

【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24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】	雄谷 敦史
【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40）
【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40）（以下「ファンド」といいます。）
- ・愛称として「Aナビ40」、「ステージ3」、「アセット・ナビゲーション・ファンド」、「Aナビ」という名称を用いることがあります。

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

(5) 【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.05%（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24年1月27日から平成25年1月25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

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	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いません。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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。
2. インデックスファンドで構成しています。
3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

ファンドの仕組み

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



- (主な投資制限) ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
 ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- (分配方針) ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
 ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ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。

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

主として世界各国の債券に投資し、シティ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。

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

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

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

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

3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%とします。
- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
- 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	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	5%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成11年10月29日 ファンドの信託契約締結、運用開始

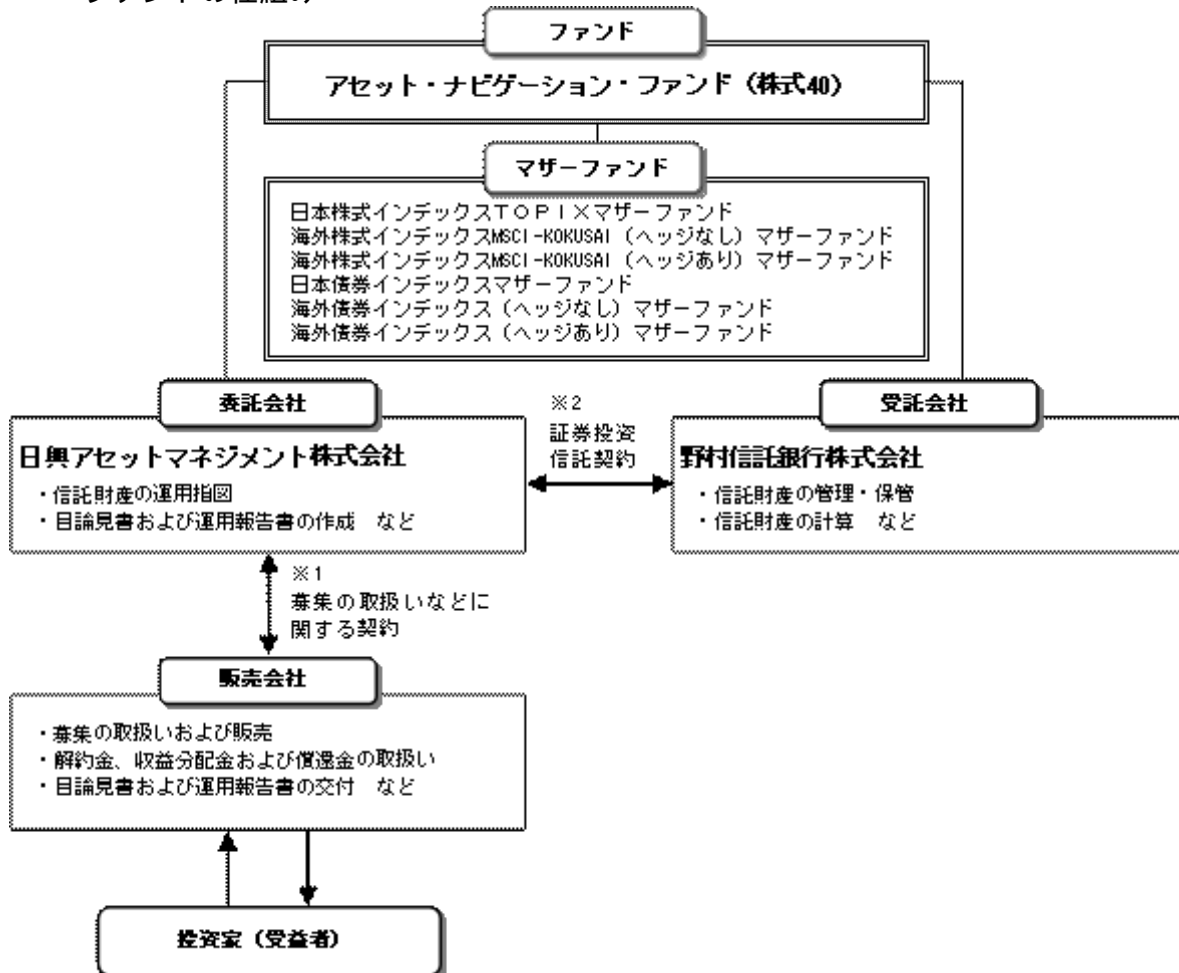
平成13年6月1日 ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ3）

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。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23年11月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
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	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

- 純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。

株式の標準実質組入比率.....40%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%

- 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。

- また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。

- 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40）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券

