク	1,400	647	905,800	
5186	ニッタ	2,500	1,366	3,415,000	
5187	クリエートメディック	800	908	726,400	
5191	東海ゴム工業	5,300	1,064	5,639,200	
5192	三ツ星ベルト	9,000	344	3,096,000	
5195	バンドー化学	10,000	234	2,340,000	
5196	鬼怒川ゴム工業	7,000	170	1,190,000	
5201	旭硝子	130,000	795	103,350,000	
5202	日本板硝子	90,000	300	27,000,000	
5204	石塚硝子	4,000	202	808,000	
5208	有沢製作所	3,800	634	2,409,200	
5210	日本山村硝子	13,000	289	3,757,000	
5214	日本電気硝子	46,000	993	45,678,000	
5218	オハラ	1,100	1,385	1,523,500	
5232	住友大阪セメント	54,000	168	9,072,000	
5233	太平洋セメント	112,000	114	12,768,000	
5234	デイ・シイ	2,300	290	667,000	
5261	リゾートソリューション	3,000	151	453,000	
5262	日本ヒューム	2,000	266	532,000	
5269	日本コンクリート工業	5,000	157	785,000	
5301	東海カーボン	26,000	473	12,298,000	
5302	日本カーボン	15,000	330	4,950,000	
5310	東洋炭素	1,200	4,710	5,652,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	15,000	285	4,275,000	
5332	TOTO	44,000	559	24,596,000	
5333	日本ガイシ	34,000	2,170	73,780,000	
5334	日本特殊陶業	25,000	1,042	26,050,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	110	440,000	
5344	MARUWA	800	2,095	1,676,000	
5351	品川リフラクトリーズ	8,000	192	1,536,000	
5352	黒崎播磨	7,000	148	1,036,000	
5363	TYK	4,000	211	844,000	
5367	ニッカトー	1,100	420	462,000	
5384	フジインコーポレーテッド	2,800	1,514	4,239,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	75	450,000	
5393	ニチアス	14,000	336	4,704,000	
5401	新日本製鐵	745,000	354	263,730,000	
5405	住友金属工業	485,000	234	113,490,000	
5406	神戸製鋼所	393,000	167	65,631,000	
5407	日新製鋼	109,000	157	17,113,000	
5408	中山製鋼所	16,000	157	2,512,000	
5410	合同製鐵	17,000	183	3,111,000	
5411	JFEホールディングス	72,400	3,130	226,612,000	
5423	東京製鐵	11,700	1,190	13,923,000	
5440	共英製鋼	2,300	2,030	4,669,000	
5444	大和工業	6,700	2,885	19,329,500	
5445	東京鐵鋼	6,000	311	1,866,000	
5449	大阪製鐵	1,800	1,620	2,916,000	
5451	淀川製鋼所	22,000	386	8,492,000	
5453	東洋鋼鈑	6,000	417	2,502,000	
5457	住友鋼管	1,900	520	988,000	
5463	丸一鋼管	7,900	1,733	13,690,700	
5464	モリ工業	5,000	194	970,000	
5471	大同特殊鋼	44,000	330	14,520,000	
5476	日本高周波鋼業	11,000	100	1,100,000	
5479	日本金属工業	19,000	172	3,268,000	
5480	日本冶金工業	15,500	480	7,440,000	

5481	山陽特殊製鋼	14,000	327	4,578,000	
5482	愛知製鋼	15,000	411	6,165,000	
5486	日立金属	18,000	957	17,226,000	
5491	日本金属	7,000	176	1,232,000	
5541	大平洋金属	20,000	758	15,160,000	
5563	日本電工	12,000	688	8,256,000	
5602	栗本鐵工所	13,000	93	1,209,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	133	399,000	
5631	日本製鋼所	41,000	1,065	43,665,000	
5632	三菱製鋼	17,000	189	3,213,000	
5658	日亜鋼業	4,000	295	1,180,000	
5659	日本精線	2,000	265	530,000	
5701	日本軽金属	69,000	86	5,934,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	5,000	228	1,140,000	
5706	三井金属	82,000	255	20,910,000	
5707	東邦亜鉛	16,000	508	8,128,000	
5711	三菱マテリアル	172,000	258	44,376,000	
5713	住友金属鉱山	74,000	1,566	115,884,000	
5714	DOWAホールディングス	36,000	580	20,880,000	
5715	古河機械金属	48,000	128	6,144,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	2,660	7,448,000	
5727	東邦チタニウム	4,600	1,215	5,589,000	
5738	住友軽金属工業	47,000	83	3,901,000	
5741	古河スカイ	13,000	146	1,898,000	
5801	古河電気工業	89,000	371	33,019,000	
5802	住友電気工業	93,600	1,187	111,103,200	
5803	フジクラ	42,000	485	20,370,000	
5804	三菱電線工業	18,000	88	1,584,000	
5805	昭和電線ホールディングス	34,000	94	3,196,000	
5809	タツタ電線	7,000	208	1,456,000	
5812	日立電線	22,000	257	5,654,000	
5815	沖電線	3,000	137	411,000	
5819	カナレ電気	300	1,055	316,500	
5821	平河ヒューテック	800	697	557,600	
5851	リョービ	17,000	247	4,199,000	
5857	アサヒホールディングス	4,000	1,600	6,400,000	
5901	東洋製罐	21,900	1,586	34,733,400	
5902	ホッカンホールディングス	7,000	237	1,659,000	
5909	コロナ	1,300	1,312	1,705,600	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	749	3,745,000	
5915	駒井鉄工	4,000	198	792,000	
5929	三和ホールディングス	28,000	275	7,700,000	
5930	文化シャッター	7,000	311	2,177,000	
5936	東洋シャッター	700	674	471,800	
5938	住生活グループ	34,300	1,499	51,415,700	
5942	日本フィルコン	2,100	501	1,052,100	
5943	ノーリツ	4,300	1,185	5,095,500	
5946	長府製作所	3,000	1,844	5,532,000	
5947	リンナイ	5,500	3,930	21,615,000	
5949	ユニプレス	3,800	1,320	5,016,000	
5951	ダイニチ工業	1,600	601	961,600	
5957	日東精工	4,000	239	956,000	
5958	三洋工業	4,000	151	604,000	
5959	岡部	5,600	334	1,870,400	
5963	日立ツール	1,600	835	1,336,000	
5974	中国工業	4,000	97	388,000	
5975	東プレ	5,900	780	4,602,000	
5976	ネツレン	4,100	676	2,771,600	
5981	東京製綱	20,000	287	5,740,000	
5988	パイオラックス	1,200	1,585	1,902,000	
5991	ニッパツ	18,000	726	13,068,000	
5992	中央発條	4,000	267	1,068,000	

5998	アドバネクス	5,000	73	365,000	
6005	三浦工業	4,200	2,530	10,626,000	
6013	タクマ	11,000	236	2,596,000	
6101	ツガミ	8,000	180	1,440,000	
6103	オークマ	17,000	476	8,092,000	
6104	東芝機械	15,000	313	4,695,000	
6113	アマダ	43,000	601	25,843,000	
6118	アイダエンジニアリング	7,300	286	2,087,800	
6135	牧野フライス製作所	13,000	374	4,862,000	
6136	OSG	11,700	954	11,161,800	
6138	ダイジェット工業	3,000	144	432,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	7,000	666	4,662,000	
6141	森精機製作所	12,200	1,033	12,602,600	
6146	ディスコ	2,600	5,570	14,482,000	
6151	日東工器	1,700	1,912	3,250,400	
6201	豊田自動織機	21,900	2,530	55,407,000	
6203	豊和工業	16,000	55	880,000	
6205	OKK	10,000	79	790,000	
6210	東洋機械金属	1,800	139	250,200	
6213	オーエム製作所	2,000	287	574,000	
6217	津田駒工業	7,000	130	910,000	
6222	島精機製作所	3,400	1,906	6,480,400	
6242	日本スピンドル製造	4,000	145	580,000	
6247	日阪製作所	3,000	1,019	3,057,000	
6250	やまびこ	1,000	1,239	1,239,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,500	180	450,000	
6268	ナブテスコ	12,000	1,119	13,428,000	
6269	三井海洋開発	1,900	1,965	3,733,500	
6272	レオン自動機	3,000	269	807,000	
6273	SMC	8,500	11,100	94,350,000	
6274	新川	2,500	1,556	3,890,000	
6277	ホソカワミクロン	4,000	369	1,476,000	
6278	ユニオンツール	1,800	2,720	4,896,000	
6282	オイレス工業	3,100	1,565	4,851,500	
6287	サトー	3,000	1,126	3,378,000	
6291	日本エアテック	800	648	518,400	
6293	日精樹脂工業	2,300	291	669,300	
6298	ワイエイシイ	1,200	820	984,000	
6301	コマツ	126,100	1,878	236,815,800	
6302	住友重機械工業	72,000	443	31,896,000	
6305	日立建機	14,500	2,400	34,800,000	
6306	日工	4,000	267	1,068,000	
6309	巴工業	1,100	1,476	1,623,600	
6310	井関農機	29,000	364	10,556,000	
6315	TOWA	2,500	751	1,877,500	
6316	丸山製作所	6,000	192	1,152,000	
6317	北川鉄工所	13,000	104	1,352,000	
6319	シンニッタン	2,500	250	625,000	
6326	クボタ	130,000	732	95,160,000	
6328	荏原実業	600	1,356	813,600	
6330	東洋エンジニアリング	18,000	326	5,868,000	
6331	三菱化工機	9,000	243	2,187,000	
6332	月島機械	4,000	571	2,284,000	
6333	帝国電機製作所	1,000	1,863	1,863,000	
6339	新東工業	5,700	664	3,784,800	
6340	澁谷工業	1,600	841	1,345,600	
6345	アイチコーポレーション	4,700	442	2,077,400	
6349	小森コーポレーション	8,100	1,110	8,991,000	
6351	鶴見製作所	2,000	666	1,332,000	
6355	住友精密工業	5,000	285	1,425,000	
6358	酒井重工業	6,000	141	846,000	
6361	荏原	61,000	434	26,474,000	

6362	石井鐵工所	4,000	175	700,000	
6363	西島製作所	2,500	1,644	4,110,000	
6366	千代田化工建設	24,000	694	16,656,000	
6367	ダイキン工業	29,600	3,260	96,496,000	
6368	オルガノ	5,000	685	3,425,000	
6369	トーヨーカネツ	18,000	154	2,772,000	
6370	栗田工業	15,700	2,995	47,021,500	
6371	椿本チエイン	15,000	419	6,285,000	
6373	大同工業	5,000	159	795,000	
6374	T C M	7,000	238	1,666,000	
6375	日本コンベヤ	10,000	81	810,000	
6376	日機装	8,000	692	5,536,000	
6378	木村化工機	2,600	976	2,537,600	
6379	新興プランテック	5,100	944	4,814,400	
6381	アネスト岩田	6,000	299	1,794,000	
6383	ダイフク	11,500	586	6,739,000	
6390	加藤製作所	6,000	183	1,098,000	
6393	油研工業	5,000	135	675,000	
6395	タダノ	13,000	446	5,798,000	
6406	フジテック	8,000	470	3,760,000	
6407	C K D	7,600	841	6,391,600	
6409	キトー	8	93,300	746,400	
6412	平和	5,000	910	4,550,000	
6413	理想科学工業	2,200	1,105	2,431,000	
6417	S A N K Y O	7,400	5,380	39,812,000	
6418	日本金銭機械	3,000	753	2,259,000	
6419	マースエンジニアリング	1,300	2,980	3,874,000	
6420	福島工業	900	847	762,300	
6421	キャノンファインテック	2,100	1,252	2,629,200	
6428	オーイズミ	1,000	223	223,000	
6430	ダイコク電機	1,100	1,833	2,016,300	
6436	アマノ	8,200	792	6,494,400	
6440	J U K I	14,000	100	1,400,000	
6444	サンデン	15,000	282	4,230,000	
6445	蛇の目ミシン工業	26,000	65	1,690,000	
6448	ブラザー工業	32,700	1,093	35,741,100	
6454	マックス	5,000	903	4,515,000	
6455	モリタホールディングス	4,000	474	1,896,000	
6457	グローリー	8,200	2,055	16,851,000	
6459	大和冷機工業	4,000	486	1,944,000	
6460	セガサミーホールディングス	31,000	1,250	38,750,000	
6461	日本ピストンリング	11,000	106	1,166,000	
6462	リケン	12,000	333	3,996,000	
6463	T P R	3,300	375	1,237,500	
6465	ホシザキ電機	5,500	1,294	7,117,000	
6470	大豊工業	2,100	669	1,404,900	
6471	日本精工	56,000	573	32,088,000	
6472	N T N	54,000	394	21,276,000	
6473	ジェイテクト	27,100	1,054	28,563,400	
6474	不二越	27,000	205	5,535,000	
6479	ミネベア	40,000	395	15,800,000	
6480	日本トムソン	9,000	503	4,527,000	
6481	T H K	16,900	1,716	29,000,400	
6482	ユーシン精機	1,200	1,480	1,776,000	
6485	前澤給装工業	1,100	1,350	1,485,000	
6486	イーグル工業	3,000	484	1,452,000	
6489	前澤工業	2,200	174	382,800	
6490	日本ピラー工業	3,000	411	1,233,000	
6498	キッツ	12,000	489	5,868,000	
6501	日立製作所	454,000	299	135,746,000	
6502	東芝	535,000	560	299,600,000	
6503	三菱電機	253,000	746	188,738,000	

6504	富士電機ホールディングス	63,000	178	11,214,000	
6505	東洋電機製造	6,000	859	5,154,000	
6506	安川電機	30,000	778	23,340,000	
6507	シンフォニア テクノロジー	17,000	228	3,876,000	
6508	明電舎	25,000	515	12,875,000	
6513	オリジン電気	4,000	250	1,000,000	
6517	デンヨー	2,800	685	1,918,000	
6581	日立工機	9,300	1,016	9,448,800	
6584	三桜工業	3,400	595	2,023,000	
6586	マキタ	16,500	3,160	52,140,000	
6588	東芝テック	19,000	392	7,448,000	
6590	芝浦メカトロニクス	5,000	333	1,665,000	
6592	マブチモーター	3,700	4,360	16,132,000	
6594	日本電産	13,400	7,430	99,562,000	
6621	高岳製作所	11,000	313	3,443,000	
6622	ダイヘン	14,000	339	4,746,000	
6632	JVC・ケンウッド・ホールディングス	100,900	46	4,641,400	
6641	日新電機	6,000	504	3,024,000	
6644	大崎電気工業	4,000	920	3,680,000	
6645	オムロン	32,200	1,567	50,457,400	
6651	日東工業	4,100	917	3,759,700	
6652	I D E C	3,500	712	2,492,000	
6665	エルピーダメモリ	18,200	1,369	24,915,800	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	49,000	841	41,209,000	
6675	サクサホールディングス	7,000	208	1,456,000	
6676	メルコホールディングス	1,500	1,851	2,776,500	
6678	テクノメディカ	2	287,000	574,000	
6701	N E C	274,000	277	75,898,000	
6702	富士通	286,000	567	162,162,000	
6703	O K I	86,000	79	6,794,000	
6704	岩崎通信機	12,000	84	1,008,000	
6706	電気興業	7,000	423	2,961,000	
6707	サンケン電気	16,000	328	5,248,000	
6715	ナカヨ通信機	3,000	181	543,000	
6718	アイホン	1,900	1,600	3,040,000	
6723	N E C エレクトロニクス	5,200	796	4,139,200	
6724	セイコーエプソン	20,500	1,476	30,258,000	
6727	ワコム	53	218,300	11,569,900	
6728	アルバック	4,300	2,250	9,675,000	
6737	ナナオ	2,300	2,160	4,968,000	
6741	日本信号	6,800	884	6,011,200	
6742	京三製作所	6,000	433	2,598,000	
6744	能美防災	4,000	704	2,816,000	
6745	ホーチキ	3,000	521	1,563,000	
6749	マスプロ電工	2,100	899	1,887,900	
6751	日本無線	11,000	186	2,046,000	
6752	パナソニック	289,100	1,257	363,398,700	
6753	シャープ	131,000	1,013	132,703,000	
6754	アンリツ	14,000	289	4,046,000	
6755	富士通ゼネラル	7,000	327	2,289,000	
6756	日立国際電気	8,000	643	5,144,000	
6758	ソニー	143,800	2,715	390,417,000	
6762	T D K	14,200	5,300	75,260,000	
6763	帝国通信工業	6,000	216	1,296,000	
6764	三洋電機	268,000	218	58,424,000	
6767	ミツミ電機	9,600	1,956	18,777,600	
6768	タムラ製作所	8,000	323	2,584,000	
6770	アルプス電気	22,900	608	13,923,200	
6771	池上通信機	9,000	84	756,000	
6773	パイオニア	21,200	226	4,791,200	
6779	日本電波工業	2,100	1,835	3,853,500	
6788	日本トリム	400	1,845	738,000	

[次へ](#)

6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	1,172	1,289,200	
6791	コロムビアミュージックエンタテインメント	19,000	36	684,000	
6794	フォスター電機	2,600	2,450	6,370,000	
6796	クラリオン	12,000	92	1,104,000	
6798	S M K	8,000	606	4,848,000	
6800	ヨコオ	2,300	542	1,246,600	
6801	東光	12,000	135	1,620,000	
6803	ティアック	12,000	40	480,000	
6804	ホシデン	6,700	1,178	7,892,600	
6806	ヒロセ電機	4,700	9,620	45,214,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	475	2,850,000	
6809	T O A	3,000	565	1,695,000	
6810	日立マクセル	5,600	1,769	9,906,400	
6815	ユニデン	8,000	208	1,664,000	
6816	アルパイン	5,900	924	5,451,600	
6817	スミダ コーポレーション	1,900	642	1,219,800	
6820	アイコム	1,500	2,210	3,315,000	
6839	船井電機	2,400	4,400	10,560,000	
6841	横河電機	29,400	798	23,461,200	
6844	新電元工業	10,000	226	2,260,000	
6845	山武	7,000	2,040	14,280,000	
6849	日本光電	5,400	1,324	7,149,600	
6850	チノー	5,000	244	1,220,000	
6853	共和電業	3,000	272	816,000	
6855	日本電子材料	1,100	639	702,900	
6856	堀場製作所	4,300	2,245	9,653,500	
6857	アドバンテスト	18,500	2,380	44,030,000	
6858	小野測器	3,000	412	1,236,000	
6859	エスベック	2,600	574	1,492,400	
6860	S U N X	2,400	320	768,000	
6861	キーエンス	5,600	18,480	103,488,000	
6866	H I O K I	1,300	1,803	2,343,900	
6869	シスメックス	5,200	3,940	20,488,000	
6875	メガチップス	2,500	1,594	3,985,000	
6877	O B A R A	1,900	894	1,698,600	
6883	日本電産コバル電子	2,800	577	1,615,600	
6885	ミヤチテクノス	1,300	676	878,800	
6900	東京電波	1,000	614	614,000	
6901	澤藤電機	2,000	158	316,000	
6902	デンソー	59,600	2,745	163,602,000	
6905	コーセル	3,600	1,029	3,704,400	
6910	日立メディコ	2,000	809	1,618,000	
6911	新日本無線	2,000	203	406,000	
6914	オブテックス	1,900	1,013	1,924,700	
6915	千代田インテグレ	1,400	1,219	1,706,600	
6921	東光電気	2,000	510	1,020,000	
6923	スタンレー電気	19,000	1,918	36,442,000	
6924	岩崎電気	9,000	177	1,593,000	
6925	ウシオ電機	15,300	1,472	22,521,600	
6926	岡谷電機産業	1,500	239	358,500	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,300	369	848,700	
6929	日本セラミック	1,800	1,229	2,212,200	
6934	新神戸電機	3,000	1,212	3,636,000	
6935	日本デジタル研究所	2,600	1,161	3,018,600	
6937	古河電池	2,000	850	1,700,000	
6938	双信電機	1,300	403	523,900	
6941	山一電機	2,300	194	446,200	
6947	図研	1,900	734	1,394,600	
6951	日本電子	10,000	375	3,750,000	
6952	カシオ計算機	25,800	692	17,853,600	
6954	ファナック	26,200	8,160	213,792,000	

6958	日本CMK	5,300	664	3,519,200	
6961	エンプラス	1,600	1,508	2,412,800	
6963	ローム	13,600	6,230	84,728,000	
6965	浜松ホトニクス	9,900	2,330	23,067,000	
6966	三井ハイテック	3,600	999	3,596,400	
6967	新光電気工業	8,000	1,494	11,952,000	
6971	京セラ	24,200	8,050	194,810,000	
6973	協栄産業	3,000	201	603,000	
6974	日本インター	2,900	311	901,900	
6976	太陽誘電	13,000	1,059	13,767,000	
6981	村田製作所	30,400	4,500	136,800,000	
6985	ユーシン	3,000	492	1,476,000	
6986	双葉電子工業	4,600	1,430	6,578,000	
6988	日東電工	24,900	2,885	71,836,500	
6989	北陸電気工業	13,000	164	2,132,000	
6991	パナソニック電工	44,000	1,159	50,996,000	
6995	東海理化	7,100	1,767	12,545,700	
6996	ニチコン	8,500	961	8,168,500	
6997	日本ケミコン	14,000	364	5,096,000	
6999	KOA	3,800	789	2,998,200	
7003	三井造船	98,000	246	24,108,000	
7004	日立造船	120,500	122	14,701,000	
7007	佐世保重工業	16,000	202	3,232,000	
7011	三菱重工業	483,000	341	164,703,000	
7012	川崎重工業	225,000	240	54,000,000	
7013	IHI	185,000	184	34,040,000	
7102	日本車輛製造	12,000	606	7,272,000	
7105	ニチユ	3,000	226	678,000	
7122	近畿車輛	5,000	806	4,030,000	
7201	日産自動車	342,400	676	231,462,400	
7202	いすゞ自動車	128,000	212	27,136,000	
7203	トヨタ自動車	348,200	3,650	1,270,930,000	代用有価証券 35,000株
7205	日野自動車	39,000	382	14,898,000	
7211	三菱自動車	606,000	140	84,840,000	
7212	エフテック	1,000	915	915,000	
7220	武蔵精密工業	2,700	1,895	5,116,500	
7221	トヨタ車体	5,900	1,686	9,947,400	
7222	日産車体	9,000	808	7,272,000	
7223	関東自動車工業	4,100	916	3,755,600	
7224	新明和工業	12,000	343	4,116,000	
7226	極東開発工業	5,400	366	1,976,400	
7230	日信工業	5,000	1,362	6,810,000	
7231	トピー工業	24,000	187	4,488,000	
7236	ティラド	8,000	254	2,032,000	
7238	曙ブレーキ工業	7,500	800	6,000,000	
7239	タチエス	3,500	745	2,607,500	
7240	NOK	14,600	1,361	19,870,600	
7241	フタバ産業	5,900	486	2,867,400	
7242	KYB	19,000	280	5,320,000	
7243	シロキ工業	5,000	148	740,000	
7244	市光工業	7,000	172	1,204,000	
7245	大同メタル工業	5,000	254	1,270,000	
7246	プレス工業	11,000	209	2,299,000	
7248	カルソニックカンセイ	16,000	268	4,288,000	
7250	太平洋工業	6,000	424	2,544,000	
7251	ケーヒン	6,200	1,458	9,039,600	
7256	河西工業	4,000	250	1,000,000	
7259	アイシン精機	24,800	2,350	58,280,000	
7260	富士機工	3,000	112	336,000	
7261	マツダ	131,000	216	28,296,000	
7262	ダイハツ工業	29,000	978	28,362,000	

7263	愛知機械工業	7,000	279	1,953,000	
7266	今仙電機製作所	2,000	1,047	2,094,000	
7267	ホンダ	231,700	2,900	671,930,000	
7269	スズキ	54,800	2,265	124,122,000	
7270	富士重工業	92,000	375	34,500,000	
7272	ヤマハ発動機	31,400	1,106	34,728,400	
7274	ショーワ	5,800	520	3,016,000	
7276	小糸製作所	14,000	1,282	17,948,000	
7277	T B K	3,000	159	477,000	
7278	エクセディ	3,300	2,000	6,600,000	
7280	ミツバ	5,000	430	2,150,000	
7282	豊田合成	7,700	2,745	21,136,500	
7283	愛三工業	3,300	700	2,310,000	
7294	ヨロズ	1,800	1,135	2,043,000	
7296	エフ・シー・シー	4,000	1,596	6,384,000	
7305	新家工業	6,000	141	846,000	
7309	シマノ	10,500	3,930	41,265,000	
7312	タカタ	4,800	1,793	8,606,400	
7313	テイ・エス テック	5,700	1,864	10,624,800	
7414	小野建	2,200	784	1,724,800	
7416	はるやま商事	1,300	418	543,400	
7420	佐鳥電機	2,000	605	1,210,000	
7421	カップ・クリエイト	1,600	2,075	3,320,000	
7427	エコートレーディング	600	1,040	624,000	
7433	伯東	1,600	848	1,356,800	
7442	中山福	1,700	593	1,008,100	
7445	ライトオン	2,000	787	1,574,000	
7447	ナガイレーベン	1,600	2,045	3,272,000	
7448	ジーンズメイト	800	556	444,800	
7451	菱食	2,600	2,465	6,409,000	
7453	良品計画	2,800	4,290	12,012,000	
7455	三城ホールディングス	3,800	741	2,815,800	
7456	松田産業	2,000	1,625	3,250,000	
7459	メディカルホールディングス	28,800	1,277	36,777,600	
7463	アドヴァン	1,800	581	1,045,800	
7466	S P K	600	1,170	702,000	
7476	アズワン	1,800	1,679	3,022,200	
7480	スズデン	900	496	446,400	
7482	シモジマ	1,800	1,327	2,388,600	
7483	ドウシシャ	1,400	1,855	2,597,000	
7494	コナカ	3,200	273	873,600	
7504	高速	1,600	700	1,120,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,289	386,700	
7508	G - 7ホールディングス	800	487	389,600	
7512	イオン北海道	1,700	294	499,800	
7513	コジマ	3,600	462	1,663,200	
7516	コーナン商事	3,100	1,089	3,375,900	
7517	黒田電気	3,800	1,323	5,027,400	
7518	ネットワンシステムズ	65	121,500	7,897,500	
7520	エコス	900	661	594,900	
7522	ワタミ	3,500	1,789	6,261,500	
7524	マルシェ	800	765	612,000	
7532	ドン・キホーテ	4,900	2,345	11,490,500	
7537	丸文	2,100	494	1,037,400	
7541	メガネトップ	1,500	1,646	2,469,000	
7545	西松屋チェーン	7,000	916	6,412,000	
7550	ゼンショー	9,000	646	5,814,000	
7552	ハビネット	700	1,287	900,900	
7554	幸楽苑	1,700	1,184	2,012,800	
7558	トーメンエレクトロニクス	800	998	798,400	
7560	ユニマットライフ	1,100	951	1,046,100	
7561	ハークスレイ	800	805	644,000	

7581	サイゼリヤ	4,000	1,735	6,940,000	
7591	エクセル	1,200	1,148	1,377,600	
7594	マルカキカイ	900	765	688,500	
7595	アルゴグラフィックス	1,100	1,031	1,134,100	
7599	ガリバーインターナショナル	630	7,120	4,485,600	
7600	日本エム・ディ・エム	2,200	290	638,000	
7601	ポブラ	800	673	538,400	
7606	ユナイテッドアローズ	3,600	900	3,240,000	
7607	進和	1,500	1,311	1,966,500	
7608	エスケイジャパン	700	328	229,600	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	499	548,900	
7611	ハイデイ日高	1,200	1,154	1,384,800	
7613	シークス	1,700	979	1,664,300	
7615	京都きもの友禅	1,700	943	1,603,100	
7616	コロワイド	6,000	583	3,498,000	
7619	田中商事	800	458	366,400	
7628	オーハシテクニカ	1,700	512	870,400	
7630	壺番屋	1,000	2,270	2,270,000	
7631	マクニカ	1,200	1,444	1,732,800	
7637	白銅	900	634	570,600	
7640	トップカルチャー	900	434	390,600	
7649	スギホールディングス	4,300	1,943	8,354,900	
7701	島津製作所	30,000	639	19,170,000	
7702	JMS	5,000	398	1,990,000	
7704	アロカ	1,700	784	1,332,800	
7714	モリテックス	700	302	211,400	
7715	長野計器	1,600	600	960,000	
7718	スター精密	5,100	760	3,876,000	
7721	東京計器	9,000	123	1,107,000	
7723	愛知時計電機	3,000	271	813,000	
7728	日本電産トーソク	800	743	594,400	
7729	東京精密	5,100	1,202	6,130,200	
7731	ニコン	47,300	1,782	84,288,600	
7732	トプコン	6,200	498	3,087,600	
7733	オリンパス	29,700	2,785	82,714,500	
7734	理研計器	2,200	672	1,478,400	
7735	大日本スクリーン製造	30,000	428	12,840,000	
7739	キヤノン電子	2,400	1,825	4,380,000	
7740	タムロン	2,400	1,041	2,498,400	
7741	HOYA	62,300	1,995	124,288,500	
7744	ノーリツ鋼機	2,400	779	1,869,600	
7745	エー・アンド・デイ	2,300	407	936,100	
7751	キヤノン	157,200	3,650	573,780,000	
7752	リコー	88,000	1,273	112,024,000	
7756	日本電産コバル	2,700	1,191	3,215,700	
7757	日本電産サンキョー	8,000	620	4,960,000	
7762	シチズンホールディングス	35,200	545	19,184,000	
7769	リズム時計工業	13,000	129	1,677,000	
7825	SRIスポーツ	15	86,500	1,297,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	29,500	944	27,848,000	
7838	共立印刷	2,400	147	352,800	
7840	フランスベッドホールディングス	18,000	141	2,538,000	
7846	パイロットコーポレーション	24	108,600	2,606,400	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	5,000	825	4,125,000	
7862	トッパン・フォームズ	5,800	1,125	6,525,000	
7864	フジシールインターナショナル	3,000	1,810	5,430,000	
7867	タカラトミー	8,100	822	6,658,200	
7868	廣済堂	2,300	215	494,500	
7874	レック	800	1,741	1,392,800	
7882	アロン化成	2,000	389	778,000	
7885	タカノ	1,200	581	697,200	
7893	プロネクサス	3,300	623	2,055,900	

7897	ホクシン	2,200	158	347,600	
7898	ウッドワン	5,000	246	1,230,000	
7905	大建工業	12,000	213	2,556,000	
7908	K I M O T O	2,300	956	2,198,800	
7911	凸版印刷	82,000	839	68,798,000	
7912	大日本印刷	82,000	1,168	95,776,000	
7913	図書印刷	6,000	195	1,170,000	
7914	共同印刷	9,000	274	2,466,000	
7915	日本写真印刷	4,200	4,300	18,060,000	
7916	光村印刷	3,000	309	927,000	
7917	藤森工業	1,900	1,347	2,559,300	
7921	宝印刷	1,300	798	1,037,400	
7925	前澤化成工業	2,000	1,001	2,002,000	
7935	コンビ	1,500	665	997,500	
7936	アシックス	27,000	845	22,815,000	
7937	ツツミ	1,000	2,150	2,150,000	
7942	J S P	1,900	879	1,670,100	
7943	ニチハ	3,200	559	1,788,800	
7944	ローランド	1,900	984	1,869,600	
7947	エフピコ	1,400	4,380	6,132,000	
7949	小松ウオール工業	1,000	1,125	1,125,000	
7951	ヤマハ	21,600	1,006	21,729,600	
7952	河合楽器製作所	10,000	110	1,100,000	
7955	クリナップ	2,900	650	1,885,000	
7956	ビジョン	1,700	3,500	5,950,000	
7958	天馬	2,000	1,089	2,178,000	
7960	パラマウントベッド	2,700	2,005	5,413,500	
7961	兼松日産農林	4,000	126	504,000	
7962	キングジム	2,100	703	1,476,300	
7966	リンテック	5,200	1,657	8,616,400	
7968	田崎真珠	5,000	103	515,000	
7970	信越ポリマー	5,600	581	3,253,600	
7971	東リ	7,000	182	1,274,000	
7972	イトーキ	5,700	232	1,322,400	
7974	任天堂	14,300	24,480	350,064,000	
7976	三菱鉛筆	2,400	1,114	2,673,600	
7981	タカラスタンダード	12,000	535	6,420,000	
7984	コクヨ	14,100	829	11,688,900	
7987	ナカバヤシ	6,000	193	1,158,000	
7988	ニフコ	5,900	1,925	11,357,500	
7993	サンウエーブ工業	4,000	237	948,000	
7994	岡村製作所	11,000	462	5,082,000	
7995	日本バルカー工業	11,000	183	2,013,000	
7999	M U T O Hホールディングス	3,000	150	450,000	
8001	伊藤忠商事	200,000	612	122,400,000	
8002	丸紅	234,000	484	113,256,000	
8005	スクロール	3,100	405	1,255,500	
8007	高島	5,000	132	660,000	
8008	F & A アクアホールディングス	2,300	1,006	2,313,800	
8011	三陽商会	13,000	291	3,783,000	
8012	長瀬産業	14,000	1,070	14,980,000	
8013	ナイガイ	9,000	47	423,000	
8014	蝶理	18,000	110	1,980,000	
8015	豊田通商	26,800	1,383	37,064,400	
8016	オンワードホールディングス	19,000	586	11,134,000	
8018	三共生興	4,600	244	1,122,400	
8020	兼松	57,000	78	4,446,000	
8022	ミズノ	14,000	419	5,866,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	85	425,000	
8028	ファミリーマート	8,200	2,650	21,730,000	
8029	ルック	5,000	100	500,000	
8031	三井物産	230,500	1,307	301,263,500	

8032	日本紙パルプ商事	14,000	347	4,858,000	
8035	東京エレクトロン	19,800	5,660	112,068,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	9,300	1,589	14,777,700	
8037	カメイ	3,000	492	1,476,000	
8038	東都水産	5,000	175	875,000	
8042	日本マタイ	5,000	98	490,000	
8043	スターゼン	9,000	237	2,133,000	
8050	セイコーホールディングス	10,000	200	2,000,000	
8051	山善	10,300	314	3,234,200	
8052	椿本興業	3,000	205	615,000	
8053	住友商事	157,900	939	148,268,100	
8056	日本ユニシス	6,500	807	5,245,500	
8057	内田洋行	6,000	278	1,668,000	
8058	三菱商事	199,900	2,075	414,792,500	
8059	第一実業	6,000	271	1,626,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	8,900	1,523	13,554,700	
8061	西華産業	11,000	217	2,387,000	
8065	佐藤商事	2,400	493	1,183,200	
8068	菱洋エレクトロ	2,700	751	2,027,700	
8070	東京産業	2,500	264	660,000	
8074	ユアサ商事	29,000	89	2,581,000	
8075	神鋼商事	7,000	163	1,141,000	
8078	阪和興業	27,000	325	8,775,000	
8081	カナデン	3,000	504	1,512,000	
8084	菱電商事	4,000	548	2,192,000	
8086	ニプロ	6,400	2,010	12,864,000	
8087	フルサト工業	1,700	591	1,004,700	
8088	岩谷産業	30,000	275	8,250,000	
8089	すてきナイスグループ	11,000	196	2,156,000	
8090	昭光通商	10,000	115	1,150,000	
8091	ニチモウ	4,000	154	616,000	
8093	極東貿易	3,000	134	402,000	
8095	イワキ	3,000	287	861,000	
8096	兼松エレクトロニクス	1,700	846	1,438,200	
8097	三愛石油	7,000	477	3,339,000	
8098	稲畑産業	7,100	347	2,463,700	
8101	G S イクレオス	7,000	100	700,000	
8103	明和産業	2,100	167	350,700	
8111	ゴールドウイン	7,000	183	1,281,000	
8112	東京スタイル	10,000	779	7,790,000	
8113	ユニ・チャーム	5,800	8,450	49,010,000	
8114	デサント	8,000	453	3,624,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,700	400	680,000	
8129	東邦ホールディングス	6,200	1,419	8,797,800	
8130	サンゲツ	4,600	1,996	9,181,600	
8131	ミツウロコ	4,400	672	2,956,800	
8132	シナネン	6,000	480	2,880,000	
8133	伊藤忠エネクス	6,900	494	3,408,600	
8134	T O K A I	6,000	507	3,042,000	
8136	サンリオ	7,400	753	5,572,200	
8137	サンワテクノス	1,300	404	525,200	
8140	リョーサン	4,100	2,195	8,999,500	
8141	新光商事	2,700	704	1,900,800	
8142	トーヨー	5,000	345	1,725,000	
8150	三信電気	3,100	757	2,346,700	
8151	東陽テクニカ	4,100	833	3,415,300	
8153	モスフードサービス	3,800	1,487	5,650,600	
8154	加賀電子	2,900	916	2,656,400	
8155	三益半導体工業	2,100	1,286	2,700,600	
8158	ソーダニッカ	3,000	344	1,032,000	
8159	立花エレテック	1,800	657	1,182,600	
8160	木曽路	3,100	2,005	6,215,500	

8165	千趣会	4,800	620	2,976,000	
------	-----	-------	-----	-----------	--

[次へ](#)

8166	タカキュー	2,000	161	322,000	
8168	ケーヨー	5,500	450	2,475,000	
8170	アデランスホールディングス	3,000	1,131	3,393,000	
8173	上新電機	6,000	645	3,870,000	
8174	日本瓦斯	2,900	1,623	4,706,700	
8175	ベスト電器	8,500	407	3,459,500	
8178	マルエツ	6,000	432	2,592,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,100	1,014	4,157,400	
8181	東天紅	2,000	167	334,000	
8182	いなげや	3,000	947	2,841,000	
8184	島忠	6,000	2,125	12,750,000	
8185	チヨダ	3,900	1,093	4,262,700	
8193	鈴丹	700	263	184,100	
8194	ライフコーポレーション	1,700	1,600	2,720,000	
8196	カスミ	5,500	452	2,486,000	
8200	リンガーハット	2,000	1,164	2,328,000	
8201	さが美	2,000	183	366,000	
8203	M r M a x	3,000	461	1,383,000	
8207	テンアライド	1,800	319	574,200	
8214	A O K Iホールディングス	2,900	894	2,592,600	
8217	オークワ	4,000	974	3,896,000	
8218	コメリ	3,700	2,550	9,435,000	
8219	青山商事	6,800	1,520	10,336,000	
8227	しまむら	2,800	9,010	25,228,000	
8229	C F Sコーポレーション	3,500	514	1,799,000	
8233	高島屋	36,000	654	23,544,000	
8236	丸善	13,000	98	1,274,000	
8237	松屋	5,400	803	4,336,200	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	17,000	563	9,571,000	
8245	丸栄	4,000	135	540,000	
8248	ニッセンホールディングス	5,300	307	1,627,100	
8251	パルコ	7,600	815	6,194,000	
8252	丸井グループ	34,900	550	19,195,000	
8253	クレディセゾン	23,400	1,087	25,435,800	
8255	原信ナルスホールディングス	1,600	1,013	1,620,800	
8258	セディナ	21,300	182	3,876,600	
8263	ダイエー	12,400	338	4,191,200	
8266	イズミヤ	9,000	459	4,131,000	
8267	イオン	107,800	839	90,444,200	
8270	ユニー	20,100	692	13,909,200	
8273	イズミ	7,300	1,133	8,270,900	
8274	東武ストア	4,000	304	1,216,000	
8276	平和堂	5,400	1,206	6,512,400	
8278	フジ	3,000	1,830	5,490,000	
8279	ヤオコー	1,500	3,180	4,770,000	
8281	ゼビオ	2,800	2,050	5,740,000	
8282	ケーズホールディングス	4,700	3,020	14,194,000	
8289	オリンピック	1,800	634	1,141,200	
8291	東日カーライフグループ	5,000	101	505,000	
8303	新生銀行	156,000	112	17,472,000	
8304	あおぞら銀行	97,000	107	10,379,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,568,500	470	737,195,000	
8308	りそなホールディングス	92,100	1,025	94,402,500	
8309	中央三井トラスト・ホールディングス	137,000	340	46,580,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	145,700	3,140	457,498,000	
8324	第四銀行	37,000	334	12,358,000	
8325	北越銀行	30,000	157	4,710,000	
8327	西日本シティ銀行	87,000	229	19,923,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	40,300	314	12,654,200	
8331	千葉銀行	105,000	585	61,425,000	
8332	横浜銀行	183,000	466	85,278,000	
8333	常陽銀行	104,000	406	42,224,000	

8334	群馬銀行	63,000	476	29,988,000	
8336	武蔵野銀行	4,100	2,630	10,783,000	
8337	千葉興業銀行	5,100	820	4,182,000	
8338	関東つくば銀行	7,600	305	2,318,000	
8339	東京都民銀行	5,100	1,350	6,885,000	
8341	七十七銀行	45,000	525	23,625,000	
8342	青森銀行	19,000	253	4,807,000	
8343	秋田銀行	18,000	353	6,354,000	
8344	山形銀行	16,000	442	7,072,000	
8345	岩手銀行	1,800	5,470	9,846,000	
8346	東邦銀行	21,000	298	6,258,000	
8349	東北銀行	14,000	145	2,030,000	
8350	みちのく銀行	14,000	205	2,870,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	116,000	353	40,948,000	
8355	静岡銀行	84,000	917	77,028,000	
8356	十六銀行	34,000	326	11,084,000	
8358	スルガ銀行	31,000	837	25,947,000	
8359	八十二銀行	51,000	542	27,642,000	
8360	山梨中央銀行	18,000	423	7,614,000	
8361	大垣共立銀行	36,000	310	11,160,000	
8362	福井銀行	23,000	297	6,831,000	
8363	北國銀行	31,000	358	11,098,000	
8364	清水銀行	900	3,770	3,393,000	
8366	滋賀銀行	25,000	579	14,475,000	
8367	南都銀行	26,000	498	12,948,000	
8368	百五銀行	26,000	437	11,362,000	
8369	京都銀行	47,000	806	37,882,000	
8374	三重銀行	12,000	291	3,492,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	187,000	202	37,774,000	
8379	広島銀行	79,000	354	27,966,000	
8381	山陰合同銀行	16,000	786	12,576,000	
8382	中国銀行	22,000	1,214	26,708,000	
8383	鳥取銀行	9,000	249	2,241,000	
8385	伊予銀行	31,000	832	25,792,000	
8386	百十四銀行	31,000	376	11,656,000	
8387	四国銀行	19,000	307	5,833,000	
8388	阿波銀行	24,000	486	11,664,000	
8390	鹿児島銀行	19,000	675	12,825,000	
8392	大分銀行	17,000	361	6,137,000	
8393	宮崎銀行	14,000	409	5,726,000	
8394	肥後銀行	21,000	542	11,382,000	
8395	佐賀銀行	16,000	308	4,928,000	
8396	十八銀行	17,000	254	4,318,000	
8397	沖縄銀行	2,200	3,130	6,886,000	
8399	琉球銀行	5,600	990	5,544,000	
8403	住友信託銀行	253,000	491	124,223,000	
8404	みずほ信託銀行	254,000	91	23,114,000	
8409	八千代銀行	1,600	2,730	4,368,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	2,043,800	172	351,533,600	
8415	紀陽ホールディングス	106,000	108	11,448,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	25,000	903	22,575,000	
8424	芙蓉総合リース	2,800	2,095	5,866,000	
8425	興銀リース	3,700	1,560	5,772,000	
8439	東京センチュリーリース	6,300	1,061	6,684,300	
8473	SBIホールディングス	2,118	18,480	39,140,640	
8511	日本証券金融	10,200	718	7,323,600	
8512	大証金	3,100	206	638,600	
8519	ポケットカード	2,600	235	611,000	
8521	長野銀行	10,000	198	1,980,000	
8522	名古屋銀行	26,000	365	9,490,000	
8527	愛知銀行	1,000	7,420	7,420,000	
8529	第三銀行	16,000	220	3,520,000	

8530	中京銀行	12,000	255	3,060,000	
8536	東日本銀行	14,000	197	2,758,000	
8541	愛媛銀行	17,000	249	4,233,000	
8542	トマト銀行	11,000	199	2,189,000	
8543	みなと銀行	28,000	118	3,304,000	
8544	京葉銀行	24,000	446	10,704,000	
8545	関西アーバン銀行	37,000	113	4,181,000	
8550	栃木銀行	14,000	421	5,894,000	
8551	北日本銀行	900	2,755	2,479,500	
8556	香川銀行	10,000	327	3,270,000	
8558	東和銀行	24,000	63	1,512,000	
8561	徳島銀行	8,000	336	2,688,000	
8562	福島銀行	33,000	55	1,815,000	
8563	大東銀行	18,000	72	1,296,000	
8566	リコーリース	1,800	1,866	3,358,800	
8570	イオンクレジットサービス	11,900	919	10,936,100	
8584	ジャックス	16,000	228	3,648,000	
8586	日立キャピタル	6,300	1,139	7,175,700	
8591	オリックス	15,770	6,270	98,877,900	
8593	三菱UFJリース	6,790	2,900	19,691,000	
8595	ジャフコ	4,100	2,505	10,270,500	
8601	大和証券グループ本社	221,000	492	108,732,000	
8604	野村ホールディングス	510,300	654	333,736,200	
8606	みずほ証券	68,000	321	21,828,000	
8607	みずほインバスターズ証券	62,000	98	6,076,000	
8609	岡三証券グループ	23,000	434	9,982,000	
8613	丸三証券	8,900	546	4,859,400	
8614	東洋証券	10,000	189	1,890,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	31,000	297	9,207,000	
8617	光世証券	7,000	108	756,000	
8622	水戸証券	9,000	217	1,953,000	
8624	いちよし証券	6,000	667	4,002,000	
8628	松井証券	20,400	662	13,504,800	
8692	だいこう証券ビジネス	1,100	497	546,700	
8698	マネックスグループ	138	36,050	4,974,900	
8703	カブドットコム証券	57	96,400	5,494,800	
8706	極東証券	3,300	694	2,290,200	
8707	岩井証券	2,700	700	1,890,000	
8713	フィデアホールディングス	13,300	178	2,367,400	
8714	池田泉州ホールディングス	45,200	392	17,718,400	
8725	三井住友海上グループホールディングス	63,900	2,150	137,385,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	95	273,300	25,963,500	
8742	小林洋行	800	311	248,800	
8754	日本興亜損害保険	103,000	513	52,839,000	
8755	損保ジャパン	125,000	560	70,000,000	
8759	ニッセイ同和損害保険	29,000	411	11,919,000	
8761	あいおい損害保険	70,000	413	28,910,000	
8763	富士火災海上保険	32,000	107	3,424,000	
8766	東京海上ホールディングス	115,200	2,380	274,176,000	
8772	アサックス	4	85,400	341,600	
8793	NECキャピタルソリューション	900	1,295	1,165,500	
8795	T&Dホールディングス	39,200	2,425	95,060,000	
8801	三井不動産	119,000	1,583	188,377,000	
8802	三菱地所	187,000	1,424	266,288,000	
8803	平和不動産	19,000	308	5,852,000	
8804	東京建物	37,000	461	17,057,000	
8806	ダイビル	6,900	797	5,499,300	
8809	サンケイビル	4,000	737	2,948,000	
8815	東急不動産	54,000	399	21,546,000	
8818	京阪神不動産	3,500	423	1,480,500	