2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券

3) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券

4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券

5) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券

6) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券

- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 13) コマーシャル・ペーパー
- 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
- 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 19) 預託証券（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。）
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 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券

- 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)をいいます。
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)をいいます。
- 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をいいます。
- 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、)をいいます。
- 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) 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、)をいいます。
- 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー

- 7) 外国または外国の者の発行する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。)

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

項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

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

< 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。)

- 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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* 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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成12年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI-KOKUSAI インデックスは、MSCI Inc. が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* 日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興フィナンシャル・インテリジェンス株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からB B B格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS M B C日興証券株式会社に帰属します。また、S M B C日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティ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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

*シティ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 >

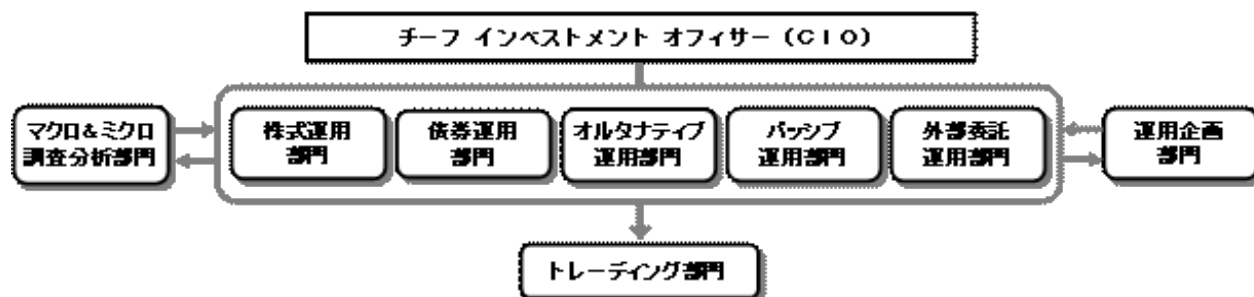
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

^{*}シティ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。

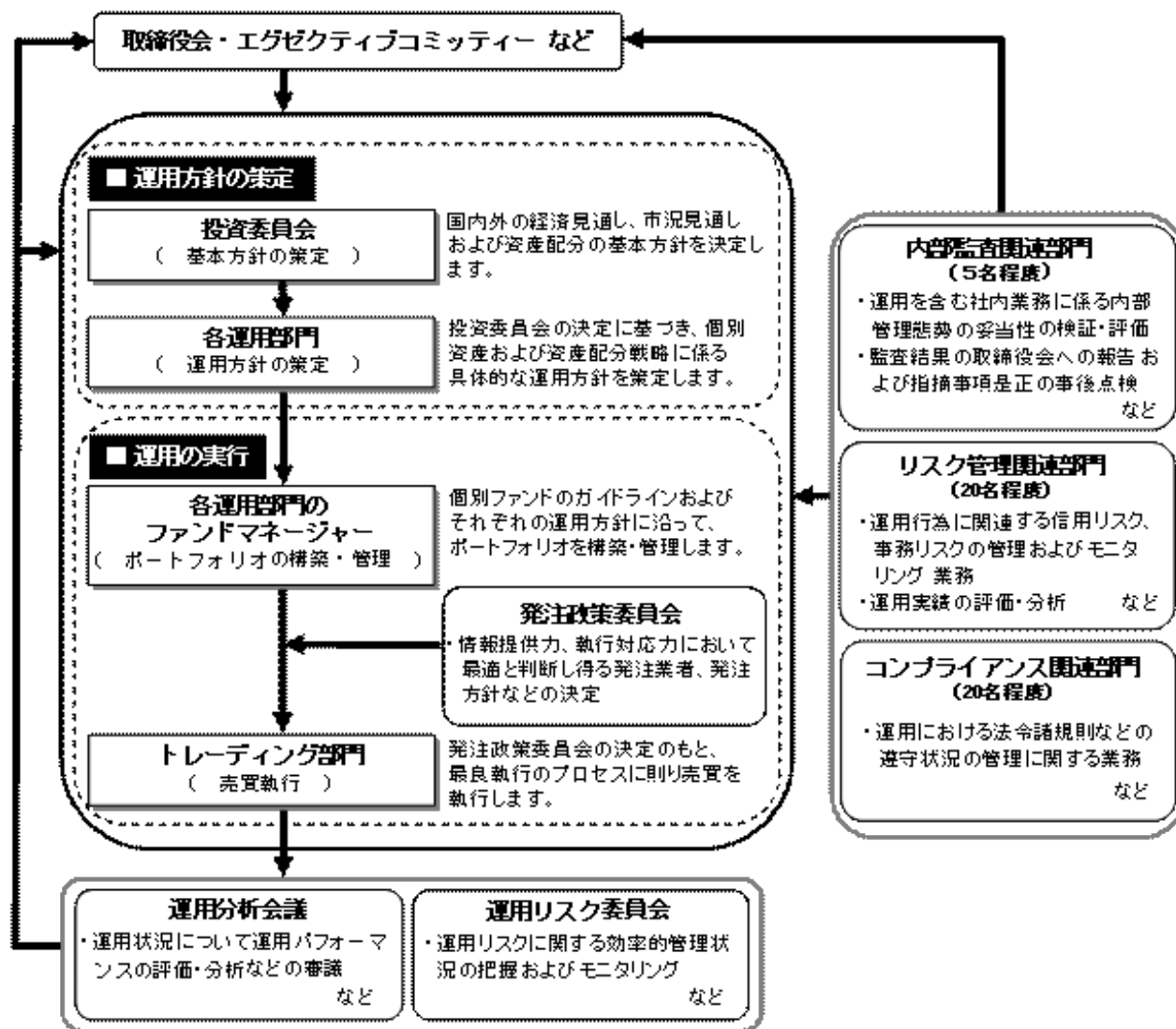
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