8830	住友不動産	68,000	1,810	123,080,000	
8833	東宝不動産	2,900	558	1,618,200	
8835	太平洋興発	9,000	75	675,000	
8838	有楽土地	3,000	369	1,107,000	
8840	大京	29,000	246	7,134,000	
8841	テーオーシー	10,400	432	4,492,800	
8842	東京楽天地	5,000	365	1,825,000	
8848	レオパレス21	18,800	642	12,069,600	
8860	フジ住宅	3,100	383	1,187,300	
8864	空港施設	2,800	526	1,472,800	
8869	明和地所	1,300	636	826,800	
8870	住友不動産販売	1,200	3,350	4,020,000	
8871	ゴールドクレスト	2,110	2,850	6,013,500	
8875	東栄住宅	2,100	1,135	2,383,500	
8877	日本エスリード	900	1,045	940,500	
8879	東急リバブル	2,800	842	2,357,600	
8880	飯田産業	1,300	1,750	2,275,000	
8881	日神不動産	1,600	515	824,000	
8895	アーネストワン	4,400	1,097	4,826,800	
8897	タカラレーベン	1,300	637	828,100	
8904	サンヨーハウジング名古屋	13	84,600	1,099,800	
8905	イオンモール	12,200	2,035	24,827,000	
8907	フージャースコーポレーション	22	11,290	248,380	
8915	タクトホーム	14	95,900	1,342,600	
8918	ランド	1,600	55	88,000	
8924	リサ・パートナーズ	35	73,600	2,576,000	
8933	NTT都市開発	166	79,000	13,114,000	
8934	サンフロンティア不動産	26	24,100	626,600	
8939	大和システム	1,200	253	303,600	
8944	ランドビジネス	18	25,820	464,760	
9001	東武鉄道	116,000	511	59,276,000	
9003	相鉄ホールディングス	37,000	401	14,837,000	
9005	東京急行電鉄	149,000	401	59,749,000	
9006	京浜急行電鉄	70,000	733	51,310,000	
9007	小田急電鉄	87,000	762	66,294,000	
9008	京王電鉄	70,000	592	41,440,000	
9009	京成電鉄	44,000	541	23,804,000	
9010	富士急行	7,000	443	3,101,000	
9020	東日本旅客鉄道	50,500	6,230	314,615,000	
9021	西日本旅客鉄道	253	322,000	81,466,000	
9022	東海旅客鉄道	217	612,000	132,804,000	
9030	アートコーポレーション	700	1,530	1,071,000	
9031	西日本鉄道	35,000	361	12,635,000	
9037	ハマキョウレックス	900	2,215	1,993,500	
9039	サカイ引越センター	500	2,075	1,037,500	
9041	近畿日本鉄道	245,000	335	82,075,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	182,000	412	74,984,000	
9044	南海電気鉄道	57,000	405	23,085,000	
9045	京阪電気鉄道	61,000	382	23,302,000	
9047	名糖運輸	1,100	797	876,700	
9048	名古屋鉄道	95,000	279	26,505,000	
9062	日本通運	116,000	382	44,312,000	
9064	ヤマトホールディングス	54,000	1,429	77,166,000	
9065	山九	33,000	409	13,497,000	
9066	日新	10,000	212	2,120,000	
9067	丸運	2,000	235	470,000	
9068	丸全昭和運輸	8,000	310	2,480,000	
9069	センコー	9,000	346	3,114,000	
9070	トナミホールディングス	6,000	252	1,512,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,000	994	6,958,000	
9074	日本石油輸送	3,000	199	597,000	
9075	福山通運	21,000	491	10,311,000	

9076	セイノーホールディングス	22,000	704	15,488,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	527	1,581,000	
9086	日立物流	5,700	1,180	6,726,000	
9101	日本郵船	145,000	356	51,620,000	
9104	商船三井	142,000	565	80,230,000	
9107	川崎汽船	64,000	377	24,128,000	
9110	新和海運	11,000	271	2,981,000	
9113	乾汽船	3,300	748	2,468,400	
9115	明治海運	2,400	488	1,171,200	
9119	飯野海運	13,100	422	5,528,200	
9123	太平洋海運	5,000	87	435,000	
9130	共栄タンカー	2,000	216	432,000	
9132	第一中央汽船	18,000	235	4,230,000	
9202	全日本空輸	361,000	254	91,694,000	
9205	日本航空	391,000	117	45,747,000	
9232	パスコ	3,000	188	564,000	
9234	国際航業ホールディングス	2,000	308	616,000	
9301	三菱倉庫	19,000	1,041	19,779,000	
9302	三井倉庫	12,000	319	3,828,000	
9303	住友倉庫	21,000	408	8,568,000	
9304	澁澤倉庫	8,000	306	2,448,000	
9305	ヤマタネ	14,000	138	1,932,000	
9306	東陽倉庫	5,000	194	970,000	
9310	日本トランスシティ	6,000	285	1,710,000	
9312	ケイヒン	6,000	119	714,000	
9324	安田倉庫	2,000	640	1,280,000	
9351	東洋埠頭	8,000	177	1,416,000	
9358	宇徳	2,000	253	506,000	
9364	上組	32,000	702	22,464,000	
9366	サンリツ	800	619	495,200	
9368	キムラユニティー	600	741	444,600	
9369	キューソー流通システム	800	1,019	815,200	
9370	郵船航空サービス	2,100	1,289	2,706,900	
9375	近鉄エクスプレス	2,400	2,250	5,400,000	
9380	東海運	1,700	236	401,200	
9382	バンテック	13	128,000	1,664,000	
9401	東京放送ホールディングス	16,000	1,390	22,240,000	
9404	日本テレビ放送網	2,560	12,260	31,385,600	
9409	テレビ朝日	68	142,300	9,676,400	
9411	テレビ東京	1,000	2,330	2,330,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	203	41,700	8,465,100	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	6	213,000	1,278,000	
9427	イー・アクセス	122	63,500	7,747,000	
9430	N E C モバイリング	1,000	2,480	2,480,000	
9432	日本電信電話	123,000	3,770	463,710,000	代用有価証券 12,300株
9433	K D D I	415	482,000	200,030,000	
9435	光通信	3,400	1,757	5,973,800	
9437	N T T ドコモ	2,590	132,500	343,175,000	
9449	G M O インターネット	7,600	419	3,184,400	
9470	学研ホールディングス	9,000	285	2,565,000	
9474	ゼンリン	3,900	1,355	5,284,500	
9475	昭文社	1,500	621	931,500	
9477	角川グループホールディングス	2,300	2,115	4,864,500	
9479	インプレスホールディングス	2,300	234	538,200	
9501	東京電力	170,800	2,235	381,738,000	代用有価証券 17,000株
9502	中部電力	91,800	2,060	189,108,000	
9503	関西電力	112,500	1,986	223,425,000	
9504	中国電力	40,600	1,845	74,907,000	
9505	北陸電力	27,800	2,055	57,129,000	
9506	東北電力	67,800	1,859	126,040,200	
9507	四国電力	28,100	2,565	72,076,500	

9508	九州電力	59,900	1,858	111,294,200	
9509	北海道電力	25,400	1,744	44,297,600	
9511	沖縄電力	1,900	4,930	9,367,000	
9513	J-POWER	19,600	2,800	54,880,000	
9531	東京ガス	343,000	357	122,451,000	
9532	大阪ガス	291,000	304	88,464,000	
9533	東邦ガス	71,000	445	31,595,000	
9534	北海道ガス	5,000	242	1,210,000	
9536	西部ガス	31,000	258	7,998,000	
9543	静岡ガス	7,500	686	5,145,000	
9600	アイネット	1,300	500	650,000	
9601	松竹	15,000	830	12,450,000	
9602	東宝	19,100	1,404	26,816,400	
9603	エイチ・アイ・エス	2,600	1,956	5,085,600	
9605	東映	11,000	497	5,467,000	
9607	葵プロモーション	1,500	454	681,000	
9613	NTTデータ	165	272,900	45,028,500	
9616	共立メンテナンス	1,200	1,536	1,843,200	
9619	イチネンホールディングス	2,700	353	953,100	
9621	建設技術研究所	1,400	517	723,800	
9628	燦ホールディングス	600	1,621	972,600	
9632	スバル興業	2,000	280	560,000	
9633	東京テアトル	10,000	163	1,630,000	
9665	吉本興業	4,100	1,347	5,522,700	
9667	ホリプロ	1,000	803	803,000	
9671	よみうりランド	6,000	305	1,830,000	
9672	東京都競馬	19,000	146	2,774,000	
9675	常磐興産	9,000	151	1,359,000	
9678	カナモト	3,000	391	1,173,000	
9681	東京ドーム	21,000	290	6,090,000	
9682	DTS	2,600	769	1,999,400	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,800	2,360	16,048,000	
9692	シーイーシー	1,600	594	950,400	
9694	日立ソフトウェアエンジニアリング	3,700	2,640	9,768,000	
9697	カブコン	5,700	1,632	9,302,400	
9706	日本空港ビルデング	6,400	1,247	7,980,800	
9715	トランスコスモス	3,700	887	3,281,900	
9716	乃村工藝社	6,000	255	1,530,000	
9717	ジャステック	1,600	559	894,400	
9719	住商情報システム	2,700	1,433	3,869,100	
9722	藤田観光	7,000	372	2,604,000	
9726	KNT	9,000	86	774,000	
9728	日本管財	1,100	1,800	1,980,000	
9731	白洋舎	3,000	267	801,000	
9735	セコム	27,500	4,340	119,350,000	
9737	CSKホールディングス	8,100	383	3,102,300	
9739	NSW	1,000	311	311,000	
9740	CSP	1,300	888	1,154,400	
9741	日立情報システムズ	2,100	2,890	6,069,000	
9742	アイネス	3,200	728	2,329,600	
9743	丹青社	3,000	243	729,000	
9744	メイテック	4,700	1,528	7,181,600	
9746	TKC	2,600	1,811	4,708,600	
9747	アサツー ディ・ケイ	5,000	1,877	9,385,000	
9749	富士ソフト	3,300	1,571	5,184,300	
9750	ソラン	2,700	466	1,258,200	
9755	応用地質	3,000	849	2,547,000	
9757	船井総合研究所	2,800	544	1,523,200	
9759	日本システムディベロップメント	4,700	966	4,540,200	
9760	進学会	1,400	303	424,200	
9763	丸紅建材リース	3,000	125	375,000	
9766	コナミ	12,100	1,779	21,525,900	

9783	ベネッセホールディングス	9,900	4,020	39,798,000	
9787	イオンディライト	2,100	1,357	2,849,700	
9788	ナック	700	858	600,600	
9790	福井コンピュータ	600	315	189,000	
9792	ニチイ学館	6,800	927	6,303,600	
9793	ダイセキ	4,200	1,851	7,774,200	
9828	元気寿司	800	1,209	967,200	
9830	トラスコ中山	3,100	1,437	4,454,700	
9831	ヤマダ電機	13,010	5,760	74,937,600	
9832	オートバックスセブン	4,100	2,915	11,951,500	
9842	アークランドサカモト	1,900	1,115	2,118,500	
9843	ニトリ	5,800	7,570	43,906,000	
9854	愛眼	2,100	543	1,140,300	
9861	吉野家ホールディングス	61	108,700	6,630,700	
9869	加藤産業	3,900	1,618	6,310,200	
9882	イエローハット	2,700	865	2,335,500	
9883	富士エレクトロニクス	1,500	798	1,197,000	
9887	松屋フーズ	1,300	1,306	1,697,800	
9889	J B C Cホールディングス	2,100	634	1,331,400	
9896	J Kホールディングス	2,200	416	915,200	
9897	ユニダックス	1,500	416	624,000	
9900	サガミチェーン	3,000	811	2,433,000	
9902	日伝	1,100	2,695	2,964,500	
9930	北沢産業	2,500	230	575,000	
9932	杉本商事	1,400	925	1,295,000	
9934	因幡電機産業	2,600	2,200	5,720,000	
9938	住金物産	14,000	203	2,842,000	
9945	プレナス	3,400	1,260	4,284,000	
9946	ミニストップ	2,000	1,269	2,538,000	
9948	アークス	3,200	1,308	4,185,600	
9956	パロー	5,300	786	4,165,800	
9962	ミスミグループ本社	9,000	1,655	14,895,000	
9963	江守商事	500	735	367,500	
9972	アルテック	1,200	188	225,600	
9974	ベルク	1,200	823	987,600	
9979	大庄	1,600	1,259	2,014,400	
9982	タキヒヨー	5,000	487	2,435,000	
9983	ファーストリテイリング	5,400	15,850	85,590,000	
9984	ソフトバンク	109,400	2,215	242,321,000	
9987	スズケン	9,500	3,290	31,255,000	
9989	サンドラッグ	5,100	2,335	11,908,500	
9991	ジェコス	1,900	409	777,100	
9993	ヤマザワ	700	1,348	943,600	
9994	やまや	500	820	410,000	
9997	ペルーナ	3,350	404	1,353,400	
合計		39,210,379		31,913,941,890	

(2) 株式以外の有価証券

(新株予約権証券)

(単位：円)

銘柄	券面総額	評価額	備考
5714-4 DOWAホールディングス	4,000	112,000	
合計	4,000	112,000	

(注) 新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券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

「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。

[次へ](#)

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		89,730,959	325,562,561
コール・ローン		2,420,365,686	282,273,310
株式		48,304,537,246	69,620,560,066
新株予約権証券		-	2,817
投資証券		695,314,240	972,114,978
派生商品評価勘定		368,824	30,952,229
未収入金		1,432,949,094	16,258,785
未収配当金		63,367,236	61,611,611
差入委託証拠金		537,513,493	364,619,828
流動資産合計		53,544,146,778	71,673,956,185
資産合計		53,544,146,778	71,673,956,185
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		565,892,700	2,229,877
未払金		2,212,260,113	-
未払解約金		8,030,448	8,202,007
流動負債合計		2,786,183,261	10,431,884
負債合計		2,786,183,261	10,431,884
純資産の部			
元本等			
元本		77,820,389,733	81,113,705,231
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		27,062,426,216	9,450,180,930
元本等合計		50,757,963,517	71,663,524,301
純資産合計		50,757,963,517	71,663,524,301
負債純資産合計		53,544,146,778	71,673,956,185

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(1)デリバティブ取引 同左</p> <p>(2)為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成20年10月27日現在			平成21年10月26日現在		
1.	期首	平成19年10月27日	1.	期首	平成20年10月28日
	期首元本額	54,686,655,127 円		期首元本額	77,820,389,733 円
	期首からの追加設定元本額	26,443,924,828 円		期首からの追加設定元本額	21,427,250,271 円
	期首からの解約元本額	3,310,190,222 円		期首からの解約元本額	18,133,934,773 円
	平成20年10月27日現在の元本の内訳			平成21年10月26日現在の元本の内訳	
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	6,964,120,204 円		インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	9,117,356,044 円
	DCインデックスバランス(株式20)	39,502,080 円		DCインデックスバランス(株式20)	37,867,008 円
	DCインデックスバランス(株式40)	137,286,007 円		DCインデックスバランス(株式40)	143,955,460 円
	DCインデックスバランス(株式60)	251,031,240 円		DCインデックスバランス(株式60)	278,670,542 円
	DCインデックスバランス(株式80)	252,522,822 円		DCインデックスバランス(株式80)	301,414,972 円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	22,920,540,566 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	19,625,582,867 円
	日興五大陸株式ファンド	21,187,318,459 円		日興五大陸株式ファンド	24,189,978,867 円
	グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	24,175,570 円		全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	82,880,289 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	52,070,966 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)	233,605,655 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)	180,122,738 円		アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	26,445,181 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	24,005,516 円		アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	23,345,864 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	24,042,034 円		アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	40,517,089 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	44,538,217 円		アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,831,232 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	60,671,021 円		国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	19,054,989,782 円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	19,370,056,399 円		3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	176,360,524 円
	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	499,790,823 円		グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	31,437,801 円
	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	38,131,376 円		年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	41,301,828 円
	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	109,532,650 円		年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	109,702,383 円
	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	136,369,054 円		年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	141,376,749 円
	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	122,460,118 円		年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	147,533,927 円
	年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	5,382,101,873 円		年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	7,257,551,167 円
	(合計)	77,820,389,733 円		(合計)	81,113,705,231 円
2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	77,820,389,733 口	2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	81,113,705,231 口
3.	元本の欠損		3.	元本の欠損	
	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は27,062,426,216円であります。			貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,450,180,930円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	48,304,537,246	30,555,049,253
投資証券	695,314,240	537,905,379
合計	48,999,851,486	31,092,954,632

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	69,620,560,066	14,735,770,262
新株予約権証券	2,817	93,476
投資証券	972,114,978	131,896,254
合計	70,592,677,861	14,867,573,040

（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報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,093,592,946	-	1,777,220,136	316,372,810
		合計	2,093,592,946	-	1,777,220,136

(単位:円)

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,028,473,208	-	1,045,327,394	16,854,186
		合計	1,028,473,208	-	1,045,327,394

(注)時価の算定方法

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

(通貨関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,928,658,056	-	3,679,506,990	249,151,066
	アメリカドル	2,347,344,146	-	2,239,564,780	107,779,366
	カナダドル	95,119,258	-	90,464,660	4,654,598
	オーストラリアドル	62,601,500	-	58,480,000	4,121,500
	イギリスポンド	258,127,728	-	245,646,480	12,481,248
	スイスフラン	97,036,296	-	94,226,580	2,809,716
	スウェーデンクローナ	16,374,800	-	15,444,000	930,800
	シンガポールドル	3,164,910	-	3,068,870	96,040
	デンマーククローネ	9,819,602	-	9,340,840	478,762
	ノルウェークローネ	7,747,300	-	7,397,500	349,800
	ユーロ	1,031,322,516	-	915,873,280	115,449,236
	合計	3,928,658,056	-	3,679,506,990	249,151,066

(単位:円)

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	397,813,394	-	409,681,560	11,868,166
	アメリカドル	167,228,813	-	171,562,560	4,333,747
	ユーロ	230,584,581	-	238,119,000	7,534,419
	合計	397,813,394	-	409,681,560	11,868,166

(注)時価の算定方法

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

(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20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.6522 円	1口当たり純資産額	0.8835 円
(1万口当たり純資産額)	(6,522 円)	(1万口当たり純資産額)	(8,835 円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

外国株式(アメリカドル)

(単位:株,アメリカドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
00105510	AFLAC INC	19,467	44.41000	864,529.47	
00108410	AGCO CORP	4,815	29.54000	142,235.10	
00130H10	AES CORPORATION	25,938	14.22000	368,838.36	
00282410	ABBOTT LABORATORIES	61,777	51.31000	3,169,777.87	
00289620	ABERCROMBIE&FITCH CO-CL A	3,501	36.27000	126,981.27	
00493020	ACTIVISION BLIZZARD INC	21,260	12.20000	259,372.00	
00724F10	ADOBE SYSTEMS INC	22,184	34.78000	771,559.52	
00751Y10	ADVANCE AUTO PARTS, INC.	3,993	36.70000	146,543.10	
00790310	ADVANCED MICRO DEVICES INC	26,706	5.60000	149,553.60	
00811710	AETNA INC	17,088	26.07000	445,484.16	
00819010	AFFILIATED COMPUTER SERVICES INC-A	3,633	53.92000	195,891.36	
00846U10	AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,445	26.20000	378,459.00	
00915810	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,730	81.14000	708,352.20	
00936310	AIRGAS INC	3,745	49.34000	184,778.30	
00971T10	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,700	21.50000	165,550.00	
01381710	ALCOA INC	33,834	13.73000	464,540.82	
01736110	ALLEGHENY ENERGY INC	7,190	26.30000	189,097.00	
01741R10	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	3,675	34.00000	124,950.00	
01849010	ALLERGAN INC	12,885	56.73000	730,966.05	
01858110	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,425	60.28000	206,459.00	
01880210	ALLIANT ENERGY CORP	4,465	27.47000	122,653.55	
02000210	ALLSTATE CORP	20,358	31.50000	641,277.00	
02076X10	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	4,800	37.86000	181,728.00	
02144110	ALTERA CORPORATION	12,031	20.86000	250,966.66	
02313510	AMAZON.COM INC	13,705	118.49000	1,623,905.45	
02355110	HESS CORP	12,240	58.95000	721,548.00	
02360810	AMEREN CORPORATION	8,557	25.20000	215,636.40	
02364J10	TIME WARNER INC	47,808	30.78000	1,471,530.24	
02553710	AMERICAN ELECTRIC POWER	19,043	30.81000	586,714.83	
02553E10	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	7,627	19.03000	145,141.81	
02581610	AMERICAN EXPRESS CO	41,729	34.58000	1,442,988.82	
02687410	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,750	38.90000	68,075.00	
02991220	AMERICAN TOWER CORP	16,859	38.46000	648,397.14	
03073E10	AMERISOURCEBERGEN CORP	13,544	23.19000	314,085.36	
03076C10	AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,360	37.07000	346,975.20	
03110010	AMETEK INC	4,695	36.77000	172,635.15	
03116210	AMGEN INC	40,441	56.17000	2,271,570.97	
03209510	AMPHENOL CORPORATION-CL A	7,400	41.28000	305,472.00	
03251110	ANADARKO PETROLEUM CORP	19,953	65.34000	1,303,729.02	
03265410	ANALOG DEVICES INC	10,486	27.12000	284,380.32	
03674B10	WELLPOINT INC	20,191	46.03000	929,391.73	
03738910	AON CORP	8,802	40.50000	356,481.00	
03741110	APACHE CORP	13,379	99.39000	1,329,738.81	
03760410	APOLLO GROUP INC-CL A	4,882	74.03000	361,414.46	
03783310	APPLE INC	35,601	203.94000	7,260,467.94	
03822210	APPLIED MATERIALS INC	55,658	12.95000	720,771.10	
03836W10	AQUA AMERICA INC	7,385	15.89000	117,347.65	
03938010	ARCH COAL INC	7,905	24.03000	189,957.15	
03948310	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,888	30.66000	671,086.08	
04273510	ARROW ELECTRONICS INC	6,365	27.34000	174,019.10	
04621X10	ASSURANT INC	4,665	31.15000	145,314.75	
05276910	AUTODESK INC	9,580	26.58000	254,636.40	
05301510	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	20,191	40.37000	815,110.67	
05333210	AUTOZONE INC	1,247	137.62000	171,612.14	

05361110	VERY DENNISON CORP	4,000	37.79000	151,160.00	
05380710	AVNET INC	6,970	26.18000	182,474.60	
05430310	AVON PRODUCTS INC	17,908	34.98000	626,421.84	
05493710	BB&T CORPORATION	26,083	26.07000	679,983.81	
05548210	BJ SERVICES CO	11,313	20.50000	231,916.50	
05592110	BMC SOFTWARE INC	7,584	37.16000	281,821.44	
05722410	BAKER HUGHES INC	11,321	45.36000	513,520.56	
05849810	BALL CORP	4,129	50.16000	207,110.64	
06405710	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	47,752	29.67000	1,416,801.84	
06605F10	BANK OF AMERICA CORP	345,464	16.22000	5,603,426.08	
06738310	C.R. BARD INC	3,534	76.74000	271,199.16	
07181310	BAXTER INTERNATIONAL INC	24,539	55.08000	1,351,608.12	
07581110	BECKMAN COULTER INC	2,773	69.33000	192,252.09	
07588710	BECTON DICKINSON & CO	9,266	67.50000	625,455.00	
07589610	BED BATH & BEYOND INC	9,402	36.17000	340,070.34	
07785310	VERIZON COMMUNICATIONS INC	113,553	28.85000	3,276,004.05	
08442310	W.R. BERKLEY CORPORATION	6,018	24.99000	150,389.82	
08467020	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	439	3,318.00000	1,456,602.00	
08651610	BEST BUY CO INC	14,659	39.17000	574,193.03	
09062X10	BIOGEN IDEC INC	11,362	43.81000	497,769.22	
09179710	BLACK & DECKER CORP	3,545	49.95000	177,072.75	
09247X10	BLACKROCK INC CLASS A	710	231.20000	164,152.00	
09367110	H&R BLOCK INC	14,360	19.46000	279,445.60	
09702310	BOEING CO	27,577	49.89000	1,375,816.53	
09972410	BORGWARNER INC	4,810	33.07000	159,066.70	
10113710	BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,203	8.75000	500,526.25	
11012210	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	79,129	22.24000	1,759,828.96	
11132010	BROADCOM CORP-CL A	15,951	28.50000	454,603.50	
1150G111	ACCENTURE PLC-CL A	23,658	37.77000	893,562.66	
11563720	BROWN-FORMAN CORP -CL B	3,205	48.33000	154,897.65	
12189T10	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION	13,751	79.12000	1,087,979.12	
12485720	CBS CORP	23,838	13.04000	310,847.52	
12526910	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,290	89.48000	204,909.20	
12541W20	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,145	57.24000	351,739.80	
12550910	CIGNA CORP	11,500	28.50000	327,750.00	
12640810	CSX CORP	16,751	43.32000	725,653.32	
12665010	CVS CAREMARK CORP	57,412	37.16000	2,133,429.92	
12686C10	CABLEVISION SYSTEM CORPORATION	9,160	23.49000	215,168.40	
12709710	CABOT OIL & GAS CORP	4,145	38.90000	161,240.50	
13134730	CALPINE CORP	14,055	11.25000	158,118.75	
13442910	CAMPBELL SOUP CO	7,460	31.89000	237,899.40	
14040H10	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	18,055	40.95000	739,352.25	
14149Y10	CARDINAL HEALTH INC	13,320	28.66000	381,751.20	
14170T10	CAREFUSION CORP	6,660	22.63000	150,715.80	
14313010	CARMAX INC	11,189	22.32000	249,738.48	
14365810	CARNIVAL CORP	18,017	32.03000	577,084.51	
14912310	CATERPILLAR INC	24,046	57.60000	1,385,049.60	
15087010	CELANESE CORP	7,245	26.12000	189,239.40	
15102010	CELGENE CORPORATION	18,112	54.21000	981,851.52	
15670010	CENTURYTEL INC	12,560	33.12000	415,987.20	
15670810	CEPHALON INC	2,845	53.92000	153,402.40	
15678210	CERNER CORP	2,820	82.02000	231,296.40	
15688010	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	12,585	22.82000	287,189.70	
15986410	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	3,685	38.99000	143,678.15	
16161A10	JPMORGAN CHASE & CO	150,160	45.23000	6,791,736.80	
16516710	CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	23,050	26.73000	616,126.50	
16675110	CHEVRON CORPORATION	80,131	76.68000	6,144,445.08	
16776010	CME GROUP INC	2,411	319.96000	771,423.56	
17123210	CHUBB CORP	13,408	50.64000	678,981.12	

[次へ](#)

17134010	CHURCH & DWIGHT CO INC	3,245	55.39000	179,740.55	
17179810	CIMAREX ENERGY CO	4,510	43.60000	196,636.00	
17206210	CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	6,340	25.69000	162,874.60	
17275R10	CISCO SYSTEMS INC	230,400	24.17000	5,568,768.00	
17290810	CINTAS CORP	5,682	28.11000	159,721.02	
17296710	CITIGROUP INC	639,513	4.46000	2,852,227.98	
17737610	CITRIX SYSTEMS INC	7,163	39.34000	281,792.42	
18589610	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	6,535	37.83000	247,219.05	
18905410	CLOROX COMPANY	5,961	59.14000	352,533.54	
18975410	COACH INC	11,641	34.22000	398,355.02	
19121610	COCA-COLA COMPANY	83,276	53.24000	4,433,614.24	
19121910	COCA-COLA ENTERPRISES	12,210	19.98000	243,955.80	
19244610	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	11,579	40.52000	469,181.08	
19416210	COLGATE-PALMOLIVE CO	20,175	77.72000	1,568,001.00	
20030010	COMCAST CORP-CL A	78,266	15.06000	1,178,685.96	
20030020	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	29,901	14.47000	432,667.47	
20034010	COMERICA INC	6,145	30.79000	189,204.55	
20491210	CA INC	14,950	21.61000	323,069.50	
20536310	COMPUTER SCIENCES CORP	6,273	51.78000	324,815.94	
20588710	CONAGRA FOODS INC	17,880	21.56000	385,492.80	
20854P10	CONSOL ENERGY INC	7,633	47.42000	361,956.86	
20911110	CONSOLIDATED EDISON INC	10,036	41.81000	419,605.16	
21036P10	CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,550	16.25000	171,437.50	
21037110	CONSTELLATION ENERGY GROUP INC	7,810	31.83000	248,592.30	
21664010	CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,101	40.16000	365,496.16	
21666910	COOPER INDUSTRIES PLC	7,098	40.36000	286,475.28	
21935010	CORNING INC	63,003	15.65000	985,996.95	
22160Q10	COSTCO WHOLESALE CORP	17,109	57.81000	989,071.29	
22281610	COVANCE INC	2,480	55.97000	138,805.60	
22286210	COVENTRY HEALTH CARE INC	7,750	18.70000	144,925.00	
22822710	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	11,710	32.27000	377,881.70	
22825510	CROWN HOLDINGS INC	6,525	26.25000	171,281.25	
23102110	CUMMINS INC	7,205	48.59000	350,090.95	
23331A10	DR HORTON INC	11,641	12.42000	144,581.22	
23332610	DST SYSTEMS INC	2,494	43.73000	109,062.62	
23333110	DTE ENERGY COMPANY	6,843	37.85000	259,007.55	
23585110	DANAHER CORP	10,297	70.00000	720,790.00	
23719410	DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	31.29000	163,427.67	
23918K10	DAVITA INC	4,319	54.36000	234,780.84	
23975310	TARGET CORP	28,585	49.03000	1,401,522.55	
24237010	DEAN FOODS CO	6,427	18.26000	117,357.02	
24419910	DEERE & CO	17,635	48.08000	847,890.80	
24702510	DELL INC	69,981	15.48000	1,083,305.88	
24791620	DENBURY RESOURCES INC	10,025	16.40000	164,410.00	
24903010	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,312	35.99000	227,168.88	
25179M10	DEVON ENERGY CORPORATION	16,861	68.22000	1,150,257.42	
25189310	DEVRY INC	2,625	55.50000	145,687.50	
25271C10	DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC	2,405	105.80000	254,449.00	
25468710	THE WALT DISNEY CO.	70,498	28.89000	2,036,687.22	
25468Y10	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	5,675	29.74000	168,774.50	
25470910	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,695	15.03000	326,075.85	
25470F30	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	5,670	26.36000	149,461.20	
25674710	DOLLAR TREE INC	3,745	47.55000	178,074.75	
25747010	DOMINION RESOURCES INC/VA	22,747	35.17000	800,011.99	
25786710	RR DONNELLEY & SONS CO	11,125	21.37000	237,741.25	
26000310	DOVER CORP	7,370	38.66000	284,924.20	
26054310	DOW CHEMICAL COMPANY	43,278	25.15000	1,088,441.70	
26138E10	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,854	27.65000	272,463.10	
26353410	E.I. DU PONT DE NEMOURS AND COMPANY	36,078	33.23000	1,198,871.94	
26439910	DUKE ENERGY CORP	48,453	16.10000	780,093.30	
26483E10	DUN & BRADSTREET CORPORATION	2,337	78.75000	184,038.75	

26864810	EMC CORP	81,579	17.49000	1,426,816.71	
26874010	ENSCO INTERNATIONAL INC	5,530	50.32000	278,269.60	
27743210	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,810	55.14000	210,083.40	
27805810	EATON CORP	5,603	63.10000	353,549.30	
27826510	EATON VANCE CORP	5,645	30.23000	170,648.35	
27864210	EBAY INC	43,607	23.56000	1,027,380.92	
27876210	DISH NETWORK CORP-A	8,249	18.07000	149,059.43	
27886510	ECOLAB INC	8,660	46.10000	399,226.00	
28102010	EDISON INTERNATIONAL	11,234	32.64000	366,677.76	
28176E10	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,280	76.00000	173,280.00	
28390510	EL PASO CORP	30,330	10.52000	319,071.60	
28551210	ELECTRONIC ARTS INC	12,614	19.71000	248,621.94	
29101110	EMERSON ELECTRIC CO	30,585	39.68000	1,213,612.80	
29265N10	ENERGEN CORP	3,570	47.20000	168,504.00	
29266R10	ENERGIZER HOLDINGS INC	3,166	64.14000	203,067.24	
29356210	EOG RESOURCES INC	10,391	89.16000	926,461.56	
29364G10	ENTERGY CORP	7,807	79.29000	619,017.03	
29442910	EQUIFAX INC	5,569	28.90000	160,944.10	
29454910	EQT CORP	5,345	44.54000	238,066.30	
30161N10	EXELON CORPORATION	26,314	49.87000	1,312,279.18	
30212P10	EXPEDIA INC	6,900	26.36000	181,884.00	
30213010	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	7,947	33.08000	262,886.76	
30218210	EXPRESS SCRIPTS INC	10,191	80.70000	822,413.70	
30231G10	EXXON MOBIL CORPORATION	194,921	73.57000	14,340,337.97	
30244510	FLIR SYSTEMS INC	5,565	29.33000	163,221.45	
30249130	FMC CORP	2,825	54.88000	155,036.00	
30249U10	FMC TECHNOLOGIES INC	5,745	57.67000	331,314.15	
30257110	FPL GROUP INC	15,385	52.63000	809,712.55	
30294110	FTI CONSULTING INC	2,295	41.81000	95,953.95	
30700010	FAMILY DOLLAR STORES	5,308	29.17000	154,834.36	
31190010	FASTENAL COMPANY	5,509	37.60000	207,138.40	
31304N10	FEDEX CORP	11,233	77.10000	866,064.30	
31410H10	MACY'S INC	16,104	18.87000	303,882.48	
31620R10	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL, INC.	8,541	14.63000	124,954.83	
31677310	FIFTH THIRD BANCORP	30,274	10.34000	313,033.16	
31852230	FIRST AMERICAN CORP	4,440	31.31000	139,016.40	
33643310	FIRST SOLAR INC	1,615	152.39000	246,109.85	
33773810	FISERV INC	6,424	48.61000	312,270.64	
33793210	FIRSTENERGY CORP	11,333	45.93000	520,524.69	
34354P10	FLOWSERVE CORP	2,620	105.15000	275,493.00	
34386110	FLUOR CORP	6,633	49.54000	328,598.82	
34537010	FORD MOTOR CO	103,000	7.63000	785,890.00	
34583810	FOREST LABORATORIES INC	10,690	27.88000	298,037.20	
34963110	FORTUNE BRANDS INC	5,661	43.25000	244,838.25	
35461310	FRANKLIN RESOURCES INC	6,600	112.93000	745,338.00	
35671D85	FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	16,454	81.35000	1,338,532.90	
36467W10	GAMESTOP CORP	6,535	24.77000	161,871.95	
36476010	GAP INC	17,826	22.02000	392,528.52	
36955010	GENERAL DYNAMICS CORP	13,122	66.60000	873,925.20	
36960410	GENERAL ELECTRIC COMPANY	422,453	15.20000	6,421,285.60	
37033410	GENERAL MILLS INC	12,702	64.95000	824,994.90	
37246010	GENUINE PARTS CO	6,956	37.47000	260,641.32	
37291710	GENZYME CORP - GENL DIVISION	9,994	52.24000	522,086.56	
37555810	GILEAD SCIENCES INC	36,397	43.83000	1,595,280.51	
38141G10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,093	180.36000	3,443,613.48	
38238810	GOODRICH CORP	4,860	57.44000	279,158.40	
38255010	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,190	17.75000	163,122.50	
38259P50	GOOGLE INC-CL A	9,606	553.69000	5,318,746.14	
38480210	WW GRAINGER INC	2,792	96.96000	270,712.32	
40621610	HALLIBURTON CO	37,447	30.21000	1,131,273.87	
41131010	HANSEN NATURAL CORP	3,005	37.45000	112,537.25	

41282210	HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	27.73000	246,630.62	
41387510	HARRIS CORP	5,795	39.45000	228,612.75	
41586410	HARSCO CORP	4,395	36.47000	160,285.65	
41651510	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	12,237	25.90000	316,938.30	
41805610	HASBRO INC	4,903	28.03000	137,431.09	
42307410	HJ HEINZ CO	13,425	40.46000	543,175.50	
42345210	HELMERICH & PAYNE INC	4,105	43.07000	176,802.35	
42786610	HERSHEY COMPANY	6,780	38.06000	258,046.80	
42823610	HEWLETT-PACKARD CO	96,240	48.56000	4,673,414.40	
43644010	HOLOGIC INC	10,133	15.59000	157,973.47	
43707610	HOME DEPOT INC	67,775	26.27000	1,780,449.25	
43850610	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,931	38.26000	1,068,640.06	
44045210	HORMEL FOODS CORP	3,430	36.31000	124,543.30	
44106010	HOSPIRA INC	6,641	45.97000	305,286.77	
44368310	HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	13.41000	266,456.70	
44441810	THE DIRECTV GROUP INC	18,816	26.42000	497,118.72	
44485910	HUMANA INC	7,140	37.54000	268,035.60	
44565810	JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,075	32.67000	100,460.25	
44993410	IMS HEALTH INC	9,360	17.41000	162,957.60	
45068B10	ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	1,575	101.77000	160,287.75	
45091110	ITT CORPORATION	6,173	54.81000	338,342.13	
45173410	IHS INC	2,125	53.59000	113,878.75	
45230810	ILLINOIS TOOL WORKS	16,050	47.78000	766,869.00	
45232710	ILLUMINA INC	5,280	40.87000	215,793.60	
45686610	INGERSOLL-RAND PLC	11,491	34.81000	400,001.71	
45814010	INTEL CORP	222,342	19.78000	4,397,924.76	
45822P10	WPS RESOURCES CORP	4,205	35.22000	148,100.10	
45865V10	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,325	104.54000	243,055.50	
45920010	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	52,782	120.36000	6,352,841.52	
45950610	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	4,194	39.65000	166,292.10	
45990210	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	11,686	20.82000	243,302.52	
46014610	INTERNATIONAL PAPER CO	14,895	23.72000	353,309.40	
46069010	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	25,686	6.12000	157,198.32	
46120210	INTUIT INC	10,961	29.87000	327,405.07	
46120E60	INTUITIVE SURGICAL INC	1,410	262.96000	370,773.60	
46284610	IRON MOUNTAIN INC	7,807	25.98000	202,825.86	
46815R10	LIFE TECHNOLOGIES CORP	7,726	47.75000	368,916.50	
46981410	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	46.92000	244,922.40	
47816010	JOHNSON & JOHNSON	110,074	60.54000	6,663,879.96	
47836610	JOHNSON CONTROLS INC	24,663	26.54000	654,556.02	
48116510	JOY GLOBAL INC	4,425	56.55000	250,233.75	
48203R10	JUNIPER NETWORKS INC	22,083	27.31000	603,086.73	
48242W10	KBR INC	7,335	24.02000	176,186.70	
48248010	KLA-TENCOR CORPORATION	6,579	35.07000	230,725.53	
48783610	KELLOGG CO	11,058	50.20000	555,111.60	
49326710	KEYCORP	34,838	6.48000	225,750.24	
49436810	KIMBERLY-CLARK CORP	16,378	61.57000	1,008,393.46	
50025510	KOHL'S CORP	12,122	59.19000	717,501.18	
50075N10	KRAFT FOODS INC-A	58,730	27.05000	1,588,646.50	
50104410	KROGER CO	23,025	23.70000	545,692.50	
50216110	LSI CORP	31,720	5.35000	169,702.00	
50242410	L-3 COMMUNICATIONS	4,301	74.42000	320,080.42	
50540R40	LABORATORY CORPORATION OF AMERICAN HOLDINGS	4,830	70.73000	341,625.90	
51280710	LAM RESEARCH CORPORATION	5,822	36.33000	211,513.26	
51783410	LAS VEGAS SANDS CORP	12,095	16.51000	199,688.45	
51843910	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,275	42.00000	179,550.00	
52466010	LEGGETT & PLATT INC	8,218	20.82000	171,098.76	
52490110	LEGG MASON INC	7,030	31.90000	224,257.00	
52602E10	LENDER PROCESSING SERVICES INC	5,080	43.99000	223,469.20	
52728810	LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	24.23000	177,000.15	

53055530	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	5,543	21.75000	120,560.25	
53071910	LIBERTY GLOBAL INC-A	6,058	21.80000	132,064.40	
53071M10	LIBERTY MEDIA HOLDING CORP-INTERACTIVE A	20,745	12.07000	250,392.15	
53071M50	LIBERTY MEDIA CORP - ENTERTAINMENT	20,161	31.19000	628,821.59	
53245710	ELI LILLY & CO	40,903	33.96000	1,389,065.88	
53271610	LIMITED BRANDS	12,153	19.22000	233,580.66	
53418710	LINCOLN NATIONAL CORP	9,838	25.41000	249,983.58	
53567810	LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	26.60000	236,846.40	
53983010	LOCKHEED MARTIN CORP	13,616	72.19000	982,939.04	
54042410	LOEWS CORP	12,955	35.88000	464,825.40	
54414710	LORILLARD INC	6,220	79.82000	496,480.40	
54866110	LOWE'S COS INC	58,764	20.71000	1,217,002.44	
54927110	LUBRIZOL CORP	2,695	73.88000	199,106.60	
55261F10	M & T BANK CORP	2,798	68.77000	192,418.46	
55269010	MDU RESOURCES GROUP INC	6,650	21.28000	141,512.00	
55271510	MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	8,695	13.87000	120,599.65	
56418H10	MANPOWER INC	3,217	51.37000	165,257.29	
57174810	MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	18,883	24.89000	469,997.87	
57183410	MARSHALL & ILSLEY CORP	20,337	5.97000	121,411.89	
57190310	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,810	27.20000	294,032.00	
57328410	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	1,635	90.54000	148,032.90	
57459910	MASCO CORP	15,919	13.54000	215,543.26	
57636Q10	MASTERCARD INC-A	3,345	229.96000	769,216.20	
57708110	MATTEL INC	14,664	19.52000	286,241.28	
57772K10	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	12,465	18.41000	229,480.65	
57978020	MCCORMIK & CO-NON VTG SHRS	5,285	34.38000	181,698.30	
58003710	MCDERMOTT INTERNATIONAL INC	9,085	25.49000	231,576.65	
58013510	MCDONALD'S CORPORATION	44,516	59.43000	2,645,585.88	
58064510	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,407	30.49000	347,799.43	
58155Q10	MCKESSON CORPORATION	11,574	60.31000	698,027.94	
58333410	MEADWESTVACO CORP	8,929	23.93000	213,670.97	
58405U10	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	19,762	57.27000	1,131,769.74	
58505510	MEDTRONIC INC	44,702	36.37000	1,625,811.74	
58933110	MERCK & CO. INC.	84,513	32.43000	2,740,756.59	
59156R10	METLIFE INC	32,695	36.95000	1,208,080.25	
59170810	METROPCS COMMUNICATIONS INC	12,715	6.64000	84,427.60	
59491810	MICROSOFT CORP	319,859	28.02000	8,962,449.18	
59501710	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	25.29000	187,879.41	
59511210	MICRON TECHNOLOGY INC	29,277	7.45000	218,113.65	
60107310	MILLIPORE CORP	2,505	70.75000	177,228.75	
60405910	3M CO	26,346	77.82000	2,050,245.72	
60467510	MIRANT CORP	8,230	15.85000	130,445.50	
60819010	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,203	48.02000	105,788.06	
60871R20	MOLSON COORS BREWING COMPANY-B	6,295	50.24000	316,260.80	
61166W10	MONSANTO CO	21,881	75.23000	1,646,107.63	
61536910	MOODY'S CORPORATION	8,597	25.03000	215,182.91	
61744644	MORGAN STANLEY	47,060	35.00000	1,647,100.00	
61945A10	MOSAIC CO/THE	7,075	51.79000	366,414.25	
62007610	MOTOROLA INC	95,680	8.24000	788,403.20	
62671710	MURPHY OIL CORPORATION	6,605	63.10000	416,775.50	
62853010	MYLAN INC	12,415	16.13000	200,253.95	
62855J10	MYRIAD GENETICS INC	3,895	26.09000	101,620.55	
62913F20	NII HOLDINGS INC	6,562	30.99000	203,356.38	
62937750	NRG ENERGY INC	9,360	26.90000	251,784.00	
62940M10	VIRGIN MEDIA INC	14,950	13.75000	205,562.50	
62949W10	NYSE EURONEXT	10,860	29.15000	316,569.00	
62956810	NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	22.60000	242,746.60	
63110310	NASDAQ STOCK MARKET INC	5,680	19.85000	112,748.00	
63707110	NATIONAL-OILWELL VARCO INC	17,111	46.89000	802,334.79	
63764010	NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	10,270	13.68000	140,493.60	
64093810	MCAFFEE INC	6,335	43.73000	277,029.55	

64120L10	NETAPP INC	14,311	28.75000	411,441.25	
64944510	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	12,954	10.96000	141,975.84	
65119210	NEWELL RUBBERMAID INC	9,710	15.15000	147,106.50	
65129010	NEWFIELD EXPLORATION COMPANY	5,285	46.08000	243,532.80	
65163910	NEWMONT MINING CORP	19,130	44.91000	859,128.30	
65248770	NEWS CORP INC-CL B WHEN ISS	14,409	14.42000	207,777.78	
65248780	NEWS CORP-CL A	75,497	12.26000	925,593.22	
65410610	NIKE INC -CL B	14,737	64.17000	945,673.29	
65473P10	NISOURCE INC	11,580	13.36000	154,708.80	
65489410	NOBLE ENERGY INC	6,931	69.49000	481,635.19	
65504210	NOBLE CORP	9,412	43.81000	412,339.72	
65566410	NORDSTROM INC	6,435	33.64000	216,473.40	
65584410	NORFOLK SOUTHERN CORP	15,115	46.88000	708,591.20	
66439710	NORTHEAST UTILITIES	6,920	23.08000	159,713.60	
66577210	XCEL ENERGY INC	16,129	19.45000	313,709.05	
66585910	NORTHERN TRUST CORP	8,440	53.14000	448,501.60	
66680710	NORTHROP GRUMMAN CORP	11,734	49.66000	582,710.44	
67019E10	NSTAR	5,005	31.42000	157,257.10	
67020Y10	NUANCE COMMUNICATIONS INC	10,635	14.63000	155,590.05	
67034610	NUCOR CORP	12,554	44.17000	554,510.18	
67066G10	NVIDIA CORP	22,340	13.15000	293,771.00	
67459910	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	32,391	82.15000	2,660,920.65	
68022310	OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP	12,853	11.23000	144,339.19	
68190410	OMNICARE INC	4,820	22.77000	109,751.40	
68191910	OMNICOM GROUP INC	11,412	35.86000	409,234.32	
68267810	ONEOK INC	5,070	37.98000	192,558.60	
68389X10	ORACLE CORP	159,253	22.05000	3,511,528.65	
68609110	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,205	35.02000	182,279.10	
69076840	OWENS-ILLINOIS INC	6,475	36.60000	236,985.00	
69331C10	P G & E CORP	14,016	41.69000	584,327.04	
69347510	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,655	52.41000	925,298.55	
69349910	PPL CORPORATION	13,738	30.54000	419,558.52	
69350610	PPG INDUSTRIES INC	5,922	59.34000	351,411.48	
69371810	PACCAR INTERNATIONAL INC	12,764	39.06000	498,561.84	
69525710	PACTIV CORPORATION	6,429	24.59000	158,089.11	
69642930	PALL CORP	5,116	32.88000	168,214.08	
70109410	PARKER HANNIFIN CORP	6,635	56.86000	377,266.10	
70341210	PATTERSON COS INC	5,182	26.84000	139,084.88	
70348110	PATTERSON-UTI ENERGY INC	8,752	17.00000	148,784.00	
70432610	PAYCHEX INC	11,682	28.52000	333,170.64	
70454910	PEABODY ENERGY CORPORATION	11,300	43.22000	488,386.00	
70816010	J.C. PENNEY CO INC (HOLDING CO)	8,461	36.03000	304,849.83	
70963110	PENTAIR INC	5,054	32.05000	161,980.70	
71019810	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,980	16.61000	248,817.80	
71340910	PEPSI BOTTLING GROUP INC	5,315	37.38000	198,674.70	
71344810	PEPSICO INC	62,213	61.03000	3,796,859.39	
71429010	PERRIGO CO	4,345	36.77000	159,765.65	
71649510	PETROHAWK ENERGY CORP	10,750	26.47000	284,552.50	
71676810	PETSMART INC	5,125	24.75000	126,843.75	
71708110	PFIZER INC	322,065	17.25000	5,555,621.25	
71712410	PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	5,690	23.05000	131,154.50	
71815410	ALTRIA GROUP INC	82,363	17.93000	1,476,768.59	
71817210	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	78,358	49.07000	3,845,027.06	
71850710	CONOCOPHILLIPS	56,215	51.97000	2,921,493.55	
72348410	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	4,079	33.48000	136,564.92	
72378710	PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	5,260	42.74000	224,812.40	
72447910	PITNEY BOWES INC	8,543	25.87000	221,007.41	
72650510	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	4,405	29.54000	130,123.70	
73157210	POLO RALPH LAUREN CORP	2,350	78.05000	183,417.50	
73767910	PEPCO HOLDINGS INC	8,712	14.75000	128,502.00	
74005P10	PRAXAIR INC	12,275	82.68000	1,014,897.00	

[次へ](#)

74018910	PRECISION CASTPARTS CORP	5,160	102.77000	530,293.20	
74147710	T ROWE PRICE GROUP INC	9,480	54.27000	514,479.60	
74150340	PRICELINE.COM INC	1,635	177.14000	289,623.90	
74153Q10	PRIDE INTERNATIONAL INC	6,670	32.95000	219,776.50	
74251V10	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,520	28.21000	296,769.20	
74271810	PROCTER & GAMBLE COMPANY	116,429	57.64000	6,710,967.56	
74326310	PROGRESS ENERGY INC	10,108	37.68000	380,869.44	
74331510	PROGRESSIVE CORP	23,485	16.49000	387,267.65	
74432010	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,032	49.73000	896,731.36	
74457310	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	21,318	30.31000	646,148.58	
74586710	PULTE HOMES INC	8,769	10.08000	88,391.52	
74752510	QUALCOMM INC	65,937	40.70000	2,683,635.90	
74762E10	QUANTA SERVICES INC	8,315	22.82000	189,748.30	
74834L10	QUEST DIAGNOSTICS INC	5,921	56.32000	333,470.72	
74835610	QUESTAR CORPORATION	7,365	41.15000	303,069.75	
74912110	QWEST COMMUNICATIONS INTERNATIONAL INC	65,293	3.58000	233,748.94	
75102510	RALCORP HOLDINGS INC	2,415	55.71000	134,539.65	
75281A10	RANGE RESOURCES CORP	6,505	54.98000	357,644.90	
75511140	RAYTHEON COMPANY	15,262	46.43000	708,614.66	
75657710	RED HAT INC	7,790	27.49000	214,147.10	
75894010	REGIONS FINANCIAL CORP	44,609	5.53000	246,687.77	
75952J10	CENTERPOINT ENERGY INC	13,697	12.85000	176,006.45	
76075910	REPUBLIC SERVICES INC	13,660	26.80000	366,088.00	
76182K10	REYNOLDS AMERICAN INC	6,350	48.44000	307,594.00	
77032310	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	6,240	25.72000	160,492.80	
77390310	ROCKWELL AUTOMATION INC	5,878	43.26000	254,282.28	
77434110	ROCKWELL COLLINS INC.	6,270	51.54000	323,155.80	
77669610	ROPER INDUSTRIES INC	3,990	52.21000	208,317.90	
77829610	ROSS STORES INC	5,483	46.12000	252,875.96	
77938210	ROWAN COMPANIES INC	6,265	26.25000	164,456.25	
78387G10	AT&T INC	235,586	25.73000	6,061,627.78	
78390X10	SAIC INC	7,890	18.34000	144,702.60	
78411710	SEI INVESTMENTS CO	6,985	18.33000	128,035.05	
78463510	SPX CORP	2,892	60.74000	175,660.08	
78651420	SAFeway INC	15,208	22.40000	340,659.20	
79084910	ST JUDE MEDICAL INC	14,275	34.40000	491,060.00	
79286010	TRAVELERS COS INC/THE	23,389	51.30000	1,199,855.70	
79466L30	SALESFORCE.COM INC	4,700	63.12000	296,664.00	
80004C10	SANDISK CORPORATION	10,323	22.12000	228,344.76	
80311110	SARA LEE CORP	30,403	11.48000	349,026.44	
80589M10	SCANA CORP	4,853	34.96000	169,660.88	
80640710	HENRY SCHEIN INC	4,060	55.22000	224,193.20	
80660510	SCHERING-PLOUGH CORP	65,000	28.97000	1,883,050.00	
80685710	SCHLUMBERGER LTD	47,807	65.20000	3,117,016.40	
80851310	CHARLES SCHWAB CORP	37,459	17.94000	672,014.46	
81106510	SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,345	39.26000	131,324.70	
81211K10	SEALED AIR CORP	8,226	20.24000	166,494.24	
81235010	SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,326	72.78000	169,286.28	
81685110	SEMPRA ENERGY	9,527	52.74000	502,453.98	
82434810	SHERWIN-WILLIAMS CO	4,042	58.26000	235,486.92	
82655210	SIGMA ALDRICH CORP	5,485	54.08000	296,628.80	
83211010	SMITH INTERNATIONAL INC	8,676	32.65000	283,271.40	
83269640	JM SMUCKER CO/THE	5,110	52.84000	270,012.40	
84258710	SOUTHERN CO	31,410	32.67000	1,026,164.70	
84474110	SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	6,100	8.84000	53,924.00	
84546710	SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,945	47.22000	611,262.90	
84756010	SPECTRA ENERGY CORP	26,769	20.00000	535,380.00	
85206110	SPRINT NEXTEL CORPORATION	115,162	3.25000	374,276.50	
85461610	STANLEY WORKS	2,642	47.31000	124,993.02	
85503010	STAPLES INC	28,519	22.60000	644,529.40	

85524410	STARBUCKS CORP	29,757	20.27000	603,174.39	
85590520	STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	6,957	33.00000	229,581.00	
85747710	STATE STREET CORP	20,067	45.70000	917,061.90	
85981210	STERICYCLE INC	3,555	53.17000	189,019.35	
86366710	STRYKER CORP	11,638	48.03000	558,973.14	
86676210	SUNOCO INC	5,078	33.12000	168,183.36	
86681010	SUN MICROSYSTEMS INC	29,386	8.44000	248,017.84	
86765210	SUNPOWER CORP-CLASS A	3,350	28.35000	94,972.50	
86791410	SUNTRUST BANKS INC	17,417	20.99000	365,582.83	
86853610	SUPERVALU INC	8,880	16.55000	146,964.00	
87150310	SYMANTEC CORP	30,615	16.66000	510,045.90	
87160710	SYNOPSYS INC	5,697	23.28000	132,626.16	
87182910	SYSCO CORP	23,321	27.23000	635,030.83	
87236Y10	TD AMERITRADE HOLDING CORP	9,050	19.42000	175,751.00	
87240R10	TFS FINANCIAL CORP	4,255	11.72000	49,868.60	
87254010	TJX COMPANIES INC	15,554	39.78000	618,738.12	
87943310	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	2,240	32.82000	73,516.80	
88076W10	TERADATA CORP	7,150	28.33000	202,559.50	
88250810	TEXAS INSTRUMENTS INC	51,032	23.50000	1,199,252.00	
88320310	TEXTRON INC	9,791	19.13000	187,301.83	
88355610	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,399	47.66000	829,236.34	
88654710	TIFFANY & CO	5,030	41.45000	208,493.50	
88706M10	TIM HORTONS INC	7,404	28.90000	213,975.60	
88732J10	TIME WARNER CABLE INC	14,837	41.24000	611,877.88	
88947810	TOLL BROTHERS INC	5,526	19.17000	105,933.42	
89102710	TORCHMARK CORP	4,181	44.26000	185,051.06	
89190610	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	8,221	16.57000	136,221.97	
89595310	YUM! BRANDS INC	19,174	34.29000	657,476.46	
90212410	TYCO INTERNATIONAL LTD	17,725	35.12000	622,502.00	
90249410	TYSON FOODS INC	11,206	12.07000	135,256.42	
90290582	MARATHON OIL CORPORATION	28,207	34.01000	959,320.07	
90297310	US BANCORP	75,856	24.95000	1,892,607.20	
90319210	UNUM GROUP	13,988	21.34000	298,503.92	
90323610	URS CORP	3,420	40.60000	138,852.00	
90337T10	UNITED STATES STEEL CORP	4,537	40.87000	185,427.19	
90390U10	SLM CORP	19,052	11.00000	209,572.00	
90391410	ULTRA PETROLEUM CORP	6,379	53.60000	341,914.40	
90781810	UNION PACIFIC CORP	20,113	57.73000	1,161,123.49	
91058110	UNITEDHEALTH GROUP INC	48,595	25.85000	1,256,180.75	
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	27,932	55.70000	1,555,812.40	
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	35,830	65.81000	2,357,972.30	
91704710	URBAN OUTFITTERS INC	4,770	32.80000	156,456.00	
91820410	VF CORP	3,830	78.32000	299,965.60	
91913Y10	VALERO ENERGY CORPORATION	20,287	20.67000	419,332.29	
92220P10	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,339	41.63000	222,262.57	
92343E10	VERISIGN INC	7,695	23.79000	183,064.05	
92532F10	VERTEX PHARMACEUTICA	6,860	32.50000	222,950.00	
92552430	VIACOM INC-CLASS B	21,643	28.36000	613,795.48	
92826C83	VISA INC	17,970	74.12000	1,331,936.40	
92916010	VULCAN MATERIALS CO	4,443	50.73000	225,393.39	
93114210	WAL-MART STORES INC	94,082	50.44000	4,745,496.08	
93142210	WALGREEN CO	39,447	39.05000	1,540,405.35	
93964010	THE WASHINGTON POST COMPANY	247	467.10000	115,373.70	
94106L10	WASTE MANAGEMENT INC	17,484	30.93000	540,780.12	
94184810	WATERS CORP	4,046	56.99000	230,581.54	
94268310	WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,075	35.81000	145,925.75	
94707410	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	28,484	19.93000	567,686.12	
94974610	WELLS FARGO & COMPANY	174,875	29.32000	5,127,335.00	
95810210	WESTERN DIGITAL CORP	9,920	35.44000	351,564.80	
95980210	WESTERN UNION CO/THE	29,946	18.79000	562,685.34	
96216610	WEYERHAEUSER CO	8,495	39.48000	335,382.60	

96332010	WHIRLPOOL CORP	2,934	77.13000	226,299.42	
96683710	WHOLE FOODS MARKET INC	7,010	33.36000	233,853.60	
96945710	THE WILLIAMS COMPANIES INC	21,019	19.13000	402,093.47	
97428010	WINDSTREAM CORPORATION	20,465	9.96000	203,831.40	
97665710	WISCONSIN ENERGY CORP	5,127	44.45000	227,895.15	
98313410	WYNN RESORTS LIMITED	2,420	62.46000	151,153.20	
98385X10	XTO ENERGY INC	22,617	43.88000	992,433.96	
98391910	XILINX INC	11,600	22.91000	265,756.00	
98412110	XEROX CORP	34,421	7.88000	271,237.48	
98433210	YAHOO! INC	52,720	17.22000	907,838.40	
98956P10	ZIMMER HOLDINGS INC	8,177	54.71000	447,363.67	
99990000	FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	30,311	7.24000	219,451.64	
G0070K10	ACE LTD	12,608	54.38000	685,623.04	
G0450A10	ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,815	68.88000	125,017.20	
G0692U10	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,885	30.39000	178,845.15	
G1696210	BUNGE LIMITED	5,132	63.54000	326,087.28	
G2552X10	COVIDIEN PLC	21,265	43.44000	923,751.60	
G3223R10	EVEREST RE GROUP LTD	2,684	89.11000	239,171.24	
G3653513	FOSTER WHEELER AG	6,295	31.78000	200,055.10	
G3726010	GARMIN LTD	4,625	37.92000	175,380.00	
G491BT10	INVESCO LTD	16,357	22.36000	365,742.52	
G5876H10	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	20,549	14.58000	299,604.42	
G6852T10	PARTNERRE LTD	2,372	78.56000	186,344.32	
G7496G10	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,362	55.42000	130,902.04	
G7945J10	SEAGATE TECHNOLOGY	20,539	15.73000	323,078.47	
G9007810	TRANSOCEAN LTD	12,780	89.86000	1,148,410.80	
G9144P10	TYCO ELECTRONICS LTD	16,680	23.26000	387,976.80	
G9319H10	VALIDUS HOLDINGS LTD	3,700	26.63000	98,531.00	
G9618E10	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD	470	320.00000	150,400.00	
G9665510	WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	6,770	26.62000	180,217.40	
G9825510	XL CAPITAL LTD -CLASS A	13,665	17.18000	234,764.70	
V7780T10	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,188	22.50000	116,730.00	
アメリカドル 計		12,387,135		398,621,364.24	
(邦貨換算額)				(36,693,096,578)	

外国株式(カナダドル)

(単位:株,カナダドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ABX	BARRICK GOLD CORP	38,589	39.59000	1,527,738.51	
ACM/A	ASTRAL MEDIA INC	3,130	32.21000	100,817.30	
AER	GROUPE AEROPLAN INC	12,575	9.21000	115,815.75	
AGE	AGNICO-EAGLE MINES	5,575	72.10000	401,957.50	
AGU	AGRIUM INC	5,535	55.52000	307,303.20	
ATD/B	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	6,060	18.70000	113,322.00	
BBDB	BOMBARDIER INC 'B'	48,226	4.69000	226,179.94	
BCE	BCE INC	11,310	25.45000	287,839.50	
BMO	BANK OF MONTREAL	21,621	52.03000	1,124,940.63	
BNNA	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	21,152	23.99000	507,436.48	
BNS	BANK OF NOVA SCOTIA	39,654	46.34000	1,837,566.36	
BPO	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	8,959	11.50000	103,028.50	
BVF	BIOVAIL CORPORATION	5,759	14.70000	84,657.30	
CAE	CAE INC	15,585	9.08000	141,511.80	
CCO	CAMECO CORP CORPORATION	15,572	31.95000	497,525.40	
CIXF	CI FINANCIAL CORP	7,240	19.69000	142,555.60	
CM	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	15,655	64.36000	1,007,555.80	
CNQ	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	21,627	74.43000	1,609,697.61	
CNR	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	19,384	53.00000	1,027,352.00	
CPG	CRESCENT POINT ENERGY CORP	5,900	38.15000	225,085.00	
CPZ	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,890	49.20000	289,788.00	
CTR/A	CANADIAN TIRE CORPORATION LIMITED -CL A	3,340	58.02000	193,786.80	

CU	CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,725	39.19000	145,982.75	
ECA	ENCANA CORP	29,978	63.10000	1,891,611.80	
ELD	ELDORADO GOLD CORP	15,315	12.53000	191,896.95	
ENB	ENBRIDGE INC	15,040	42.18000	634,387.20	
ESI	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	4,520	15.99000	72,274.80	
FFH	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	737	373.26000	275,092.62	
FM	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,875	77.27000	222,151.25	
FNV	FRANCO-NEVADA CORP	3,845	27.39000	105,314.55	
FTS	FORTIS INC	7,570	25.93000	196,290.10	
FTT	FINNING INTERNATIONAL INC	7,120	17.10000	121,752.00	
G	GOLDCORP INC	29,567	42.18000	1,247,136.06	
GIB/A	CGI GROUP INC	11,525	13.31000	153,397.75	
GIL	GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	20.22000	79,262.40	
GWO	GREAT WEST LIFECO INC	11,049	24.71000	273,020.79	
HSE	HUSKY ENERGY INC	9,239	30.40000	280,865.60	
IAG	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	3,025	29.93000	90,538.25	
IFC	INTACT FINANCIAL CORP	3,300	33.40000	110,220.00	
IGI	IGM FINANCIAL INC	5,215	40.80000	212,772.00	
IMG	IAMGOLD CORP	12,045	14.49000	174,532.05	
IMN	INMET MINING CORP	2,935	67.03000	196,733.05	
IMO	IMPERIAL OIL LTD	11,667	43.03000	502,031.01	
IVN	IVANHOE MINES LTD	15,050	13.29000	200,014.50	
K	KINROSS GOLD CORP	27,133	22.50000	610,492.50	
L	LOBLAW COMPANIES LTD	4,479	30.66000	137,326.14	
MFC	MANULIFE FINANCIAL CORP	64,361	21.71000	1,397,277.31	
MGA	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	3,522	46.94000	165,322.68	
MRU/A	METRO INC-A	5,410	34.35000	185,833.50	
NA	NATIONAL BANK OF CANADA	5,720	59.10000	338,052.00	
NKO	NIKO RESOURCES LTD	1,905	86.60000	164,973.00	
NXY	NEXEN INC	19,790	24.52000	485,250.80	
OCX	ONEX CORPORATION	3,840	26.01000	99,878.40	
PAA	PAN AMERICAN SILVER CORP	5,030	24.11000	121,273.30	
PBN	PETROBAKKEN ENERGY LTD	2,800	31.30000	87,640.00	
POT	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	11,804	105.95000	1,250,633.80	
POW	POWER CORP OF CANADA	13,675	27.53000	376,472.75	
PWF	POWER FINANCIAL CORPORATION	9,705	29.10000	282,415.50	
RBA	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	4,365	24.81000	108,295.65	
RCI/B	ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B	20,915	28.89000	604,234.35	
RIM	RESEARCH IN MOTION	20,368	69.20000	1,409,465.60	
RY	ROYAL BANK OF CANADA	56,169	56.11000	3,151,642.59	
SAP	SAPUTO INC	6,845	26.05000	178,312.25	
SC	SHOPPERS DRUG MART CORP	7,365	43.81000	322,660.65	
SHER	SHERRITT INTERNATIONAL CORP	18,000	7.79000	140,220.00	
SJRB	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,785	19.95000	235,110.75	
SLC	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,099	30.50000	704,519.50	
SLW	SILVER WHEATON CORP	11,515	14.67000	168,925.05	
SNC	SNC-LAVALIN GROUP INC	5,800	45.44000	263,552.00	
SU	SUNCOR ENERGY INC	62,260	38.37000	2,388,916.20	
T	TELUS CORP	1,440	33.07000	47,620.80	
T/A	TELUS CORPORATION -NON VOTE	4,348	30.92000	134,440.16	
TA	TRANSALTA CORP	9,680	21.24000	205,603.20	
TCW	TRICAN WELL SERVICE LTD	8,190	13.90000	113,841.00	
TD	TORONTO-DOMINION BANK	33,930	64.97000	2,204,432.10	
TEK/B	TECK RESOURCES LTD-CLS B	19,655	34.81000	684,190.55	
TLM	TALISMAN ENERGY INC	42,987	19.37000	832,658.19	
TOC	THOMSON REUTERS CORP	16,464	34.47000	567,514.08	
TRE	SINO-FOREST CORP	11,590	16.34000	189,380.60	
TRP	TRANSCANADA CORP	26,738	33.40000	893,049.20	
VT	VITERRA INC	9,300	10.54000	98,022.00	
WN	GEORGE WESTON LTD	2,187	56.18000	122,865.66	
X	TMX GROUP INC	3,590	34.15000	122,598.50	

YRI	YAMANA GOLD INC	25,391	12.66000	321,450.06	
カナダドル 計		1,190,750		41,167,100.83	
(邦貨換算額)				(3,598,416,284)	

[次へ](#)

外国株式(オーストラリアドル)

(単位:株,オーストラリアドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AGK	AGL ENERGY LTD	20,580	14.35000	295,323.00	
AIO	ASCIANO GROUP	109,000	1.65000	179,850.00	
ALL	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,305	4.91000	55,507.55	
AMC	AMCOR LTD	35,775	5.72000	204,633.00	
AMP	AMP LIMITED	81,862	6.38000	522,279.56	
ANZ	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	93,209	23.85000	2,223,034.65	
ASX	ASX LTD	7,235	35.65000	257,927.75	
BBG	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	12,830	11.45000	146,903.50	
BEN	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	17,948	9.90000	177,685.20	
BHP	BHP BILLITON LTD	134,161	40.20000	5,393,272.20	
BOR	BORAL LIMITED	22,060	6.31000	139,198.60	
BSL	BLUESCOPE STEEL LIMITED	72,831	3.31000	241,070.61	
BXBAU	BRAMBLES LTD	50,713	7.28000	369,190.64	
CBA	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	60,667	56.24000	3,411,912.08	
CCL	COCA-COLA AMATIL LIMITED	21,315	10.72000	228,496.80	
COH	COCHLEAR LIMITED	2,157	63.07000	136,041.99	
CPU	COMPUTERSHARE LIMITED	17,960	10.72000	192,531.20	
CSL	CSL LIMITED	22,667	32.17000	729,197.39	
CSR	CSR LIMITED	52,528	1.98500	104,268.08	
CTX	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	6,935	10.87000	75,383.45	
CWN	CROWN LTD	17,690	8.60000	152,134.00	
FBG	FOSTER'S GROUP LTD	77,620	5.58000	433,119.60	
FMG	FORTESCUE METALS GROUP LTD	49,920	4.03000	201,177.60	
FXJ	FAIRFAX MEDIA LTD	57,250	1.78000	101,905.00	
GFF	GOODMAN FIELDER LTD	81,745	1.63500	133,653.07	
HVN	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	4.11000	104,866.65	
IPL	INCITEC PIVOT LTD	64,675	2.81000	181,736.75	
JHX	JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	26,890	7.56000	203,288.40	
LEI	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,795	37.65000	218,181.75	
LLC	LEND LEASE CORP LIMITED	21,287	10.29000	219,043.23	
MAP	MAP GROUP	22,500	2.86000	64,350.00	
MBL	MACQUARIE GROUP LIMITED	11,166	53.24000	594,477.84	
MIG	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP	95,017	1.43000	135,874.31	
MTS	METCASH LTD	31,160	4.60000	143,336.00	
NAB	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	76,638	30.91000	2,368,880.58	
NCM	NEWCREST MINING LIMITED	20,224	35.47000	717,345.28	
NMH	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	34,590	4.65000	160,843.50	
NRM	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	84,608	3.86000	326,586.88	
ORG	ORIGIN ENERGY LIMITED	37,670	16.48000	620,801.60	
ORI	ORICA LTD	14,920	23.88000	356,289.60	
OST	ONESTEEL LIMITED	33,285	3.38000	112,503.30	
PDN	PALADIN ENERGY LTD	22,400	4.82000	107,968.00	
PPT	PERPETUAL LTD	2,260	40.00000	90,400.00	
QAN	QANTAS AIRWAYS LIMITED	46,470	2.93000	136,157.10	
QBE	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	40,350	23.45000	946,207.50	
RIO	RIO TINTO LIMITED	18,178	67.50000	1,227,015.00	
SGM	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	22.61000	146,851.95	
SHL	SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	13.98000	206,344.80	
STO	SANTOS LTD	28,970	15.55000	450,483.50	
SUN	SUNCORP-METWAY LIMITED	46,635	9.40000	438,369.00	
TAH	TABCORP HOLDINGS LIMITED	21,580	7.40000	159,692.00	
TCL	TRANSURBAN GROUP	49,780	4.41000	219,529.80	
TLS	TELSTRA CORP LTD	167,139	3.19000	533,173.41	
TOL	TOLL HOLDINGS LIMITED	24,745	8.67000	214,539.15	
TTS	TATTS GROUP LTD	45,070	2.53000	114,027.10	
WBC	WESTPAC BANKING CORPORATION	116,321	27.30000	3,175,563.30	
WES	WESFARMERS LIMITED	42,425	28.26000	1,198,930.50	
WESN	WESFARMERS LTD-PPS	8,002	28.35000	226,856.70	

WMC	ALUMINA LIMITED	116,912	1.86000	217,456.32	
WOR	WORLEYPARSONS LTD	6,770	29.04000	196,600.80	
WOW	WOOLWORTHS LIMITED	49,922	29.31000	1,463,213.82	
WPL	WOODSIDE PETROLEUM LTD	19,548	51.80000	1,012,586.40	
オーストラリアドル 計		2,638,635		35,116,068.34	
(邦貨換算額)				(2,982,056,523)	

外国株式(イギリスポンド)

(単位:株,イギリスポンド)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AAL	ANGLO AMERICAN PLC	52,624	23.80000	1,252,451.20	
ABF	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,730	8.50000	99,705.00	
ADM	ADMIRAL GROUP PLC	6,965	10.87000	75,709.55	
AMEC	AMEC PLC	12,860	8.64000	111,110.40	
ANTO	ANTOFAGASTA PLC	16,090	8.58000	138,052.20	
AU	AUTONOMY CORP PLC	8,700	14.44000	125,628.00	
AZN	ASTRAZENECA PLC	57,868	27.69000	1,602,364.92	
BA	BAE SYSTEMS PLC	141,075	3.17300	447,630.97	
BATS	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	79,802	19.75000	1,576,089.50	
BAW	BRITISH AIRWAYS PLC	22,875	2.09800	47,991.75	
BCS	BARCLAYS PLC	440,396	3.61450	1,591,811.34	
BG	BG GROUP PLC	134,219	11.39000	1,528,754.41	
BICC	BALFOUR BEATTY PLC	25,690	2.87200	73,781.68	
BKG	BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	5,791	9.07500	52,553.32	
BLT	BHP BILLITON PLC	88,226	18.32000	1,616,300.32	
BNZL	BUNZL PLC	17,096	6.51500	111,380.44	
BP	BP PLC	749,103	5.65000	4,232,431.95	
BRBY	BURBERRY GROUP PLC	22,444	5.49000	123,217.56	
BSBE	INVENSYS PLC	32,000	3.05900	97,888.00	
BSY	BRITISH SKY BROADCASTING GROUP PLC	41,529	5.53000	229,655.37	
BT	BT GROUP PLC	309,517	1.35300	418,776.50	
CBRY	CADBURY SCHWEPPE'S PLC	50,710	7.86000	398,580.60	
CGU	AVIVA PLC	107,985	4.31200	465,631.32	
CNA	CENTRICA PLC	198,475	2.41200	478,721.70	
CNE	CAIRN ENERGY PLC	5,690	29.21000	166,204.90	
COB	COBHAM PLC	44,635	2.20100	98,241.63	
CPG	COMPASS GROUP PLC	67,133	3.94000	264,504.02	
CPI	CAPITA GROUP PLC	25,499	7.81500	199,274.68	
CPW	CARPHONE WAREHOUSE GROUP	26,830	1.94400	52,157.52	
CW	CABLE & WIRELESS PLC	103,336	1.41000	145,703.76	
DGE	DIAGEO PLC	99,917	9.62500	961,701.12	
DRX	DRAX GROUP PLC	12,800	4.71900	60,403.20	
EMG	MAN GROUP PLC	69,121	3.51000	242,614.71	
ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	13,335	9.44500	125,949.07	
EXPN	EXPERIAN PLC	41,513	5.74000	238,284.62	
FGP	FIRSTGROUP PLC	18,545	4.02600	74,662.17	
FPLN	FRIENDS PROVIDENT GROUP PLC	124,144	0.79800	99,066.91	
GFS	G4S PLC	59,864	2.48300	148,642.31	
GLXO	GLAXOSMITHKLINE PLC	207,396	12.36500	2,564,451.54	
HG	LADBROKES PLC	35,342	1.37400	48,559.90	
HOME	HOME RETAIL GROUP	37,193	3.05600	113,661.80	
HSBA	HSBC HOLDINGS PLC	691,641	6.98600	4,831,804.02	
IAP	ICAP PLC	20,840	4.54500	94,717.80	
IHG	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	9,602	8.11500	77,920.23	
III	3I GROUP PLC	33,579	2.96300	99,494.57	
IMT	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	40,622	18.17000	738,101.74	
INVP	INVESTEC PLC	21,430	4.71500	101,042.45	
JMAT	JOHNSON MATTHEY PLC	8,484	14.92000	126,581.28	
KAZ	KAZAKHMYS PLC	7,345	12.94000	95,044.30	
KGF	KINGFISHER PLC	98,082	2.36300	231,767.76	
LGEN	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	232,476	0.84800	197,139.64	
LLOY	LLOYDS BANKING GROUP PLC	649,536	0.96230	625,048.49	

LMI	LONMIN PLC	5,290	17.11000	90,511.90	
LSE	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	8,878	8.80000	78,126.40	
MKS	MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,120	3.47300	222,688.76	
MRW	WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	76,000	2.72000	206,720.00	
NGG	NATIONAL GRID PLC	97,115	5.87500	570,550.62	
NPW	INTERNATIONAL POWER PLC	61,825	2.59300	160,312.22	
NXT	NEXT PLC	7,872	18.70000	147,206.40	
OML	OLD MUTUAL PLC	213,005	1.12700	240,056.63	
PFC	PETROFAC LTD	8,280	10.27000	85,035.60	
POC	CARNIVAL PLC	6,710	20.82000	139,702.20	
PRU	PRUDENTIAL PLC	99,817	6.33500	632,340.69	
PSON	PEARSON PLC	29,164	8.48000	247,310.72	
RB/	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,450	30.66000	749,637.00	
RBOS	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	683,034	0.47080	321,572.40	
RDSA	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	141,738	19.04000	2,698,691.52	
RDSB	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	107,764	18.52500	1,996,328.10	
REED	REED ELSEVIER PLC	43,666	4.62000	201,736.92	
REX	REXAM PLC	28,945	2.80000	81,046.00	
RIO	RIO TINTO PLC	54,780	30.00500	1,643,673.90	
RR	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	68,855	4.74100	326,441.55	
RRS	RANDGOLD RESOURCES LTD	3,145	44.75000	140,738.75	
RSA	RSA INSURANCE GROUP PLC	116,917	1.30000	151,992.10	
SAB	SABMILLER PLC	37,376	16.47000	615,582.72	
SBRY	J SAINSBURY PLC	49,036	3.38900	166,183.00	
SDR	SCHRODERS PLC	4,981	11.87000	59,124.47	
SGL	SAGE GROUP PLC	63,105	2.29600	144,889.08	
SHP	SHIRE PLC	23,470	10.35000	242,914.50	
SL/	STANDARD LIFE PLC	87,275	2.30300	200,994.32	
SMIN	SMITHS GROUP PLC	15,713	9.25500	145,423.81	
SMU	SMITH & NEPHEW PLC	37,036	5.40500	200,179.58	
SRP	SERCO GROUP PLC	19,635	5.21000	102,298.35	
SSE	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY PLC	35,777	10.74000	384,244.98	
STAN	STANDARD CHARTERED PLC	77,195	16.05000	1,238,979.75	
SVT	SEVERN TRENT PLC	9,513	9.58000	91,134.54	
TCG	THOMAS COOK GROUP PLC	15,475	2.21800	34,323.55	
TLW	TULLOW OIL PLC	30,375	12.61000	383,028.75	
TOMK	TOMKINS PLC	49,174	1.76000	86,546.24	
TSCO	TESCO PLC	314,369	3.89700	1,225,095.99	
TT	TUI TRAVEL PLC	22,990	2.44400	56,187.56	
ULVR	UNILEVER PLC	51,307	18.66000	957,388.62	
UU	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	4.39300	117,446.85	
VED	VEDANTA RESOURCES PLC	6,350	23.58000	149,733.00	
VOD	VODAFONE GROUP PLC	2,097,815	1.37500	2,884,495.62	
WOS	WOLSELEY PLC	6,410	14.45000	92,624.50	
WPP	WPP PLC	46,799	5.56000	260,202.44	
WTB	WHITBREAD PLC	9,490	12.91000	122,515.90	
XTA	XSTRATA PLC	77,605	10.12000	785,362.60	
イギリスボンド 計		10,606,076		51,598,285.24	
(邦貨換算額)				(7,724,779,283)	

外国株式(スイスフラン)

(単位:株、スイスフラン)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ABBN	ABB LTD	87,955	21.54000	1,894,550.70	
ADEN	ADECCO SA-REG	4,757	50.85000	241,893.45	
ARYN	ARYZTA AG	4,245	39.70000	168,526.50	
ATLN	ACTELION LTD	4,185	58.50000	244,822.50	
BAER	GAM HOLDING LTD	8,125	13.29000	107,981.25	
BAERGRP	JULIUS BAER GROUP LTD	8,125	42.26000	343,362.50	
BALN	BALOISE HOLDING -R	2,475	93.90000	232,402.50	
BKWN	BKW FMB ENERGIE AG	860	86.95000	74,777.00	
CS	CREDIT SUISSE GROUP AG	44,990	56.75000	2,553,182.50	

GEBN	GEBERIT AG-REG	1,885	161.70000	304,804.50	
GIVN	GIVAUDAN-REG	254	755.00000	191,770.00	
HOL	HOLCIM LTD-REG	9,923	70.05000	695,106.15	
KNI	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG	2,115	92.90000	196,483.50	
LISN	LINDT & SPRUENGLI AG-REG.	5	26,740.00000	133,700.00	
LISP	LINDT & SPRUENGLI-PC	30	2,238.00000	67,140.00	
LOGN	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,690	19.18000	185,854.20	
LONN	LONZA GROUP AG-REG	2,025	108.30000	219,307.50	
NESZ	NESTLE SA	145,448	46.46000	6,757,514.08	
NOBE	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	6,530	30.60000	199,818.00	
NOVN	NOVARTIS AG-REG SHS	84,543	52.40000	4,430,053.20	
PARG	PARGESA HOLDING SA-BEARER	1,045	88.95000	92,952.75	
PHBN	SONOVA HOLDING AG	1,940	106.00000	205,640.00	
RAN	SCHWEIZERISCHE LEBENSVERSICHERUNGS-UND RENTENANSTALT/SWISS LIFE-RE	1,535	135.30000	207,685.50	
RIFZ	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG	20,929	30.12000	630,381.48	
ROCZ	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,083	161.10000	4,524,171.30	
RUKZ	SWISS REINSURANCE COMPANY LTD	13,669	47.66000	651,464.54	
SCHP	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,520	71.55000	180,306.00	
SCMZ	SWISSCOM AG-REG	1,004	374.50000	375,998.00	
SGSN	SGS SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDINGS SA	181	1,371.00000	248,151.00	
STMN	STRAUMANN HOLDING AG-REG	491	276.00000	135,516.00	
SYNN	SYNGENTA AG	3,876	253.25000	981,597.00	
SYST	SYNTHES INC	2,409	122.30000	294,620.70	
UBSZ	UBS AG-REGISTERED	142,082	18.41000	2,615,729.62	
UHR	SWATCH GROUP AG-B	1,385	254.00000	351,790.00	
UHRN	SWATCH GROUP AG-REG	2,650	48.90000	129,585.00	
ZURN	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,906	253.25000	1,495,694.50	
スイスフラン 計		657,870		32,364,333.42	
(邦貨換算額)				(2,953,569,068)	

[次へ](#)

外国株式（香港ドル）

（単位：株、香港ドル）

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AP	HANG LUNG PROPERTIES LTD	94,000	31.10000	2,923,400.00	
ASMP	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	58.80000	382,200.00	
BKEA	BANK OF EAST ASIA	60,440	28.55000	1,725,562.00	
BOC	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	142,500	18.22000	2,596,350.00	
CATH	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	39,000	12.74000	496,860.00	
CGK	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	57,682	105.50000	6,085,451.00	
CHES	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	33,000	13.88000	458,040.00	
CHL	CLP HOLDINGS LTD	86,000	52.15000	4,484,900.00	
CKIZ	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	17,000	27.70000	470,900.00	
EPA	ESPRIT HOLDINGS LTD	39,500	54.90000	2,168,550.00	
FOXCON	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	65,000	7.33000	476,450.00	
HAC	HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG	2,000	94.50000	189,000.00	
HCG	HONG KONG & CHINA GAS CO LTD	167,981	19.46000	3,268,910.26	
HEL	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	49,500	41.70000	2,064,150.00	
HKEX	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	42,700	145.40000	6,208,580.00	
HL	HANG LUNG GROUP LIMITED	39,000	42.10000	1,641,900.00	
HNDH	HENDERSON LAND DEVELOPMENT CO LTD	49,426	55.30000	2,733,257.80	
HPWH	HOPEWELL HOLDINGS	29,000	25.30000	733,700.00	
HSGH	HANG SENG BANK LTD	30,300	111.20000	3,369,360.00	
HTW	HUTCHISON WHAMPOA LTD	82,823	57.95000	4,799,592.85	
HWD	NEW WORLD DEVELOPMENT CO LTD	104,000	18.14000	1,886,560.00	
HYS	HYSAN DEVELOPMENT CO LTD	22,000	24.05000	529,100.00	
KERP	KERRY PROPERTIES LTD	27,950	45.70000	1,277,315.00	
LIFE	LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	26,500	13.10000	347,150.00	
LIFU	LI & FUNG LTD	98,000	33.95000	3,327,100.00	
MTRC	MTR CORP	58,000	28.35000	1,644,300.00	
NWC	MONGOLIA ENERGY CO LTD	116,000	3.28000	380,480.00	
ORIO	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	13,500	41.05000	554,175.00	
PAP	NWS HOLDINGS LTD	27,000	14.90000	402,300.00	
SHGH	SHANGRI-LA ASIA LTD.	52,000	15.66000	814,320.00	
SHK	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	56,480	122.30000	6,907,504.00	
SINO	SINO LAND CO	71,500	16.40000	1,172,600.00	
SWPA	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	34,017	97.20000	3,306,452.40	
TVB	TELEVISION BROADCASTS LTD	12,000	37.40000	448,800.00	
WHB	WING HANG BANK LIMITED	7,500	78.15000	586,125.00	
WHEL	WHEELOCK&CO LTD	40,000	25.70000	1,028,000.00	
WHH	WHARF HOLDINGS LTD	53,800	42.45000	2,283,810.00	
YYN	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	36,000	21.95000	790,200.00	
香港ドル 計		1,989,599		74,963,405.31	
（邦貨換算額）				(890,565,255)	

外国株式（スウェーデンクローナ）

（単位：株、スウェーデンクローナ）

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ALFA	ALFA LAVAL AB	15,145	88.00000	1,332,760.00	
ASSA	ASSA ABLOY AB-B	12,755	115.50000	1,473,202.50	
ATCOA	ATLAS COPCO AB-A SHS	26,370	95.20000	2,510,424.00	
ATCOB	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,745	84.50000	1,330,452.50	
ELUX	ELECTROLUX AB-SER B	10,295	165.00000	1,698,675.00	
GETIB	GETINGE AB-B SHS	8,670	132.25000	1,146,607.50	
HMB	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	20,434	406.50000	8,306,421.00	
HUSQB	HUSQVARNA AB	11,315	47.00000	531,805.00	
INVEB	INVESTOR AB	18,940	126.75000	2,400,645.00	
LMEB	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON AB-B SHS	118,515	72.00000	8,533,080.00	
LUPE	LUNDIN PETROLEUM AB	8,410	63.40000	533,194.00	

MIC	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA-SDR	3,220	466.50000	1,502,130.00	
MODO	HOLMEN AB-B SHARES	2,005	190.50000	381,952.50	
NBH	NORDEA BANK AB	128,883	74.50000	9,601,783.50	
NCOMB	TELE2 AB -B SHS	12,765	104.10000	1,328,836.50	
SAND	SANDVIK AB	41,040	79.00000	3,242,160.00	
SCAB	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	23,220	98.90000	2,296,458.00	
SCVB	SCANIA AB-B SHS	13,665	96.25000	1,315,256.25	
SEBA	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	63,290	44.60000	2,822,734.00	
SECB	SECURITAS AB-B SHS	14,469	66.90000	967,976.10	
SHBA	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	18,560	192.50000	3,572,800.00	
SKAB	SKANSKA AB-B SHS	14,850	105.40000	1,565,190.00	
SKFB	SKF AB-B SHS	14,784	114.00000	1,685,376.00	
SSABA	SSAB AB-A SHARES	6,295	105.00000	660,975.00	
SSABB	SSAB AB -B SHARES	2,765	96.00000	265,440.00	
SWEDA	SWEDBANK AB	11,850	61.50000	728,775.00	
SWMA	SWEDISH MATCH AB	10,915	146.50000	1,599,047.50	
TLIA	TELIASONERA AB	89,755	47.30000	4,245,411.50	
VOLV	VOLVO AB-B SHS	44,205	69.75000	3,083,298.75	
VOLVA	VOLVO AB-A SHS	23,255	67.75000	1,575,526.25	
スウェーデンクローナ 計		806,385		72,238,393.35	
(邦貨換算額)				(979,552,614)	

外国株式(シンガポールドル)

(単位:株,シンガポールドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
CAPL	CAPITALAND LTD	112,000	4.35000	487,200.00	
CD	COMFORTDELGRO CORP	77,000	1.57000	120,890.00	
COS	COSCO CORP SINGAPORE LIMITED	55,000	1.18000	64,900.00	
CYCM	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,000	25.18000	125,900.00	
CYDM	CITY DEVELOPMENTS LTD	23,000	10.26000	235,980.00	
DBS	DBS GROUP HOLDINGS LTD	68,625	13.00000	892,125.00	
FN	FRASER AND NEAVE LTD	43,000	3.90000	167,700.00	
GIL	GENTING SINGAPORE PLC	111,000	1.11000	123,210.00	
JRSS	SEBACORP MARINE LTD	28,000	3.72000	104,160.00	
KPL	KEPPEL CORP LTD	57,600	8.15000	469,440.00	
NEPS	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	42,000	1.74000	73,080.00	
NOBL	NOBLE GROUP LIMITED	72,200	2.74000	197,828.00	
OCBM	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	106,240	7.63000	810,611.20	
SAL	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,800	14.08000	250,624.00	
SCIL	SEBACORP INDUSTRIES LTD	45,000	3.40000	153,000.00	
SGX	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	8.24000	288,400.00	
SPR	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	3.90000	269,295.00	
STEG	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	64,000	2.90000	185,600.00	
TELE	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	314,810	3.10000	975,911.00	
UOBH	UNITED OVERSEAS BANK LTD	50,300	17.40000	875,220.00	
UTOS	UOL GROUP LIMITED	32,250	3.53000	113,842.50	
WIL	WILMAR INTERNATIONAL LTD	51,000	6.43000	327,930.00	
シンガポールドル 計		1,479,875		7,312,846.70	
(邦貨換算額)				(482,428,497)	

外国株式(ニュージーランドドル)

(単位:株,ニュージーランドドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AIA	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	13,675	2.00000	27,350.00	
CEN	CONTACT ENERGY LTD	4,685	6.28000	29,421.80	
FBU	FLETCHER BUILDING LTD	17,570	8.42000	147,939.40	
SKC	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.39000	67,766.10	
TEL	TELECOM CORPORATION OF NEW ZEALAND LIMITED	60,962	2.50000	152,405.00	