上記体制は平成23年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

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40）>

- 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が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

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

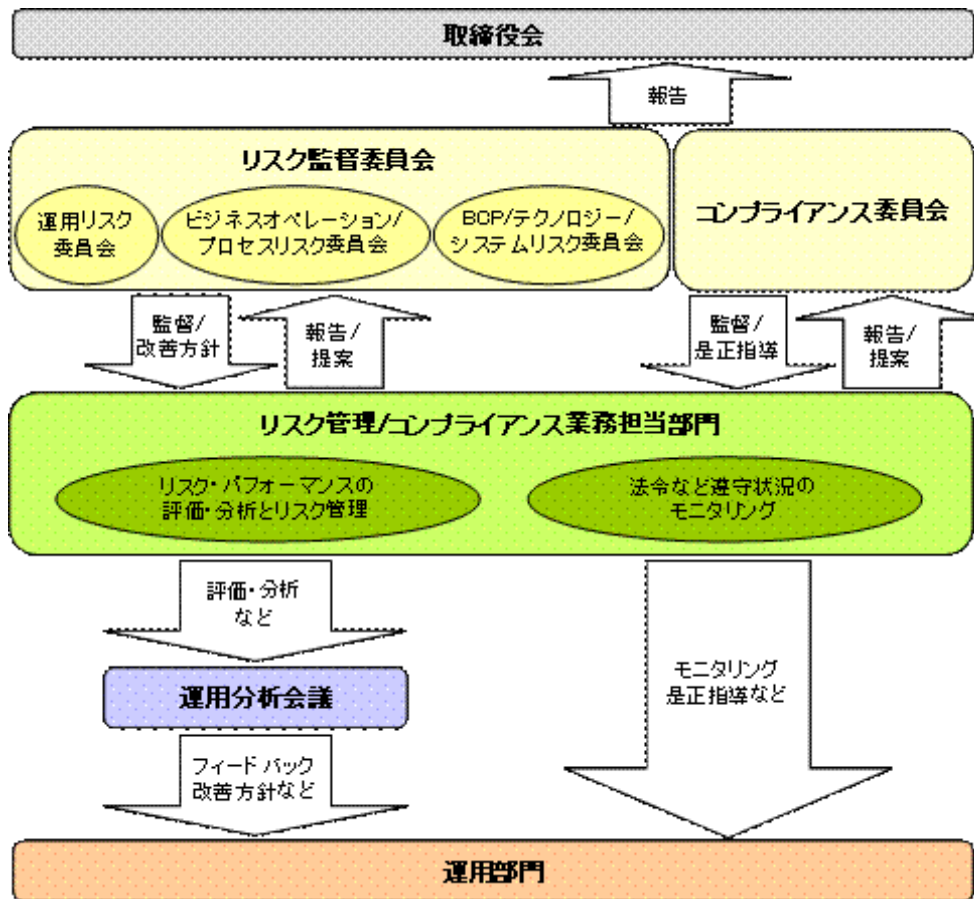
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、

- ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・ 基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
 - ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
 - ・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社的リスク管理

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・分析とリスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果については運用分析会議に報告し、リスク管理状況についてはリスク監督委員会あるいはその部門別委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成23年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【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0.2%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0.6405%（税抜0.61%）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
0.6405%	0.2310%	0.3675%	0.0420%
（0.61%）	（0.22%）	（0.35%）	（0.04%）

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（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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25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（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもで

きます。

- ・なお、平成26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25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26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ます。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）および普通分配金（申告分離課税を選択したものに限ります。）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25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26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

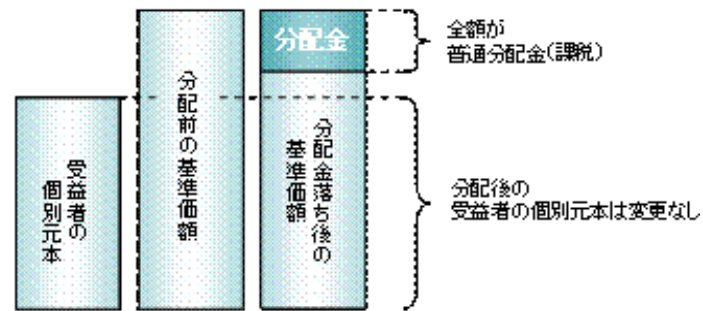
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と特別分配金

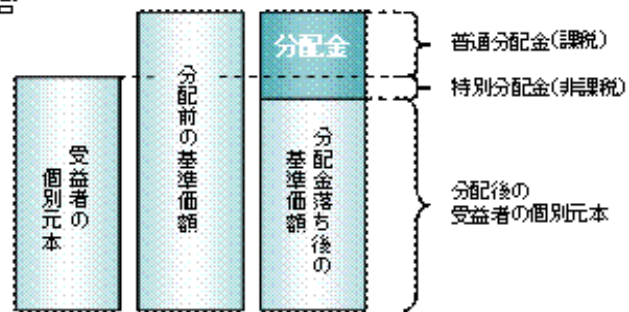
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から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



上記は本書提出日現在のものであり、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

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

5【運用状況】

以下の運用状況は2011年11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】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	520,794,119	95.07
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	26,985,961	4.93
合計(純資産総額)		547,780,080	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	198,249,357	1.2289	243,628,635	1.2255	242,954,587	44.35
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	294,662,026	0.5792	170,668,246	0.5665	166,926,037	30.47
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	36,159,003	0.7962	28,789,799	0.7853	28,395,665	5.18
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	38,254,553	0.7527	28,794,203	0.7325	28,021,460	5.12
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	19,681,119	1.3973	27,500,428	1.3940	27,435,479	5.01
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	21,548,727	1.2632	27,220,352	1.2558	27,060,891	4.94

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.07
合計	95.07

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】
【純資産の推移】

期別		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第3計算期間末	2002年10月28日	512	512	0.8698	0.8698
第4計算期間末	2003年10月27日	584	584	0.9266	0.9266
第5計算期間末	2004年10月26日	773	773	0.9602	0.9602
第6計算期間末	2005年10月26日	800	801	1.0655	1.0665
第7計算期間末	2006年10月26日	851	851	1.1456	1.1466
第8計算期間末	2007年10月26日	807	807	1.1554	1.1564
第9計算期間末	2008年10月27日	596	596	0.8732	0.8732
第10計算期間末	2009年10月26日	678	678	0.9839	0.9839
第11計算期間末	2010年10月26日	646	646	0.9762	0.9762
第12計算期間末	2011年10月26日	560	560	0.9571	0.9571
	2010年11月末日	646	-	0.9840	-
	12月末日	651	-	1.0018	-
	2011年1月末日	645	-	1.0056	-
	2月末日	639	-	1.0210	-
	3月末日	626	-	1.0039	-
	4月末日	619	-	1.0024	-
	5月末日	608	-	0.9964	-
	6月末日	608	-	0.9989	-
	7月末日	599	-	0.9934	-
	8月末日	570	-	0.9630	-
	9月末日	568	-	0.9576	-
	10月末日	567	-	0.9688	-
	11月末日	547	-	0.9466	-

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第3期	2001年10月27日～2002年10月28日	0
第4期	2002年10月29日～2003年10月27日	0
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	0
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	0.0010
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	0.0010
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.0010
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	0
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	0
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	0

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第3期	2001年10月27日～2002年10月28日	6.59
第4期	2002年10月29日～2003年10月27日	6.53
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	3.63
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	11.07
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	7.61
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	0.94

第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	24.42
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	12.68
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.78
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	1.96

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第3期	2001年10月27日～2002年10月28日	515,868,360	64,429,487
第4期	2002年10月29日～2003年10月27日	122,922,594	81,523,098
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	322,027,757	146,412,974
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	204,514,978	258,946,016
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	190,242,412	198,919,086
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	124,313,633	168,417,903
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	75,494,820	90,623,951
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	59,505,614	53,844,794
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	44,772,360	71,522,165
第12期	2010年10月27日～2011年10月26日	38,817,760	115,309,278