ニュージーランドドル 計	116,882		424,882.30	
(邦貨換算額)			(29,503,827)	

外国株式(デンマーククローネ)

(単位:株,デンマーククローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
BRYB	CARLSBERG AS-B	4,385	367.00000	1,609,295.00	
CPLCB	COLOPLAST A/S	1,041	427.00000	444,507.00	
DANS	DANSKE BANK A/S	16,535	129.50000	2,141,282.50	
DSAC	A P MOLLER MAERSK A/S-B	46	38,300.00000	1,761,800.00	
DSVB	DSV DE SAMMENSLUT VOGN	7,370	88.00000	648,560.00	
MAERSKA	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	28	37,200.00000	1,041,600.00	
NOVO	NOVO NORDISK A/S-B	17,895	322.00000	5,762,190.00	
NZYMB	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,440	453.00000	652,320.00	
TDP	TOPDANMARK A/S	655	770.00000	504,350.00	
TRYG	TRYGVESTA AS	1,045	381.50000	398,667.50	
VWS	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,755	341.00000	2,644,455.00	
WDH	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	378.00000	378,000.00	
デンマーククローネ 計		59,195		17,987,027.00	
(邦貨換算額)				(333,659,351)	

外国株式(ノルウェークローネ)

(単位:株,ノルウェークローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
DNBNOR	DNB NOR ASA	31,955	67.90000	2,169,744.50	
NHY	NORSK HYDRO ASA	24,150	41.90000	1,011,885.00	
ORK	ORKLA ASA	28,895	54.65000	1,579,111.75	
REC	RENEWABLE ENERGY CORP AS	13,750	41.75000	574,062.50	
SDRL	SEADRILL LTD	11,455	126.60000	1,450,203.00	
STL	STATOILHYDRO ASA	44,909	138.60000	6,224,387.40	
TEL	TELENOR ASA	37,285	71.30000	2,658,420.50	
YAR	YARA INTERNATIONAL ASA	7,565	197.00000	1,490,305.00	
ノルウェークローネ 計		199,964		17,158,119.65	
(邦貨換算額)				(284,310,043)	

外国株式(ユーロ)

(単位:株,ユーロ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AC	ACCOR SA	6,096	34.31000	209,153.76	
ACA	CREDIT AGRICOLE SA	35,922	14.67000	526,975.74	
ACRX	ACERINOX SA	5,862	14.32000	83,943.84	
ACS	ACS ACTIVIDADES CONSTRUCTION Y SERVICIOS SA	5,101	34.35000	175,219.35	
ACSA	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	11,383	15.65000	178,143.95	
ACUM	UMICORE	5,885	21.94500	129,146.32	
ADP	AEROPORTS DE PARIS	1,175	54.94000	64,554.50	
ADS	ADIDAS AG	8,191	34.70000	284,227.70	
AEGO	AEGON NV	59,769	5.74200	343,193.59	
AEM	A2A SPA	50,790	1.32200	67,144.38	
AGL	AUTOGRILL SPA	4,025	8.52500	34,313.12	
AHLN	KONINKLIJKE AHOLD NV	49,779	8.56500	426,357.13	
AI	AIR LIQUIDE	9,912	77.12000	764,413.44	
AIRF	AIR FRANCE-KLM	5,240	11.30500	59,238.20	
AKZO	AKZO NOBEL NV	9,923	44.17500	438,348.52	
ALO	ALSTOM SA	7,565	49.11500	371,554.97	
ALPHA	ALPHA BANK A.E.	15,998	14.20000	227,171.60	
ALV	ALLIANZ SE-REG	18,108	83.70000	1,515,639.60	
ARR	SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-RHIN-RHONE	850	50.40000	42,840.00	
ASML	ASML HOLDING NV	17,862	20.00500	357,329.31	
AUTO	ATLANTIA SPA	9,919	16.96000	168,226.24	

BAK	BANKINTER SA	11,065	7.62000	84,315.30	
BASF	BASF SE	36,900	39.16000	1,445,004.00	
BAYE	BAYER AG	30,555	47.68000	1,456,862.40	
BBV	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	142,333	12.50000	1,779,162.50	
BCP	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	75,702	1.03300	78,200.16	
BCSA	BANCO SANTANDER SA	326,021	11.40000	3,716,639.40	
BEI	BEIERSDORF AG	2,825	42.37000	119,695.25	
BELG	BELGACOM SA	7,190	27.25500	195,963.45	
BESNN	BANCO ESPIRITO SANTO SA	10,630	5.17000	54,957.10	
BI	INTESA SANPAOLO SPA	307,888	3.04500	937,518.96	
BICP	SOCIETE BIC SA	1,640	48.17000	78,998.80	
BINR	INTESA SANPAOLO SPA	51,105	2.33000	119,074.65	
BMPS	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	68,245	1.41400	96,498.43	
BMW	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,945	35.94000	501,183.30	
BMW3	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG-PFD	2,005	24.79000	49,703.95	
BNP	BNP PARIBAS SA	36,737	56.25000	2,066,456.25	
BOC	BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	22,840	5.94000	135,669.60	
BOUY	BOUYGUES SA	8,105	35.30000	286,106.50	
BP	BANCO POPOLARE SPA	25,264	6.64000	167,752.96	
BPE	BANCO POPULAR ESPANOL SA	28,510	6.50000	185,315.00	
BPM	BANCA POPOLARE DI MILANO SCRL	16,037	5.52000	88,524.24	
BPU	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	20,424	10.32000	210,775.68	
BRISA	BRISA-PRIV SHR	9,145	6.96200	63,667.49	
BSN	DANONE	21,984	41.25000	906,840.00	
BVA	BANCO DE VALENCIA SA	9,305	6.12000	56,946.60	
BVI	BUREAU VERITAS SA	2,000	38.60500	77,210.00	
CAP	CAP GEMINI SA	5,469	33.69500	184,277.95	
CAR	CARREFOUR SA	25,358	30.15500	764,670.49	
CCB	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING COMPANY SA	9,103	18.40000	167,495.20	
CGE	ALCATEL LUCENT	96,574	3.06400	295,902.73	
CIMP	CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL SGPS SA	10,985	5.53000	60,747.05	
CIN	CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS DE TRANSPORTE SA	7,985	7.92500	63,281.12	
CNPP	CNP ASSURANCES	1,395	72.05000	100,509.75	
CO	CASINO GUICHARD- PERRACHON SA	1,819	55.50000	100,954.50	
COLR	COLRUYT NV	597	157.60000	94,087.20	
COM	COMMERZBANK AG	27,978	8.14000	227,740.92	
CRDI	UNICREDIT SPA	576,161	2.48500	1,431,760.08	
CRG	BANCA CARIGE SPA	28,825	2.00750	57,866.18	
CRH	CRH PLC	27,765	18.87000	523,925.55	
CRIS	CRITERIA CAIXACORP SA	36,705	3.43500	126,081.67	
CTG	GAS NATURAL SDG SA	7,130	13.85500	98,786.15	
CUBE	ACCIONA S.A.	1,146	88.70000	101,650.20	
DAST	DASSAULT SYSTEMES SA	3,320	37.99500	126,143.40	
DB1	DEUTSCHE BOERSE AG	7,794	59.84000	466,392.96	
DBK	DEUTSCHE BANK AG -REG	23,560	52.90500	1,246,441.80	
DCXG	DAIMLER AG-REG	36,052	36.87500	1,329,417.50	
DECX	JC DECAUX S.A.	2,520	14.46500	36,451.80	
DELB	DELHAIZE GROUP	4,201	47.48000	199,463.48	
DESC	ERSTE GROUP BANK AG	8,263	29.86000	246,733.18	
DEX	DEXIA	19,999	6.65000	132,993.35	
DG	VINCI S.A.	17,740	37.89000	672,168.60	
DPB	DEUTSCHE POSTBANK AG	5,060	25.37000	128,372.20	
DPW	DEUTSCHE POST AG-REG	33,823	12.38500	418,897.85	
DSMN	KONINKLIJKE DSM NV	5,112	31.93000	163,226.16	
DTEG	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	113,321	9.56500	1,083,915.36	
EAD	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE CO	13,738	13.95000	191,645.10	
EDF	ELECTRICITE DE FRANCE	9,490	39.41000	374,000.90	
EDPP	ENERGIAS DE PORTUGAL, S.A.	64,696	3.05700	197,775.67	
EDPR	EDP RENOVAVEIS SA	11,970	6.81200	81,539.64	
ELIAV	ELISA CORP-A SHARES	7,450	14.72000	109,664.00	

ELN	ELAN CORPORATION PLC	10,000	3.42000	34,200.00
ELSN	REED ELSEVIER NV	25,748	7.75100	199,572.74
ENEL	ENEL SPA	263,129	4.18500	1,101,194.86
ENG	ENAGAS	7,585	13.86500	105,166.02
ENI	ENI SPA	104,076	17.73000	1,845,267.48
ERCK	MERCK KGAA	2,325	69.50000	161,587.50
ERMT	ERAMET	190	258.75000	49,162.50
ESSI	ESSILOR INTERNATIONAL SA	7,335	38.65000	283,497.75
ETE	NATIONAL BANK OF GREECE SA	24,263	26.42000	641,028.46
ETL	EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,400	21.44000	94,336.00
EURB	EFG EUROBANK ERGASIAS	14,653	12.00000	175,836.00
EX	VIVENDI SA	46,777	19.62000	917,764.74
EXHO	SODEXO	3,690	40.36500	148,946.85
EXO	EXOR SPA	3,969	14.70000	58,344.30
FCC	FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS SA-FCC	1,465	29.86000	43,744.90
FER	GRUPO FERROVIAL SA	2,515	32.24000	81,083.60
FGR	EIFFAGE SA	1,525	40.25000	61,381.25
FIA	FIAT SPA	26,775	11.04000	295,596.00
FME	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	7,203	32.28000	232,512.84
FOR/CRTS	FORTIS -RTS COUPON 42	69,259	0.00000	0.00
FORB	FORTIS	69,259	3.18400	220,520.65
FQDA	CHRISTIAN DIOR SA	1,835	68.89000	126,413.15
FRA	FRAPORT AG	1,350	34.99000	47,236.50
FRE	FRESENIUS SE-PRF	3,785	40.05000	151,589.25
FSA	FONDIARIA-SAI SPA	3,030	13.75000	41,662.50
FTE	FRANCE TELECOM SA	73,154	17.77000	1,299,946.58
FUGR	FUGRO NV	2,640	40.85500	107,857.20
FUM1V	FORTUM OYJ	19,525	16.75000	327,043.75
G1A	GEA GROUP AG	7,415	14.47000	107,295.05
GA	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITAS	7,340	15.64500	114,834.30
GALP	GALP ENERGIA SGPS SA	8,465	12.19000	103,188.35
GAM	GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA S.A.	7,555	12.75000	96,326.25
GASI	ASSICURAZIONI GENERALI	49,313	18.53000	913,769.89
GAZ	GDF SUEZ	48,229	29.53000	1,424,202.37
GBL	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,127	65.36000	204,380.72
GEHG	CELESIO AG	3,845	17.52000	67,364.40
GLEDSR	SOCIETE GENERALE-RTS	18,573	2.98000	55,347.54
GRF	GRIFOLS SA	5,210	11.30500	58,899.05
HEI	HEIDELBERGCEMENT AG	5,600	45.25000	253,400.00
HEIN	HEINEKEN NV	10,228	29.75500	304,334.14
HEIO	HEINEKEN HOLDING NV	3,380	27.50500	92,966.90
HEN	HENKEL AG & CO KGAA	6,968	31.25000	217,750.00
HEN1	HENKEL KGAA	5,425	27.04000	146,692.00
HNRG	HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	2,455	33.31000	81,776.05
HNSY	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	9,794	72.00000	705,168.00
HO	THALES SA	3,110	33.87000	105,335.70
HOC	HOCHTIEF AG	1,610	56.84000	91,512.40
HTO	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	11,930	12.60000	150,318.00
IBER	IBERDROLA SA	146,975	6.27000	921,533.25
IBLA	IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPANA SA	31,085	2.12600	66,086.71
IBR	IBERDROLA RENOVABLES	27,425	3.11000	85,291.75
IDR	INDRA SISTEMAS SA	4,864	16.37000	79,623.68
IFXG	INFINEON TECHNOLOGIES AG	43,260	3.47500	150,328.50
IHC	SBM OFFSHORE NV	7,810	14.17000	110,667.70
ING	ING GROEP NV-CVA	81,310	11.66000	948,074.60
INTB	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	28,826	33.81500	974,751.19
ITAI	ITALCEMENTI SPA	1,930	10.73000	20,708.90
ITX	INDITEX	7,990	39.48000	315,445.20
KBC	KBC GROUP	5,244	34.10000	178,820.40
KESBV	KESKO OYJ-B SHS	2,910	22.99000	66,900.90
KN	NATIXIS	15,000	4.49900	67,485.00

KONBS	KONE OYJ	6,032	26.75000	161,356.00
KPN	KONINKLIJKE KPN NV	68,531	11.99000	821,686.69
KSZ	K+S AG	6,245	41.00000	256,045.00
KYGA	KERRY GROUP PLC-A	6,445	20.00000	128,900.00
LAFI	LAFARGE SA	7,668	61.70000	473,115.60
LEGP	LEGRAND S.A.	4,050	19.86000	80,433.00
LHA	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,250	11.60000	107,300.00
LIN	LINDE AG	5,710	74.91000	427,736.10
LTO	LOTTOMATICA SPA	2,425	15.15000	36,738.75
LUX	LUXOTTICA GROUP SPA	4,621	17.23000	79,619.83
MAN	MAN SE	4,549	58.85000	267,708.65
MAP	MAPFRE SA	26,725	3.32100	88,753.72
MB	MEDIOBANCA SPA	21,420	9.01000	192,994.20
MCNB	MICHELIN (CGDE)-B	5,969	54.63000	326,086.47
MED	MEDIOLANUM SPA	8,725	4.61750	40,287.68
MEOG	METRO AG	5,035	39.28000	197,774.80
MIDI	AXA	62,637	18.44000	1,155,026.28
MIG	MARFIN INVESTMENT GROUP SA	25,330	3.01000	76,243.30
MMBP	LAGARDERE S.C.A.	5,040	33.65500	169,621.20
MMT	M6-METROPOLE TELEVISION	4,205	17.38000	73,082.90
MOBB	MOBISTAR SA	1,539	46.52500	71,601.97
MS	MEDIASET SPA	22,451	4.74250	106,473.86
MT	ARCELORMITTAL	34,316	25.48000	874,371.68
MUVG	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,251	110.54000	912,065.54
NAT	NATIONALE A PORTEFEUILLE	1,545	37.96000	58,648.20
NEO	NEOPOST SA	1,632	60.90000	99,388.80
NEST	NESTE OIL OYJ	6,515	12.89000	83,978.35
NK	IMERYS SA	2,170	38.90000	84,413.00
NOKS	NOKIA OYJ	151,941	8.80000	1,337,080.80
NOR1V	NOKIAN RENKAAT OYJ	6,545	16.50000	107,992.50
OEEW	OESTERREICHISCHE ELEKTRIZITAETSWIRTSCHAFTS AG-A	2,370	32.79000	77,712.30
OKOAS	POHJOLA BANK PLC	8,995	7.91000	71,150.45
OMV	OMV AG	6,775	29.26000	198,236.50
OPAP	OPAP SA	7,845	18.15000	142,386.75
ORL	L'OREAL SA	9,956	69.15000	688,457.40
ORNBV	ORION OYJ	4,485	12.53000	56,197.05
OUTO	OUTOKUMPU OYJ	4,060	12.31000	49,978.60
PAJ	PAGESJAUNES GROUPE SA	4,850	8.77900	42,578.15
PC	PIRELLI&C.	136,655	0.40800	55,755.24
PERP	PERNOD-RICARD SA	7,997	55.72000	445,592.84
PHG	PHILIPS ELECTRONICS NV	40,481	18.07000	731,491.67
PLT	PARMALAT SPA	72,660	1.90100	138,126.66
POR	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	3,555	56.05000	199,257.75
PPC	PUBLIC POWER CORP	3,916	14.70000	57,565.20
PRE	TUI AG	8,370	5.87500	49,173.75
PRTP	PPR	3,037	79.76000	242,231.12
PRYS	PRYSMIAN SPA	6,680	12.79000	85,437.20
PSAF	PEUGEOT SA	7,062	23.90000	168,781.80
PTCO	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	28,203	7.87500	222,098.62
PUB	PUBLICIS GROUPE	5,530	27.80500	153,761.65
PUM	PUMA AG	296	215.10000	63,669.60
QGEN	QIAGEN N.V.	7,635	14.32000	109,333.20
REE	RED ELECTRICA CORP SA	4,400	35.90000	157,960.00
RENA	RENAULT SA	6,632	35.04500	232,418.44
RF	EURAZEO	1,804	47.72000	86,086.88
RIBH	RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK HOLDING AG	1,930	45.20000	87,236.00
RMS	HERMES INTERNATIONAL	2,159	98.01000	211,603.59
RPSL	REPSOL YPF SA	28,426	18.64000	529,860.64
RSTD	RANDSTAD HOLDING N.V.	4,040	28.38500	114,675.40
RTRKS	RAUTARUUKKI OYJ	3,645	15.66000	57,080.70
RWE	RWE AG	16,740	61.32000	1,026,496.80

RWEP	RWE AG-NON VTG PFD	2,070	56.18000	116,292.60	
RYA	RYANAIR HOLDINGS PLC	16,845	3.22000	54,240.90	
SAB	BANCO DE SABADELL SA	36,695	4.82000	176,869.90	
SAG	SAFRAN SA	7,770	11.83500	91,957.95	
SAMAS	SAMPO OYJ-A SHS	17,564	17.16000	301,398.24	
SAP	SAP AG	34,302	34.44000	1,181,360.88	
SCG	SOCIETE GENERALE-A	18,573	48.24500	896,054.38	
SCHN	SCHNEIDER ELECTRIC SA	9,364	72.80000	681,699.20	
SCR	SCOR SE	7,142	17.67000	126,199.14	
SEGN	ATOS ORIGIN	3,065	34.86500	106,861.22	
SESF	SES GROBAL-FDR	12,005	15.99000	191,959.95	
SEV	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	11,434	15.71500	179,685.31	
SIF	FINMECCANICA SPA	13,850	12.15000	168,277.50	
SM	SIEMENS AG-REG	32,891	65.55000	2,156,005.05	
SNAM	SNAM RETE GAS SPA	52,290	3.20250	167,458.72	
SOFP	SANOFI-AVENTIS SA	42,071	52.03000	2,188,954.13	
SOLV	SOLVAY SA	2,016	70.34000	141,805.44	
SPM	SAIPEM	11,025	22.05000	243,101.25	
STER	STORA ENSO OYJ-R SHS	17,665	5.40000	95,391.00	
STGO	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	15,016	36.41000	546,732.56	
STM	STMICROELECTRONICS NV	31,453	5.92000	186,201.76	
SWS1V	SANOMA OYJ	3,275	13.61000	44,572.75	
SWV	SOLARWORLD AG	4,785	15.40000	73,689.00	
SZG	SALZGITTER AG	1,610	67.18000	108,159.80	
TECF	TECHNIP S.A.	4,043	48.65000	196,691.95	
TEN	TENARIS SA	19,310	13.22000	255,278.20	
TFFP	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	7,655	11.28000	86,348.40	
TITI	TELECOM ITALIA SPA	415,613	1.16000	482,111.08	
TITR	TELECOM ITALIA RNC	252,797	0.83050	209,947.90	
TKA	THYSSENKRUPP AG	13,130	24.40000	320,372.00	
TKAV	TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	11.95000	167,539.00	
TL5	GESTEVISION TELECINCO SA	6,845	7.63500	52,261.57	
TNE	TELEFONICA S.A.	169,273	19.05000	3,224,650.65	
TOL	TOTAL SA	85,332	42.33000	3,612,103.56	
TP	TNT NV	13,270	18.69500	248,082.65	
TPEI	BANK OF PIRAEUS	13,598	12.72000	172,966.56	
TRN	TERNA SPA	53,152	2.68000	142,447.36	
TTNR	TITAN CEMENT CO. S.A.	2,075	24.00000	49,800.00	
UCB	UCB SA	4,063	30.37500	123,413.62	
UNI1	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA	29,785	1.06600	31,750.81	
UNL	UNILEVER NV-CVA	65,120	20.84500	1,357,426.40	
UPM1	UPM-KYMMENE OYJ	19,943	8.31000	165,726.33	
VALH	SACYR VALLEHERMOSO SA	4,705	11.57000	54,436.85	
VAST	VOESTALPINE AG	4,649	25.50000	118,549.50	
VEB	E.ON AG	75,989	26.95000	2,047,903.55	
VIE	VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,954	22.86500	341,923.21	
VK	VALLUREC	2,135	116.05000	247,766.75	
VLMT	METSO OYJ	5,480	19.14000	104,887.20	
VOW	VOLKSWAGEN AG	3,536	115.00000	406,640.00	
VOWG	VOLKSWAGEN AG PFD	3,770	73.34000	276,491.80	
WCH	WACKER CHEMIE AG	580	106.99000	62,054.20	
WLSN	WOLTERS KLUWER NV	9,117	15.46500	140,994.40	
WRTBV	WARTSILA OYJ	3,270	26.53000	86,753.10	
WST	VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	42.19000	59,487.90	
ZRDY	ZARDOYA OTIS SA	4,971	14.12000	70,190.52	
ユーロ計		7,013,592		91,755,071.65	
(邦貨換算額)				(12,668,622,743)	

(単位：円)

総合計			(69,620,560,066)	
			69,620,560,066	

(注) 総合計の()内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

(2) 株式以外の有価証券

(外国投資証券)

外国投資証券（アメリカドル）

（単位：アメリカドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
00163T10	AMB PROPERTY CORPORATION	7,440	172,608.00
05348410	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,575	261,475.50
10112110	BOSTON PROPERTIES INC	5,282	330,970.12
26441150	DUKE REALTY CORPORATION	12,420	148,170.60
29476L10	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,170	323,594.90
31374720	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,435	144,152.00
42191510	HCP INC	10,850	325,066.00
42217K10	HEALTH CARE REIT INC	4,910	218,445.90
44107P10	HOST HOTELS & RESORTS INC	20,198	213,492.86
49446R10	KIMCO REALTY CORPORATION	10,375	141,722.50
53117210	LIBERTY PROPERTY TRUST	5,398	165,826.56
72925110	PLUM CREEK TIMBER CO	7,618	252,231.98
74341010	PROLOGIS	17,681	221,542.93
74460D10	PUBLIC STORAGE	4,609	344,522.75
75490710	RAYONIER INC	3,230	138,437.80
75884910	REGENCY CENTERS CORPORATION	2,910	104,905.50
82880610	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	11,444	787,804.96
92276F10	VENTAS INC	6,200	248,434.00
92904210	VORNADO REALTY TRUST	5,726	347,911.76
アメリカドル 計		153,471	4,891,316.62
(邦貨換算額)			(450,245,695)

外国投資証券（カナダドル）

（単位：カナダドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
AET-U	ARC ENERGY TRUST	5,470	115,471.70
COS-U	CANADIAN OIL SANDS TRUST	10,095	319,809.60
ERF-U	ENERPLUS RESOURCES FUND	7,630	192,428.60
PVE-U	PROVIDENT ENERGY TRUST	16,895	115,561.80
PWT-U	PENN WEST ENERGY TRUST	15,498	287,642.88
REI-U	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	93,975.00
YLO-U	YELLOW PAGES INCOME FUND	7,750	44,175.00
カナダドル 計		68,588	1,169,064.58
(邦貨換算額)			(102,187,935)

外国投資証券（オーストラリアドル）

（単位：オーストラリアドル）

銘柄	券面総額	評価額	備考
DRT	DEXUS PROPERTY GROUP	144,615	120,030.45
GAN	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	77,145	160,461.60
MGR	MIRVAC GROUP	137,930	224,136.25
SGP	STOCKLAND	71,210	287,688.40
WDC	WESTFIELD GROUP	80,625	1,061,831.25
オーストラリアドル 計		511,525	1,854,147.95
(邦貨換算額)			(157,454,244)

外国投資証券（イギリスポンド）

（単位：イギリスポンド）

銘柄	券面総額	評価額	備考
BLND	BRITISH LAND COMPANY PLC	37,816	182,310.93
HMSO	HAMMERSON PLC	28,610	120,905.86
LAND	LAND SECURITIES GROUP PLC	31,634	211,631.46
LII	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	23,320	116,133.60
SLOU	SEGRO PLC	30,873	115,897.24
イギリスポンド 計		152,253	746,879.09
(邦貨換算額)			(111,815,269)

外国投資証券(香港ドル)

(単位:香港ドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
LINK	LINK REIT	94,500	1,687,770.00	
香港ドル計		94,500	1,687,770.00	
(邦貨換算額)			(20,050,708)	

外国投資証券(シンガポールドル)

(単位:シンガポールドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
CT	CAPITAMALL TRUST	120,800	211,400.00	
シンガポールドル計		120,800	211,400.00	
(邦貨換算額)			(13,946,058)	

外国投資証券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

銘柄		券面総額	評価額	備考
CORA	CORIO NV	2,210	104,024.70	
EMGP	ICADE	1,215	89,351.10	
GFC	GECINA SA	560	42,761.60	
LI	KLEPIERRE	3,895	116,168.37	
UL	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,255	490,854.00	
ユーロ計		11,135	843,159.77	
(邦貨換算額)			(116,415,069)	

(単位:円)

総合計			(972,114,978)	
			972,114,978	

(注1) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(外国新株予約権証券)

ユーロ

(単位:ユーロ)

銘柄		券面総額	評価額	備考
MBW	MEDIOBANCA SPA-CW11 WARRANT	20,400	20.40	
ユーロ計		20,400	20.40	
(邦貨換算額)			(2,817)	

(単位:円)

総合計			(2,817)	
			2,817	

(注1) 総合計の()内の金額は外国新株予約権証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 外国新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率(%)	組入投資証券時価比率(%)	組入新株予約権証券時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	株式 570銘柄	98.8	-	-	52.1
アメリカドル	投資証券 19銘柄	-	1.2	-	0.6
カナダドル	株式 84銘柄	97.2	-	-	5.1
カナダドル	投資証券 7銘柄	-	2.8	-	0.1
オーストラリアドル	株式 62銘柄	95.0	-	-	4.2
オーストラリアドル	投資証券 5銘柄	-	5.0	-	0.2
イギリスポンド	株式 99銘柄	98.6	-	-	10.9
イギリスポンド	投資証券 5銘柄	-	1.4	-	0.2
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0	-	-	4.2
香港ドル	株式 38銘柄	97.8	-	-	1.3
香港ドル	投資証券 1銘柄	-	2.2	-	0.0
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0	-	-	1.4
シンガポールドル	株式 22銘柄	97.2	-	-	0.7
シンガポールドル	投資証券 1銘柄	-	2.8	-	0.0
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0	-	-	0.0
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0	-	-	0.5

ノルウェークローネ	株式 8銘柄	100.0	-	-	0.4
ユーロ	株式 258銘柄	99.1	-	-	17.9
ユーロ	新株予約権証券 1銘柄	-	-	0.0	0.0
ユーロ	投資証券 5銘柄	-	0.9	-	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。

[次へ](#)

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		2,238,413	3,386,338
コール・ローン		206,902,415	30,822,276
株式		782,566,539	1,089,074,181
新株予約権証券		-	79
投資証券		10,546,426	12,863,763
派生商品評価勘定		105,245,866	3,773,391
未収入金		3,263,939	180,181
未収配当金		3,387,655	1,030,234
差入委託証拠金		96,643,525	17,676,051
流動資産合計		1,210,794,778	1,158,806,494
資産合計		1,210,794,778	1,158,806,494
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		54,994,420	36,475,784
未払金		-	98,758
未払解約金		26,978,786	1,056,257
流動負債合計		81,973,206	37,630,799
負債合計		81,973,206	37,630,799
純資産の部			
元本等			
元本		2,111,169,382	1,614,863,595
剰余金			
剰余金又は欠損金()		982,347,810	493,687,900
元本等合計		1,128,821,572	1,121,175,695
純資産合計		1,128,821,572	1,121,175,695
負債純資産合計		1,210,794,778	1,158,806,494

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2)為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(1)デリバティブ取引 同左</p> <p>(2)為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成20年10月27日現在		平成21年10月26日現在		
1.	期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成19年10月27日 5,333,418,532 円 4,657,719,743 円 7,879,968,893 円	1. 期首 期首元本額 期首からの追加設定元本額 期首からの解約元本額	平成20年10月28日 2,111,169,382 円 720,307,858 円 1,216,613,645 円
	平成20年10月27日現在の元本の内訳		平成21年10月26日現在の元本の内訳	
	インデックスファンド海外 株式ヘッジあり(DC専用)	25,222,573 円	インデックスファンド海外 株式ヘッジあり(DC専用)	34,028,818 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式80)	32,148,174 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式80)	32,553,964 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式60)	30,574,173 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式60)	28,677,076 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式40)	56,634,119 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式40)	49,627,650 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式20)	82,682,762 円	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式20)	64,108,543 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)	523,990,913 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)	317,515,437 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)	565,642,036 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)	219,423,692 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式20)	51,918,458 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式20)	51,386,052 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式40)	139,279,817 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式40)	134,557,152 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式60)	173,419,822 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式60)	174,261,269 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式80)	166,451,448 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式80)	185,127,119 円
	年金積立 インデックスファ ンド海外株式(ヘッジあ り)	263,205,087 円	年金積立 インデックスファ ンド海外株式(ヘッジあ り)	323,596,823 円
	(合計)	2,111,169,382 円	(合計)	1,614,863,595 円
2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	2,111,169,382 口	2. 本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	1,614,863,595 口
3.	元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は982,347,810円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は493,687,900円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	782,566,539	515,302,986
投資証券	10,546,426	7,935,758
合計	793,112,965	523,238,744

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,089,074,181	222,303,130
新株予約権証券	79	2,601
投資証券	12,863,763	1,173,611
合計	1,101,938,023	223,474,140

（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報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	337,996,376	-	283,038,762	54,957,614
		合計	337,996,376	-	283,038,762

(単位:円)

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	16,353,820	-	16,725,239	371,419
		合計	16,353,820	-	16,725,239

(注)時価の算定方法

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

(通貨関連)

(単位:円)

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	961,090,860	-	855,855,600	105,235,260
	アメリカドル	522,876,420	-	493,398,140	29,478,280
	カナダドル	48,013,098	-	36,117,800	11,895,298
	オーストラリアドル	34,717,870	-	24,324,950	10,392,920
	イギリスポンド	102,734,249	-	84,829,070	17,905,179
	スイスフラン	42,682,051	-	35,706,710	6,975,341
	香港ドル	8,680,199	-	7,866,420	813,779
	スウェーデンクローナ	10,164,708	-	7,218,690	2,946,018
	シンガポールドル	4,593,411	-	4,057,140	536,271
	デンマーククローネ	3,921,299	-	3,056,920	864,379
	ノルウェークローネ	4,308,070	-	3,156,310	1,151,760
	ユーロ	178,399,485	-	156,123,450	22,276,035
	買建	11,907,200	-	11,881,000	26,200
	ユーロ	11,907,200	-	11,881,000	26,200
合計	972,998,060	-	867,736,600	105,209,060	

(単位:円)

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,089,957,758	-	1,123,031,570	33,073,812
	アメリカドル	581,713,038	-	593,258,170	11,545,132
	カナダドル	54,143,918	-	55,838,810	1,694,892
	オーストラリアドル	46,348,173	-	49,861,110	3,512,937
	イギリスポンド	117,889,605	-	122,235,180	4,345,575
	スイスフラン	44,911,906	-	46,451,340	1,539,434
	香港ドル	14,445,797	-	14,303,520	142,277
	スウェーデンクローナ	14,067,944	-	14,617,680	549,736
	シンガポールドル	6,554,135	-	6,659,000	104,865
	デンマーククローネ	4,332,365	-	4,446,660	114,295
	ノルウェークローネ	5,654,472	-	6,000,310	345,838
	ユーロ	199,896,405	-	209,359,790	9,463,385
	合計	1,089,957,758	-	1,123,031,570	33,073,812

(注) 時価の算定方法

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

(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20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.5347 円	1口当たり純資産額	0.6943 円
(1万口当たり純資産額)	(5,347 円)	(1万口当たり純資産額)	(6,943 円)

[次へ](#)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

外国株式（アメリカドル）

（単位：株、アメリカドル）

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
00105510	AFLAC INC	345	44.41000	15,321.45	
00130H10	AES CORPORATION	754	14.22000	10,721.88	
00282410	ABBOTT LABORATORIES	961	51.31000	49,308.91	
00493020	ACTIVISION BLIZZARD INC	554	12.20000	6,758.80	
00724F10	ADOBE SYSTEMS INC	423	34.78000	14,711.94	
00811710	AETNA INC	378	26.07000	9,854.46	
00846U10	AGILENT TECHNOLOGIES INC	450	26.20000	11,790.00	
00915810	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	170	81.14000	13,793.80	
01381710	ALCOA INC	769	13.73000	10,558.37	
01736110	ALLEGHENY ENERGY INC	212	26.30000	5,575.60	
01849010	ALLERGAN INC	197	56.73000	11,175.81	
02000210	ALLSTATE CORP	386	31.50000	12,159.00	
02144110	ALTERA CORPORATION	407	20.86000	8,490.02	
02313510	AMAZON.COM INC	215	118.49000	25,475.35	
02355110	HESS CORP	213	58.95000	12,556.35	
02364J10	TIME WARNER INC	742	30.78000	22,838.76	
02553710	AMERICAN ELECTRIC POWER	310	30.81000	9,551.10	
02553E10	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	336	19.03000	6,394.08	
02581610	AMERICAN EXPRESS CO	658	34.58000	22,753.64	
02687410	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	130	38.90000	5,057.00	
02991220	AMERICAN TOWER CORP	371	38.46000	14,268.66	
03073E10	AMERISOURCEBERGEN CORP	322	23.19000	7,467.18	
03076C10	AMERIPRISE FINANCIAL INC	247	37.07000	9,156.29	
03116210	AMGEN INC	633	56.17000	35,555.61	
03251110	ANADARKO PETROLEUM CORP	313	65.34000	20,451.42	
03265410	ANALOG DEVICES INC	448	27.12000	12,149.76	
03674B10	WELLPOINT INC	319	46.03000	14,683.57	
03738910	AON CORP	227	40.50000	9,193.50	
03741110	APACHE CORP	210	99.39000	20,871.90	
03760410	APOLLO GROUP INC-CL A	115	74.03000	8,513.45	
03783310	APPLE INC	557	203.94000	113,594.58	
03822210	APPLIED MATERIALS INC	1,150	12.95000	14,892.50	
03948310	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	452	30.66000	13,858.32	
05276910	AUTODESK INC	308	26.58000	8,186.64	
05301510	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	344	40.37000	13,887.28	
05333210	AUTOZONE INC	41	137.62000	5,642.42	
05430310	AVON PRODUCTS INC	368	34.98000	12,872.64	
05493710	BB&T CORPORATION	425	26.07000	11,079.75	
05592110	BMC SOFTWARE INC	240	37.16000	8,918.40	
05722410	BAKER HUGHES INC	236	45.36000	10,704.96	
06405710	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	749	29.67000	22,222.83	
06605F10	BANK OF AMERICA CORP	5,392	16.22000	87,458.24	
06738310	C.R. BARD INC	95	76.74000	7,290.30	
07181310	BAXTER INTERNATIONAL INC	375	55.08000	20,655.00	
07588710	BECTON DICKINSON & CO	168	67.50000	11,340.00	
07589610	BED BATH & BEYOND INC	250	36.17000	9,042.50	
07785310	VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,766	28.85000	50,949.10	
08442310	W.R. BERKLEY CORPORATION	298	24.99000	7,447.02	
08467020	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	7	3,318.00000	23,226.00	
08651610	BEST BUY CO INC	261	39.17000	10,223.37	
09062X10	BIOGEN IDEC INC	230	43.81000	10,076.30	
09367110	H&R BLOCK INC	388	19.46000	7,550.48	
09702310	BOEING CO	432	49.89000	21,552.48	
10113710	BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,162	8.75000	10,167.50	

11012210	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,240	22.24000	27,577.60	
11132010	BROADCOM CORP-CL A	426	28.50000	12,141.00	
1150G111	ACCENTURE PLC-CL A	443	37.77000	16,732.11	
12189T10	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION	206	79.12000	16,298.72	
12485720	CBS CORP	585	13.04000	7,628.40	
12541W20	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	172	57.24000	9,845.28	
12550910	CIGNA CORP	288	28.50000	8,208.00	
12640810	CSX CORP	246	43.32000	10,656.72	
12665010	CVS CAREMARK CORP	904	37.16000	33,592.64	
14040H10	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	356	40.95000	14,578.20	
14149Y10	CARDINAL HEALTH INC	281	28.66000	8,053.46	
14170T10	CAREFUSION CORP	140	22.63000	3,168.20	
14365810	CARNIVAL CORP	313	32.03000	10,025.39	
14912310	CATERPILLAR INC	377	57.60000	21,715.20	
15102010	CELGENE CORPORATION	324	54.21000	17,564.04	
15670810	CEPHALON INC	65	53.92000	3,504.80	
15688010	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	317	22.82000	7,233.94	
16161A10	JPMORGAN CHASE & CO	2,345	45.23000	106,064.35	
16516710	CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	458	26.73000	12,242.34	
16675110	CHEVRON CORPORATION	1,248	76.68000	95,696.64	
16776010	CME GROUP INC	44	319.96000	14,078.24	
17123210	CHUBB CORP	214	50.64000	10,836.96	
17275R10	CISCO SYSTEMS INC	3,590	24.17000	86,770.30	
17296710	CITIGROUP INC	10,007	4.46000	44,631.22	
18905410	CLOROX COMPANY	131	59.14000	7,747.34	
18975410	COACH INC	304	34.22000	10,402.88	
19121610	COCA-COLA COMPANY	1,296	53.24000	68,999.04	
19244610	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	332	40.52000	13,452.64	
19416210	COLGATE-PALMOLIVE CO	310	77.72000	24,093.20	
20030010	COMCAST CORP-CL A	1,230	15.06000	18,523.80	
20030020	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	414	14.47000	5,990.58	
20034010	COMERICA INC	172	30.79000	5,295.88	
20491210	CA INC	421	21.61000	9,097.81	
20536310	COMPUTER SCIENCES CORP	169	51.78000	8,750.82	
20588710	CONAGRA FOODS INC	386	21.56000	8,322.16	
20854P10	CONSOL ENERGY INC	180	47.42000	8,535.60	
20911110	CONSOLIDATED EDISON INC	220	41.81000	9,198.20	
21036P10	CONSTELLATION BRANDS INC-A	306	16.25000	4,972.50	
21037110	CONSTELLATION ENERGY GROUP INC	295	31.83000	9,389.85	
21664010	CAMERON INTERNATIONAL CORP	236	40.16000	9,477.76	
21666910	COOPER INDUSTRIES PLC	210	40.36000	8,475.60	
21935010	CORNING INC	1,113	15.65000	17,418.45	
22160Q10	COSTCO WHOLESALE CORP	233	57.81000	13,469.73	
22281610	COVANCE INC	83	55.97000	4,645.51	
23102110	CUMMINS INC	215	48.59000	10,446.85	
23585110	DANAHER CORP	130	70.00000	9,100.00	
23918K10	DAVITA INC	150	54.36000	8,154.00	
23975310	TARGET CORP	443	49.03000	21,720.29	
24419910	DEERE & CO	307	48.08000	14,760.56	
24702510	DELL INC	1,158	15.48000	17,925.84	
25179M10	DEVON ENERGY CORPORATION	265	68.22000	18,078.30	
25271C10	DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC	70	105.80000	7,406.00	
25468710	THE WALT DISNEY CO.	1,095	28.89000	31,634.55	
25470910	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	580	15.03000	8,717.40	
25747010	DOMINION RESOURCES INC/VA	420	35.17000	14,771.40	
26000310	DOVER CORP	182	38.66000	7,036.12	
26054310	DOW CHEMICAL COMPANY	685	25.15000	17,227.75	
26138E10	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	260	27.65000	7,189.00	
26353410	E.I. DU PONT DE NEMOURS AND COMPANY	567	33.23000	18,841.41	
26439910	DUKE ENERGY CORP	774	16.10000	12,461.40	

26864810	EMC CORP	1,261	17.49000	22,054.89	
26874010	ENSCO INTERNATIONAL INC	135	50.32000	6,793.20	
27805810	EATON CORP	127	63.10000	8,013.70	
27864210	EBAY INC	720	23.56000	16,963.20	
27876210	DISH NETWORK CORP-A	368	18.07000	6,649.76	
28102010	EDISON INTERNATIONAL	272	32.64000	8,878.08	
28551210	ELECTRONIC ARTS INC	336	19.71000	6,622.56	
29101110	EMERSON ELECTRIC CO	471	39.68000	18,689.28	
29356210	EOG RESOURCES INC	183	89.16000	16,316.28	
29364610	ENERGY CORP	162	79.29000	12,844.98	
29442910	EQUIFAX INC	217	28.90000	6,271.30	
29454910	EQT CORP	181	44.54000	8,061.74	
30161N10	EXELON CORPORATION	413	49.87000	20,596.31	
30213010	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	238	33.08000	7,873.04	
30218210	EXPRESS SCRIPTS INC	171	80.70000	13,799.70	
30231G10	EXXON MOBIL CORPORATION	3,039	73.57000	223,579.23	
30249U10	FMC TECHNOLOGIES INC	149	57.67000	8,592.83	
30257110	FPL GROUP INC	277	52.63000	14,578.51	
31190010	FASTENAL COMPANY	124	37.60000	4,662.40	
31304N10	FEDEX CORP	224	77.10000	17,270.40	
31410H10	MACY'S INC	436	18.87000	8,227.32	
33773810	FISERV INC	184	48.61000	8,944.24	
33793210	FIRSTENERGY CORP	256	45.93000	11,758.08	
34386110	FLUOR CORP	192	49.54000	9,511.68	
34537010	FORD MOTOR CO	2,029	7.63000	15,481.27	
34583810	FOREST LABORATORIES INC	265	27.88000	7,388.20	
34963110	FORTUNE BRANDS INC	147	43.25000	6,357.75	
35461310	FRANKLIN RESOURCES INC	116	112.93000	13,099.88	
35671D85	FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	258	81.35000	20,988.30	
36467W10	GAMESTOP CORP	181	24.77000	4,483.37	
36476010	GAP INC	445	22.02000	9,798.90	
36955010	GENERAL DYNAMICS CORP	165	66.60000	10,989.00	
36960410	GENERAL ELECTRIC COMPANY	6,592	15.20000	100,198.40	
37033410	GENERAL MILLS INC	171	64.95000	11,106.45	
37246010	GENUINE PARTS CO	115	37.47000	4,309.05	
37291710	GENZYME CORP - GENL DIVISION	193	52.24000	10,082.32	
37555810	GILEAD SCIENCES INC	568	43.83000	24,895.44	
38141G10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	299	180.36000	53,927.64	
38259P50	GOOGLE INC-CL A	150	553.69000	83,053.50	
40621610	HALLIBURTON CO	616	30.21000	18,609.36	
41131010	HANSEN NATURAL CORP	113	37.45000	4,231.85	
41282210	HARLEY-DAVIDSON INC	205	27.73000	5,684.65	
41387510	HARRIS CORP	150	39.45000	5,917.50	
42307410	HJ HEINZ CO	113	40.46000	4,571.98	
42823610	HEWLETT-PACKARD CO	1,493	48.56000	72,500.08	
43707610	HOME DEPOT INC	1,053	26.27000	27,662.31	
43850610	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	434	38.26000	16,604.84	
44106010	HOSPIRA INC	179	45.97000	8,228.63	
44368310	HUDSON CITY BANCORP INC	458	13.41000	6,141.78	
44441810	THE DIRECTV GROUP INC	380	26.42000	10,039.60	
44485910	HUMANA INC	181	37.54000	6,794.74	
45091110	ITT CORPORATION	145	54.81000	7,947.45	
45230810	ILLINOIS TOOL WORKS	251	47.78000	11,992.78	
45686610	INGERSOLL-RAND PLC	345	34.81000	12,009.45	
45814010	INTEL CORP	3,487	19.78000	68,972.86	
45865V10	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	67	104.54000	7,004.18	
45920010	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	823	120.36000	99,056.28	
46120210	INTUIT INC	291	29.87000	8,692.17	
46284610	IRON MOUNTAIN INC	291	25.98000	7,560.18	
46981410	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	169	46.92000	7,929.48	
47816010	JOHNSON & JOHNSON	1,715	60.54000	103,826.10	

47836610	JOHNSON CONTROLS INC	415	26.54000	11,014.10	
48203R10	JUNIPER NETWORKS INC	448	27.31000	12,234.88	
48783610	KELLOGG CO	129	50.20000	6,475.80	
49326710	KEYCORP	612	6.48000	3,965.76	
49436810	KIMBERLY-CLARK CORP	216	61.57000	13,299.12	
50025510	KOHL'S CORP	234	59.19000	13,850.46	
50075N10	KRAFT FOODS INC-A	913	27.05000	24,696.65	
50104410	KROGER CO	226	23.70000	5,356.20	
50242410	L-3 COMMUNICATIONS	98	74.42000	7,293.16	
50540R40	LABORATORY CORPORATION OF AMERICAN HOLDINGS	147	70.73000	10,397.31	
53071M50	LIBERTY MEDIA CORP - ENTERTAINMENT	567	31.19000	17,684.73	
53245710	ELI LILLY & CO	641	33.96000	21,768.36	
53271610	LIMITED BRANDS	374	19.22000	7,188.28	
53567810	LINEAR TECHNOLOGY CORP	306	26.60000	8,139.60	
53983010	LOCKHEED MARTIN CORP	180	72.19000	12,994.20	
54414710	LORILLARD INC	141	79.82000	11,254.62	
54866110	LOWE'S COS INC	913	20.71000	18,908.23	
55261F10	M & T BANK CORP	69	68.77000	4,745.13	
57174810	MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	445	24.89000	11,076.05	
57183410	MARSHALL & ILSLEY CORP	396	5.97000	2,364.12	
57190310	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	348	27.20000	9,465.60	
57328410	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	90	90.54000	8,148.60	
57459910	MASCO CORP	589	13.54000	7,975.06	
57636Q10	MASTERCARD INC-A	71	229.96000	16,327.16	
57708110	MATTEL INC	333	19.52000	6,500.16	
58013510	MCDONALD'S CORPORATION	685	59.43000	40,709.55	
58064510	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	290	30.49000	8,842.10	
58155Q10	MCKESSON CORPORATION	211	60.31000	12,725.41	
58405U10	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	310	57.27000	17,753.70	
58505510	MEDTRONIC INC	694	36.37000	25,240.78	
58933110	MERCK & CO. INC.	1,318	32.43000	42,742.74	
59156R10	METLIFE INC	513	36.95000	18,955.35	
59491810	MICROSOFT CORP	4,987	28.02000	139,735.74	
59501710	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	423	25.29000	10,697.67	
60405910	3M CO	412	77.82000	32,061.84	
60819010	MOHAWK INDUSTRIES INC	86	48.02000	4,129.72	
61166W10	MONSANTO CO	342	75.23000	25,728.66	
61536910	MOODY'S CORPORATION	202	25.03000	5,056.06	
61744644	MORGAN STANLEY	737	35.00000	25,795.00	
62007610	MOTOROLA INC	2,015	8.24000	16,603.60	
62671710	MURPHY OIL CORPORATION	154	63.10000	9,717.40	
62913F20	NII HOLDINGS INC	217	30.99000	6,724.83	
62956810	NABORS INDUSTRIES LTD	307	22.60000	6,938.20	
63707110	NATIONAL-OILWELL VARCO INC	308	46.89000	14,442.12	
64944510	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	328	10.96000	3,594.88	
65119210	NEWELL RUBBERMAID INC	451	15.15000	6,832.65	
65163910	NEWMONT MINING CORP	378	44.91000	16,975.98	
65248780	NEWS CORP-CL A	1,414	12.26000	17,335.64	
65410610	NIKE INC -CL B	253	64.17000	16,235.01	
65489410	NOBLE ENERGY INC	158	69.49000	10,979.42	
65504210	NOBLE CORP	219	43.81000	9,594.39	
65584410	NORFOLK SOUTHERN CORP	222	46.88000	10,407.36	
66577210	XCEL ENERGY INC	443	19.45000	8,616.35	
66585910	NORTHERN TRUST CORP	144	53.14000	7,652.16	
66680710	NORTHROP GRUMMAN CORP	183	49.66000	9,087.78	
67034610	NUCOR CORP	319	44.17000	14,090.23	
67459910	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	507	82.15000	41,650.05	
68022310	OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP	451	11.23000	5,064.73	
68191910	OMNICOM GROUP INC	304	35.86000	10,901.44	
68389X10	ORACLE CORP	2,479	22.05000	54,661.95	
69331C10	P G & E CORP	223	41.69000	9,296.87	

69347510	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	317	52.41000	16,613.97	
69349910	PPL CORPORATION	362	30.54000	11,055.48	
69371810	PACCAR INTERNATIONAL INC	265	39.06000	10,350.90	
70109410	PARKER HANNIFIN CORP	158	56.86000	8,983.88	
70432610	PAYCHEX INC	316	28.52000	9,012.32	
70454910	PEABODY ENERGY CORPORATION	242	43.22000	10,459.24	
70816010	J.C. PENNEY CO INC (HOLDING CO)	222	36.03000	7,998.66	
71019810	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	350	16.61000	5,813.50	
71344810	PEPSICO INC	968	61.03000	59,077.04	
71708110	PFIZER INC	5,020	17.25000	86,595.00	
71815410	ALTRIA GROUP INC	1,282	17.93000	22,986.26	
71817210	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	1,220	49.07000	59,865.40	
71850710	CONOCOPHILLIPS	875	51.97000	45,473.75	
72348410	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	244	33.48000	8,169.12	
72378710	PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	159	42.74000	6,795.66	
74005P10	PRAXAIR INC	208	82.68000	17,197.44	
74018910	PRECISION CASTPARTS CORP	122	102.77000	12,537.94	
74147710	T ROWE PRICE GROUP INC	184	54.27000	9,985.68	
74271810	PROCTER & GAMBLE COMPANY	1,814	57.64000	104,558.96	
74331510	PROGRESSIVE CORP	651	16.49000	10,734.99	
74432010	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	318	49.73000	15,814.14	
74457310	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	401	30.31000	12,154.31	
74752510	QUALCOMM INC	1,034	40.70000	42,083.80	
74834L10	QUEST DIAGNOSTICS INC	146	56.32000	8,222.72	
74835610	QUESTAR CORPORATION	193	41.15000	7,941.95	
75281A10	RANGE RESOURCES CORP	161	54.98000	8,851.78	
75511140	RAYTHEON COMPANY	234	46.43000	10,864.62	
75894010	REGIONS FINANCIAL CORP	931	5.53000	5,148.43	
75952J10	CENTERPOINT ENERGY INC	509	12.85000	6,540.65	
76182K10	REYNOLDS AMERICAN INC	170	48.44000	8,234.80	
77032310	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	255	25.72000	6,558.60	
77434110	ROCKWELL COLLINS INC.	156	51.54000	8,040.24	
77829610	ROSS STORES INC	163	46.12000	7,517.56	
78387G10	AT&T INC	3,672	25.73000	94,480.56	
78651420	SAFEWAY INC	203	22.40000	4,547.20	
79084910	ST JUDE MEDICAL INC	266	34.40000	9,150.40	
79286010	TRAVELERS COS INC/THE	367	51.30000	18,827.10	
80311110	SARA LEE CORP	617	11.48000	7,083.16	
80660510	SCHERING-PLOUGH CORP	1,018	28.97000	29,491.46	
80685710	SCHLUMBERGER LTD	747	65.20000	48,704.40	
80851310	CHARLES SCHWAB CORP	672	17.94000	12,055.68	
81235010	SEARS HOLDINGS CORPORATION	64	72.78000	4,657.92	
81685110	SEMPRA ENERGY	197	52.74000	10,389.78	
82655210	SIGMA ALDRICH CORP	170	54.08000	9,193.60	
83211010	SMITH INTERNATIONAL INC	184	32.65000	6,007.60	
84258710	SOUTHERN CO	480	32.67000	15,681.60	
84546710	SOUTHWESTERN ENERGY CO	265	47.22000	12,513.30	
84756010	SPECTRA ENERGY CORP	471	20.00000	9,420.00	
85206110	SPRINT NEXTEL CORPORATION	2,153	3.25000	6,997.25	
85461610	STANLEY WORKS	157	47.31000	7,427.67	
85503010	STAPLES INC	462	22.60000	10,441.20	
85524410	STARBUCKS CORP	678	20.27000	13,743.06	
85590520	STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	263	33.00000	8,679.00	
85747710	STATE STREET CORP	324	45.70000	14,806.80	
86366710	STRYKER CORP	223	48.03000	10,710.69	
86681010	SUN MICROSYSTEMS INC	890	8.44000	7,511.60	
86765210	SUNPOWER CORP-CLASS A	106	28.35000	3,005.10	
86791410	SUNTRUST BANKS INC	315	20.99000	6,611.85	
86853610	SUPERVALU INC	232	16.55000	3,839.60	
87150310	SYMANTEC CORP	708	16.66000	11,795.28	

[次へ](#)

87182910	SYSCO CORP	189	27.23000	5,146.47	
87254010	TJX COMPANIES INC	335	39.78000	13,326.30	
88250810	TEXAS INSTRUMENTS INC	799	23.50000	18,776.50	
88320310	TEXTRON INC	441	19.13000	8,436.33	
88355610	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	238	47.66000	11,343.08	
88654710	TIFFANY & CO	179	41.45000	7,419.55	
88706M10	TIM HORTONS INC	244	28.90000	7,051.60	
88732J10	TIME WARNER CABLE INC	257	41.24000	10,598.68	
89595310	YUM! BRANDS INC	349	34.29000	11,967.21	
90212410	TYCO INTERNATIONAL LTD	398	35.12000	13,977.76	
90249410	TYSON FOODS INC	334	12.07000	4,031.38	
90290582	MARATHON OIL CORPORATION	467	34.01000	15,882.67	
90297310	US BANCORP	1,188	24.95000	29,640.60	
90319210	UNUM GROUP	341	21.34000	7,276.94	
90337710	UNITED STATES STEEL CORP	178	40.87000	7,274.86	
90391410	ULTRA PETROLEUM CORP	156	53.60000	8,361.60	
90781810	UNION PACIFIC CORP	312	57.73000	18,011.76	
91058110	UNITEDHEALTH GROUP INC	746	25.85000	19,284.10	
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	438	55.70000	24,396.60	
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	556	65.81000	36,590.36	
91820410	VF CORP	96	78.32000	7,518.72	
91913Y10	VALERO ENERGY CORPORATION	438	20.67000	9,053.46	
92220P10	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	158	41.63000	6,577.54	
92552430	VIACOM INC-CLASS B	429	28.36000	12,166.44	
92826C83	VISA INC	281	74.12000	20,827.72	
92916010	VULCAN MATERIALS CO	156	50.73000	7,913.88	
93114210	WAL-MART STORES INC	1,461	50.44000	73,692.84	
93142210	WALGREEN CO	621	39.05000	24,250.05	
93964010	THE WASHINGTON POST COMPANY	12	467.10000	5,605.20	
94106L10	WASTE MANAGEMENT INC	323	30.93000	9,990.39	
94184810	WATERS CORP	112	56.99000	6,382.88	
94707410	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	532	19.93000	10,602.76	
94974610	WELLS FARGO & COMPANY	2,730	29.32000	80,043.60	
95980210	WESTERN UNION CO/THE	616	18.79000	11,574.64	
96216610	WEYERHAEUSER CO	192	39.48000	7,580.16	
96332010	WHIRLPOOL CORP	92	77.13000	7,095.96	
96945710	THE WILLIAMS COMPANIES INC	506	19.13000	9,679.78	
97665710	WISCONSIN ENERGY CORP	247	44.45000	10,979.15	
98385X10	XTO ENERGY INC	357	43.88000	15,665.16	
98391910	XILINX INC	379	22.91000	8,682.89	
98412110	XEROX CORP	1,027	7.88000	8,092.76	
98433210	YAHOO! INC	964	17.22000	16,600.08	
98956P10	ZIMMER HOLDINGS INC	183	54.71000	10,011.93	
G0070K10	ACE LTD	237	54.38000	12,888.06	
G0692U10	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	213	30.39000	6,473.07	
G1696210	BUNGE LIMITED	126	63.54000	8,006.04	
G2552X10	COVIDIEN PLC	344	43.44000	14,943.36	
G491BT10	INVESCO LTD	349	22.36000	7,803.64	
G5876H10	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	699	14.58000	10,191.42	
G7945J10	SEAGATE TECHNOLOGY	684	15.73000	10,759.32	
G9007810	TRANSOCEAN LTD	201	89.86000	18,061.86	
アメリカドル 計		192,281		6,235,482.13	
(邦貨換算額)				(573,976,130)	

外国株式(カナダドル)

(単位:株,カナダドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ABX	BARRICK GOLD CORP	607	39.59000	24,031.13	
AGE	AGNICO-EAGLE MINES	154	72.10000	11,103.40	
AGU	AGRIUM INC	176	55.52000	9,771.52	
BBDB	BOMBARDIER INC 'B'	1,360	4.69000	6,378.40	

BMO	BANK OF MONTREAL	351	52.03000	18,262.53	
BNNA	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	439	23.99000	10,531.61	
BNS	BANK OF NOVA SCOTIA	618	46.34000	28,638.12	
BPO	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	481	11.50000	5,531.50	
CCO	CAMECO CORP CORPORATION	395	31.95000	12,620.25	
CM	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	257	64.36000	16,540.52	
CNQ	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	339	74.43000	25,231.77	
CNR	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	305	53.00000	16,165.00	
CPZ	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	164	49.20000	8,068.80	
ECA	ENCANA CORP	469	63.10000	29,593.90	
ENB	ENBRIDGE INC	194	42.18000	8,182.92	
G	GOLDCORP INC	458	42.18000	19,318.44	
HSE	HUSKY ENERGY INC	274	30.40000	8,329.60	
IGI	IGM FINANCIAL INC	275	40.80000	11,220.00	
IMO	IMPERIAL OIL LTD	262	43.03000	11,273.86	
K	KINROSS GOLD CORP	609	22.50000	13,702.50	
MFC	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,009	21.71000	21,905.39	
MGA	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	113	46.94000	5,304.22	
NA	NATIONAL BANK OF CANADA	152	59.10000	8,983.20	
NXY	NEXEN INC	403	24.52000	9,881.56	
POT	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	196	105.95000	20,766.20	
POW	POWER CORP OF CANADA	404	27.53000	11,122.12	
RCI/B	ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B	435	28.89000	12,567.15	
RIM	RESEARCH IN MOTION	320	69.20000	22,144.00	
RY	ROYAL BANK OF CANADA	878	56.11000	49,264.58	
SLC	SUN LIFE FINANCIAL INC	473	30.50000	14,426.50	
SNC	SNC-LAVALIN GROUP INC	195	45.44000	8,860.80	
SU	SUNCOR ENERGY INC	974	38.37000	37,372.38	
T/A	TELUS CORPORATION -NON VOTE	204	30.92000	6,307.68	
TA	TRANSALTA CORP	266	21.24000	5,649.84	
TD	TORONTO-DOMINION BANK	533	64.97000	34,629.01	
TEK/B	TECK RESOURCES LTD-CLS B	477	34.81000	16,604.37	
TLM	TALISMAN ENERGY INC	780	19.37000	15,108.60	
TOC	THOMSON REUTERS CORP	247	34.47000	8,514.09	
TRP	TRANSCANADA CORP	290	33.40000	9,686.00	
カナダドル 計		16,536		613,593.46	
(邦貨換算額)				(53,634,204)	

外国株式（オーストラリアドル）

（単位：株、オーストラリアドル）

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AGK	AGL ENERGY LTD	545	14.35000	7,820.75	
AMP	AMP LIMITED	2,093	6.38000	13,353.34	
ANZ	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	1,459	23.85000	34,797.15	
BHP	BHP BILLITON LTD	2,095	40.20000	84,219.00	
BSL	BLUESCOPE STEEL LIMITED	2,556	3.31000	8,460.36	
CBA	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	949	56.24000	53,371.76	
CCL	COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,065	10.72000	11,416.80	
CPU	COMPUTERSHARE LIMITED	928	10.72000	9,948.16	
CSL	CSL LIMITED	401	32.17000	12,900.17	
CWN	CROWN LTD	1,235	8.60000	10,621.00	
FBG	FOSTER'S GROUP LTD	1,902	5.58000	10,613.16	
FXJ	FAIRFAX MEDIA LTD	4,742	1.78000	8,440.76	
LEI	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	240	37.65000	9,036.00	
LLC	LEND LEASE CORP LIMITED	1,257	10.29000	12,934.53	
MBL	MACQUARIE GROUP LIMITED	306	53.24000	16,291.44	
MIG	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP	3,460	1.43000	4,947.80	
NAB	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,200	30.91000	37,092.00	
NCM	NEWCREST MINING LIMITED	436	35.47000	15,464.92	
NRM	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,431	3.86000	9,383.66	
ORG	ORIGIN ENERGY LIMITED	670	16.48000	11,041.60	

QBE	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	743	23.45000	17,423.35	
RIO	RIO TINTO LIMITED	321	67.50000	21,667.50	
STO	SANTOS LTD	622	15.55000	9,672.10	
SUN	SUNCORP-METWAY LIMITED	1,108	9.40000	10,415.20	
TAH	TABCORP HOLDINGS LIMITED	884	7.40000	6,541.60	
TLS	TELSTRA CORP LTD	1,618	3.19000	5,161.42	
WBC	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,819	27.30000	49,658.70	
WES	WESFARMERS LIMITED	735	28.26000	20,771.10	
WOR	WORLEYPARSONS LTD	266	29.04000	7,724.64	
WOW	WOOLWORTHS LIMITED	770	29.31000	22,568.70	
WPL	WOODSIDE PETROLEUM LTD	383	51.80000	19,839.40	
オーストラリアドル 計		39,239		573,598.07	
(邦貨換算額)				(48,709,948)	

外国株式(イギリスポンド)

(単位:株、イギリスポンド)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AAL	ANGLO AMERICAN PLC	824	23.80000	19,611.20	
AZN	ASTRAZENECA PLC	905	27.69000	25,059.45	
BA	BAE SYSTEMS PLC	2,137	3.17300	6,780.70	
BATS	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,240	19.75000	24,490.00	
BCS	BARCLAYS PLC	6,897	3.61450	24,929.20	
BG	BG GROUP PLC	2,101	11.39000	23,930.39	
BLT	BHP BILLITON PLC	1,380	18.32000	25,281.60	
BP	BP PLC	11,664	5.65000	65,901.60	
BSY	BRITISH SKY BROADCASTING GROUP PLC	968	5.53000	5,353.04	
BT	BT GROUP PLC	5,672	1.35300	7,674.21	
CBRY	CADBURY SCHWEPPE'S PLC	913	7.86000	7,176.18	
CGU	AVIVA PLC	1,799	4.31200	7,757.28	
CNA	CENTRICA PLC	3,640	2.41200	8,779.68	
CPG	COMPASS GROUP PLC	1,521	3.94000	5,992.74	
CPI	CAPITA GROUP PLC	875	7.81500	6,838.12	
CW	CABLE & WIRELESS PLC	2,940	1.41000	4,145.40	
DGE	DIAGEO PLC	1,550	9.62500	14,918.75	
EMG	MAN GROUP PLC	1,493	3.51000	5,240.43	
EXPN	EXPERIAN PLC	973	5.74000	5,585.02	
FGP	FIRSTGROUP PLC	678	4.02600	2,729.62	
FPLN	FRIENDS PROVIDENT GROUP PLC	3,433	0.79800	2,739.53	
GFS	G4S PLC	2,313	2.48300	5,743.17	
GLXO	GLAXOSMITHKLINE PLC	3,228	12.36500	39,914.22	
HSBA	HSBC HOLDINGS PLC	10,780	6.98600	75,309.08	
IHG	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	522	8.11500	4,236.03	
IMT	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	638	18.17000	11,592.46	
KGF	KINGFISHER PLC	2,317	2.36300	5,475.07	
LGEN	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,991	0.84800	4,232.36	
LLOY	LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,831	0.96230	10,422.67	
MKS	MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,640	3.47300	5,695.72	
MRW	WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	1,607	2.72000	4,371.04	
NGG	NATIONAL GRID PLC	1,552	5.87500	9,118.00	
NPW	INTERNATIONAL POWER PLC	1,531	2.59300	3,969.88	
NXT	NEXT PLC	270	18.70000	5,049.00	
OML	OLD MUTUAL PLC	5,007	1.12700	5,642.88	
POC	CARNIVAL PLC	169	20.82000	3,518.58	
PRU	PRUDENTIAL PLC	1,758	6.33500	11,136.93	
RB/	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	379	30.66000	11,620.14	
RBOS	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	12,226	0.47080	5,756.00	
RDSA	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,206	19.04000	42,002.24	
RDSB	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,676	18.52500	31,047.90	
REED	REED ELSEVIER PLC	538	4.62000	2,485.56	
RIO	RIO TINTO PLC	857	30.00500	25,714.28	
RR	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	1,350	4.74100	6,400.35	
RSA	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,754	1.30000	3,580.20	

SAB	SABMILLER PLC	656	16.47000	10,804.32	
SBRY	J SAINSBURY PLC	655	3.38900	2,219.79	
SGL	SAGE GROUP PLC	2,708	2.29600	6,217.56	
SHP	SHIRE PLC	426	10.35000	4,409.10	
SL/	STANDARD LIFE PLC	2,250	2.30300	5,181.75	
SMIN	SMITHS GROUP PLC	489	9.25500	4,525.69	
SMU	SMITH & NEPHEW PLC	956	5.40500	5,167.18	
SSE	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY PLC	651	10.74000	6,991.74	
STAN	STANDARD CHARTERED PLC	1,257	16.05000	20,174.85	
SVT	SEVERN TRENT PLC	454	9.58000	4,349.32	
TSCO	TESCO PLC	4,904	3.89700	19,110.88	
ULVR	UNILEVER PLC	804	18.66000	15,002.64	
VOD	VODAFONE GROUP PLC	32,655	1.37500	44,900.62	
WOS	WOLSELEY PLC	225	14.45000	3,251.25	
WPP	WPP PLC	1,052	5.56000	5,849.12	
WTB	WHITBREAD PLC	328	12.91000	4,234.48	
XTA	XSTRATA PLC	1,196	10.12000	12,103.52	
イギリスポンド 計		176,409		809,441.71	
(邦貨換算額)				(121,181,518)	

外国株式(スイスフラン)

(単位:株、スイスフラン)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ABBN	ABB LTD	1,381	21.54000	29,746.74	
ADEN	ADECCO SA-REG	162	50.85000	8,237.70	
ATLN	ACTELION LTD	119	58.50000	6,961.50	
BAER	GAM HOLDING LTD	145	13.29000	1,927.05	
BAERGRP	JULIUS BAER GROUP LTD	125	42.26000	5,282.50	
CS	CREDIT SUISSE GROUP AG	703	56.75000	39,895.25	
GEBN	GEBERIT AG-REG	66	161.70000	10,672.20	
GIVN	GIVAUDAN-REG	13	755.00000	9,815.00	
HOL	HOLCIM LTD-REG	167	70.05000	11,698.35	
KNI	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG	103	92.90000	9,568.70	
LONN	LONZA GROUP AG-REG	52	108.30000	5,631.60	
NESZ	NESTLE SA	2,265	46.46000	105,231.90	
NOBE	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	202	30.60000	6,181.20	
NOVN	NOVARTIS AG-REG SHS	1,316	52.40000	68,958.40	
RIFZ	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG	255	30.12000	7,680.60	
ROCZ	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	437	161.10000	70,400.70	
RUKZ	SWISS REINSURANCE COMPANY LTD	259	47.66000	12,343.94	
SYNN	SYNGENTA AG	74	253.25000	18,740.50	
SYST	SYNTHES INC	50	122.30000	6,115.00	
UBSZ	UBS AG-REGISTERED	2,224	18.41000	40,943.84	
UHR	SWATCH GROUP AG-B	33	254.00000	8,382.00	
ZURN	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	91	253.25000	23,045.75	
スイスフラン 計		10,242		507,460.42	
(邦貨換算額)				(46,310,838)	

外国株式(香港ドル)

(単位:株、香港ドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AP	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	31.10000	93,300.00	
BKEA	BANK OF EAST ASIA	2,680	28.55000	76,514.00	
CGK	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1,044	105.50000	110,142.00	
CHL	CLP HOLDINGS LTD	1,000	52.15000	52,150.00	
EPA	ESPRIT HOLDINGS LTD	1,200	54.90000	65,880.00	
HCG	HONG KONG & CHINA GAS CO LTD	3,900	19.46000	75,894.00	
HKEX	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	900	145.40000	130,860.00	
HNDH	HENDERSON LAND DEVELOPMENT CO LTD	2,000	55.30000	110,600.00	
HSGH	HANG SENG BANK LTD	350	111.20000	38,920.00	
HTW	HUTCHISON WHAMPOA LTD	2,146	57.95000	124,360.70	

LIFU	LI & FUNG LTD	2,000	33.95000	67,900.00	
NWC	MONGOLIA ENERGY CO LTD	5,000	3.28000	16,400.00	
SHK	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	933	122.30000	114,105.90	
SWPA	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	754	97.20000	73,288.80	
香港ドル 計		26,907		1,150,315.40	
(邦貨換算額)				(13,665,747)	

外国株式(スウェーデンクローナ)

(単位:株、スウェーデンクローナ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ASSA	ASSA ABLOY AB-B	895	115.50000	103,372.50	
ATCOA	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,166	95.20000	111,003.20	
HMB	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	319	406.50000	129,673.50	
LMEB	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON AB-B SHS	1,872	72.00000	134,784.00	
NBH	NORDEA BANK AB	2,025	74.50000	150,862.50	
SAND	SANDVIK AB	1,232	79.00000	97,328.00	
SEBA	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,227	44.60000	54,724.20	
SECB	SECURITAS AB-B SHS	598	66.90000	40,006.20	
SKAB	SKANSKA AB-B SHS	674	105.40000	71,039.60	
TLIA	TELIASONERA AB	1,775	47.30000	83,957.50	
VOLV	VOLVO AB-B SHS	1,443	69.75000	100,649.25	
スウェーデンクローナ 計		13,226		1,077,400.45	
(邦貨換算額)				(14,609,550)	

外国株式(シンガポールドル)

(単位:株、シンガポールドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
COS	COSCO CORP SINGAPORE LIMITED	3,000	1.18000	3,540.00	
CYDM	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,500	10.26000	15,390.00	
DBS	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,423	13.00000	18,499.00	
KPL	KEPPEL CORP LTD	2,000	8.15000	16,300.00	
SGX	SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,000	8.24000	8,240.00	
SPR	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	3,000	3.90000	11,700.00	
TELE	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	3,000	3.10000	9,300.00	
UOBH	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,000	17.40000	17,400.00	
シンガポールドル 計		15,923		100,369.00	
(邦貨換算額)				(6,621,343)	

外国株式(デンマーククローネ)

(単位:株、デンマーククローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
DSAC	A P MOLLER MAERSK A/S-B	1	38,300.00000	38,300.00	
DSVB	DSV DE SAMMENSLUT VOGN	542	88.00000	47,696.00	
NOVO	NOVO NORDISK A/S-B	281	322.00000	90,482.00	
VWS	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	188	341.00000	64,108.00	
デンマーククローネ 計		1,012		240,586.00	
(邦貨換算額)				(4,462,870)	

外国株式(ノルウェークローネ)

(単位:株、ノルウェークローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
DNBOR	DNB NOR ASA	738	67.90000	50,110.20	
NHY	NORSK HYDRO ASA	2,004	41.90000	83,967.60	
ORK	ORKLA ASA	918	54.65000	50,168.70	
STL	STATOILHYDRO ASA	651	138.60000	90,228.60	
TEL	TELENOR ASA	664	71.30000	47,343.20	
YAR	YARA INTERNATIONAL ASA	203	197.00000	39,991.00	
ノルウェークローネ 計		5,178		361,809.30	

(邦貨換算額)			(5,995,180)	
---------	--	--	-------------	--

外国株式(ユーロ)

(単位:株,ユーロ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AC	ACCOR SA	152	34.31000	5,215.12	
ACA	CREDIT AGRICOLE SA	561	14.67000	8,229.87	
ACRX	ACERINOX SA	436	14.32000	6,243.52	
ACS	ACS ACTIVIDADES CONSTRUCTION Y SERVICIOS SA	194	34.35000	6,663.90	
ACSA	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	468	15.65000	7,324.20	
ACUM	UMICORE	312	21.94500	6,846.84	
ADS	ADIDAS AG	211	34.70000	7,321.70	
AHLN	KONINKLIJKE AHOLD NV	828	8.56500	7,091.82	
AI	AIR LIQUIDE	158	77.12000	12,184.96	
AIB	ANGLO IRISH BANK CORP PLC	2,782	0.00000	0.00	
AKZO	AKZO NOBEL NV	233	44.17500	10,292.77	
ALO	ALSTOM SA	186	49.11500	9,135.39	
ALPHA	ALPHA BANK A.E.	494	14.20000	7,014.80	
ALV	ALLIANZ SE-REG	283	83.70000	23,687.10	
ASML	ASML HOLDING NV	557	20.00500	11,142.78	
AUTO	ATLANTIA SPA	340	16.96000	5,766.40	
BASF	BASF SE	577	39.16000	22,595.32	
BAYE	BAYER AG	478	47.68000	22,791.04	
BBV	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	2,226	12.50000	27,825.00	
BCP	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	7,314	1.03300	7,555.36	
BCSA	BANCO SANTANDER SA	5,090	11.40000	58,026.00	
BEI	BEIERSDORF AG	118	42.37000	4,999.66	
BELG	BELGACOM SA	120	27.25500	3,270.60	
BI	INTESA SANPAOLO SPA	4,826	3.04500	14,695.17	
BMW	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	245	35.94000	8,805.30	
BNP	BNP PARIBAS SA	575	56.25000	32,343.75	
BOUY	BOUYGUES SA	212	35.30000	7,483.60	
BP	BANCO POPOLARE SPA	791	6.64000	5,252.24	
BPE	BANCO POPULAR ESPANOL SA	947	6.50000	6,155.50	
BPM	BANCA POPOLARE DI MILANO SCRL	1,072	5.52000	5,917.44	
BPU	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	523	10.32000	5,397.36	
BSN	DANONE	341	41.25000	14,066.25	
CAP	CAP GEMINI SA	157	33.69500	5,290.11	
CAR	CARREFOUR SA	393	30.15500	11,850.91	
CGE	ALCATEL LUCENT	2,776	3.06400	8,505.66	
COM	COMMERZBANK AG	651	8.14000	5,299.14	
CRDI	UNICREDIT SPA	8,905	2.48500	22,128.92	
CRH	CRH PLC	604	18.87000	11,397.48	
CUBE	ACCIONA S.A.	69	88.70000	6,120.30	
DB1	DEUTSCHE BOERSE AG	153	59.84000	9,155.52	
DBK	DEUTSCHE BANK AG -REG	371	52.90500	19,627.75	
DCXG	DAIMLER AG-REG	564	36.87500	20,797.50	
DELB	DELHAIZE GROUP	99	47.48000	4,700.52	
DESC	ERSTE GROUP BANK AG	207	29.86000	6,181.02	
DG	VINCI S.A.	293	37.89000	11,101.77	
DPW	DEUTSCHE POST AG-REG	730	12.38500	9,041.05	
DSMN	KONINKLIJKE DSM NV	183	31.93000	5,843.19	
DTEG	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,758	9.56500	16,815.27	
EAD	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE CO	384	13.95000	5,356.80	
EDF	ELECTRICITE DE FRANCE	147	39.41000	5,793.27	
ENEL	ENEL SPA	4,084	4.18500	17,091.54	
ENI	ENI SPA	1,618	17.73000	28,687.14	
ERCK	MERCK KGAA	70	69.50000	4,865.00	
ESSI	ESSILOR INTERNATIONAL SA	213	38.65000	8,232.45	
ETE	NATIONAL BANK OF GREECE SA	297	26.42000	7,846.74	

EX	VIVENDI SA	726	19.62000	14,244.12	
EXHO	SODEXO	122	40.36500	4,924.53	

[次へ](#)

FME	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	123	32.28000	3,970.44
FOR/CRTS	FORTIS -RTS COUPON 42	5,187	0.00000	0.00
FORB	FORTIS	2,274	3.18400	7,240.41
FRE	FRESENIUS SE-PRF	116	40.05000	4,645.80
FTE	FRANCE TELECOM SA	1,136	17.77000	20,186.72
FUM1V	FORTUM OYJ	436	16.75000	7,303.00
GASI	ASSICURAZIONI GENERALI	732	18.53000	13,563.96
GAZ	GDF SUEZ	749	29.53000	22,117.97
GLEDSR	SOCIETE GENERALE-RTS	299	2.98000	891.02
GRF	GRIFOLS SA	273	11.30500	3,086.26
HEIN	HEINEKEN NV	172	29.75500	5,117.86
HEN	HENKEL AG & CO KGAA	239	31.25000	7,468.75
HNSY	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	140	72.00000	10,080.00
IBER	IBERDROLA SA	2,304	6.27000	14,446.08
ING	ING GROEP NV-CVA	1,228	11.66000	14,318.48
INTB	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	452	33.81500	15,284.38
ITX	INDITEX	188	39.48000	7,422.24
KONBS	KONE OYJ	284	26.75000	7,597.00
KPN	KONINKLIJKE KPN NV	1,075	11.99000	12,889.25
KSZ	K+S AG	141	41.00000	5,781.00
LIN	LINDE AG	99	74.91000	7,416.09
MAN	MAN SE	116	58.85000	6,826.60
MB	MEDIOBANCA SPA	602	9.01000	5,424.02
MCNB	MICHELIN (CGDE)-B	130	54.63000	7,101.90
MIDI	AXA	981	18.44000	18,089.64
MMBP	LAGARDERE S.C.A.	164	33.65500	5,519.42
MOBB	MOBISTAR SA	70	46.52500	3,256.75
MS	MEDIASET SPA	1,393	4.74250	6,606.30
MT	ARCELORMITTAL	538	25.48000	13,708.24
MUVG	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	129	110.54000	14,259.66
NOKS	NOKIA OYJ	2,326	8.80000	20,468.80
OMV	OMV AG	130	29.26000	3,803.80
OPAP	OPAP SA	185	18.15000	3,357.75
ORL	L'OREAL SA	123	69.15000	8,505.45
PERP	PERNOD-RICARD SA	169	55.72000	9,416.68
PHG	PHILIPS ELECTRONICS NV	657	18.07000	11,871.99
PLT	PARMALAT SPA	3,204	1.90100	6,090.80
POR	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	73	56.05000	4,091.65
PRTP	PPR	86	79.76000	6,859.36
PSAF	PEUGEOT SA	208	23.90000	4,971.20
RMS	HERMES INTERNATIONAL	67	98.01000	6,566.67
RPSL	REPSOL YPF SA	613	18.64000	11,426.32
RWE	RWE AG	262	61.32000	16,065.84
SAB	BANCO DE SABADELL SA	1,416	4.82000	6,825.12
SAMAS	SAMPO OYJ-A SHS	514	17.16000	8,820.24
SAP	SAP AG	537	34.44000	18,494.28
SCG	SOCIETE GENERALE-A	290	48.24500	13,991.05
SCHN	SCHNEIDER ELECTRIC SA	164	72.80000	11,939.20
SESF	SES GROBAL-FDR	358	15.99000	5,724.42
SEV	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	343	15.71500	5,390.24
SIF	FINMECCANICA SPA	480	12.15000	5,832.00
SM	SIEMENS AG-REG	514	65.55000	33,692.70
SOFP	SANOFI-AVENTIS SA	654	52.03000	34,027.62
SOLV	SOLVAY SA	56	70.34000	3,939.04
SPM	SAIPEM	298	22.05000	6,570.90
STM	STMICROELECTRONICS NV	1,053	5.92000	6,233.76
TECF	TECHNIP S.A.	141	48.65000	6,859.65
TITI	TELECOM ITALIA SPA	9,661	1.16000	11,206.76
TKA	THYSSENKRUPP AG	390	24.40000	9,516.00
TKAV	TELEKOM AUSTRIA AG	293	11.95000	3,501.35
TNE	TELEFONICA S.A.	2,643	19.05000	50,349.15
TOL	TOTAL SA	1,328	42.33000	56,214.24

TP	TNT NV	341	18.69500	6,374.99	
TPEI	BANK OF PIRAEUS	634	12.72000	8,064.48	
UCB	UCB SA	138	30.37500	4,191.75	
UNL	UNILEVER NV-CVA	1,011	20.84500	21,074.29	
UPM1	UPM-KYMMENE OYJ	593	8.31000	4,927.83	
VEB	E.ON AG	1,182	26.95000	31,854.90	
VIE	VEOLIA ENVIRONNEMENT	362	22.86500	8,277.13	
VK	VALLOUREC	52	116.05000	6,034.60	
VOW	VOLKSWAGEN AG	57	115.00000	6,555.00	
VOWG	VOLKSWAGEN AG PFD	76	73.34000	5,573.84	
WLSN	WOLTERS KLUWER NV	298	15.46500	4,608.57	
WRTBV	WARTSILA OYJ	145	26.53000	3,846.85	
ユーロ計		115,119		1,447,865.96	
(邦貨換算額)				(199,906,853)	

(単位：円)

総合計			(1,089,074,181)	1,089,074,181	
-----	--	--	-----------------	---------------	--

(注) 総合計の()内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

(2) 株式以外の有価証券

(外国投資証券)

外国投資証券(アメリカドル)

(単位：アメリカドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
05348410	AVALONBAY COMMUNITIES INC	83	6,070.62
10112110	BOSTON PROPERTIES INC	113	7,080.58
29476L10	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	236	6,836.92
44107P10	HOST HOTELS & RESORTS INC	638	6,743.66
49446R10	KIMCO REALTY CORPORATION	370	5,054.20
74460D10	PUBLIC STORAGE	104	7,774.00
75884910	REGENCY CENTERS CORPORATION	156	5,623.80
82880610	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	196	13,492.64
92904210	VORNADO REALTY TRUST	129	7,838.04
アメリカドル計		2,025	66,514.46
(邦貨換算額)			(6,122,656)

外国投資証券(カナダドル)

(単位：カナダドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
COS-U	CANADIAN OIL SANDS TRUST	241	7,634.88
ERF-U	ENERPLUS RESOURCES FUND	267	6,733.74
PWT-U	PENN WEST ENERGY TRUST	517	9,595.52
カナダドル計		1,025	23,964.14
(邦貨換算額)			(2,094,705)

外国投資証券(オーストラリアドル)

(単位：オーストラリアドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
WDC	WESTFIELD GROUP	1,160	15,277.20
オーストラリアドル計		1,160	15,277.20
(邦貨換算額)			(1,297,340)

外国投資証券(イギリスポンド)

(単位：イギリスポンド)

銘柄	券面総額	評価額	備考
BLND	BRITISH LAND COMPANY PLC	814	3,924.29
LAND	LAND SECURITIES GROUP PLC	521	3,485.49
イギリスポンド計		1,335	7,409.78
(邦貨換算額)			(1,109,318)

外国投資証券(香港ドル)

(単位：香港ドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
LINK	LINK REIT	3,000	53,580.00	
香港ドル 計		3,000	53,580.00	
(邦貨換算額)			(636,530)	

外国投資証券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

銘柄		券面総額	評価額	備考
UL	UNIBAIL-RODAMCO SE	77	11,611.60	
ユーロ 計		77	11,611.60	
(邦貨換算額)			(1,603,214)	

(単位:円)

総合計			(12,863,763)	
			12,863,763	

(注1) 総合計の()内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(外国新株予約権証券)

ユーロ

(単位:ユーロ)

銘柄		券面総額	評価額	備考
MBW	MEDIOBANCA SPA-CW11 WARRANT	574	0.57	
ユーロ 計		574	0.57	
(邦貨換算額)			(79)	

(単位:円)

総合計			(79)	
			79	

(注1) 総合計の()内の金額は外国新株予約権証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 外国新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時 価比率(%)	組入新株予約権証 券時価比率(%)	合計額に対する 比率(%)
アメリカドル	株式 347銘柄	98.9	-	-	52.2
アメリカドル	投資証券 9銘柄	-	1.1	-	0.6
カナダドル	株式 39銘柄	96.2	-	-	4.9
カナダドル	投資証券 3銘柄	-	3.8	-	0.2
オーストラリアドル	株式 31銘柄	97.4	-	-	4.4
オーストラリアドル	投資証券 1銘柄	-	2.6	-	0.1
イギリスポンド	株式 62銘柄	99.1	-	-	11.0
イギリスポンド	投資証券 2銘柄	-	0.9	-	0.1
スイスフラン	株式 22銘柄	100.0	-	-	4.2
香港ドル	株式 14銘柄	95.5	-	-	1.2
香港ドル	投資証券 1銘柄	-	4.5	-	0.1
スウェーデンクローナ	株式 11銘柄	100.0	-	-	1.3
シンガポールドル	株式 8銘柄	100.0	-	-	0.6
デンマーククローネ	株式 4銘柄	100.0	-	-	0.4
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0	-	-	0.5
ユーロ	株式 131銘柄	99.2	-	-	18.1
ユーロ	新株予約権証券 1銘柄	-	-	0.0	0.0
ユーロ	投資証券 1銘柄	-	0.8	-	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。

[次へ](#)

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科目	対象年月日	平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		100,054,263	11,002,267
国債証券		24,800,401,046	27,559,845,220
地方債証券		2,207,663,000	2,375,039,000
特殊債券		4,128,371,000	4,004,019,863
社債券		3,997,496,000	3,369,249,000
未収入金		927,860,710	-
未収利息		113,255,735	121,613,411
前払費用		7,237,201	4,673,104
流動資産合計		36,282,338,955	37,445,441,865
資産合計			
		36,282,338,955	37,445,441,865
負債の部			
流動負債			
未払金		80,645,200	-
未払解約金		947,878,607	4,154,423
流動負債合計		1,028,523,807	4,154,423
負債合計			
		1,028,523,807	4,154,423
純資産の部			
元本等			
元本		30,966,595,295	32,047,347,137
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,287,219,853	5,393,940,305
元本等合計		35,253,815,148	37,441,287,442
純資産合計			
		35,253,815,148	37,441,287,442
負債純資産合計			
		36,282,338,955	37,445,441,865

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成20年10月27日現在			平成21年10月26日現在		
1.	期首	平成19年10月27日	1.	期首	平成20年10月28日
	期首元本額	41,894,109,462 円		期首元本額	30,966,595,295 円
	期首からの追加設定元本額	11,543,117,027 円		期首からの追加設定元本額	9,783,515,337 円
	期首からの解約元本額	22,470,631,194 円		期首からの解約元本額	8,702,763,495 円
	平成20年10月27日現在の元本の内訳			平成21年10月26日現在の元本の内訳	
	DCインデックスバランス (株式20)	318,435,644 円		DCインデックスバランス (株式20)	365,696,274 円
	DCインデックスバランス (株式40)	383,097,710 円		DCインデックスバランス (株式40)	464,703,468 円
	DCインデックスバランス (株式60)	259,402,061 円		DCインデックスバランス (株式60)	331,606,826 円
	DCインデックスバランス (株式80)	42,536,644 円		DCインデックスバランス (株式80)	55,266,785 円
	インデックスファンド日本 債券(DC専用)	814,224,100 円		インデックスファンド日本 債券(DC専用)	889,301,975 円
	世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式)毎月 分配型	14,211,277,734 円		世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式)毎月 分配型	14,441,109,369 円
	グローバルコレクション (債券/株式/不動産・資 源・食料等)隔月分配型	14,989,007 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	8,590,141 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	4,558,108 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)	343,634,465 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)	231,762,261 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式80)	9,429,220 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式80)	8,127,368 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式60)	55,121,412 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式60)	49,691,658 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式40)	256,266,695 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式40)	248,571,481 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式20)	975,445,379 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド(株式20)	1,141,176,054 円		国際分散型ファンド40(適 格機関投資家向け)	7,950,831,489 円
	国際分散型ファンド40(適 格機関投資家向け)	7,206,458,002 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)	154,270,272 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)	257,726,323 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)	298,513,863 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)	778,821,514 円		3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	121,241,924 円
	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	309,878,155 円		グローバルバランスファン ド35(適格機関投資家向 け)	43,294,234 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式20)	709,967,548 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式20)	754,616,539 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式40)	611,311,456 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式40)	685,295,201 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式60)	281,859,734 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式60)	338,167,489 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式80)	44,089,162 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド(株 式80)	52,600,344 円
	年金積立 インデックスファ ンド日本債券	2,970,160,802 円		年金積立 インデックスファ ンド日本債券	3,365,835,661 円
	日本債券インデックスファ ンド(個人型年金向け)	68,472,769 円		日本債券インデックスファ ンド(個人型年金向け)	86,508,112 円
	(合計)	30,966,595,295 円		(合計)	32,047,347,137 円
2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	30,966,595,295 円	2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	32,047,347,137 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

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	24,800,401,046	125,489,140
地方債証券	2,207,663,000	13,533,000
特殊債証券	4,128,371,000	10,128,000
社債証券	3,997,496,000	18,610,000
合計	35,133,931,046	130,540,140

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	27,559,845,220	145,890,960
地方債証券	2,375,039,000	53,140,000
特殊債証券	4,004,019,863	63,477,863
社債証券	3,369,249,000	50,742,000
合計	37,308,153,083	313,250,823

（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報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（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20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1384 円	1口当たり純資産額	1.1683 円
（1万口当たり純資産額）	（11,384 円）	（1万口当たり純資産額）	（11,683 円）

(3) 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

(邦貨建債券)