(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2011年11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

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	24,514,682,025	98.78
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	303,623,197	1.22
合計(純資産総額)		24,818,305,222	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	276,450,000	1.11

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	317,000	2,527.87	801,336,300	2,509.00	795,353,000	3.20
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,843,700	330.99	610,248,200	328.00	604,733,600	2.44
日本	株式	キヤノン	電気機器	153,300	3,509.58	538,020,000	3,420.00	524,286,000	2.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	208,200	2,328.85	484,866,900	2,389.00	497,389,800	2.00
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	112,100	3,852.63	431,880,000	3,775.00	423,177,500	1.71
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	184,200	2,125.86	391,585,000	2,089.00	384,793,800	1.55
日本	株式	ファナック	電気機器	25,700	12,507.23	321,436,000	12,270.00	315,339,000	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,127,000	107.97	337,644,000	100.00	312,700,000	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	96,800	3,509.14	339,685,000	3,145.00	304,436,000	1.23
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	110,400	2,428.41	268,097,500	2,547.00	281,188,800	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	177,400	1,525.94	270,701,900	1,551.00	275,147,400	1.11
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	2,006	135,801.99	272,418,800	135,000.00	270,810,000	1.09
日本	株式	三井物産	卸売業	210,200	1,107.05	232,702,400	1,182.00	248,456,400	1.00
日本	株式	日立製作所	電気機器	554,000	423.95	234,869,000	423.00	234,342,000	0.94
日本	株式	小松製作所	機械	122,500	1,843.08	225,777,300	1,895.00	232,137,500	0.94
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	613	378,567.69	232,062,000	364,500.00	223,438,500	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	101,900	2,084.92	212,454,100	2,127.00	216,741,300	0.87
日本	株式	三菱地所	不動産業	171,000	1,328.47	227,170,000	1,262.00	215,802,000	0.87
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	311,700	689.97	215,064,700	690.00	215,073,000	0.87
日本	株式	ソニー	電気機器	154,000	1,577.31	242,906,200	1,372.00	211,288,000	0.85
日本	株式	パナソニック	電気機器	282,000	781.73	220,449,100	727.00	205,014,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	42,900	4,525.93	194,162,500	4,695.00	201,415,500	0.81
日本	株式	KDDI	情報・通信業	378	561,883.59	212,392,000	505,000.00	190,890,000	0.77
日本	株式	東芝	電気機器	520,000	350.57	182,298,000	347.00	180,440,000	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	46,300	3,955.90	183,158,500	3,805.00	176,171,500	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	247,000	729.75	180,249,000	712.00	175,864,000	0.71
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	336	524,031.25	176,074,500	504,000.00	169,344,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	92,400	1,810.00	167,244,200	1,832.00	169,276,800	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	57,400	2,819.35	161,830,700	2,938.00	168,641,200	0.68
日本	株式	任天堂	その他製品	14,100	11,180.00	157,638,000	11,630.00	163,983,000	0.66

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.76
		建設業	2.36
		食料品	3.64
		繊維製品	0.94
		パルプ・紙	0.40
		化学	6.03
		医薬品	4.78
		石油・石炭製品	0.93
		ゴム製品	0.78
		ガラス・土石製品	1.17
		鉄鋼	1.82
		非鉄金属	1.14
		金属製品	0.68
		機械	5.05
		電気機器	14.09
		輸送用機器	9.37
		精密機器	1.39
		その他製品	1.67
		電気・ガス業	3.18
		陸運業	4.03
		海運業	0.33
		空運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.64
		卸売業	5.36
		小売業	4.21
		銀行業	9.13
		証券、商品先物取引業	0.97
		保険業	2.24
その他金融業	0.80		
不動産業	2.32		
サービス業	1.90		
合 計			98.78

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
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
-------	----	-----	----	----	----	----	---------------	--------	-----------------

株価指数先物取引	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物 2011年1月2月	買建	38	日本円	282,304,849	276,450,000	1.11
----------	----	---------	--------------------	----	----	-----	-------------	-------------	------

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(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2011年11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