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	0042 0274	利付国庫債券(2年)第274回	105,000,000	105,454,650
	0042 0275	利付国庫債券(2年)第275回	70,000,000	70,319,200
	0042 0276	利付国庫債券(2年)第276回	205,000,000	205,744,150
	0042 0280	利付国庫債券(2年)第280回	95,000,000	95,240,350
	0042 0282	利付国庫債券(2年)第282回	155,000,000	155,117,800
	0042 0283	利付国庫債券(2年)第283回	510,000,000	510,316,200
	0045 0052	利付国庫債券(5年)第52回	270,000,000	271,844,100
	0045 0053	利付国庫債券(5年)第53回	110,000,000	111,002,100
	0045 0054	利付国庫債券(5年)第54回	215,000,000	217,588,600
	0045 0055	利付国庫債券(5年)第55回	169,000,000	171,737,800
	0045 0056	利付国庫債券(5年)第56回	58,000,000	59,019,640
	0045 0057	利付国庫債券(5年)第57回	390,000,000	397,261,800
	0045 0058	利付国庫債券(5年)第58回	382,000,000	389,739,320
	0045 0060	利付国庫債券(5年)第60回	295,000,000	300,138,900
	0045 0062	利付国庫債券(5年)第62回	153,000,000	156,255,840
	0045 0063	利付国庫債券(5年)第63回	75,000,000	76,537,500
	0045 0064	利付国庫債券(5年)第64回	657,000,000	676,506,330
	0045 0065	利付国庫債券(5年)第65回	124,000,000	127,372,800
	0045 0066	利付国庫債券(5年)第66回	340,000,000	346,854,400
	0045 0068	利付国庫債券(5年)第68回	170,000,000	173,530,900
	0045 0069	利付国庫債券(5年)第69回	250,000,000	253,642,500
	0045 0070	利付国庫債券(5年)第70回	167,000,000	168,865,390
	0045 0071	利付国庫債券(5年)第71回	248,000,000	254,951,440
	0045 0072	利付国庫債券(5年)第72回	307,000,000	318,033,580
	0045 0074	利付国庫債券(5年)第74回	103,000,000	104,840,610
	0045 0075	利付国庫債券(5年)第75回	176,000,000	179,757,600
	0045 0076	利付国庫債券(5年)第76回	143,000,000	146,597,880
	0045 0078	利付国庫債券(5年)第78回	200,000,000	202,588,000
	0045 0079	利付国庫債券(5年)第79回	98,000,000	98,475,300
	0045 0081	利付国庫債券(5年)第81回	130,000,000	131,027,000
	0045 0083	利付国庫債券(5年)第83回	132,000,000	133,486,320
	0045 0084	利付国庫債券(5年)第84回	107,000,000	107,216,140
	0045 0085	利付国庫債券(5年)第85回	200,000,000	200,142,000
	0067 0225	利付国庫債券(10年)第225回	35,000,000	35,680,050
	0067 0226	利付国庫債券(10年)第226回	44,000,000	44,802,120
	0067 0227	利付国庫債券(10年)第227回	538,000,000	548,184,340
	0067 0229	利付国庫債券(10年)第229回	102,000,000	103,648,320
	0067 0230	利付国庫債券(10年)第230回	137,000,000	138,642,630
	0067 0231	利付国庫債券(10年)第231回	217,000,000	220,669,470
	0067 0232	利付国庫債券(10年)第232回	84,000,000	85,282,680
	0067 0233	利付国庫債券(10年)第233回	368,000,000	374,822,720
	0067 0234	利付国庫債券(10年)第234回	260,000,000	265,483,400
	0067 0236	利付国庫債券(10年)第236回	80,000,000	82,052,000
	0067 0237	利付国庫債券(10年)第237回	32,000,000	32,883,520
	0067 0238	利付国庫債券(10年)第238回	220,000,000	225,552,800
	0067 0239	利付国庫債券(10年)第239回	275,000,000	282,480,000
	0067 0240	利付国庫債券(10年)第240回	401,000,000	410,860,590
	0067 0241	利付国庫債券(10年)第241回	200,000,000	205,148,000
	0067 0245	利付国庫債券(10年)第245回	160,000,000	162,305,600
	0067 0247	利付国庫債券(10年)第247回	17,000,000	17,192,780
	0067 0250	利付国庫債券(10年)第250回	235,000,000	235,000,000
	0067 0251	利付国庫債券(10年)第251回	227,000,000	230,246,100
	0067 0252	利付国庫債券(10年)第252回	228,000,000	232,074,360
	0067 0253	利付国庫債券(10年)第253回	120,000,000	124,873,200
	0067 0254	利付国庫債券(10年)第254回	52,000,000	53,725,360
	0067 0256	利付国庫債券(10年)第256回	410,000,000	423,685,800

0067 0258	利付国庫債券(10年)第258回	72,000,000	74,107,440
0067 0259	利付国庫債券(10年)第259回	127,000,000	131,831,080
0067 0261	利付国庫債券(10年)第261回	340,000,000	357,775,200
0067 0262	利付国庫債券(10年)第262回	155,000,000	163,802,450
0067 0264	利付国庫債券(10年)第264回	351,000,000	364,713,570
0067 0265	利付国庫債券(10年)第265回	100,000,000	103,919,000
0067 0266	利付国庫債券(10年)第266回	118,000,000	122,039,140
0067 0268	利付国庫債券(10年)第268回	386,000,000	401,200,680
0067 0269	利付国庫債券(10年)第269回	39,000,000	40,121,250
0067 0270	利付国庫債券(10年)第270回	98,000,000	100,752,820
0067 0271	利付国庫債券(10年)第271回	56,000,000	57,254,960
0067 0272	利付国庫債券(10年)第272回	98,000,000	101,251,640
0067 0273	利付国庫債券(10年)第273回	66,000,000	68,561,460
0067 0274	利付国庫債券(10年)第274回	73,000,000	75,814,150
0067 0276	利付国庫債券(10年)第276回	55,000,000	57,457,950
0067 0278	利付国庫債券(10年)第278回	80,000,000	84,502,400
0067 0279	利付国庫債券(10年)第279回	70,000,000	74,809,700
0067 0280	利付国庫債券(10年)第280回	71,000,000	75,425,430
0067 0281	利付国庫債券(10年)第281回	182,000,000	194,545,260
0067 0282	利付国庫債券(10年)第282回	479,000,000	502,078,220
0067 0283	利付国庫債券(10年)第283回	50,000,000	52,749,500
0067 0284	利付国庫債券(10年)第284回	364,000,000	381,111,640
0067 0285	利付国庫債券(10年)第285回	308,000,000	322,168,000
0067 0286	利付国庫債券(10年)第286回	156,000,000	164,101,080
0067 0287	利付国庫債券(10年)第287回	370,000,000	391,966,900
0067 0288	利付国庫債券(10年)第288回	255,000,000	265,916,550
0067 0289	利付国庫債券(10年)第289回	64,000,000	65,642,880
0067 0290	利付国庫債券(10年)第290回	406,000,000	412,500,060
0067 0291	利付国庫債券(10年)第291回	219,000,000	220,752,000
0067 0292	利付国庫債券(10年)第292回	241,000,000	250,565,290
0067 0293	利付国庫債券(10年)第293回	236,000,000	246,891,400
0067 0294	利付国庫債券(10年)第294回	32,000,000	33,213,440
0067 0295	利付国庫債券(10年)第295回	317,000,000	323,935,960
0067 0296	利付国庫債券(10年)第296回	276,000,000	281,296,440
0067 0297	利付国庫債券(10年)第297回	333,000,000	335,857,140
0067 0298	利付国庫債券(10年)第298回	251,000,000	251,000,000
0067 0299	利付国庫債券(10年)第299回	735,000,000	732,846,450
0067 0300	利付国庫債券(10年)第300回	201,000,000	203,936,610
0067 0301	利付国庫債券(10年)第301回	277,000,000	280,304,610
0067 0302	利付国庫債券(10年)第302回	79,000,000	79,235,420
0067 0303	利付国庫債券(10年)第303回	255,000,000	255,109,650
0068 0014	利付国庫債券(30年)第14回	208,000,000	214,431,360
0068 0015	利付国庫債券(30年)第15回	162,000,000	169,900,740
0068 0023	利付国庫債券(30年)第23回	55,000,000	57,529,450
0068 0024	利付国庫債券(30年)第24回	158,000,000	165,309,080
0068 0026	利付国庫債券(30年)第26回	140,000,000	143,557,400
0068 0027	利付国庫債券(30年)第27回	134,000,000	140,101,020
0068 0028	利付国庫債券(30年)第28回	54,000,000	56,485,080
0068 0029	利付国庫債券(30年)第29回	216,000,000	221,285,520
0068 0030	利付国庫債券(30年)第30回	112,000,000	112,393,120
0069 0023	利付国庫債券(20年)第23回	100,000,000	118,912,000
0069 0026	利付国庫債券(20年)第26回	37,000,000	43,752,130
0069 0027	利付国庫債券(20年)第27回	16,000,000	19,304,160
0069 0029	利付国庫債券(20年)第29回	110,000,000	131,353,200
0069 0031	利付国庫債券(20年)第31回	40,000,000	46,468,400
0069 0033	利付国庫債券(20年)第33回	200,000,000	237,106,000
0069 0034	利付国庫債券(20年)第34回	85,000,000	99,620,850
0069 0037	利付国庫債券(20年)第37回	63,000,000	72,229,500
0069 0039	利付国庫債券(20年)第39回	86,000,000	95,357,660
0069 0041	利付国庫債券(20年)第41回	27,000,000	27,394,470
0069 0042	利付国庫債券(20年)第42回	178,000,000	197,526,600
0069 0043	利付国庫債券(20年)第43回	73,000,000	83,128,750
0069 0044	利付国庫債券(20年)第44回	51,000,000	56,113,260
0069 0047	利付国庫債券(20年)第47回	21,000,000	22,439,550
0069 0048	利付国庫債券(20年)第48回	99,000,000	108,556,470
0069 0049	利付国庫債券(20年)第49回	57,000,000	60,093,960
0069 0050	利付国庫債券(20年)第50回	62,000,000	64,070,180
0069 0051	利付国庫債券(20年)第51回	39,000,000	40,650,870
0069 0054	利付国庫債券(20年)第54回	15,000,000	15,906,900

0069 0055	利付国庫債券(20年)第55回	66,000,000	68,446,620	
0069 0057	利付国庫債券(20年)第57回	102,000,000	104,393,940	
0069 0058	利付国庫債券(20年)第58回	135,000,000	138,001,050	
0069 0059	利付国庫債券(20年)第59回	33,000,000	32,876,250	
0069 0060	利付国庫債券(20年)第60回	545,000,000	523,216,350	
0069 0061	利付国庫債券(20年)第61回	27,000,000	24,523,830	
0069 0063	利付国庫債券(20年)第63回	31,000,000	31,101,990	
0069 0064	利付国庫債券(20年)第64回	54,000,000	54,721,440	
0069 0065	利付国庫債券(20年)第65回	140,000,000	141,498,000	
0069 0066	利付国庫債券(20年)第66回	34,000,000	33,942,540	
0069 0067	利付国庫債券(20年)第67回	54,000,000	54,430,380	
0069 0068	利付国庫債券(20年)第68回	38,000,000	39,759,780	
0069 0070	利付国庫債券(20年)第70回	49,000,000	52,406,480	
0069 0072	利付国庫債券(20年)第72回	42,000,000	43,225,980	
0069 0073	利付国庫債券(20年)第73回	13,000,000	13,191,620	
0069 0074	利付国庫債券(20年)第74回	78,000,000	80,116,920	
0069 0076	利付国庫債券(20年)第76回	206,000,000	205,754,860	
0069 0088	利付国庫債券(20年)第88回	300,000,000	312,993,000	
0069 0090	利付国庫債券(20年)第90回	156,000,000	160,241,640	
0069 0091	利付国庫債券(20年)第91回	200,000,000	208,364,000	
0069 0092	利付国庫債券(20年)第92回	225,000,000	227,580,750	
0069 0094	利付国庫債券(20年)第94回	100,000,000	100,899,000	
0069 0095	利付国庫債券(20年)第95回	182,000,000	188,750,380	
0069 0096	利付国庫債券(20年)第96回	98,000,000	98,762,440	
0069 0097	利付国庫債券(20年)第97回	195,000,000	199,089,150	
0069 0098	利付国庫債券(20年)第98回	44,000,000	44,258,720	
0069 0099	利付国庫債券(20年)第99回	170,000,000	170,783,700	
0069 0100	利付国庫債券(20年)第100回	140,000,000	142,518,600	
0069 0101	利付国庫債券(20年)第101回	96,000,000	100,621,440	
0069 0102	利付国庫債券(20年)第102回	106,000,000	111,003,200	
0069 0103	利付国庫債券(20年)第103回	11,000,000	11,355,520	
0069 0104	利付国庫債券(20年)第104回	33,000,000	33,044,220	
0069 0105	利付国庫債券(20年)第105回	82,000,000	81,944,240	
0069 0106	利付国庫債券(20年)第106回	142,000,000	144,114,380	
0069 0107	利付国庫債券(20年)第107回	30,000,000	29,918,100	
0069 0108	利付国庫債券(20年)第108回	117,000,000	113,109,750	
0069 0109	利付国庫債券(20年)第109回	119,000,000	114,770,740	
0069 0110	利付国庫債券(20年)第110回	118,000,000	117,513,840	
0069 0111	利付国庫債券(20年)第111回	90,000,000	90,935,100	
0069 0113	利付国庫債券(20年)第113回	140,000,000	139,120,800	
国債証券計		26,831,000,000	27,559,845,220	
地方債証券	0100 0596	東京都公募公債 5 9 6 回	100,000,000	100,422,000
	0100 0597	東京都公募公債 5 9 7 回	100,000,000	100,038,000
	0100 0598	東京都公募公債 5 9 8 回	100,000,000	99,637,000
	0100 0636	東京都公募公債 6 3 6 回	100,000,000	106,425,000
	0101 1404	北海道公募公債 平成14年度4回	100,000,000	101,974,000
	0103 0123	神奈川県公募公債 1 2 3 回	100,000,000	103,257,000
	0103 7001	神奈川県公募公債 1 回	100,000,000	107,012,000
	0104 0261	大阪府公募公債 2 6 1 回	100,000,000	102,868,000
	0104 8001	大阪府公募公債 1 回	100,000,000	103,974,000
	0106 1904	兵庫県公募公債 平成19年度4回	100,000,000	104,291,000
	0107 1503	静岡県公募公債 平成15年度3回	100,000,000	102,863,000
	0107 1901	静岡県公募公債 平成19年度1回	100,000,000	104,041,000
	0109 1801	広島県公募公債 平成18年度1回	100,000,000	106,616,000
	0110 1601	埼玉県公募公債 平成16年度1回	100,000,000	103,288,000
	0120 1603	千葉県公募公債 平成16年度3回	100,000,000	105,158,000
	0121 1701	新潟県公募公債 平成17年度1回	100,000,000	102,039,000
	0128 0055	共同発行市場公募地方債 5 5 回	100,000,000	104,389,000
	0128 0056	共同発行市場公募地方債 5 6 回	100,000,000	103,342,000
	0150 1605	大阪市公募公債 平成16年度5回	100,000,000	103,160,000
	0151 1240	名古屋市公募公債 1 2 回め号	100,000,000	104,705,000
	0154 1502	横浜市公募公債 平成15年度2回	100,000,000	99,960,000
	0155 1407	札幌市公募公債 平成14年度7回	100,000,000	100,357,000
	0183 0005	鹿児島県公募公債 平成18年度1回	100,000,000	105,223,000
地方債証券計		2,300,000,000	2,375,039,000	
特殊債券	0903 0004	政府保証日本政策投資銀行債券 政府保証第4回	100,000,000	101,757,000
	0903 9029	日本政策投資銀行債券(財投機関債)第2回	100,000,000	104,677,000

0905 0329	政府保証道路債券 政府保証第3 2 9回	100,000,000	104,092,000	
0905 0332	政府保証道路債券 政府保証第3 3 2回	100,000,000	103,683,000	
0905 0335	政府保証道路債券 政府保証第3 3 5回	100,000,000	103,175,000	
0905 0336	政府保証道路債券 政府保証第3 3 6回	100,000,000	103,154,000	
0905 0338	政府保証道路債券 政府保証第3 3 8回	100,000,000	103,679,000	
0905 0343	政府保証道路債券 政府保証第3 4 3回	100,000,000	102,516,000	
0905 8002	政府保証 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証第2回	100,000,000	101,880,000	
0905 8005	政府保証 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証第5回	100,000,000	104,027,000	
0906 0794	政府保証公営企業債券 政府保証第7 9 4回	100,000,000	101,643,863	
0906 0809	政府保証公営企業債券 政府保証第8 0 9回	100,000,000	102,258,000	
0906 0812	政府保証公営企業債券 政府保証第8 1 2回	100,000,000	102,610,000	
0906 0820	政府保証公営企業債券 政府保証第8 2 0回	100,000,000	102,485,000	
0906 0832	政府保証公営企業債券 政府保証第8 3 2回	100,000,000	103,143,000	
0906 0858	政府保証公営企業債券 政府保証第8 5 8回	100,000,000	103,535,000	
0906 9012	公営企業債券(財投機関債) 第1 2回	100,000,000	103,477,000	
0906 9020	公営企業債券(財投機関債) 第2 0回	100,000,000	106,406,000	
0907 0199	政府保証首都高速道路債券 政府保証第1 9 9回	100,000,000	103,016,000	
0910 0176	政府保証中小企業債券 政府保証第1 7 6回	100,000,000	103,863,000	
0910 9020	中小企業債券(財投機関債) 第2 0回	100,000,000	101,240,000	
0916 9025	国際協力銀行債券(財投機関債) 第2 5回	100,000,000	106,222,000	
0917 7007	政府保証都市再生債券 政府保証第7回	100,000,000	101,063,000	
0942 0108	政府保証預金保険機構債券 政府保証第1 0 8回	100,000,000	102,017,000	
0944 0014	政府保証国民生活債券 政府保証第1 4回	100,000,000	103,661,000	
0945 9008	農林漁業金融公庫債券(財投機関債) 第8回	200,000,000	205,946,000	
0949 0003	沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債) 第3回	100,000,000	103,670,000	
0949 0005	沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債) 第5回	200,000,000	204,894,000	
0953 1665	利附農林債券(5年) 利附第6 6 5号	100,000,000	100,478,000	
0953 1667	利附農林債券(5年) 利附第6 6 7号	100,000,000	100,573,000	
0953 1671	利附農林債券(5年) 利附第6 7 1号	100,000,000	101,568,000	
0953 1677	利附農林債券(5年) 利附第6 7 7号	100,000,000	101,720,000	
0958 0198	利附しんきん中金債券(5年) 利附第1 9 8回	100,000,000	101,796,000	
0958 0201	利附しんきん中金債券(5年) 利附第2 0 1回	100,000,000	102,045,000	
0958 0231	利附しんきん中金債券(5年) 利附第2 3 1回	100,000,000	102,287,000	
0958 0234	利附しんきん中金債券(5年) 利附第2 3 4回	100,000,000	101,353,000	
1094 1005	第5回韓国ガス公社円貨債券(2 0 0 5)	100,000,000	98,410,000	
特殊債券 計		3,900,000,000	4,004,019,863	
社債券				
0931 0324	東京交通債券 3 2 4回	100,000,000	115,320,000	
1212 1004	ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー 第2回円貨社債(2 0 0 4)	100,000,000	99,043,000	
1218 1011	エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第1 1回円貨社債(2 0 0 6)	100,000,000	98,350,000	
1236 1003	ドイツ銀行A Gロンドン支店 第3回円貨社債(2 0 0 7)	100,000,000	98,174,000	
2801 0401	キックマン(社債間限定同順位特約付) 4回	100,000,000	100,747,000	
4005 3201	住友化学(社債間限定同順位特約付) 3 2回	100,000,000	102,232,000	
4631 3001	大日本インキ化学工業(社債間限定同順位特約付) 3 0回	100,000,000	100,417,000	

5001 1901	新日本石油(社債間限定同順位特約付) 19回	100,000,000	102,730,000	
5233 1605	太平洋セメント(社債間限定同順位特約付) 16回	100,000,000	94,227,000	
5401 4901	新日本製鉄(社債間限定同順位特約付) 49回	100,000,000	100,099,000	
5411 0801	ジェイエフイーホールディングス(JFEスチール(株)保証付) 8回	100,000,000	101,558,000	
5711 2001	三菱マテリアル(社債間限定同順位特約付) 20回	100,000,000	101,083,000	
6201 1501	豊田自動織機(社債間限定同順位特約付) 15回	100,000,000	102,761,000	
7011 1701	三菱重工業(社債間限定同順位特約付) 17回	100,000,000	99,562,000	
8002 6601	丸紅(社債間限定同順位特約付) 66回	100,000,000	101,545,000	
8315 0085	三菱東京UFJ銀行(特定社債間限定同順位特約付) 85回	100,000,000	101,898,000	
8604 0501	野村ホールディングス 5回	100,000,000	100,004,000	
8801 2601	三井不動産(社債間限定同順位特約付) 26回	100,000,000	104,037,000	
8802 6501	三菱地所(担保提供制限等財務上特約無) 65回	100,000,000	89,867,000	
9020 3101	東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付) 31回	100,000,000	103,525,000	
9022 1601	東海旅客鉄道(社債間限定同順位特約付) 16回	100,000,000	102,976,000	
9075 0601	福山通運(社債間限定同順位特約付) 6回	100,000,000	100,050,000	
9101 2501	日本郵船(社債間限定同順位特約付) 25回	100,000,000	103,514,000	
9101 2601	日本郵船(社債間限定同順位特約付) 26回	100,000,000	102,585,000	
9501 0496	東京電力 496回	100,000,000	102,579,000	
9501 0510	東京電力 510回	100,000,000	102,843,000	
9501 0523	東京電力 523回	100,000,000	105,069,000	
9502 0461	中部電力 461回	100,000,000	101,256,000	
9503 0433	関西電力 433回	100,000,000	102,167,000	
9503 0451	関西電力 451回	100,000,000	104,812,000	
9504 0306	中国電力 306回	100,000,000	116,502,000	
9506 0434	東北電力 434回	100,000,000	105,205,000	
9507 0257	四国電力 257回	100,000,000	102,512,000	
社債券計		3,300,000,000	3,369,249,000	
合計		36,331,000,000	37,308,153,083	

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。

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

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		603,954,368	167,407,122
コール・ローン		521,014,011	137,385,907
国債証券		610,217,463,728	714,012,210,023
派生商品評価勘定		153,715,436	-
未収入金		3,456,424,251	-
未収利息		9,708,088,037	10,243,226,776
前払費用		833,467,462	766,432,695
流動資産合計		625,494,127,293	725,326,662,523
資産合計		625,494,127,293	725,326,662,523
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,131,050	89,700
未払金		472,035,664	64,476,025
未払解約金		4,105,278,212	160,186,079
流動負債合計		4,578,444,926	224,751,804
負債合計		4,578,444,926	224,751,804
純資産の部			
元本等			
元本		444,628,186,777	449,277,081,384
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		176,287,495,590	275,824,829,335
元本等合計		620,915,682,367	725,101,910,719
純資産合計		620,915,682,367	725,101,910,719
負債純資産合計		625,494,127,293	725,326,662,523

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法		<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引</p> <p>同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1. 期首	平成19年10月27日	1. 期首	平成20年10月28日
期首元本額	512,655,085,446 円	期首元本額	444,628,186,777 円
期首からの追加設定元本額	81,577,025,985 円	期首からの追加設定元本額	61,931,959,357 円
期首からの解約元本額	149,603,924,654 円	期首からの解約元本額	57,283,064,750 円
平成20年10月27日現在の元本の内訳		平成21年10月26日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	7,460,997,961 円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	8,060,127,791 円
DCインデックスバランス(株式20)	38,133,946 円	DCインデックスバランス(株式20)	41,810,491 円
DCインデックスバランス(株式40)	66,269,775 円	DCインデックスバランス(株式40)	77,088,517 円
DCインデックスバランス(株式60)	80,770,311 円	DCインデックスバランス(株式60)	99,139,127 円
DCインデックスバランス(株式80)	63,387,070 円	DCインデックスバランス(株式80)	82,223,185 円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	244,963,242,774 円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	245,731,313,235 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	11,062,366,295 円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	10,594,265,493 円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	161,013,814,829 円	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	163,693,803,361 円
グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	11,667,592 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	42,823,442 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	25,624,517 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)	1,513,043,585 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)	468,145,825 円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	436,606 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)	147,070,015 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)	217,794,606 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,996,663 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,044,043 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	7,736,397 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,293,797 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	21,499,342 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	21,414,946 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	63,747,495 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	56,088,292 円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,520,098,880 円	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,429,503,892 円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,869,869,308 円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,998,589,896 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)	246,470,928 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)	162,259,567 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)	607,985,821 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)	256,319,280 円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	241,213,389 円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	90,956,960 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	39,323,132 円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	73,354,107 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	52,873,238 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	43,743,637 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	43,882,094 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	57,047,488 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	31,600,974 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	50,614,396 円
年金積立インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)	12,312,400,270 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	39,119,042 円

海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	161,997,936	円	年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッジ なし)	12,646,496,208	円
(合計)	444,628,186,777	円	海外債券インデックスファ ンド(個人型年金向け)	182,366,394	円
2. 本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	444,628,186,777	円	(合計)	449,277,081,384	円
			2. 本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	449,277,081,384	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

(有価証券に関する注記)

対象期間(自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	610,217,463,728	10,038,523,888
合計	610,217,463,728	10,038,523,888

対象期間(自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	714,012,210,023	11,965,413,808
合計	714,012,210,023	11,965,413,808

(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報告書における開示対象ファンドの期
末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（単位：円）

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	3,670,579,376	-	3,516,872,060	153,707,316
	アメリカドル	1,308,620,880	-	1,270,749,800	37,871,080
	カナダドル	93,158,876	-	88,687,940	4,470,936
	イギリスポンド	281,603,820	-	268,358,320	13,245,500
	ユーロ	1,987,195,800	-	1,889,076,000	98,119,800
	買建	22,508,730	-	21,385,800	1,122,930
	ユーロ	22,508,730	-	21,385,800	1,122,930
	合計	3,693,088,106	-	3,538,257,860	152,584,386

（単位：円）

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	86,123,200	-	86,212,900	89,700
	オーストラリアドル	36,446,800	-	36,511,300	64,500
	ユーロ	49,676,400	-	49,701,600	25,200
	合計	86,123,200	-	86,212,900	89,700

（注）時価の算定方法

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

いる対顧客先物相場の仲値を用います。

2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

（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20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3965 円	1口当たり純資産額	1.6139 円
（1万口当たり純資産額）	（13,965 円）	（1万口当たり純資産額）	（16,139 円）

[次へ](#)

(3) 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

(外貨建債券)

外貨建債券(アメリカドル)

(単位:アメリカドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	110I01	アメリカ国債 2% 20100930	26,600,000.00	26,994,842.42	
	110J00	アメリカ国債 4.25% 20101015	10,500,000.00	10,890,468.74	
	110J02	アメリカ国債 1.5% 20101031	25,000,000.00	25,266,600.00	
	110K00	アメリカ国債 4.5% 20101115	10,000,000.00	10,425,390.00	
	110K01	アメリカ国債 1.25% 20101130	26,880,000.00	27,103,649.66	
	110L00	アメリカ国債 4.375% 20101215	9,500,000.00	9,921,933.00	
	110L01	アメリカ国債 0.875% 20101231	28,000,000.00	28,111,560.40	
	111A00	アメリカ国債 4.25% 20110115	8,680,000.00	9,071,277.89	
	111A01	アメリカ国債 0.875% 20110131	27,500,000.00	27,600,974.50	
	111B00	アメリカ国債 5% 20110215	15,600,000.00	16,481,155.07	
	111B01	アメリカ国債 4.5% 20110228	12,800,000.00	13,458,999.04	
	111B02	アメリカ国債 0.875% 20110228	27,400,000.00	27,486,693.60	
	111C00	アメリカ国債 4.75% 20110331	10,400,000.00	10,994,343.35	
	111C01	アメリカ国債 0.875% 20110331	27,000,000.00	27,073,826.10	
	111D00	アメリカ国債 4.875% 20110430	10,750,000.00	11,420,615.10	
	111D01	アメリカ国債 0.875% 20110430	26,700,000.00	26,758,406.25	
	111E00	アメリカ国債 4.875% 20110531	13,180,000.00	14,045,966.85	
	111E01	アメリカ国債 0.875% 20110531	26,000,000.00	26,044,686.19	
	111F00	アメリカ国債 5.125% 20110630	10,000,000.00	10,714,842.98	
	111F01	アメリカ国債 1.125% 20110630	28,000,000.00	28,140,000.00	
	111G00	アメリカ国債 4.875% 20110731	13,000,000.00	13,907,459.80	
	111G01	アメリカ国債 1% 20110731	27,500,000.00	27,560,156.25	
	111H00	アメリカ国債 5% 20110815	17,000,000.00	18,259,062.48	
	111H01	アメリカ国債 4.625% 20110831	14,000,000.00	14,939,530.20	
	111H02	アメリカ国債 1% 20110831	21,600,000.00	21,622,779.36	
	111I00	アメリカ国債 4.5% 20110930	14,400,000.00	15,362,436.96	
	111I01	アメリカ国債 1% 20110930	25,000,000.00	25,000,000.00	
	111J00	アメリカ国債 4.625% 20111031	10,400,000.00	11,143,031.12	
	111K00	アメリカ国債 4.5% 20111130	11,830,000.00	12,669,190.62	
	111K01	アメリカ国債 1.75% 20111115	18,000,000.00	18,247,500.00	
	111L00	アメリカ国債 4.625% 20111231	10,000,000.00	10,749,218.00	
	111L01	アメリカ国債 1.125% 20111215	21,600,000.00	21,597,468.48	
	112A00	アメリカ国債 4.75% 20120131	11,050,000.00	11,921,913.51	
	112A01	アメリカ国債 1.125% 20120115	23,000,000.00	22,963,163.20	
	112B00	アメリカ国債 4.875% 20120215	18,700,000.00	20,252,975.14	
	112B01	アメリカ国債 4.625% 20120229	9,100,000.00	9,815,558.47	
	112B02	アメリカ国債 1.375% 20120215	23,900,000.00	23,971,886.42	
	112C00	アメリカ国債 4.5% 20120331	9,450,000.00	10,174,991.71	
	112C01	アメリカ国債 1.375% 20120315	21,000,000.00	21,049,217.69	
	112D00	アメリカ国債 4.5% 20120430	9,100,000.00	9,826,933.48	
	112D01	アメリカ国債 1.375% 20120415	19,700,000.00	19,733,858.39	
	112E00	アメリカ国債 4.75% 20120531	9,110,000.00	9,907,836.49	
112E01	アメリカ国債 1.375% 20120515	20,950,000.00	20,971,276.82		
112F00	アメリカ国債 4.875% 20120630	8,430,000.00	9,211,421.37		
112F01	アメリカ国債 1.875% 20120615	16,000,000.00	16,208,748.79		
112G00	アメリカ国債 4.625% 20120731	8,200,000.00	8,919,421.26		
112G01	アメリカ国債 1.5% 20120715	26,800,000.00	26,877,468.08		
112H00	アメリカ国債 4.375% 20120815	14,000,000.00	15,142,968.39		
112H01	アメリカ国債 4.125% 20120831	10,000,000.00	10,748,828.00		

112H02	アメリカ国債 1.75% 20120815	21,500,000.00	21,667,128.10	
112I00	アメリカ国債 4.25% 20120930	10,000,000.00	10,790,234.00	
112I01	アメリカ国債 1.375% 20120915	12,800,000.00	12,751,499.52	
112J00	アメリカ国債 3.875% 20121031	9,800,000.00	10,479,108.64	
112K00	アメリカ国債 4% 20121115	14,400,000.00	15,454,124.63	
112K01	アメリカ国債 3.375% 20121130	10,350,000.00	10,905,907.81	
112L00	アメリカ国債 3.625% 20121231	9,800,000.00	10,404,460.07	
113A00	アメリカ国債 2.875% 20130131	10,000,000.00	10,375,390.00	
113B00	アメリカ国債 3.875% 20130215	13,550,000.00	14,469,917.60	
113B01	アメリカ国債 2.75% 20130228	10,900,000.00	11,254,675.10	
113C00	アメリカ国債 2.5% 20130331	12,800,000.00	13,106,999.04	
113D00	アメリカ国債 3.125% 20130430	14,600,000.00	15,250,155.52	
113E00	アメリカ国債 3.625% 20130515	8,000,000.00	8,486,874.39	
113E01	アメリカ国債 3.5% 20130531	14,900,000.00	15,743,362.35	
113F00	アメリカ国債 3.375% 20130630	13,950,000.00	14,690,002.86	
113G00	アメリカ国債 3.375% 20130731	12,500,000.00	13,158,202.50	
113H00	アメリカ国債 4.25% 20130815	18,400,000.00	19,964,000.00	
113H01	アメリカ国債 3.125% 20130831	18,000,000.00	18,762,186.60	
113I00	アメリカ国債 3.125% 20130930	17,400,000.00	18,128,625.00	
113J00	アメリカ国債 2.75% 20131031	14,500,000.00	14,884,589.30	
113K00	アメリカ国債 4.25% 20131115	21,970,000.00	23,868,344.20	
113K01	アメリカ国債 2% 20131130	17,900,000.00	17,840,564.84	
113L00	アメリカ国債 1.5% 20131231	23,000,000.00	22,413,318.30	
114A00	アメリカ国債 1.75% 20140131	20,550,000.00	20,195,189.86	
114B00	アメリカ国債 4% 20140215	19,580,000.00	21,063,795.86	
114B01	アメリカ国債 1.875% 20140228	19,000,000.00	18,742,460.70	
114C00	アメリカ国債 1.75% 20140331	20,500,000.00	20,082,792.20	
114D00	アメリカ国債 1.875% 20140430	21,500,000.00	21,126,267.65	
114E00	アメリカ国債 4.75% 20140515	16,050,000.00	17,787,913.26	
114E01	アメリカ国債 2.25% 20140531	25,000,000.00	24,943,357.49	
114F00	アメリカ国債 2.625% 20140630	26,500,000.00	26,840,564.75	
114G00	アメリカ国債 2.625% 20140731	20,400,000.00	20,634,279.71	
114H00	アメリカ国債 4.25% 20140815	18,450,000.00	20,054,284.69	
114H01	アメリカ国債 2.375% 20140831	21,400,000.00	21,374,921.34	
114I00	アメリカ国債 2.375% 20140930	24,400,000.00	24,339,951.60	
114K01	アメリカ国債 4.25% 20141115	19,780,000.00	21,470,570.87	
115B00	アメリカ国債 4% 20150215	27,300,000.00	29,253,656.23	
115E00	アメリカ国債 4.125% 20150515	18,000,000.00	19,385,155.78	
115H00	アメリカ国債 4.25% 20150815	21,000,000.00	22,725,937.48	
115K01	アメリカ国債 4.5% 20151115	16,100,000.00	17,648,365.98	
116B00	アメリカ国債 4.5% 20160215	15,800,000.00	17,294,826.93	
116B01	アメリカ国債 2.625% 20160229	13,800,000.00	13,559,577.78	
116C00	アメリカ国債 2.375% 20160331	14,600,000.00	14,108,390.26	
116D00	アメリカ国債 2.625% 20160430	13,700,000.00	13,417,437.50	
116E00	アメリカ国債 5.125% 20160515	15,900,000.00	17,973,210.53	
116E01	アメリカ国債 3.25% 20160531	11,600,000.00	11,781,250.00	
116F00	アメリカ国債 3.25% 20160630	15,000,000.00	15,233,202.00	
116G00	アメリカ国債 3.25% 20160731	15,600,000.00	15,829,125.00	
116H00	アメリカ国債 4.875% 20160815	14,650,000.00	16,329,026.22	
116H01	アメリカ国債 3% 20160831	9,500,000.00	9,468,827.65	
116I01	アメリカ国債 3% 20160930	16,200,000.00	16,115,202.72	
116K00	アメリカ国債 4.625% 20161115	15,000,000.00	16,483,593.00	
117B00	アメリカ国債 4.625% 20170215	13,050,000.00	14,331,550.45	
117E00	アメリカ国債 4.5% 20170515	14,330,000.00	15,593,950.40	
117H00	アメリカ国債 4.75% 20170815	18,450,000.00	20,378,600.63	
117K00	アメリカ国債 4.25% 20171115	17,900,000.00	19,118,037.72	
118B00	アメリカ国債 3.5% 20180215	26,000,000.00	26,312,811.20	
118E00	アメリカ国債 3.875% 20180515	19,850,000.00	20,600,578.12	
118H00	アメリカ国債 4% 20180815	23,400,000.00	24,454,827.54	
118K01	アメリカ国債 3.75% 20181115	39,300,000.00	40,251,794.91	
119B00	アメリカ国債 2.75% 20190215	42,200,000.00	39,839,437.49	
119E00	アメリカ国債 3.125% 20190515	48,000,000.00	46,668,748.80	

119H00	アメリカ国債 3.625% 20190815	21,000,000.00	21,262,500.00	
138B00	アメリカ国債 4.375% 20380215	12,000,000.00	12,157,500.00	
215020	アメリカ国債 11.25% 20150215	5,000,000.00	7,152,343.48	
216110	アメリカ国債 7.5% 20161115	10,200,000.00	13,050,421.60	
216E00	アメリカ国債 7.25% 20160515	9,000,000.00	11,299,921.18	
217050	アメリカ国債 8.75% 20170515	8,000,000.00	10,985,000.00	
217080	アメリカ国債 8.875% 20170815	4,000,000.00	5,552,812.39	
219020	アメリカ国債 8.875% 20190215	7,700,000.00	11,022,429.10	
219022	アメリカ国債 8.125% 20190815	9,000,000.00	12,428,437.49	
220080	アメリカ国債 8.75% 20200815	8,650,000.00	12,548,581.79	
220B00	アメリカ国債 8.5% 20200215	5,400,000.00	7,674,750.00	
221020	アメリカ国債 7.875% 20210215	5,000,000.00	6,890,233.99	
221050	アメリカ国債 8.125% 20210515	6,600,000.00	9,263,718.42	
221080	アメリカ国債 8.125% 20210815	4,060,000.00	5,712,863.74	
221110	アメリカ国債 8% 20211115	15,000,000.00	20,970,702.00	
222080	アメリカ国債 7.25% 20220815	4,000,000.00	5,322,187.20	
223020	アメリカ国債 7.125% 20230215	8,000,000.00	10,556,874.38	
223080	アメリカ国債 6.25% 20230815	14,800,000.00	18,209,780.86	
224K01	アメリカ国債 7.5% 20241115	6,500,000.00	8,955,781.24	
225020	アメリカ国債 7.625% 20250215	7,000,000.00	9,757,890.10	
225080	アメリカ国債 6.875% 20250815	5,000,000.00	6,578,125.00	
226020	アメリカ国債 6% 20260215	8,300,000.00	10,061,156.24	
226080	アメリカ国債 6.75% 20260815	3,310,000.00	4,325,497.39	
226110	アメリカ国債 6.5% 20261115	6,700,000.00	8,558,726.06	
227080	アメリカ国債 6.375% 20270815	4,000,000.00	5,069,687.19	
227110	アメリカ国債 6.125% 20271115	12,500,000.00	15,463,866.22	
228H00	アメリカ国債 5.5% 20280815	7,370,000.00	8,544,017.41	
228K00	アメリカ国債 5.25% 20281115	6,100,000.00	6,878,226.40	
229B00	アメリカ国債 5.25% 20290215	8,400,000.00	9,470,343.12	
229H00	アメリカ国債 6.125% 20290815	6,000,000.00	7,492,968.59	
230B00	アメリカ国債 6.25% 20300515	10,000,000.00	12,708,592.96	
231B00	アメリカ国債 5.375% 20310215	11,300,000.00	13,014,421.26	
236B00	アメリカ国債 4.5% 20360215	18,700,000.00	19,332,585.44	
237B00	アメリカ国債 4.75% 20370215	10,900,000.00	11,713,241.36	
237E00	アメリカ国債 5% 20370515	10,500,000.00	11,711,601.30	
238E00	アメリカ国債 4.5% 20380515	16,500,000.00	17,069,764.80	
239B00	アメリカ国債 3.5% 20390215	21,000,000.00	18,219,140.09	
239E00	アメリカ国債 4.25% 20390515	22,300,000.00	22,148,429.12	
239H00	アメリカ国債 4.5% 20390815	14,000,000.00	14,496,561.80	
N00106	アメリカ国債 6.625% 20270215	4,000,000.00	5,175,624.78	
国債証券 計		2,341,460,000.00	2,473,232,979.78	
アメリカドル 計		2,341,460,000.00	2,473,232,979.78	
(邦貨換算額)		(215,531,393,000)	(227,661,095,789)	

外貨建債券(カナダドル)

(単位:カナダドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	310L00	カナダ国債 2.75% 20101201	8,800,000.00	9,000,552.00
	311F00	カナダ国債 6% 20110601	7,100,000.00	7,648,688.00
	311F02	カナダ国債 1.25% 20110601	9,340,000.00	9,360,454.60
	311100	カナダ国債 3.75% 20110901	6,500,000.00	6,785,935.00
	311101	カナダ国債 1% 20110901	6,950,000.00	6,907,744.00
	311L00	カナダ国債 1.25% 20111201	3,600,000.00	3,580,920.00
	312F00	カナダ国債 5.25% 20120601	7,750,000.00	8,427,815.00
	312F01	カナダ国債 3.75% 20120601	5,200,000.00	5,456,568.00
	312100	カナダ国債 2% 20120901	7,600,000.00	7,604,788.00
	313F00	カナダ国債 5.25% 20130601	6,800,000.00	7,488,160.00
	313F01	カナダ国債 3.5% 20130601	11,500,000.00	11,967,475.00
	314F00	カナダ国債 5% 20140601	8,000,000.00	8,819,760.00
	314F01	カナダ国債 3% 20140601	11,800,000.00	11,985,496.00
	314L00	カナダ国債 2% 20141201	10,300,000.00	9,935,895.00
	315F00	カナダ国債 4.5% 20150601	7,550,000.00	8,200,206.00
	316F00	カナダ国債 4% 20160601	7,650,000.00	8,103,109.50

317F00	カナダ国債 4% 20170601	7,900,000.00	8,324,862.00	
318F00	カナダ国債 4.25% 20180601	8,100,000.00	8,645,454.00	
319F00	カナダ国債 3.75% 20190601	13,600,000.00	13,897,160.00	
320F00	カナダ国債 3.5% 20200601	400,000.00	394,700.00	
323F00	カナダ国債 8% 20230601	3,200,000.00	4,579,136.00	
325F00	カナダ国債 9% 20250601	2,700,000.00	4,246,560.00	
327F00	カナダ国債 8% 20270601	5,000,000.00	7,461,600.00	
329F00	カナダ国債 5.75% 20290601	9,700,000.00	11,896,953.00	
333F00	カナダ国債 5.75% 20330601	9,750,000.00	12,233,032.50	
337F00	カナダ国債 5% 20370601	10,300,000.00	12,092,200.00	
341F00	カナダ国債 4% 20410601	6,000,000.00	6,050,820.00	
国債証券 計		203,090,000.00	221,096,043.60	
カナダドル 計		203,090,000.00	221,096,043.60	
(邦貨換算額)		(17,752,096,900)	(19,326,005,171)	

外貨建債券(オーストラリアドル)

(単位:オーストラリアドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	311F00	オーストラリア国債 5.75% 20110615	8,150,000.00	8,255,102.40	
	312D00	オーストラリア国債 5.75% 20120415	8,000,000.00	8,086,160.00	
	313E00	オーストラリア国債 6.5% 20130515	8,700,000.00	8,987,491.50	
	314F00	オーストラリア国債 6.25% 20140615	5,100,000.00	5,242,902.00	
	315D00	オーストラリア国債 6.25% 20150415	6,400,000.00	6,596,889.60	
	317B00	オーストラリア国債 6% 20170215	7,600,000.00	7,759,060.40	
	319C00	オーストラリア国債 5.25% 20190315	6,400,000.00	6,194,592.00	
	320D00	オーストラリア国債 4.5% 20200415	2,100,000.00	1,888,609.80	
	321E00	オーストラリア国債 5.75% 20210515	5,600,000.00	5,574,016.00	
国債証券 計		58,050,000.00	58,584,823.70		
オーストラリアドル 計		58,050,000.00	58,584,823.70		
(邦貨換算額)		(4,929,606,000)	(4,975,023,229)		

外貨建債券(イギリスポンド)

(単位:イギリスポンド)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	310K00	イギリス国債 6.25% 20101125	5,160,000.00	5,465,141.76	
	311C00	イギリス国債 4.25% 20110307	17,800,000.00	18,607,052.00	
	311G00	イギリス国債 9% 20110712	5,180,000.00	5,866,774.76	
	311L00	イギリス国債 3.25% 20111207	12,050,000.00	12,503,754.80	
	312C00	イギリス国債 5% 20120307	20,200,000.00	21,760,066.20	
	312F00	イギリス国債 5.25% 20120607	12,450,000.00	13,522,368.30	
	313C00	イギリス国債 4.5% 20130307	17,800,000.00	19,087,064.60	
	313I00	イギリス国債 8% 20130927	6,300,000.00	7,632,103.50	
	314C00	イギリス国債 2.25% 20140307	18,300,000.00	17,998,178.10	
	314I00	イギリス国債 5% 20140907	9,050,000.00	9,978,973.45	
	315I00	イギリス国債 4.75% 20150907	10,000,000.00	10,979,230.00	
	315L00	イギリス国債 8% 20151207	4,000,000.00	5,113,488.00	
	316I00	イギリス国債 4% 20160907	14,800,000.00	15,594,256.80	
	317H00	イギリス国債 8.75% 20170825	5,500,000.00	7,557,533.50	
	318C00	イギリス国債 5% 20180307	6,900,000.00	7,685,116.50	
	319C00	イギリス国債 4.5% 20190307	16,290,000.00	17,353,867.32	
	319I00	イギリス国債 3.75% 20190907	4,500,000.00	4,494,271.50	
	320C00	イギリス国債 4.75% 20200307	5,500,000.00	5,959,761.50	
	321F00	イギリス国債 8% 20210607	7,950,000.00	11,060,628.30	
	322C00	イギリス国債 4% 20220307	4,000,000.00	4,024,668.00	
	325C00	イギリス国債 5% 20250307	12,500,000.00	13,792,150.00	
	327L00	イギリス国債 4.25% 20271207	10,500,000.00	10,677,355.50	
	328L00	イギリス国債 6% 20281207	7,300,000.00	9,143,724.50	
	330L00	イギリス国債 4.75% 20301207	11,000,000.00	11,867,779.00	
	332F00	イギリス国債 4.25% 20320607	12,000,000.00	12,152,928.00	
	334I00	イギリス国債 4.5% 20340907	4,500,000.00	4,700,430.00	
	336C00	イギリス国債 4.25% 20360307	15,350,000.00	15,416,665.05	
	338L00	イギリス国債 4.75% 20381207	13,000,000.00	14,201,707.00	
	339I00	イギリス国債 4.25% 20390907	5,000,000.00	5,047,020.00	

	342L00	イギリス国債 4.5% 20421207	14,450,000.00	15,265,095.60	
	346L00	イギリス国債 4.25% 20461207	14,000,000.00	14,227,514.00	
	349L00	イギリス国債 4.25% 20491207	10,150,000.00	10,428,282.55	
	355L00	イギリス国債 4.25% 20551207	11,200,000.00	11,441,819.20	
国債証券 計			344,680,000.00	370,606,769.29	
イギリスポンド 計			344,680,000.00	370,606,769.29	
(邦貨換算額)			(51,602,042,800)	(55,483,539,430)	