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	32,053,374,849	54.05
	カナダ	3,280,967,842	5.53
	ドイツ	2,206,078,151	3.72
	イタリア	606,356,889	1.02
	フランス	2,346,905,682	3.96
	オーストラリア	2,243,004,188	3.78
	イギリス	6,015,608,507	10.14
	スイス	2,423,755,546	4.09
	バミューダ	128,629,061	0.22
	香港	691,831,488	1.17
	シンガポール	452,546,784	0.76
	ニュージーランド	32,676,675	0.06
	オランダ	691,043,693	1.17
	スペイン	889,295,297	1.50
	ベルギー	259,448,006	0.44
	スウェーデン	770,849,293	1.30
	ノルウェー	208,544,482	0.35
	オーストリア	66,383,603	0.11
	ルクセンブルグ	126,553,395	0.21
	フィンランド	244,874,714	0.41
	デンマーク	289,002,290	0.49
	アイルランド	361,472,371	0.61
	ギリシャ	25,568,826	0.04
	イスラエル	168,793,892	0.28
	ポルトガル	59,587,984	0.10
	中国	3,819,022	0.01
	ケイマン島	37,315,410	0.06
	モーリシャス	9,236,689	0.02
	ジャージー	133,748,548	0.23
	ガーンジー	17,435,597	0.03
小計	56,844,708,774	95.86	
投資証券	アメリカ	673,045,550	1.13
	カナダ	9,948,827	0.02
	フランス	70,828,257	0.12
	オーストラリア	173,171,756	0.29
	イギリス	70,622,338	0.12
	香港	23,902,242	0.04
	シンガポール	14,953,226	0.03
	オランダ	6,455,440	0.01
	小計	1,042,927,636	1.76
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	1,414,869,479	2.39
合計(純資産総額)		59,302,505,889	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	911,454,813	1.54
	買建	ドイツ	451,721,088	0.76

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	買建		965,906,050	1.63

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	185,296	6,206.65	1,150,066,899	6,010.54	1,113,729,186	1.88
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	34,786	31,077.77	1,081,071,310	29,158.12	1,014,294,223	1.71
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービ ス	45,557	14,091.53	641,967,686	14,136.84	644,032,120	1.09
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	75,616	8,164.58	617,373,259	7,609.08	575,368,246	0.97
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	130,338	4,329.90	564,350,506	4,304.43	561,030,797	0.95
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービ ス	285,479	2,095.45	598,205,999	1,940.75	554,043,140	0.93
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	104,994	5,040.17	529,187,220	4,885.47	512,944,921	0.86
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	103,109	4,976.10	513,080,663	4,905.00	505,749,789	0.85
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	222,756	2,219.67	494,445,545	2,192.33	488,354,171	0.82
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	398,928	1,267.27	505,548,928	1,165.70	465,030,210	0.78
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	297,200	1,474.31	438,165,853	1,515.72	450,472,578	0.76
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービ ス	9,516	45,562.29	433,570,759	45,544.32	433,399,757	0.73
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	77,501	5,230.80	405,392,502	5,171.42	400,790,585	0.68
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,928,690	212.14	409,153,839	207.02	399,277,712	0.67
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	670,206	640.08	428,985,456	593.20	397,567,378	0.67
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	66,893	5,378.47	359,781,940	5,817.56	389,154,027	0.66
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	709,908	557.17	395,542,563	534.98	379,790,102	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装 置	199,437	1,924.34	383,784,975	1,842.31	367,423,862	0.62
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	87,783	4,253.49	373,384,112	4,145.67	363,919,086	0.61
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	189,005	1,996.22	377,295,844	1,881.37	355,588,412	0.60
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービ ス	152,283	2,529.07	385,134,077	2,323.59	353,842,677	0.60

イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	135,228	2,720.04	367,824,920	2,610.31	352,986,622	0.60
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	149,470	2,616.57	391,099,270	2,231.39	333,526,281	0.56
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	120,801	2,920.82	352,837,807	2,748.73	332,049,139	0.56
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	71,842	4,430.75	318,314,106	4,544.82	326,509,109	0.55
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	194,076	1,684.93	327,005,328	1,666.65	323,456,066	0.55
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	26,428	11,987.88	316,815,692	12,021.84	317,713,187	0.54
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	116,103	2,571.26	298,530,802	2,693.92	312,772,472	0.53
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	79,847	3,929.96	313,795,260	3,881.00	309,886,334	0.52
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	106,418	2,827.52	300,899,523	2,861.90	304,557,876	0.51

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	12.39
		素材	7.28
		資本財	7.14
		商業・専門サービス	0.80
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.21
		耐久消費財・アパレル	1.21
		消費者サービス	1.71
		メディア	2.42
		小売	2.77
		食品・生活必需品小売り	2.45
		食品・飲料・タバコ	7.06
		家庭用品・パーソナル用品	1.80
		ヘルスケア機器・サービス	2.68
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.75
		銀行	6.78
		各種金融	4.03
		保険	3.85
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	5.86
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.40		
電気通信サービス	4.34		
公益事業	3.94		
半導体・半導体製造装置	1.64		
投資証券	-	-	1.76