外貨建債券(スイスフラン)

(単位:スイスフラン)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	306F00	スイス国債 4% 20110610	5,600,000.00	5,910,996.00	
	312F00	スイス国債 2.75% 20120610	6,100,000.00	6,389,286.40	
	313B00	スイス国債 4% 20130211	9,900,000.00	10,819,848.60	
	314A00	スイス国債 4.25% 20140106	1,100,000.00	1,232,044.00	
	316C00	スイス国債 2.5% 20160312	4,600,000.00	4,823,518.60	
	317F00	スイス国債 4.25% 20170605	700,000.00	814,856.70	
	318A00	スイス国債 3% 20180108	5,800,000.00	6,212,658.40	
	319E00	スイス国債 3% 20190512	2,600,000.00	2,785,335.80	
	323B00	スイス国債 4% 20230211	7,180,000.00	8,366,236.52	
	328D00	スイス国債 4% 20280408	3,200,000.00	3,783,561.60	
国債証券 計			46,780,000.00	51,138,342.62	
スイスフラン 計			46,780,000.00	51,138,342.62	
(邦貨換算額)			(4,269,142,800)	(4,666,885,148)	

外貨建債券(スウェーデンクローナ)

(単位:スウェーデンクローナ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311C00	スウェーデン国債 5.25% 20110315	38,800,000.00	41,228,880.00	
	312J00	スウェーデン国債 5.5% 20121008	46,300,000.00	50,855,920.00	
	314E00	スウェーデン国債 6.75% 20140505	56,000,000.00	65,766,512.00	
	315H00	スウェーデン国債 4.5% 20150812	28,280,000.00	30,627,240.00	
	316G00	スウェーデン国債 3% 20160712	30,000,000.00	29,834,850.00	
	317H01	スウェーデン国債 3.75% 20170812	40,000,000.00	41,475,800.00	
	319C00	スウェーデン国債 4.25% 20190312	55,000,000.00	58,939,540.00	
	320L00	スウェーデン国債 5% 20201201	40,000,000.00	45,691,520.00	
	339C00	スウェーデン国債 3.5% 20390330	28,500,000.00	26,356,087.50	
国債証券 計			362,880,000.00	390,776,349.50	
スウェーデンクローナ 計			362,880,000.00	390,776,349.50	
(邦貨換算額)			(4,920,652,800)	(5,298,927,299)	

外貨建債券(シンガポールドル)

(単位:シンガポールドル)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310J00	シンガポール国債 2.5% 20121001	1,500,000.00	1,571,913.00	
	311B00	シンガポール国債 3.125% 20110201	3,300,000.00	3,410,078.10	
	311G00	シンガポール国債 3.625% 20110701	4,600,000.00	4,835,083.00	
	312D00	シンガポール国債 2.625% 20120401	2,100,000.00	2,198,084.70	
	312G00	シンガポール国債 3.5% 20120701	2,300,000.00	2,464,928.40	
	313D00	シンガポール国債 1.625% 20130401	1,900,000.00	1,940,836.70	
	313G04	シンガポール国債 2.25% 20130701	2,800,000.00	2,918,535.20	
	314G00	シンガポール国債 3.625% 20140701	4,200,000.00	4,633,015.80	
	315G05	シンガポール国債 2.875% 20150701	1,600,000.00	1,691,646.40	
	316I00	シンガポール国債 3.75% 20160901	3,800,000.00	4,179,156.40	
	318I00	シンガポール国債 4% 20180901	3,000,000.00	3,321,603.00	
	319F00	シンガポール国債 2.5% 20190601	1,150,000.00	1,138,372.35	
	320I00	シンガポール国債 3.25% 20200901	2,450,000.00	2,532,464.55	
	322I00	シンガポール国債 3.125% 20220901	2,300,000.00	2,310,131.50	
	327C00	シンガポール国債 3.5% 20270301	3,100,000.00	3,177,196.20	
	国債証券 計			40,100,000.00	42,323,045.30
シンガポールドル 計			40,100,000.00	42,323,045.30	
(邦貨換算額)			(2,645,397,000)	(2,792,051,298)	

[次へ](#)

外貨建債券(マレーシアリングット)

(単位:マレーシアリングット)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311D00	マレーシア国債 3.756% 20110428	14,100,000.00	14,392,842.90	
	311I00	マレーシア国債 3.833% 20110928	13,500,000.00	13,829,859.00	
	312B00	マレーシア国債 2.711% 20120214	3,000,000.00	3,001,602.00	
	312F00	マレーシア国債 3.718% 20120615	10,500,000.00	10,735,042.50	
	312H00	マレーシア国債 2.509% 20120827	10,000,000.00	9,889,740.00	
	313B00	マレーシア国債 3.702% 20130225	11,900,000.00	12,104,192.10	
	313G00	マレーシア国債 3.461% 20130731	6,300,000.00	6,320,487.60	
	314D00	マレーシア国債 5.094% 20140430	18,450,000.00	19,525,561.20	
	315B00	マレーシア国債 3.741% 20150227	3,300,000.00	3,274,788.00	
	315I00	マレーシア国債 4.72% 20150930	5,200,000.00	5,405,987.60	
	316I00	マレーシア国債 4.262% 20160915	7,950,000.00	8,059,201.20	
	317B00	マレーシア国債 3.814% 20170215	6,800,000.00	6,690,696.80	
	318B00	マレーシア国債 4.24% 20180207	11,600,000.00	11,664,936.80	
	319G00	マレーシア国債 5.734% 20190730	5,000,000.00	5,585,520.00	
	319K00	マレーシア国債 4.378% 20191129	6,600,000.00	6,655,400.40	
	327E00	マレーシア国債 3.502% 20270531	3,800,000.00	3,278,461.40	
328I00	マレーシア国債 5.248% 20280915	3,500,000.00	3,743,729.50		
国債証券計			141,500,000.00	144,158,049.00	
マレーシアリングット計			141,500,000.00	144,158,049.00	
(邦貨換算額)			(3,848,800,000)	(3,921,098,933)	

外貨建債券(デンマーククローネ)

(単位:デンマーククローネ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310K00	デンマーク国債 4% 20101115	40,000,000.00	41,087,600.00	
	311K00	デンマーク国債 6% 20111115	45,000,000.00	48,707,325.00	
	313K00	デンマーク国債 5% 20131115	56,500,000.00	61,366,288.50	
	315K00	デンマーク国債 4% 20151115	47,000,000.00	48,970,522.00	
	317K00	デンマーク国債 4% 20171115	40,500,000.00	41,833,462.50	
	319K00	デンマーク国債 4% 20191115	22,000,000.00	22,482,768.00	
	324K00	デンマーク国債 7% 20241110	18,500,000.00	24,637,005.00	
	339K00	デンマーク国債 4.5% 20391115	65,900,000.00	69,121,785.10	
国債証券計			335,400,000.00	358,206,756.10	
デンマーククローネ計			335,400,000.00	358,206,756.10	
(邦貨換算額)			(6,221,670,000)	(6,644,735,326)	

外貨建債券(ノルウェークローネ)

(単位:ノルウェークローネ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311E01	ノルウェー国債 6% 20110516	33,700,000.00	35,483,471.40	
	313E00	ノルウェー国債 6.5% 20130515	41,220,000.00	45,544,555.08	
	315E00	ノルウェー国債 5% 20150515	29,900,000.00	31,818,443.80	
	317E00	ノルウェー国債 4.25% 20170519	25,800,000.00	26,378,771.40	
国債証券計			130,620,000.00	139,225,241.68	
ノルウェークローネ計			130,620,000.00	139,225,241.68	
(邦貨換算額)			(2,164,373,400)	(2,306,962,255)	

外貨建債券(ポーランドズロチ)

(単位:ポーランドズロチ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310K00	ポーランド国債 6% 20101124	21,000,000.00	21,367,500.00	
	311E00	ポーランド国債 4.25% 20110524	32,500,000.00	32,370,000.00	
	312D00	ポーランド国債 4.75% 20120425	26,500,000.00	26,407,250.00	
	313D00	ポーランド国債 5.25% 20130425	16,200,000.00	16,261,560.00	
	313J00	ポーランド国債 5% 20131024	18,500,000.00	18,248,400.00	
	314D00	ポーランド国債 5.75% 20140425	17,400,000.00	17,504,400.00	
	315J00	ポーランド国債 6.25% 20151024	21,500,000.00	22,069,750.00	
	317J00	ポーランド国債 5.25% 20171025	21,000,000.00	20,107,500.00	
	319J00	ポーランド国債 5.5% 20191025	11,500,000.00	11,002,050.00	
	322I00	ポーランド国債 5.75% 20220923	18,400,000.00	17,774,400.00	

国債証券 計	204,500,000.00	203,112,810.00	
ポーランドズロチ 計	204,500,000.00	203,112,810.00	
(邦貨換算額)	(6,768,950,000)	(6,723,034,011)	

外貨建債券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	304D00	フランス国債 5.5% 20290425	12,800,000.00	14,832,896.00	
	310J00	フランス国債 5.5% 20101025	12,100,000.00	12,654,192.10	
	310J01	ドイツ国債 2.5% 20101008	12,000,000.00	12,190,176.00	
	310K00	イタリア国債 5.5% 20101101	15,750,000.00	16,467,444.00	
	310L00	ドイツ国債 2.25% 20101210	10,000,000.00	10,147,460.00	
	311A00	ドイツ国債 5.25% 20110104	17,000,000.00	17,856,664.00	
	311A01	オーストリア国債 5.25% 20110104	5,900,000.00	6,189,459.90	
	311A02	フランス国債 3% 20110112	17,000,000.00	17,411,587.00	
	311A03	オランダ国債 4% 20110115	10,000,000.00	10,360,320.00	
	311B00	フィンランド国債 5.75% 20110223	4,100,000.00	4,352,350.90	
	311B01	イタリア国債 3.75% 20110201	14,000,000.00	14,444,836.00	
	311C00	イタリア国債 3.5% 20110315	13,000,000.00	13,394,420.00	
	311C01	ベルギー国債 3.5% 20110328	8,450,000.00	8,721,853.40	
	311C02	ギリシャ国債 3.8% 20110320	6,200,000.00	6,393,006.00	
	311C03	ドイツ国債 1.25% 20110311	11,150,000.00	11,174,061.70	
	311D00	フランス国債 6.5% 20110425	13,500,000.00	14,552,986.50	
	311D01	ポルトガル国債 3.2% 20110415	4,300,000.00	4,416,375.20	
	311D02	ドイツ国債 3.5% 20110408	14,900,000.00	15,400,982.70	
	311D03	スペイン国債 4.1% 20110430	12,300,000.00	12,810,167.10	
	311E00	ギリシャ国債 5.35% 20110518	4,900,000.00	5,178,829.60	
	311F01	ポルトガル国債 5.15% 20110615	4,000,000.00	4,237,552.00	
	311F02	ドイツ国債 1.5% 20110610	11,150,000.00	11,196,941.50	
	311G00	ドイツ国債 5% 20110704	18,250,000.00	19,365,750.25	
	311G01	スペイン国債 5.4% 20110730	11,000,000.00	11,749,584.00	
	311G02	オランダ国債 5% 20110715	10,200,000.00	10,829,931.60	
	311G03	フランス国債 3.5% 20110712	16,350,000.00	16,933,629.60	
	311H00	イタリア国債 5.25% 20110801	16,000,000.00	17,021,760.00	
	311H01	ギリシャ国債 3.9% 20110820	5,300,000.00	5,491,282.30	
	311I00	ベルギー国債 5% 20110928	8,800,000.00	9,380,333.60	
	311I01	イタリア国債 3.75% 20110915	11,900,000.00	12,355,472.50	
	311I02	イタリア国債 4.25% 20110901	12,800,000.00	13,411,878.40	
	311I03	フランス国債 1.5% 20110912	9,560,000.00	9,575,085.68	
	311I04	ドイツ国債 1.25% 20110916	4,000,000.00	3,991,276.00	
	311J00	スペイン国債 5.35% 20111031	9,900,000.00	10,642,232.70	
	311J01	ドイツ国債 3.5% 20111014	13,100,000.00	13,627,261.90	
	311K00	アイルランド国債 4% 20111111	3,300,000.00	3,440,104.80	
	312A00	ドイツ国債 5% 20120104	19,200,000.00	20,607,609.60	
	312A01	フランス国債 3.75% 20120112	12,050,000.00	12,609,855.05	
	312A02	オランダ国債 2.5% 20120115	7,700,000.00	7,844,760.00	
	312B00	イタリア国債 5% 20120201	21,350,000.00	22,823,256.75	
	312C00	ギリシャ国債 4.3% 20120320	10,500,000.00	10,963,249.50	
	312C01	アイルランド国債 3.9% 20120305	3,800,000.00	3,947,428.60	
	312C02	イタリア国債 3% 20120301	12,400,000.00	12,720,106.00	
	312C03	ベルギー国債 2% 20120328	4,500,000.00	4,535,091.00	
	312D00	フランス国債 5% 20120425	13,520,000.00	14,594,677.76	
	312D01	ドイツ国債 4% 20120413	11,450,000.00	12,100,531.75	
	312D02	イタリア国債 4% 20120415	13,050,000.00	13,682,181.15	
	312D03	スペイン国債 2.75% 20120430	9,000,000.00	9,212,166.00	
	312E00	ギリシャ国債 5.25% 20120518	6,300,000.00	6,743,690.10	
	312F00	ポルトガル国債 5% 20120615	5,100,000.00	5,497,631.70	
	312G00	オーストリア国債 5% 20120715	7,700,000.00	8,323,076.30	
	312G01	スペイン国債 5% 20120730	9,000,000.00	9,735,849.00	
	312G02	ドイツ国債 5% 20120704	19,150,000.00	20,741,173.50	
	312G03	オランダ国債 5% 20120715	10,000,000.00	10,822,990.00	
	312G04	フランス国債 4.5% 20120712	11,750,000.00	12,569,057.25	
	312G05	イタリア国債 2.5% 20120701	7,000,000.00	7,064,176.00	

312H00	ギリシャ国債 4.1% 20120820	5,400,000.00	5,622,685.20
312I00	ベルギー国債 5% 20120928	9,200,000.00	9,990,362.80
312I01	フィンランド国債 4.25% 20120915	4,500,000.00	4,789,170.00
312J00	フランス国債 4.75% 20121025	14,200,000.00	15,332,904.40
312J01	スペイン国債 3.9% 20121031	11,450,000.00	12,069,445.00
312J02	ドイツ国債 4.25% 20121012	12,150,000.00	12,979,832.85
312J03	イタリア国債 4.25% 20121015	14,000,000.00	14,818,972.00
312L00	フランス国債 8.5% 20121226	4,360,000.00	5,210,649.08
312L01	ベルギー国債 8% 20121224	5,900,000.00	6,940,931.10
313A00	スペイン国債 6.15% 20130131	10,550,000.00	11,841,921.35
313A01	ドイツ国債 4.5% 20130104	18,100,000.00	19,475,980.10
313A02	フランス国債 3.75% 20130112	13,200,000.00	13,878,163.20
313B00	イタリア国債 4.75% 20130201	15,800,000.00	16,996,739.40
313C00	ベルギー国債 4% 20130328	8,100,000.00	8,563,068.90
313D00	フランス国債 4% 20130425	14,000,000.00	14,837,522.00
313D01	アイルランド国債 5% 20130418	4,550,000.00	4,862,225.55
313D02	ドイツ国債 3.5% 20130412	13,100,000.00	13,714,914.00
313D03	イタリア国債 4.25% 20130415	12,800,000.00	13,559,948.80
313E00	ギリシャ国債 4.6% 20130520	6,700,000.00	7,061,860.30
313G00	スペイン国債 4.2% 20130730	10,600,000.00	11,278,516.60
313G01	オランダ国債 4.25% 20130715	11,200,000.00	11,971,724.80
313G02	ドイツ国債 3.75% 20130704	15,000,000.00	15,818,565.00
313G03	フィンランド国債 5.375% 20130704	4,500,000.00	4,982,332.50
313G04	フランス国債 4.5% 20130712	9,100,000.00	9,800,181.30
313H00	イタリア国債 4.25% 20130801	18,950,000.00	20,128,216.25
313H01	ギリシャ国債 4% 20130820	4,000,000.00	4,129,172.00
313I00	ベルギー国債 4.25% 20130928	9,750,000.00	10,416,831.75
313I01	ポルトガル国債 5.45% 20130923	5,400,000.00	5,985,727.20
313J00	オーストリア国債 3.8% 20131020	9,100,000.00	9,561,488.30
313J01	フランス国債 4% 20131025	14,000,000.00	14,846,510.00
313J02	ドイツ国債 4% 20131011	12,200,000.00	13,000,503.00
313L00	イタリア国債 3.75% 20131215	15,400,000.00	16,015,892.20
314A00	ドイツ国債 4.25% 20140104	17,800,000.00	19,134,412.60
314A01	スペイン国債 4.25% 20140131	9,600,000.00	10,234,291.20
314A02	フランス国債 2.5% 20140112	13,900,000.00	13,912,204.20
314A03	アイルランド国債 4% 20140115	6,100,000.00	6,287,745.80
314C00	ベルギー国債 4% 20140328	8,000,000.00	8,461,152.00
314D00	フランス国債 4% 20140425	14,000,000.00	14,849,492.00
314D01	ドイツ国債 2.25% 20140411	14,450,000.00	14,376,550.65
314E01	ギリシャ国債 4.5% 20140520	5,800,000.00	6,083,997.00
314F00	ポルトガル国債 4.375% 20140616	4,200,000.00	4,492,425.00
314F01	イタリア国債 3.5% 20140601	7,950,000.00	8,171,558.55
314G00	スペイン国債 4.75% 20140730	10,800,000.00	11,770,380.00
314G01	ドイツ国債 4.25% 20140704	18,850,000.00	20,299,923.15
314G02	オーストリア国債 4.3% 20140715	7,200,000.00	7,700,241.60
314G03	オランダ国債 3.75% 20140715	9,500,000.00	9,963,562.00
314G04	フランス国債 3% 20140712	7,700,000.00	7,832,286.00
314H00	イタリア国債 4.25% 20140801	20,100,000.00	21,359,445.90
314H01	ギリシャ国債 5.5% 20140820	9,500,000.00	10,338,109.00
314I00	ベルギー国債 4.25% 20140928	8,800,000.00	9,412,101.60
314I01	フィンランド国債 3.125% 20140915	4,500,000.00	4,597,051.50
314J00	フランス国債 4% 20141025	14,450,000.00	15,317,563.55
314J01	オーストリア国債 3.4% 20141020	6,200,000.00	6,370,022.60
314J02	ポルトガル国債 3.6% 20141015	3,300,000.00	3,413,331.90
314J03	スペイン国債 3.3% 20141031	4,500,000.00	4,594,315.50
314J04	ドイツ国債 2.5% 20141010	3,200,000.00	3,200,064.00
315A00	スペイン国債 4.4% 20150131	11,000,000.00	11,801,581.00
315A01	ドイツ国債 3.75% 20150104	18,000,000.00	18,990,324.00
315A02	オランダ国債 2.75% 20150115	4,800,000.00	4,780,632.00
315B00	イタリア国債 4.25% 20150201	17,600,000.00	18,658,992.00
315C00	ベルギー国債 8% 20150328	4,700,000.00	5,896,808.00
315C01	ベルギー国債 3.5% 20150328	5,600,000.00	5,776,243.20

315D00	フランス国債 3.5% 20150425	15,000,000.00	15,524,160.00	
315G00	フィンランド国債 4.25% 20150704	3,800,000.00	4,071,776.00	
315G01	ギリシャ国債 3.7% 20150720	6,900,000.00	6,922,783.80	
315G02	ドイツ国債 3.25% 20150704	15,600,000.00	16,050,138.00	
315G03	オランダ国債 3.25% 20150715	9,180,000.00	9,355,411.44	
315G04	オーストリア国債 3.5% 20150715	7,800,000.00	8,007,971.40	
315H00	イタリア国債 3.75% 20150801	19,000,000.00	19,660,193.00	
315I00	ベルギー国債 3.75% 20150928	8,700,000.00	9,075,535.50	
315J00	フランス国債 3% 20151025	19,000,000.00	19,104,348.00	
315J01	ポルトガル国債 3.35% 20151015	5,000,000.00	5,074,565.00	
316A00	ドイツ国債 3.5% 20160104	17,100,000.00	17,771,465.70	
316A01	スペイン国債 3.15% 20160131	11,000,000.00	11,008,261.00	
316D00	アイルランド国債 4.6% 20160418	4,800,000.00	4,990,310.40	
316D01	フランス国債 3.25% 20160425	16,500,000.00	16,726,809.00	
316F00	ドイツ国債 6% 20160620	2,900,000.00	3,423,363.00	
316G00	ギリシャ国債 3.6% 20160720	5,900,000.00	5,802,343.20	
316G01	ドイツ国債 4% 20160704	17,300,000.00	18,445,294.60	
316G02	オランダ国債 4% 20160715	8,550,000.00	9,011,007.45	
316H00	イタリア国債 3.75% 20160801	20,500,000.00	21,088,063.00	
316I00	ベルギー国債 3.25% 20160928	8,700,000.00	8,727,030.90	
316I01	オーストリア国債 4% 20160915	7,600,000.00	7,964,670.80	
316J00	フランス国債 5% 20161025	16,600,000.00	18,584,911.80	
316J01	ポルトガル国債 4.2% 20161015	3,700,000.00	3,904,709.90	
317A00	スペイン国債 3.8% 20170131	10,100,000.00	10,378,588.30	
317A01	ドイツ国債 3.75% 20170104	15,500,000.00	16,244,589.00	
317B00	イタリア国債 4% 20170201	15,000,000.00	15,554,490.00	
317C00	ベルギー国債 4% 20170328	8,400,000.00	8,771,498.40	
317D00	フランス国債 3.75% 20170425	14,000,000.00	14,522,704.00	
317G00	スペイン国債 5.5% 20170730	12,000,000.00	13,653,036.00	
317G01	ギリシャ国債 4.3% 20170720	8,500,000.00	8,572,301.00	
317G02	ドイツ国債 4.25% 20170704	14,500,000.00	15,636,858.00	
317G03	オランダ国債 4.5% 20170715	8,500,000.00	9,169,553.50	
317H00	イタリア国債 5.25% 20170801	16,600,000.00	18,494,674.20	
317I00	ベルギー国債 5.5% 20170928	6,000,000.00	6,848,526.00	
317I01	フィンランド国債 3.875% 20170915	4,300,000.00	4,454,924.70	
317I02	オーストリア国債 4.3% 20170915	4,900,000.00	5,185,679.80	
317J00	ポルトガル国債 4.35% 20171016	4,500,000.00	4,754,142.00	
317J01	フランス国債 4.25% 20171025	14,150,000.00	15,059,505.40	
318A00	オーストリア国債 4.65% 20180115	7,500,000.00	8,083,035.00	
318A01	ドイツ国債 4% 20180104	15,450,000.00	16,341,372.30	
318B00	イタリア国債 4.5% 20180201	17,000,000.00	17,996,472.00	
318C00	ベルギー国債 4% 20180328	7,700,000.00	7,964,233.20	
318D00	フランス国債 4% 20180425	15,800,000.00	16,523,782.20	
318F00	ポルトガル国債 4.45% 20180615	4,600,000.00	4,856,528.20	
318G00	スペイン国債 4.1% 20180730	11,900,000.00	12,289,796.40	
318G01	オランダ国債 4% 20180715	9,300,000.00	9,646,229.70	
318G02	ギリシャ国債 4.6% 20180720	6,000,000.00	6,090,048.00	
318G03	ドイツ国債 4.25% 20180704	15,000,000.00	16,119,600.00	
318H00	イタリア国債 4.5% 20180801	15,150,000.00	15,958,873.65	
318J00	アイルランド国債 4.5% 20181018	5,700,000.00	5,685,128.70	
318J01	フランス国債 4.25% 20181025	13,300,000.00	14,095,260.20	
319A00	ドイツ国債 3.75% 20190104	18,200,000.00	18,870,306.00	
319B00	イタリア国債 4.25% 20190201	18,500,000.00	19,089,484.00	
319C00	オーストリア国債 4.35% 20190315	6,500,000.00	6,833,014.50	
319C01	イタリア国債 4.5% 20190301	17,400,000.00	18,227,648.40	
319C02	ベルギー国債 4% 20190328	6,100,000.00	6,247,973.80	
319D00	フランス国債 4.25% 20190425	21,500,000.00	22,725,392.50	
319F00	アイルランド国債 4.4% 20190618	5,880,000.00	5,739,732.60	
319F01	ポルトガル国債 4.75% 20190614	5,300,000.00	5,675,838.90	
319G00	フィンランド国債 4.375% 20190704	3,750,000.00	3,984,255.00	
319G01	スペイン国債 4.6% 20190730	9,650,000.00	10,259,773.85	
319G02	オランダ国債 4% 20190715	9,500,000.00	9,827,465.00	

319G03	ギリシャ国債 6% 20190719	10,600,000.00	11,654,890.80
319G04	ドイツ国債 3.5% 20190704	15,300,000.00	15,488,817.30
319I00	イタリア国債 4.25% 20190901	13,490,000.00	13,754,417.49
319J00	フランス国債 8.5% 20191025	6,550,000.00	9,269,887.50
319J01	ギリシャ国債 6.5% 20191022	6,400,000.00	7,352,057.60
319J03	スペイン国債 4.3% 20191031	6,050,000.00	6,272,143.90
319J04	アイルランド国債 5.9% 20191018	4,550,000.00	4,937,141.30
319J05	フランス国債 3.75% 20191025	5,970,000.00	6,006,673.71
320B00	イタリア国債 4.5% 20200201	16,000,000.00	16,543,104.00
320D00	アイルランド国債 4.5% 20200418	6,430,000.00	6,226,908.45
320G00	オーストリア国債 3.9% 20200715	7,800,000.00	7,830,833.40
321D00	ポルトガル国債 3.85% 20210415	4,700,000.00	4,624,132.60
321D01	フランス国債 3.75% 20210425	16,700,000.00	16,632,949.50
321H00	イタリア国債 3.75% 20210801	17,000,000.00	16,318,810.00
321I00	オーストリア国債 3.5% 20210915	7,700,000.00	7,350,135.10
322C00	ベルギー国債 4% 20220328	5,900,000.00	5,909,044.70
322J00	ギリシャ国債 5.9% 20221022	6,200,000.00	6,836,070.40
323A00	オランダ国債 7.5% 20230115	3,750,000.00	5,108,895.00
323A01	オランダ国債 3.75% 20230115	5,000,000.00	4,893,200.00
323D00	フランス国債 8.5% 20230425	8,200,000.00	12,052,745.40
323H00	イタリア国債 4.75% 20230801	12,450,000.00	12,823,363.05
323I00	フランス国債 4.25% 20231025	12,670,000.00	13,016,359.79
323J00	ポルトガル国債 4.95% 20231025	3,800,000.00	4,054,178.20
323K00	イタリア国債 9% 20231101	9,310,000.00	13,664,529.06
324A00	ドイツ国債 6.25% 20240104	8,180,000.00	10,283,773.30
324A01	スペイン国債 4.8% 20240131	8,000,000.00	8,414,416.00
324C00	ギリシャ国債 4.7% 20240320	7,700,000.00	7,406,553.00
325C00	イタリア国債 5% 20250301	4,100,000.00	4,270,699.40
325J00	フランス国債 6% 20251025	8,200,000.00	10,017,366.00
326C00	オーストリア国債 4.85% 20260315	2,300,000.00	2,437,491.70
326K00	イタリア国債 7.25% 20261101	7,000,000.00	9,063,348.00
327070	ドイツ国債 6.5% 20270704	8,300,000.00	10,732,945.80
327G00	オーストリア国債 6.25% 20270715	5,150,000.00	6,317,726.45
327K00	イタリア国債 6.5% 20271101	19,500,000.00	23,494,750.50
328010	ドイツ国債 5.625% 20280104	9,000,000.00	10,643,868.00
328070	ドイツ国債 4.75% 20280704	8,900,000.00	9,582,211.70
328A00	オランダ国債 5.5% 20280115	7,400,000.00	8,566,388.00
328C00	ベルギー国債 5.5% 20280328	9,400,000.00	10,665,766.40
329A00	スペイン国債 6% 20290131	12,050,000.00	14,239,207.85
329K00	イタリア国債 5.25% 20291101	20,450,000.00	21,572,868.60
330A00	ドイツ国債 6.25% 20300104	6,650,000.00	8,454,105.10
331A00	ドイツ国債 5.5% 20310104	13,100,000.00	15,371,880.60
331E00	イタリア国債 6% 20310501	22,500,000.00	25,664,017.50
332G00	スペイン国債 5.75% 20320730	9,500,000.00	10,998,264.00
332J00	フランス国債 5.75% 20321025	13,000,000.00	15,724,982.00
333B00	イタリア国債 5.75% 20330201	12,000,000.00	13,334,184.00
334G00	ドイツ国債 4.75% 20340704	15,250,000.00	16,468,764.75
334H00	イタリア国債 5% 20340801	14,430,000.00	14,533,607.40
335C00	ベルギー国債 5% 20350328	10,300,000.00	11,044,535.50
335D00	フランス国債 4.75% 20350425	11,600,000.00	12,407,974.80
337A00	スペイン国債 4.2% 20370131	10,600,000.00	9,903,028.80
337A01	オランダ国債 4% 20370115	8,700,000.00	8,375,211.60
337A02	ドイツ国債 4% 20370104	16,800,000.00	16,397,001.60
337B00	イタリア国債 4% 20370201	17,100,000.00	14,850,990.90
337C00	オーストリア国債 4.15% 20370315	5,000,000.00	4,742,255.00
337D00	ポルトガル国債 4.1% 20370415	4,600,000.00	4,217,109.80
337I00	ギリシャ国債 4.5% 20370920	6,400,000.00	5,504,588.80
338J00	フランス国債 4% 20381025	17,500,000.00	16,698,412.50
339G00	ドイツ国債 4.25% 20390704	10,350,000.00	10,598,638.05
339H00	イタリア国債 5% 20390801	14,200,000.00	14,362,490.60
340G00	スペイン国債 4.9% 20400730	9,600,000.00	10,042,944.00
340G01	ドイツ国債 4.75% 20400704	6,170,000.00	6,844,991.83

340100	ギリシャ国債 4.6% 20400920	6,150,000.00	5,294,307.45	
340101	イタリア国債 5% 20400901	2,900,000.00	2,916,727.20	
341D00	フランス国債 4.5% 20410425	4,360,000.00	4,507,128.20	
341G00	スペイン国債 4.7% 20410730	2,500,000.00	2,514,757.50	
355D00	フランス国債 4% 20550425	11,200,000.00	10,601,292.80	
N00184	ギリシャ国債 6.5% 20140111	3,700,000.00	4,169,589.20	
N00238	フランス国債 5% 20111025	12,000,000.00	12,812,184.00	
国債証券 計		2,559,910,000.00	2,710,312,538.09	
ユーロ 計		2,559,910,000.00	2,710,312,538.09	
(邦貨換算額)		(353,446,773,700)	(374,212,852,134)	

(単位:円)

総合計	(674,100,898,400)	(714,012,210,023)	
	674,100,898,400	714,012,210,023	

(注) 総合計の()内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	国債証券 151銘柄	100.0	31.9
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0	2.7
オーストラリアドル	国債証券 9銘柄	100.0	0.7
イギリスポンド	国債証券 33銘柄	100.0	7.8
スイスフラン	国債証券 10銘柄	100.0	0.7
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0	0.7
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0	0.4
マレーシアリングット	国債証券 17銘柄	100.0	0.5
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0	0.9
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0	0.3
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	100.0	0.9
ユーロ	国債証券 249銘柄	100.0	52.5

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。

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

海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成20年10月27日現在	平成21年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		10,205,545	22,355,246
コール・ローン		40,451,022	35,270,706
国債証券		20,565,291,708	28,350,145,585
派生商品評価勘定		4,638,260,750	20,343,773
未収入金		945,753,772	555,960,557
未収利息		323,316,104	423,314,053
前払費用		62,108,648	45,484,427
流動資産合計		26,585,387,549	29,452,874,347
資産合計		26,585,387,549	29,452,874,347
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		139,367	1,075,550,672
未払金		-	50,794
未払解約金		972,374,358	3,156,099
流動負債合計		972,513,725	1,078,757,565
負債合計		972,513,725	1,078,757,565
純資産の部			
元本等			
元本		22,771,913,202	24,087,399,964
剰余金			
剰余金又は欠損金()		2,840,960,622	4,286,716,818
元本等合計		25,612,873,824	28,374,116,782
純資産合計		25,612,873,824	28,374,116,782
負債純資産合計		26,585,387,549	29,452,874,347

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引</p> <p>同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成20年10月27日現在			平成21年10月26日現在		
1.	期首	平成19年10月27日	1.	期首	平成20年10月28日
	期首元本額	18,421,878,702 円		期首元本額	22,771,913,202 円
	期首からの追加設定元本額	9,600,785,462 円		期首からの追加設定元本額	6,580,146,707 円
	期首からの解約元本額	5,250,750,962 円		期首からの解約元本額	5,264,659,945 円
	平成20年10月27日現在の元本の内訳			平成21年10月26日現在の元本の内訳	
	インデックスファンド海外 債券ヘッジあり（DC専用）	354,426,102 円		インデックスファンド海外 債券ヘッジあり（DC専用）	381,702,768 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式80）	8,207,269 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式80）	9,364,038 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式60）	10,048,914 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式60）	10,912,688 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式40）	27,926,343 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式40）	28,190,249 円
	アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式20）	89,054,261 円		アセット・ナビゲーション ・ファンド（株式20）	74,411,068 円
	国際分散型ファンド40（適 格機関投資家向け）	19,431,050,132 円		国際分散型ファンド40（適 格機関投資家向け）	20,968,849,954 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20）	55,195,553 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20）	57,741,982 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40）	68,679,263 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40）	75,430,980 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60）	56,999,174 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60）	67,216,040 円
	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80）	44,946,047 円		年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80）	52,310,431 円
	年金積立 インデックス ファンド海外債券（ヘッジ あり）	2,625,380,144 円		年金積立 インデックス ファンド海外債券（ヘッジ あり）	2,361,269,766 円
	（合計）	22,771,913,202 円		（合計）	24,087,399,964 円
2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	22,771,913,202 円	2.	本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	24,087,399,964 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

[次へ](#)

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	20,565,291,708	292,027,489
合計	20,565,291,708	292,027,489

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	28,350,145,585	364,809,798
合計	28,350,145,585	364,809,798

（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報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成19年10月27日 至 平成20年10月27日	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また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。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(単位：円)

区分	種類	平成20年10月27日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	26,359,757,173	-	21,721,635,790	4,638,121,383
	アメリカドル	7,712,389,186	-	6,954,021,640	758,367,546
	カナダドル	637,974,356	-	473,076,190	164,898,166
	オーストラリアドル	109,352,967	-	77,738,080	31,614,887
	イギリスポンド	2,201,116,172	-	1,694,593,490	506,522,682
	スイスフラン	213,611,048	-	189,143,770	24,467,278
	スウェーデンクローナ	232,684,253	-	178,797,550	53,886,703
	シンガポールドル	123,330,444	-	106,925,080	16,405,364
	マレーシアリングgit	149,912,862	-	126,884,270	23,028,592
	デンマーククローネ	238,407,313	-	188,434,290	49,973,023
	ノルウェークローネ	92,784,738	-	71,316,750	21,467,988
	ポーランドズロチ	260,076,410	-	204,986,520	55,089,890
	ユーロ	14,388,117,424	-	11,455,718,160	2,932,399,264
合計	26,359,757,173	-	21,721,635,790	4,638,121,383	

(単位：円)

区分	種類	平成21年10月26日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	28,475,644,481	-	29,530,851,380	1,055,206,899
	アメリカドル	9,154,399,058	-	9,355,407,140	201,008,082
	カナダドル	772,082,399	-	798,622,020	26,539,621
	オーストラリアドル	192,044,477	-	206,641,860	14,597,383
	イギリスポンド	2,225,670,645	-	2,293,568,390	67,897,745
	スイスフラン	181,097,644	-	185,805,360	4,707,716
	スウェーデンクローナ	221,094,885	-	229,557,240	8,462,355
	シンガポールドル	125,610,538	-	127,886,960	2,276,422
	マレーシアリングgit	164,543,326	-	169,564,800	5,021,474
	デンマーククローネ	289,288,643	-	298,754,750	9,466,107
	ノルウェークローネ	100,678,587	-	106,584,600	5,906,013
	ポーランドズロチ	286,614,707	-	292,912,110	6,297,403
	ユーロ	14,762,519,572	-	15,465,546,150	703,026,578
合計	28,475,644,481	-	29,530,851,380	1,055,206,899	

(注) 時価の算定方法

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

(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20年10月27日現在		平成21年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1248 円	1口当たり純資産額	1.1780 円
(1万口当たり純資産額)	(11,248 円)	(1万口当たり純資産額)	(11,780 円)

(3) 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

(外貨建債券)

外貨建債券(アメリカドル)

(単位:アメリカドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	110I01	アメリカ国債 2% 20100930	550,000.00	558,164.03
	110J02	アメリカ国債 1.5% 20101031	1,000,000.00	1,010,664.00
	110K01	アメリカ国債 1.25% 20101130	1,300,000.00	1,310,816.39
	110L00	アメリカ国債 4.375% 20101215	960,000.00	1,002,637.44
	111A00	アメリカ国債 4.25% 20110115	900,000.00	940,570.28
	111B00	アメリカ国債 5% 20110215	1,870,000.00	1,975,625.63
	111C01	アメリカ国債 0.875% 20110331	1,920,000.00	1,925,249.85
	111E00	アメリカ国債 4.875% 20110531	1,380,000.00	1,470,670.26
	111F01	アメリカ国債 1.125% 20110630	2,000,000.00	2,010,000.00
	111G01	アメリカ国債 1% 20110731	950,000.00	952,078.12
	111H00	アメリカ国債 5% 20110815	1,320,000.00	1,417,762.49
	111H02	アメリカ国債 1% 20110831	1,500,000.00	1,501,581.90
	111I00	アメリカ国債 4.5% 20110930	1,790,000.00	1,909,636.25
	111J00	アメリカ国債 4.625% 20111031	960,000.00	1,028,587.48
	111K00	アメリカ国債 4.5% 20111130	260,000.00	278,443.75
	111K01	アメリカ国債 1.75% 20111115	1,800,000.00	1,824,750.00
	111L01	アメリカ国債 1.125% 20111215	700,000.00	699,917.96
	112A01	アメリカ国債 1.125% 20120115	1,000,000.00	998,398.40
	112B00	アメリカ国債 4.875% 20120215	1,840,000.00	1,992,806.07
	112D01	アメリカ国債 1.375% 20120415	1,000,000.00	1,001,718.70
	112E00	アメリカ国債 4.75% 20120531	2,000,000.00	2,175,156.18
	112E01	アメリカ国債 1.375% 20120515	500,000.00	500,507.80
	112G01	アメリカ国債 1.5% 20120715	2,000,000.00	2,005,781.20
	112H00	アメリカ国債 4.375% 20120815	1,400,000.00	1,514,296.82
	112H02	アメリカ国債 1.75% 20120815	1,600,000.00	1,612,437.44
	112K00	アメリカ国債 4% 20121115	1,670,000.00	1,792,249.16
	113A00	アメリカ国債 2.875% 20130131	1,000,000.00	1,037,539.00
	113B00	アメリカ国債 3.875% 20130215	100,000.00	106,789.06
	113E00	アメリカ国債 3.625% 20130515	1,850,000.00	1,962,589.70
	113F00	アメリカ国債 3.375% 20130630	2,000,000.00	2,106,093.60
	113H00	アメリカ国債 4.25% 20130815	1,600,000.00	1,736,000.00
	113I00	アメリカ国債 3.125% 20130930	1,400,000.00	1,458,625.00
	113K00	アメリカ国債 4.25% 20131115	760,000.00	825,668.71
	113L00	アメリカ国債 1.5% 20131231	1,220,000.00	1,188,880.36
	114B00	アメリカ国債 4% 20140215	2,000,000.00	2,151,562.40
	114C00	アメリカ国債 1.75% 20140331	1,400,000.00	1,371,507.76
	114E00	アメリカ国債 4.75% 20140515	1,730,000.00	1,917,326.43
	114F00	アメリカ国債 2.625% 20140630	1,100,000.00	1,114,136.65
	114H00	アメリカ国債 4.25% 20140815	1,210,000.00	1,315,213.24
	114H01	アメリカ国債 2.375% 20140831	2,400,000.00	2,397,187.44
	114I00	アメリカ国債 2.375% 20140930	600,000.00	598,523.40
	114K01	アメリカ国債 4.25% 20141115	1,500,000.00	1,628,203.05
	115E00	アメリカ国債 4.125% 20150515	1,150,000.00	1,238,496.04
	115K01	アメリカ国債 4.5% 20151115	1,750,000.00	1,918,300.64
	116B00	アメリカ国債 4.5% 20160215	1,110,000.00	1,215,016.31
	116E00	アメリカ国債 5.125% 20160515	670,000.00	757,361.70
	116H00	アメリカ国債 4.875% 20160815	1,460,000.00	1,627,329.54
	116H01	アメリカ国債 3% 20160831	1,800,000.00	1,794,093.66
	116K00	アメリカ国債 4.625% 20161115	1,560,000.00	1,714,293.66
	117E00	アメリカ国債 4.5% 20170515	820,000.00	892,326.53

117K00	アメリカ国債 4.25% 20171115	1,480,000.00	1,580,709.25	
118B00	アメリカ国債 3.5% 20180215	950,000.00	961,429.64	
118E00	アメリカ国債 3.875% 20180515	1,600,000.00	1,660,500.00	
118H00	アメリカ国債 4% 20180815	1,200,000.00	1,254,093.72	
118K01	アメリカ国債 3.75% 20181115	1,800,000.00	1,843,593.65	
119B00	アメリカ国債 2.75% 20190215	1,830,000.00	1,727,634.37	
119E00	アメリカ国債 3.125% 20190515	1,700,000.00	1,652,851.52	
138B00	アメリカ国債 4.375% 20380215	1,160,000.00	1,175,225.00	
215020	アメリカ国債 11.25% 20150215	850,000.00	1,215,898.35	
217080	アメリカ国債 8.875% 20170815	1,160,000.00	1,610,315.58	
219022	アメリカ国債 8.125% 20190815	470,000.00	649,040.62	
220080	アメリカ国債 8.75% 20200815	390,000.00	565,774.18	
220B00	アメリカ国債 8.5% 20200215	270,000.00	383,737.50	
221110	アメリカ国債 8% 20211115	970,000.00	1,356,105.34	
223020	アメリカ国債 7.125% 20230215	950,000.00	1,253,628.79	
223080	アメリカ国債 6.25% 20230815	1,130,000.00	1,390,341.32	
226020	アメリカ国債 6% 20260215	970,000.00	1,175,821.86	
227110	アメリカ国債 6.125% 20271115	1,080,000.00	1,336,078.03	
228K00	アメリカ国債 5.25% 20281115	660,000.00	744,201.53	
230B00	アメリカ国債 6.25% 20300515	680,000.00	864,184.24	
236B00	アメリカ国債 4.5% 20360215	1,240,000.00	1,281,946.84	
237B00	アメリカ国債 4.75% 20370215	1,300,000.00	1,396,992.08	
239B00	アメリカ国債 3.5% 20390215	1,940,000.00	1,683,101.51	
国債証券 計		92,140,000.00	98,246,776.40	
アメリカドル 計		92,140,000.00	98,246,776.40	
(邦貨換算額)		(8,481,487,000)	(9,043,615,768)	

外貨建債券(カナダドル)

(単位:カナダドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	310L00	カナダ国債 2.75% 20101201	400,000.00	409,116.00	
	311I00	カナダ国債 3.75% 20110901	870,000.00	908,271.30	
	312F00	カナダ国債 5.25% 20120601	660,000.00	717,723.60	
	313F00	カナダ国債 5.25% 20130601	1,370,000.00	1,508,644.00	
	314F01	カナダ国債 3% 20140601	750,000.00	761,790.00	
	314L00	カナダ国債 2% 20141201	450,000.00	434,092.50	
	316F00	カナダ国債 4% 20160601	550,000.00	582,576.50	
	318F00	カナダ国債 4.25% 20180601	1,000,000.00	1,067,340.00	
	319F00	カナダ国債 3.75% 20190601	300,000.00	306,555.00	
	327F00	カナダ国債 8% 20270601	450,000.00	671,544.00	
	329F00	カナダ国債 5.75% 20290601	530,000.00	650,039.70	
	337F00	カナダ国債 5% 20370601	810,000.00	950,940.00	
	国債証券 計		8,140,000.00	8,968,632.60	
カナダドル 計		8,140,000.00	8,968,632.60		
(邦貨換算額)		(711,517,400)	(783,948,176)		

外貨建債券(オーストラリアドル)

(単位:オーストラリアドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	311F00	オーストラリア国債 5.75% 20110615	250,000.00	253,224.00	
	312D00	オーストラリア国債 5.75% 20120415	300,000.00	303,231.00	
	313E00	オーストラリア国債 6.5% 20130515	560,000.00	578,505.20	
	314F00	オーストラリア国債 6.25% 20140615	250,000.00	257,005.00	
	317B00	オーストラリア国債 6% 20170215	480,000.00	490,045.92	
	319C00	オーストラリア国債 5.25% 20190315	300,000.00	290,371.50	
	321E00	オーストラリア国債 5.75% 20210515	200,000.00	199,072.00	
国債証券 計		2,340,000.00	2,371,454.62		
オーストラリアドル 計		2,340,000.00	2,371,454.62		
(邦貨換算額)		(198,712,800)	(201,383,926)		

外貨建債券(イギリスポンド)