合 計	97.61
-----	-------

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
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1112	買建	39	米ドル	12,080,500	911,454,813	1.54
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1112	買建	195	ユーロ	4,488,510	451,721,088	0.76

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率(%)
為替予約先物取引	米ドル	買建	8,830,000	688,981,665	688,793,620	1.16
	ユーロ	買建	2,662,000	283,926,446	277,112,430	0.47

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考) 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2011年11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

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	577,443,340	52.24
	カナダ	58,605,553	5.30
	ドイツ	39,225,448	3.55
	イタリア	11,111,915	1.01
	フランス	43,300,475	3.92
	オーストラリア	41,148,328	3.72
	イギリス	107,470,713	9.72
	スイス	45,505,978	4.12
	バミューダ	2,037,052	0.18
	香港	12,653,433	1.14
	シンガポール	7,750,706	0.70
	オランダ	11,322,647	1.02
	スペイン	15,978,752	1.45
	ベルギー	5,194,643	0.47
	スウェーデン	13,909,425	1.26
	ノルウェー	5,035,433	0.46
	オーストリア	1,932,820	0.17
	ルクセンブルグ	1,666,500	0.15
	フィンランド	4,645,885	0.42
	デンマーク	5,642,229	0.51
	アイルランド	6,262,795	0.57
	イスラエル	1,795,187	0.16
	ポルトガル	563,943	0.05
ジャージー	3,265,476	0.30	
小計		1,023,468,676	92.60
投資証券	アメリカ	12,016,830	1.09
	フランス	1,383,244	0.13
	オーストラリア	2,454,793	0.22
	イギリス	1,787,199	0.16
	香港	967,142	0.09
	小計		18,609,208
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	63,219,620	5.72
合計(純資産総額)		1,105,297,504	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	42,067,145	3.81
	買建	ドイツ	20,848,665	1.89

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	売建		1,072,228,690	97.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	3,327	6,206.65	20,649,515	6,010.54	19,997,069	1.81
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	625	31,077.77	19,423,606	29,158.12	18,223,822	1.65
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	819	14,091.53	11,540,960	14,136.84	11,578,073	1.05
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,357	8,164.58	11,079,341	7,609.08	10,325,522	0.93
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	2,344	4,329.90	10,149,285	4,304.43	10,089,583	0.91
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	5,133	2,095.45	10,755,927	1,940.75	9,961,865	0.90
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	1,884	5,040.17	9,495,673	4,885.47	9,204,223	0.83
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,850	4,976.10	9,205,784	4,905.00	9,074,252	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	3,997	2,219.67	8,872,034	2,192.33	8,762,734	0.79
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	7,157	1,267.27	9,069,841	1,165.70	8,342,912	0.75
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,332	1,474.31	7,861,037	1,515.72	8,081,829	0.73
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	171	45,562.29	7,791,151	45,544.32	7,788,078	0.70
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,394	5,230.80	7,291,740	5,171.42	7,208,966	0.65
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	34,594	212.26	7,343,016	207.02	7,161,655	0.65
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	12,022	640.08	7,695,041	593.20	7,131,471	0.65
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	1,204	5,378.47	6,475,676	5,817.56	7,004,341	0.63
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	12,731	557.42	7,096,491	534.98	6,810,892	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	3,577	1,924.34	6,883,370	1,842.31	6,589,926	0.60
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,579	4,253.49	6,716,260	4,145.67	6,546,008	0.59
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	3,390	1,996.22	6,767,190	1,881.37	6,377,845	0.58
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	2,740	2,529.07	6,929,646	2,323.59	6,366,626	0.58
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	2,425	2,720.04	6,596,085	2,610.31	6,329,994	0.57
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	2,681	2,616.57	7,015,034	2,231.39	5,982,364	0.54
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	2,174	2,920.82	6,349,859	2,748.73	5,975,735	0.54
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	1,288	4,430.75	5,706,808	4,544.82	5,853,730	0.53
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,492	1,684.93	5,883,790	1,666.65	5,819,929	0.53

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	476	11,987.88	5,706,230	12,021.84	5,722,395	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,081	2,571.26	5,350,788	2,693.92	5,606,052	0.51
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	1,431	3,930.48	5,624,512	3,881.00	5,553,713	0.50
アメリカ	株式	V E R I Z O N COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	1,908	2,827.52	5,394,917	2,861.90	5,460,508	0.49

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	12.00
		素材	6.87
		資本財	7.15
		商業・専門サービス	0.76
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.17
		耐久消費財・アパレル	1.08
		消費者サービス	1.61
		メディア	2.42
		小売	2.77
		食品・生活必需品小売り	2.08
		食品・飲料・タバコ	6.90
		家庭用品・パーソナル用品	1.60
		ヘルスケア機器・サービス	2.69
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.34
		銀行	6.38
		各種金融	3.95
		保険	3.70
		不動産	0.68
		ソフトウェア・サービス	5.74
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.28		
電気通信サービス	4.19		
公益事業	3.83		
半導体・半導体製造装置	1.61		
投資証券		-	1.68
合計			94.28