(単位:イギリスポンド)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

国債証券	311C00	イギリス国債 4.25% 20110307	770,000.00	804,911.80	
	311L00	イギリス国債 3.25% 20111207	100,000.00	103,765.60	
	312C00	イギリス国債 5% 20120307	1,500,000.00	1,615,846.50	
	313C00	イギリス国債 4.5% 20130307	1,150,000.00	1,233,153.05	
	313I00	イギリス国債 8% 20130927	200,000.00	242,289.00	
	314C00	イギリス国債 2.25% 20140307	400,000.00	393,402.80	
	314I00	イギリス国債 5% 20140907	700,000.00	771,854.30	
	315I00	イギリス国債 4.75% 20150907	450,000.00	494,065.35	
	316I00	イギリス国債 4% 20160907	580,000.00	611,126.28	
	318C00	イギリス国債 5% 20180307	710,000.00	790,787.35	
	319C00	イギリス国債 4.5% 20190307	530,000.00	564,613.24	
	320C00	イギリス国債 4.75% 20200307	670,000.00	726,007.31	
	321F00	イギリス国債 8% 20210607	350,000.00	486,945.90	
	325C00	イギリス国債 5% 20250307	320,000.00	353,079.04	
	328L00	イギリス国債 6% 20281207	740,000.00	926,898.10	
	332F00	イギリス国債 4.25% 20320607	860,000.00	870,959.84	
	336C00	イギリス国債 4.25% 20360307	850,000.00	853,691.55	
	338L00	イギリス国債 4.75% 20381207	1,270,000.00	1,387,397.53	
	342L00	イギリス国債 4.5% 20421207	100,000.00	105,640.80	
	346L00	イギリス国債 4.25% 20461207	500,000.00	508,125.50	
355L00	イギリス国債 4.25% 20551207	930,000.00	950,079.63		
国債証券 計			13,680,000.00	14,794,640.47	
イギリスポンド 計			13,680,000.00	14,794,640.47	
(邦貨換算額)			(2,048,032,800)	(2,214,905,625)	

外貨建債券(スイスフラン)

(単位:スイスフラン)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	312F00	スイス国債 2.75% 20120610	350,000.00	366,598.40	
	314A00	スイス国債 4.25% 20140106	400,000.00	448,016.00	
	317F00	スイス国債 4.25% 20170605	450,000.00	523,836.45	
	318A00	スイス国債 3% 20180108	350,000.00	374,901.80	
	323B00	スイス国債 4% 20230211	140,000.00	163,129.96	
	328D00	スイス国債 4% 20280408	100,000.00	118,236.30	
国債証券 計			1,790,000.00	1,994,718.91	
スイスフラン 計			1,790,000.00	1,994,718.91	
(邦貨換算額)			(163,355,400)	(182,038,048)	

外貨建債券(スウェーデンクローナ)

(単位:スウェーデンクローナ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311C00	スウェーデン国債 5.25% 20110315	1,900,000.00	2,018,940.00	
	312J00	スウェーデン国債 5.5% 20121008	2,800,000.00	3,075,520.00	
	314E00	スウェーデン国債 6.75% 20140505	500,000.00	587,201.00	
	316G00	スウェーデン国債 3% 20160712	4,760,000.00	4,733,796.20	
	319C00	スウェーデン国債 4.25% 20190312	1,500,000.00	1,607,442.00	
	320L00	スウェーデン国債 5% 20201201	3,100,000.00	3,541,092.80	
	339C00	スウェーデン国債 3.5% 20390330	1,000,000.00	924,775.00	
国債証券 計			15,560,000.00	16,488,767.00	
スウェーデンクローナ 計			15,560,000.00	16,488,767.00	
(邦貨換算額)			(210,993,600)	(223,587,681)	

外貨建債券(シンガポールドル)

(単位:シンガポールドル)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	312G00	シンガポール国債 3.5% 20120701	550,000.00	589,439.40	
	316I00	シンガポール国債 3.75% 20160901	800,000.00	879,822.40	
	318I00	シンガポール国債 4% 20180901	400,000.00	442,880.40	
国債証券 計			1,750,000.00	1,912,142.20	
シンガポールドル 計			1,750,000.00	1,912,142.20	
(邦貨換算額)			(115,447,500)	(126,144,021)	

外貨建債券(マレーシアリングット)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311D00	マレーシア国債 3.756% 20110428	2,500,000.00	2,551,922.50	
	316100	マレーシア国債 4.262% 20160915	1,700,000.00	1,723,351.20	
	318B00	マレーシア国債 4.24% 20180207	1,850,000.00	1,860,356.30	
国債証券 計			6,050,000.00	6,135,630.00	
マレーシアリングット 計			6,050,000.00	6,135,630.00	
(邦貨換算額)			(164,560,000)	(166,889,136)	

外貨建債券(デンマーククローネ)

(単位: デンマーククローネ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310K00	デンマーク国債 4% 20101115	700,000.00	719,033.00	
	311K00	デンマーク国債 6% 20111115	2,150,000.00	2,327,127.75	
	313K00	デンマーク国債 5% 20131115	4,100,000.00	4,453,128.90	
	317K00	デンマーク国債 4% 20171115	4,000,000.00	4,131,700.00	
	324K00	デンマーク国債 7% 20241110	600,000.00	799,038.00	
	339K00	デンマーク国債 4.5% 20391115	2,750,000.00	2,884,444.75	
国債証券 計			14,300,000.00	15,314,472.40	
デンマーククローネ 計			14,300,000.00	15,314,472.40	
(邦貨換算額)			(265,265,000)	(284,083,463)	

外貨建債券(ノルウェークローネ)

(単位: ノルウェークローネ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311E01	ノルウェー国債 6% 20110516	2,200,000.00	2,316,428.40	
	313E00	ノルウェー国債 6.5% 20130515	1,200,000.00	1,325,896.80	
	315E00	ノルウェー国債 5% 20150515	1,000,000.00	1,064,162.00	
	317E00	ノルウェー国債 4.25% 20170519	1,600,000.00	1,635,892.80	
国債証券 計			6,000,000.00	6,342,380.00	
ノルウェークローネ 計			6,000,000.00	6,342,380.00	
(邦貨換算額)			(99,420,000)	(105,093,237)	

外貨建債券(ポーランドズロチ)

(単位: ポーランドズロチ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310K00	ポーランド国債 6% 20101124	1,250,000.00	1,271,875.00	
	311E00	ポーランド国債 4.25% 20110524	600,000.00	597,600.00	
	312D00	ポーランド国債 4.75% 20120425	1,850,000.00	1,843,525.00	
	313J00	ポーランド国債 5% 20131024	2,150,000.00	2,120,760.00	
	317J00	ポーランド国債 5.25% 20171025	2,300,000.00	2,202,250.00	
	322I00	ポーランド国債 5.75% 20220923	600,000.00	579,600.00	
国債証券 計			8,750,000.00	8,615,610.00	
ポーランドズロチ 計			8,750,000.00	8,615,610.00	
(邦貨換算額)			(289,625,000)	(285,176,691)	

外貨建債券(ユーロ)

(単位: ユーロ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	304D00	フランス国債 5.5% 20290425	800,000.00	927,056.00	
	310J00	フランス国債 5.5% 20101025	400,000.00	418,320.40	
	310J01	ドイツ国債 2.5% 20101008	740,000.00	751,727.52	
	310K00	イタリア国債 5.5% 20101101	760,000.00	794,619.52	
	311A00	ドイツ国債 5.25% 20110104	250,000.00	262,598.00	
	311A02	フランス国債 3% 20110112	500,000.00	512,105.50	
	311A03	オランダ国債 4% 20110115	250,000.00	259,008.00	
	311B00	フィンランド国債 5.75% 20110223	150,000.00	159,232.35	
	311C00	イタリア国債 3.5% 20110315	850,000.00	875,789.00	
	311C02	ギリシャ国債 3.8% 20110320	800,000.00	824,904.00	
	311D00	フランス国債 6.5% 20110425	160,000.00	172,479.84	
	311D03	スペイン国債 4.1% 20110430	500,000.00	520,738.50	
	311F01	ポルトガル国債 5.15% 20110615	150,000.00	158,908.20	
	311G00	ドイツ国債 5% 20110704	1,260,000.00	1,337,032.62	

311G02	オランダ国債 5% 20110715	850,000.00	902,494.30
311G03	フランス国債 3.5% 20110712	300,000.00	310,708.80
311H00	イタリア国債 5.25% 20110801	670,000.00	712,786.20
311H01	ギリシャ国債 3.9% 20110820	880,000.00	911,760.08
311I00	ベルギー国債 5% 20110928	600,000.00	639,568.20
311J00	スペイン国債 5.35% 20111031	1,160,000.00	1,246,968.68
311J01	ドイツ国債 3.5% 20111014	1,140,000.00	1,185,883.86
311K00	アイルランド国債 4% 20111111	250,000.00	260,614.00
312A00	ドイツ国債 5% 20120104	600,000.00	643,987.80
312B00	イタリア国債 5% 20120201	1,440,000.00	1,539,367.20
312D00	フランス国債 5% 20120425	350,000.00	377,820.80
312D01	ドイツ国債 4% 20120413	350,000.00	369,885.25
312F00	ポルトガル国債 5% 20120615	500,000.00	538,983.50
312G00	オーストリア国債 5% 20120715	700,000.00	756,643.30
312G02	ドイツ国債 5% 20120704	1,110,000.00	1,202,229.90
312G03	オランダ国債 5% 20120715	680,000.00	735,963.32
312H00	ギリシャ国債 4.1% 20120820	300,000.00	312,371.40
312I00	ベルギー国債 5% 20120928	570,000.00	618,968.13
312J00	フランス国債 4.75% 20121025	1,410,000.00	1,522,492.62
312J03	イタリア国債 4.25% 20121015	1,350,000.00	1,428,972.30
313A00	スペイン国債 6.15% 20130131	1,260,000.00	1,414,295.82
313A01	ドイツ国債 4.5% 20130104	1,520,000.00	1,635,551.92
313B00	イタリア国債 4.75% 20130201	870,000.00	935,896.41
313D00	フランス国債 4% 20130425	970,000.00	1,028,028.31
313D01	アイルランド国債 5% 20130418	300,000.00	320,586.30
313G00	スペイン国債 4.2% 20130730	100,000.00	106,401.10
313G01	オランダ国債 4.25% 20130715	300,000.00	320,671.20
313G02	ドイツ国債 3.75% 20130704	1,440,000.00	1,518,582.24
313G03	フィンランド国債 5.375% 20130704	500,000.00	553,592.50
313H00	イタリア国債 4.25% 20130801	1,280,000.00	1,359,584.00
313I00	ベルギー国債 4.25% 20130928	1,420,000.00	1,517,118.06
313I01	ポルトガル国債 5.45% 20130923	100,000.00	110,846.80
313J01	フランス国債 4% 20131025	770,000.00	816,558.05
314A00	ドイツ国債 4.25% 20140104	750,000.00	806,225.25
314A03	アイルランド国債 4% 20140115	150,000.00	154,616.70
314D00	フランス国債 4% 20140425	1,380,000.00	1,463,735.64
314E01	ギリシャ国債 4.5% 20140520	1,130,000.00	1,185,330.45
314F00	ポルトガル国債 4.375% 20140616	500,000.00	534,812.50
314G00	スペイン国債 4.75% 20140730	1,270,000.00	1,384,109.50
314G01	ドイツ国債 4.25% 20140704	1,440,000.00	1,550,763.36
314G02	オーストリア国債 4.3% 20140715	790,000.00	844,887.62
314G03	オランダ国債 3.75% 20140715	830,000.00	870,500.68
314H00	イタリア国債 4.25% 20140801	1,870,000.00	1,987,172.33
314I00	ベルギー国債 4.25% 20140928	450,000.00	481,300.65
314J00	フランス国債 4% 20141025	500,000.00	530,019.50
315A01	ドイツ国債 3.75% 20150104	550,000.00	580,259.90
315B00	イタリア国債 4.25% 20150201	480,000.00	508,881.60
315D00	フランス国債 3.5% 20150425	910,000.00	941,799.04
315G02	ドイツ国債 3.25% 20150704	850,000.00	874,526.75
315H00	イタリア国債 3.75% 20150801	290,000.00	300,076.63
315I00	ベルギー国債 3.75% 20150928	950,000.00	991,006.75
315J00	フランス国債 3% 20151025	900,000.00	904,942.80
316A01	スペイン国債 3.15% 20160131	750,000.00	750,563.25
316D00	アイルランド国債 4.6% 20160418	310,000.00	322,290.88
316D01	フランス国債 3.25% 20160425	410,000.00	415,635.86
316G01	ドイツ国債 4% 20160704	690,000.00	735,679.38
316G02	オランダ国債 4% 20160715	710,000.00	748,282.49
316H00	イタリア国債 3.75% 20160801	240,000.00	246,884.64
316I01	オーストリア国債 4% 20160915	170,000.00	178,157.11
316J00	フランス国債 5% 20161025	240,000.00	268,697.52
316J01	ポルトガル国債 4.2% 20161015	260,000.00	274,385.02
317A01	ドイツ国債 3.75% 20170104	530,000.00	555,460.14

317B00	イタリア国債 4% 20170201	550,000.00	570,331.30	
317D00	フランス国債 3.75% 20170425	600,000.00	622,401.60	
317G00	スペイン国債 5.5% 20170730	810,000.00	921,579.93	
317G01	ギリシャ国債 4.3% 20170720	900,000.00	907,655.40	
317G02	ドイツ国債 4.25% 20170704	880,000.00	948,995.52	
317H00	イタリア国債 5.25% 20170801	1,050,000.00	1,169,843.85	
317I00	ベルギー国債 5.5% 20170928	1,050,000.00	1,198,492.05	
317I01	フィンランド国債 3.875% 20170915	400,000.00	414,411.60	
317J01	フランス国債 4.25% 20171025	630,000.00	670,493.88	
318A00	オーストリア国債 4.65% 20180115	1,170,000.00	1,260,953.46	
318A01	ドイツ国債 4% 20180104	750,000.00	793,270.50	
318B00	イタリア国債 4.5% 20180201	1,280,000.00	1,355,028.48	
318D00	フランス国債 4% 20180425	1,300,000.00	1,359,551.70	
318F00	ポルトガル国債 4.45% 20180615	300,000.00	316,730.10	
318G00	スペイン国債 4.1% 20180730	1,250,000.00	1,290,945.00	
318G01	オランダ国債 4% 20180715	970,000.00	1,006,112.13	
318G03	ドイツ国債 4.25% 20180704	1,050,000.00	1,128,372.00	
318H00	イタリア国債 4.5% 20180801	900,000.00	948,051.90	
319A00	ドイツ国債 3.75% 20190104	980,000.00	1,016,093.40	
319B00	イタリア国債 4.25% 20190201	1,610,000.00	1,661,301.04	
319C00	オーストリア国債 4.35% 20190315	200,000.00	210,246.60	
319C02	ベルギー国債 4% 20190328	400,000.00	409,703.20	
319D00	フランス国債 4.25% 20190425	1,500,000.00	1,585,492.50	
319G00	フィンランド国債 4.375% 20190704	100,000.00	106,246.80	
319G01	スペイン国債 4.6% 20190730	250,000.00	265,797.25	
319G03	ギリシャ国債 6% 20190719	210,000.00	230,898.78	
319I00	イタリア国債 4.25% 20190901	300,000.00	305,880.30	
319J00	フランス国債 8.5% 20191025	590,000.00	834,997.50	
320B00	イタリア国債 4.5% 20200201	1,130,000.00	1,168,356.72	
320D00	アイルランド国債 4.5% 20200418	750,000.00	726,311.25	
320G00	オーストリア国債 3.9% 20200715	200,000.00	200,790.60	
321D00	ポルトガル国債 3.85% 20210415	530,000.00	521,444.74	
321D01	フランス国債 3.75% 20210425	450,000.00	448,193.25	
322J00	ギリシャ国債 5.9% 20221022	740,000.00	815,918.08	
323D00	フランス国債 8.5% 20230425	630,000.00	926,003.61	
323K00	イタリア国債 9% 20231101	430,000.00	631,122.18	
324A00	ドイツ国債 6.25% 20240104	520,000.00	653,736.20	
327G00	オーストリア国債 6.25% 20270715	400,000.00	490,697.20	
327K00	イタリア国債 6.5% 20271101	1,200,000.00	1,445,830.80	
328010	ドイツ国債 5.625% 20280104	1,160,000.00	1,371,876.32	
328A00	オランダ国債 5.5% 20280115	510,000.00	590,386.20	
328C00	ベルギー国債 5.5% 20280328	380,000.00	431,169.28	
329A00	スペイン国債 6% 20290131	820,000.00	968,975.14	
329K00	イタリア国債 5.25% 20291101	1,020,000.00	1,076,006.16	
331A00	ドイツ国債 5.5% 20310104	960,000.00	1,126,488.96	
331E00	イタリア国債 6% 20310501	1,120,000.00	1,277,497.76	
332J00	フランス国債 5.75% 20321025	540,000.00	653,191.56	
334H00	イタリア国債 5% 20340801	1,150,000.00	1,158,257.00	
335C00	ベルギー国債 5% 20350328	380,000.00	407,468.30	
335D00	フランス国債 4.75% 20350425	580,000.00	620,398.74	
337A00	スペイン国債 4.2% 20370131	1,210,000.00	1,130,440.08	
337A01	オランダ国債 4% 20370115	450,000.00	433,200.60	
337A02	ドイツ国債 4% 20370104	990,000.00	966,251.88	
337B00	イタリア国債 4% 20370201	1,410,000.00	1,224,555.39	
337C00	オーストリア国債 4.15% 20370315	200,000.00	189,690.20	
337D00	ポルトガル国債 4.1% 20370415	200,000.00	183,352.60	
337I00	ギリシャ国債 4.5% 20370920	750,000.00	645,069.00	
338J00	フランス国債 4% 20381025	720,000.00	687,020.40	
339G00	ドイツ国債 4.25% 20390704	770,000.00	788,497.71	
355D00	フランス国債 4% 20550425	520,000.00	492,202.88	
N00238	フランス国債 5% 20111025	1,430,000.00	1,526,785.26	
国債証券計		100,140,000.00	106,708,769.56	

ユーロ計	100,140,000.00	106,708,769.56	
(邦貨換算額)	(13,826,329,800)	(14,733,279,813)	

(単位：円)

総合計	(26,574,746,300)	(28,350,145,585)	
	26,574,746,300	28,350,145,585	

(注) 総合計の()内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	国債証券 73銘柄	100.0	31.9
カナダドル	国債証券 12銘柄	100.0	2.8
オーストラリアドル	国債証券 7銘柄	100.0	0.7
イギリスポンド	国債証券 21銘柄	100.0	7.8
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0	0.6
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0	0.8
シンガポールドル	国債証券 3銘柄	100.0	0.4
マレーシアリングgit	国債証券 3銘柄	100.0	0.6
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0	1.0
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0	0.4
ポーランドズロチ	国債証券 6銘柄	100.0	1.0
ユーロ	国債証券 137銘柄	100.0	52.0

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平成21年10月30日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	260,024,767	円
負債総額	20,762	円
純資産総額（ - ）	260,004,005	円
発行済数量	293,379,336	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8862	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	32,688,934,001	円
負債総額	941,159,523	円
純資産総額（ - ）	31,747,774,478	円
発行済数量	47,699,856,450	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6656	円

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

純資産額計算書

資産総額	69,891,336,063	円
負債総額	7,251,556	円
純資産総額（ - ）	69,884,084,507	円
発行済数量	81,340,044,335	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8592	円

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

純資産額計算書

資産総額	1,129,536,292	円
負債総額	27,364,744	円
純資産総額（ - ）	1,102,171,548	円
発行済数量	1,616,621,407	口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6818	円

（参考）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	37,586,745,762	円
負債総額	52,961,476	円
純資産総額（ - ）	37,533,784,286	円
発行済数量	32,096,185,282	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1694	円

（参考）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	720,311,489,400	円
負債総額	3,263,925,337	円
純資産総額（ - ）	717,047,564,063	円
発行済数量	449,209,063,159	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5962	円

（参考）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	29,764,352,117	円
負債総額	1,341,551,084	円
純資産総額（ - ）	28,422,801,033	円
発行済数量	24,092,456,691	口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1797	円

第5【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間（1999年10月29日～2000年10月26日）	11,320,561	0
第2計算期間（2000年10月27日～2001年10月26日）	26,990,121	115,043

第3計算期間(2001年10月27日～2002年10月28日)	105,391,687	14,170,667
第4計算期間(2002年10月29日～2003年10月27日)	77,243,110	24,200,287
第5計算期間(2003年10月28日～2004年10月26日)	88,389,153	29,592,771
第6計算期間(2004年10月27日～2005年10月26日)	57,179,000	54,915,028
第7計算期間(2005年10月27日～2006年10月26日)	163,976,841	107,674,925
第8計算期間(2006年10月27日～2007年10月26日)	55,068,040	92,074,900
第9計算期間(2007年10月27日～2008年10月27日)	47,687,195	36,434,455
第10計算期間(2008年10月28日～2009年10月26日)	41,843,319	21,585,947

(注) 第1計算期間の設定数量には、当初設定数量を含みません。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成21年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	220,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減

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

(2) 会社の意思決定機構

・株主総会

取締役・監査役などの選任、定款変更などに係る決議などを行いません。

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

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

10名以内の取締役で構成され、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までを任期とします。

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

・監査役会

5名以内の監査役で構成され、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

（平成21年12月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用に関するリスク・パフォーマンスの評価と分析および法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理については、運用部門から独立したリスク管理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、精度の高い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21年12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	368	65,894
株式投資信託	291	53,184
単位型	41	986
追加型	250	52,198
公社債投資信託	77	12,709
単位型	60	948
追加型	17	11,760
投資法人合計	1	39

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、改正前の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて、第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第50期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	第49期 (平成20年3月31日)		第50期 (平成21年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		35,432		27,759
有価証券		337		
前払費用		407		393
未収入金		7		3,869
未収委託者報酬		10,138		5,506
未収収益	3	712	3	582
立替金		190		222
繰延税金資産		1,901		862
その他	2	30	2	30
流動資産合計		49,158		39,226
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	843	1	313
器具備品	1	548	1	346
有形固定資産合計		1,391		660
無形固定資産				
ソフトウェア		109		73
電話加入権等		21		21
無形固定資産合計		131		94
投資その他の資産				
投資有価証券		4,274		1,243
関係会社株式		8,154		7,719
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		1,062		1,037
繰延税金資産		661		1,218
その他		2		0
子会社投資損失引当金		576		576
投資その他の資産合計		13,639		10,702
固定資産合計		15,162		11,458
資産合計		64,321		50,684

(単位:百万円)

	第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	150	181
未払金	5,073	2,811
未払収益分配金	7	7
未払償還金	353	187
未払手数料	4,378	2,391
その他未払金	333	225
未払費用	3 6,697	3 3,701
未払法人税等	5,651	
未払消費税等	424	
賞与引当金	2,855	1,821
役員賞与引当金	320	191
その他	212	16
流動負債合計	21,384	8,723
固定負債		
退職給付引当金	624	612
その他	102	102
固定負債合計	727	714
負債合計	22,112	9,438
純資産の部		
株主資本		
資本金	16,287	16,403
資本剰余金		
資本準備金	4,157	4,272
その他資本剰余金	4	4
資本剰余金合計	4,161	4,277
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	21,660	20,593
利益剰余金合計	21,660	20,593
株主資本合計	42,109	41,273
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	99	26
評価・換算差額等合計	99	26
純資産合計	42,208	41,246
負債純資産合計	64,321	50,684

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	87,292	56,567
その他営業収益	3,894	2,962
営業収益計	91,186	59,529
営業費用		
支払手数料	36,598	27,877
広告宣伝費	4,770	1,298
公告費	42	17
受益証券発行費	13	
調査費	17,679	12,861
調査費	868	854
委託調査費	16,792	11,990
図書費	19	15
委託計算費	554	491
営業雑経費	1,002	714
通信費	237	190
印刷費	430	340
協会費	44	49
諸会費	9	7
その他	280	126
営業費用計	60,661	43,260
一般管理費		
給料	8,005	7,124
役員報酬	220	228
役員賞与引当金繰入額	320	191
給料・手当	4,578	4,879
賞与	31	4
賞与引当金繰入額	2,855	1,821
交際費	100	79
寄付金	19	33
旅費交通費	446	264
租税公課	341	255
不動産賃借料	1,164	921
退職給付費用	327	336
退職金	231	14
固定資産減価償却費	446	801
諸経費	3,806	2,992
一般管理費計	14,890	12,824
営業利益	15,634	3,444

(単位：百万円)

	第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日)		第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1		2
受取配当金		63	1	710
有価証券売却益				160
有価証券償還益				73
時効成立分配金・償還金		689		106
その他		71		122
営業外収益計		826		1,176
営業外費用				
支払利息		16		15
有価証券売却損				51
有価証券償還損				200
時効成立後支払分配金・償還金		90		129
弁護士報酬等		31		37
その他		12		2
営業外費用計		150		438
経常利益		16,310		4,182
特別利益				
投資有価証券売却益		560		38
特別利益計		560		38
特別損失				
投資有価証券売却損		390		226
投資有価証券評価損				569
関係会社株式評価損		2,618		454
固定資産処分損		46		0
移転費用		110		
割増退職金				433
その他		7		
特別損失計		3,172		1,685
税引前当期純利益		13,697		2,535
法人税、住民税及び事業税		7,266		273
法人税等調整額		1,581		568
法人税等合計		5,685		842
当期純利益		8,012		1,693

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	16,223	16,287
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	16,287	16,403
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	4,092	4,157
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	4,157	4,272
其他資本剰余金		
前期末残高	4	4
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	4	4
資本剰余金合計		
前期末残高	4,097	4,161
当期変動額		
新株の発行	64	115
当期変動額合計	64	115
当期末残高	4,161	4,277
利益剰余金		
其他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	20,616	21,660
当期変動額		
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,043	1,067
当期末残高	21,660	20,593
利益剰余金合計		
前期末残高	20,616	21,660
当期変動額		
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,043	1,067
当期末残高	21,660	20,593

(単位:百万円)

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本合計		
前期末残高	40,937	42,109
当期変動額		
新株の発行	129	230
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
当期変動額合計	1,172	836
当期末残高	42,109	41,273
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	682	99
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	582	126
当期末残高	99	26
評価・換算差額等合計		
前期末残高	682	99
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	582	126
当期末残高	99	26
純資産合計		
前期末残高	41,619	42,208
当期変動額		
新株の発行	129	230
剰余金の配当	6,969	2,760
当期純利益	8,012	1,693
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	582	126
当期変動額合計	589	962
当期末残高	42,208	41,246

重要な会計方針

	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時 価法(評価差額は、全部純資産直入 法により処理し、売却原価は、総平 均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方 法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。た だし、ソフトウェア(自社利用分)に ついては、社内における利用可能期 間(5年)に基づく定額法によってお ります。	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充て るため、支払見込額に基づき当事業 年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てる ため、支払見込額に基づき当事業年 度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当 事業年度末における退職給付債務及 び年金資産の見込額に基づき計上し ております。 数理計算上の差異は、各事業年度の 発生時における従業員の平均残存勤 務期間以内の一定の年数(10年)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。	(1) 賞与引当金 同左 (2) 役員賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左

	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
4 リース取引の処理方法	(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	(4) 子会社投資損失引当金 同左
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、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。	消費税等の会計処理 同左

会計方針の変更

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
(固定資産の減価償却の方法) 法人税法の改正((所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号)及び(法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号))に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得したのものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。これにより、従来の方法によった場合に比べて、営業利益、経常利益、税引前当期純利益が63百万円、当期純利益が37百万円それぞれ減少しております。	

表示方法の変更

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
「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)の別紙様式に基づき、前事業年度において「現金」及び「預金」として掲記されていたものは、当事業年度より「現金・預金」と表示しております。	

注記事項

（貸借対照表関係）

第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 166百万円 器具備品 210百万円 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、日興シティ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通りであります。 (流動資産) 未収収益 77百万円 (流動負債) 未払費用 693百万円 4 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 704百万円 器具備品 424百万円 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、日興シティ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通りであります。 (流動資産) 未収収益 28百万円 (流動負債) 未払費用 272百万円 4 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務64百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21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、次の通りであります。 受取配当金 703百万円

(株主資本等変動計算書関係)

第49期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	183,402,500	645,000		184,047,500

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加645,000株は、第三者割当による新株の発行による増加であります。

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
			前事業 年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出 会社	平成16年度 ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度 ストックオプション(3)	普通株式	6,520,000	-	520,000	6,000,000	-
	平成17年度 ストックオプション	普通株式	3,450,000	-	310,000	3,140,000	-
	平成18年度 ストックオプション	普通株式	1,550,000	-	80,000	1,470,000	-
	平成19年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,250,000	110,000	4,140,000	-
	平成19年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	30,000	-	30,000	-
合計			23,520,000	4,280,000	1,020,000	26,780,000	-

- (注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しております。
- 2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。
- 3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
- 4 平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成19年5月23日 取締役会	普通株式	6,969	38	平成19年3月31日	平成19年6月21日

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

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

第50期（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	184,047,500	965,000		185,012,500

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

- (注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しております。
- 2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。
- 3 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度後となるもの現時点で未定であります。

（リース取引関係）

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 当事業年度中にリース契約が終了し、金額が僅少であるため、注記を省略しております。	1 ファイナンス・リース取引
2 オペレーティング・リース取引 未経過リース料	2 オペレーティング・リース取引 未経過リース料
1年内 906百万円	1年内 906百万円
1年超 1,849百万円	1年超 942百万円
合計 2,755百万円	合計 1,849百万円

（有価証券関係）

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

	種 類	取 得 原 価	貸借対照表計上額	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	7	27	19
	そ の 他	2,667	3,071	403
	小 計	2,675	3,098	423
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,545	1,289	255
	小 計	1,545	1,289	255
合 計		4,220	4,388	167

(注) 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 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

売 却 額	売 却 益 の 合 計 額	売 却 損 の 合 計 額
8,079	560	390

3 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式	124
その他 投資証券	100
合 計	224

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない株式7百万円につき、株式の実質価額の低下を考慮し、減損処理を行っております。

4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
その他有価証券 その他 投資信託	337	1,078	792	1,112
合 計	337	1,078	792	1,112

5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差 額
子会社株式	905	787	117
合 計	905	787	117

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

	種 類	取 得 原 価	貸借対照表計上額	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	7	12	5
	そ の 他	273	299	25
	小 計	280	312	31
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	836	759	76
	小 計	836	759	76
合 計		1,117	1,072	45

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

2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

売 却 額	売 却 益 の 合 計 額	売 却 損 の 合 計 額
3,196	199	278

3 時価評価されていない有価証券

その他有価証券

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式	121
その他 投資証券	50
合 計	171

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

4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位：百万円)

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

5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位：百万円)

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

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

(持分法損益等)

第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月 31日)	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21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 2,892	(1) 関連会社に対する投資の金額 2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,201	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,495
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,519	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,019

(退職給付関係)

第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月 31日)	第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21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、キャッシュバランスプラン型退職金制度、適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。	1 採用している退職給付制度の概要 同左
2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)	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 1,502	イ 退職給付債務 1,429
ロ 年金資産 688	ロ 年金資産 676
ハ 未積立退職給付債務 813	ハ 未積立退職給付債務 753
ニ 未認識数理計算上の差異 188	ニ 未認識数理計算上の差異 141
ホ 退職給付引当金残高 624	ホ 退職給付引当金残高 612
3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)	3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)
イ 勤務費用 96	イ 勤務費用 107
ロ 利息費用 29	ロ 利息費用 30
ハ 期待運用収益 5	ハ 期待運用収益 5
ニ 数理計算上の差異の費用処理額 32	ニ 数理計算上の差異の費用処理額 34
ホ 確定拠出型企業年金への掛金 174	ホ 確定拠出型企業年金への掛金 169
ヘ 退職給付費用合計 327	ヘ 退職給付費用合計 336

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項	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	イ 退職給付見込額の期間配分方法 勤続期間比例
ロ 割引率 2.0%	ロ 割引率 2.0%
ハ 期待運用収益率 0.7%	ハ 期待運用収益率 0.7%
ニ 数理計算上の差異の処理年数 10年	ニ 数理計算上の差異の処理年数 10年
	5 割増退職金に関する事項
	(単位:百万円)
	イ 流動負債 16
	ロ 割増退職金 433

(ストックオプション等関係)

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年 8 月31日	平成16年 8 月31日
権利確定前(株)		
期首		680,000
付与		0
失効		0
権利確定		680,000
権利未確定残		0
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	5,320,000
権利確定	0	680,000
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	6,000,000

	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年 1 月11日、平成17年 1 月28日 平成17年 5 月24日、平成17年 6 月22日	平成18年 2 月14日
権利確定前(株)		
期首	6,520,000	3,450,000
付与	0	0
失効	520,000	310,000
権利確定	0	0
権利未確定残	6,000,000	3,140,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,220,000	330,000
付与	0	0
失効	80,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,140,000	330,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	0	0
付与	4,250,000	30,000
失効	110,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	4,140,000	30,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

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

単価情報

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

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

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

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

- (注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。
- 2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

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

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

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

単価情報

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

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

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。

2 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。

3 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値（DCF法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

4 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 169百万円

(税効果会計関係)

第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <p>賞与引当金繰入超過額 1,161</p> <p>未払事業税 551</p> <p>その他 188</p> <hr/> <p style="text-align: right;">1,901</p> <p>繰延税金資産(固定)</p> <p>退職給付引当金超過額 254</p> <p>子会社投資損失引当金 234</p> <p>その他 240</p> <hr/> <p style="text-align: right;">729</p> <p>繰延税金資産合計 2,630</p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <p>その他有価証券評価差額金 68</p> <hr/> <p>繰延税金負債合計 68</p> <p>繰延税金資産の純額 2,562</p>	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <p>賞与引当金繰入超過額 895</p> <p>その他 182</p> <hr/> <p style="text-align: right;">1,078</p> <p>繰延税金資産(固定)</p> <p>投資有価証券等評価損 171</p> <p>関係会社株式評価損 185</p> <p>退職給付引当金超過額 249</p> <p>子会社投資損失引当金 234</p> <p>固定資産減価償却超過額 215</p> <p>その他 162</p> <hr/> <p style="text-align: right;">1,218</p> <p>繰延税金資産合計 2,297</p> <p>繰延税金負債(流動)</p> <p>事業税中間納付還付予定額 216</p> <hr/> <p>繰延税金負債合計 216</p> <p>繰延税金資産の純額 2,080</p>
<p>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百分の五以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.6%</p> <p>(調整)</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 3.6%</p> <p>外国税額控除の影響額等 11.0%</p> <hr/> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 33.2%</p>

（関連当事者情報）

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」(平成18年10月17日 企業会計基準委員会 企業会計基準第11号)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(平成18年10月17日 企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第13号)を早期に適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に加えて、親会社又は重要な関連会社に関する注記が開示対象に追加されております。

1 関連当事者との取引

(1) 関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有) 割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払 (注1)	19,162	未払手数料	2,977

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社

株式会社日興コーディアルグループ

(注) 平成20年5月1日、シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社と株式会社日興コーディアルグループは合併し、日興シティホールディングス株式会社に名称変更しております。

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成19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	8,817百万円
負債合計	2,727百万円
純資産合計	6,090百万円
営業収益	13,173百万円
税引前当期純利益	5,719百万円
当期純利益	4,873百万円

第50期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1)	13,541	未払手数料	1,406

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

日興シティホールディングス株式会社

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情

報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成20年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	6,747百万円
負債合計	1,977百万円
純資産合計	4,769百万円

営業収益	10,700百万円
税引前当期純利益	3,968百万円
当期純利益	3,255百万円

(1株当たり情報)

第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	
1株当たり純資産額	229円33銭	1株当たり純資産額	222円93銭
1株当たり当期純利益	43円54銭	1株当たり当期純利益	9円16銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>		<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>	

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

項目	第49期 (平成20年3月31日)	第50期 (平成21年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	-	41,246
普通株式に係る純資産額(百万円)	-	41,246
差額の主な内訳(百万円)		
新株予約権	-	-
普通株式の発行済株式数(千株)	-	185,013
普通株式の自己株式数(千株)	-	-
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(千株)	-	185,013

(注) 当事業年度より、1株当たり純資産額の算定上の基礎を記載しております。

2 1株当たり当期純利益金額及び潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎

項目	第49期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第50期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
当期純利益(百万円)	8,012	1,693
普通株式に係る当期純利益(百万円)	8,012	1,693
普通株主に帰属しない金額(百万円)		
普通株式の期中平均株式数(千株)	184,023	184,790
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3)6,000,000株、平成17年度ストックオプション3,140,000株、平成18年度ストックオプション1,470,000株、平成19年度ストックオプション(1)4,140,000株、平成19年度ストックオプション(2)30,000株。	平成16年度ストックオプション(1)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3)5,330,000株、平成17年度ストックオプション2,840,000株、平成18年度ストックオプション1,320,000株、平成19年度ストックオプション(1)3,610,000株、平成19年度ストックオプション(2)30,000株。

(重要な後発事象)

第49期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

1 新株発行に対する払込

当社は、平成20年6月9日開催の定時株主総会及び同日開催の取締役会にて、965,000株の第三者割当による当社普通株式の発行を決議いたしました。決済金額は期日に払込まれております。

割当先	日興アセットマネジメント社員持株会
発行価額	1株につき金239円
資本組入額	1株につき金119円50銭
払込期日	平成20年6月23日

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1 投資有価証券の繰上償還

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

1. 当社の中間財務諸表は、改正後の「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、以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第51期中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第51期中間会計期間末
(平成21年9月30日現在)

資産の部

流動資産

現金及び預金	21,422	
未収委託者報酬	6,134	
未収収益	900	
立替金	1,211	
繰延税金資産	973	
その他	2	450
流動資産合計	31,093	

固定資産

有形固定資産	1	497
無形固定資産	81	
投資その他の資産		
投資有価証券	11,054	
関係会社株式	7,719	
長期差入保証金	1,044	
繰延税金資産	1,080	
その他	60	
子会社投資損失引当金	576	
投資その他の資産合計	20,382	
固定資産合計	20,961	
資産合計	52,054	

(単位：百万円)

第51期中間会計期間末
(平成21年9月30日現在)

負債の部

流動負債

未払金	3,389
未払費用	4,148
未払法人税等	598
未払消費税等	123
賞与引当金	1,336
役員賞与引当金	110
その他	230
流動負債合計	9,937

固定負債

退職給付引当金	678
その他	102
固定負債合計	781

負債合計 10,718

純資産の部

株主資本

資本金	16,403
資本剰余金	
資本準備金	4,272
その他資本剰余金	4
資本剰余金合計	4,277

利益剰余金

その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	20,576
利益剰余金合計	20,576

株主資本合計 41,256

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	79
評価・換算差額等合計	79

純資産合計 41,335

負債純資産合計 52,054

(2) 中間損益計算書

(単位 : 百万円)

第51期中間会計期間
(自 平成21年 4 月 1 日
至 平成21年 9 月30日)

営業収益		
委託者報酬		24,168
その他営業収益		1,347
営業収益合計		25,515
営業費用及び一般管理費	1	24,429
営業利益		1,085
営業外収益	2	855
営業外費用	3	307
経常利益		1,633
特別利益	4	1
特別損失	5	41
税引前中間純利益		1,593
法人税、住民税及び事業税		573
法人税等調整額		46
中間純利益		1,065

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

	第51期中間会計期間 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成21年 9 月30日)
株主資本	
資本金	
前期末残高	16,403
当中間期末残高	<u>16,403</u>
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	4,272
当中間期末残高	<u>4,272</u>
その他資本剰余金	
前期末残高	4
当中間期末残高	<u>4</u>
資本剰余金合計	
前期末残高	4,277
当中間期末残高	<u>4,277</u>
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
前期末残高	20,593
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	<u>1,065</u>
当中間期変動額合計	<u>16</u>
当中間期末残高	<u>20,576</u>
利益剰余金合計	
前期末残高	20,593
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	<u>1,065</u>
当中間期変動額合計	<u>16</u>
当中間期末残高	<u>20,576</u>
株主資本合計	
前期末残高	41,273
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	<u>1,065</u>
当中間期変動額合計	<u>16</u>
当中間期末残高	<u>41,256</u>
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	26
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>106</u>
当中間期変動額合計	<u>106</u>
当中間期末残高	<u>79</u>

評価・換算差額等合計	
前期末残高	26
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>106</u>
当中間期変動額合計	<u>106</u>
当中間期末残高	<u>79</u>
純資産合計	
前期末残高	41,246
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,082
中間純利益	1,065
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>106</u>
当中間期変動額合計	<u>89</u>
当中間期末残高	<u>41,335</u>

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>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</p> <p>其他有価証券 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 定額法によっております。但し、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 給見込額に基づき、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、支給 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。 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)で按分した額をそれぞれ発生の翌事 業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備 えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる 額を計上しております。</p>
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について 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>

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)
該当事項はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第51期中間会計期間末 (平成21年 9月30日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 1,292百万円
2. 信託資産 その他流動資産のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。
3. 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドンウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務49百万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51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	163 百万円
無形固定資産	14 百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	0 百万円
受取配当金	713 百万円
時効成立分配金・償還金	15 百万円
有価証券償還益	13 百万円
中間納付法人税等還付加算金	110 百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	5 百万円
時効成立後支払分配金・償還金	46 百万円
弁護士報酬等	30 百万円
為替差損	60 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	1 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	12 百万円
割増退職金	28 百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第51期中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21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	前事業年度末 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	185,012,500			185,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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)
		前事業年度末	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16年度ストックオプション (1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション (2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション (3)	普通株式	5,330,000	-	90,000	5,240,000	-
平成17年度ストックオプション	普通株式	2,840,000	-	160,000	2,680,000	-
平成18年度ストックオプション	普通株式	1,320,000	-	-	1,320,000	-
平成19年度ストックオプション (1)	普通株式	3,610,000	-	40,000	3,570,000	-
平成19年度ストックオプション (2)	普通株式	30,000	-	-	30,000	-
合計		25,130,000	-	290,000	24,840,000	-

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当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51期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)	
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引	該当事項はありません。
2. オペレーティング・リース取引	
未経過リース料	
1年内	906 百万円
1年超	488 百万円
合計	1,395 百万円

(有価証券関係)

第51期中間会計期間末（平成21年9月30日現在）

1 その他有価証券で時価のあるもの

区分	取得原価 (百万円)	中間貸借対照表 計上額(百万円)	差額 (百万円)
株式	7	18	11
その他	10,765	10,888	122
合計	10,772	10,906	134

(注) 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。当中間会計期間末においては該当ございません。

2 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
子会社株式	500	669	168
合 計	500	669	168

3 時価評価されていない主な有価証券の内容

区 分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
子会社株式	3,748
関連会社株式	2,892
その他有価証券	
非上場株式	97
その他	50

(持分法損益等)

第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21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	(単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額	2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	4,307
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	683

(ストックオプション等関係)

第51期中間会計期間(自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

第51期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)	
1株当たり純資産額	223円42銭
1株当たり中間純利益	5円75銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、新株予約権の残高はありますが、非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので希薄化効果を算定できないため、記載しておりません。</p>	

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

項目	第51期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額 (百万円)	41,335
普通株式に係る純資産額(百万円)	41,335
差額の主な内訳(百万円) 新株予約権	-
普通株式の発行済株式数(千株)	185,013
普通株式の自己株式数(千株)	-
1株当たり純資産額の算定に用いられた 普通株式の数(千株)	185,013

2 1株当たり中間純利益及び潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定上の基礎

	第51期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至平成21年9月30日)
中間純利益(百万円)	1,065
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)	1,065
普通株式の期中平均株式数(千株)	185,013
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の算定に含まれな かった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株 平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株 平成16年度ストックオプション(3) 5,240,000株 平成17年度ストックオプション 2,680,000株 平成18年度ストックオプション 1,320,000株 平成19年度ストックオプション(1) 3,570,000株 平成19年度ストックオプション(2) 30,000株

(重要な後発事象)

第51期中間会計期間(自平成21年4月1日至平成21年9月30日)

住友信託銀行株式会社は、平成21年10月1日に当社取締役から取得した新株予約権を同日行使しました。行使価額は同日払込まれ、当社は12,000,000株の当社普通株式を発行いたしました。

割当先	住友信託銀行株式会社
発行価額	1株につき金159円
資本組入額	1株につき金80円

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21年3月末現在)	事業の内容
日興シティ信託銀行株式会社	20,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成21年3月末現在)	事業の内容
日興コーディアル証券株式会社	10,000百万円 (平成21年10月1日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社きらやか銀行	17,700百万円	
ソニー銀行株式会社	31,000百万円	
株式会社第三銀行	22,461百万円	
株式会社東北銀行	8,233百万円	
株式会社もみじ銀行	74,965百万円	
株式会社琉球銀行	54,127百万円	
ソニー生命保険株式会社	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
三井生命保険株式会社	167,280百万円	

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

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) 目論見書の表紙または表紙裏に、委託会社の名称、ファンドの基本的性格などを記載し、委託会社およびファンドのロゴ・マークを表示し、図案などを採用することがあります。
- (3) 目論見書の表紙裏に、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、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なり、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こと。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ならないこと。
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こと。
投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託をご購入されたお客様が負うこと。
- (4) 目論見書の裏表紙に、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を記載することがあります。
- (5) 目論見書の巻末に「用語集」を記載します。
- (6) 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」を要約し、「ファンドの概要」などとして、目論見書の冒頭に記載することがあります。
- (7) 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。
- (8) 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。
- (9) 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。
- (10) 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。

独立監査人の監査報告書

平成20年12月10日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成19年10月27日から平成20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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成20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。

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. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年12月2日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 涉
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60）の平成20年10月28日から平成21年10月26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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）の平成21年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

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. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月23日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅
業務執行社員指定社員 公認会計士 鳥飼裕一
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19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年11月16日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第51期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成21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21年4月1日から平成21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。

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

以 上

（注）上記は、当社が、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。