投資不動産物件

該当事項はありません。

[次へ](#)

その他投資資産の主要なもの
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1112	買建	9	米ドル	547,873	42,067,145	3.81
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1112	買建	9	ユーロ	203,220	20,848,665	1.89

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

< 為替予約取引 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率(%)
為替予約先物取引	米ドル	売建	7,900,000	601,464,834	616,349,340	55.76
	ユーロ	売建	1,435,000	151,374,505	149,353,910	13.51
	英ポンド	売建	927,000	112,789,408	112,820,930	10.21
	加ドル	売建	778,000	58,202,150	58,771,400	5.32
	豪ドル	売建	562,000	43,994,012	43,952,390	3.98
	スイスフラン	売建	501,000	43,246,216	42,539,600	3.85
	スウェーデンクローナ	売建	1,225,000	14,157,959	13,851,400	1.25
	香港ドル	売建	1,365,000	13,362,920	13,675,780	1.24
	シンガポールドル	売建	139,000	8,355,834	8,388,820	0.76
	デンマーククローネ	売建	403,000	5,725,828	5,641,900	0.51
	ノルウェークローネ	売建	381,000	5,216,944	5,077,100	0.46
	イスラエルシェケル	売建	88,000	1,821,631	1,806,120	0.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考) 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2011年11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

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	23,767,609,885	75.32
地方債証券	日本	2,198,960,000	6.97
特殊債券	日本	2,904,937,000	9.21
社債券	日本	2,338,544,000	7.41
	オーストラリア	197,275,000	0.63
	小計	2,535,819,000	8.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	147,354,838	0.47
合計(純資産総額)		31,554,680,723	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1.300	2019/03/20	750,000,000	104.98	787,395,000	104.27	782,010,000	2.48
日本	国債証券	第69回利付国債(5年)	0.900	2012/12/20	633,000,000	100.88	638,590,050	100.81	638,133,630	2.02
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	1.400	2022/12/20	545,000,000	102.97	561,219,200	102.30	557,524,100	1.77
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1.400	2018/03/20	446,000,000	105.69	471,413,080	105.10	468,750,460	1.49
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	0.800	2014/03/20	444,000,000	101.50	450,691,080	101.48	450,575,640	1.43
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1.400	2019/09/20	361,000,000	105.46	380,739,480	104.75	378,133,060	1.20
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	1.500	2015/03/20	361,000,000	104.28	376,454,410	104.11	375,837,100	1.19
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	358,000,000	104.49	374,102,840	103.74	371,382,040	1.18
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	340,000,000	103.37	351,461,400	102.59	348,816,200	1.11
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	2.300	2026/06/20	300,000,000	111.13	333,402,000	110.07	330,222,000	1.05
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	300,000,000	100.85	302,574,000	100.72	302,154,000	0.96
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	1.300	2018/03/20	287,000,000	105.04	301,482,020	104.49	299,897,780	0.95
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	1.700	2016/09/20	274,000,000	106.53	291,914,120	106.21	291,020,880	0.92
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	0.500	2013/06/20	285,000,000	100.59	286,695,750	100.58	286,641,600	0.91
日本	国債証券	第261回利付国債(10年)	1.800	2014/06/20	270,000,000	104.26	281,510,100	104.14	281,164,500	0.89
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	2.400	2038/09/20	246,000,000	110.57	272,002,200	109.85	270,235,920	0.86
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	268,000,000	101.23	271,320,520	100.53	269,415,040	0.85
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1.500	2017/12/20	254,000,000	106.23	269,844,520	105.71	268,500,860	0.85
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1.700	2018/03/20	241,000,000	107.58	259,289,490	106.96	257,763,960	0.82
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	1.900	2021/03/22	237,000,000	108.70	257,628,480	107.84	255,571,320	0.81
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	0.500	2015/03/20	245,000,000	100.92	247,261,350	100.85	247,077,600	0.78
日本	国債証券	第33回利付国債(20年)	3.800	2016/09/20	200,000,000	116.77	233,550,000	116.23	232,462,000	0.74
日本	国債証券	第252回利付国債(10年)	1.000	2013/06/20	228,000,000	101.41	231,217,080	101.34	231,064,320	0.73

日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1.300	2018/12/20	221,000,000	105.04	232,138,400	104.31	230,516,260	0.73
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1.700	2017/03/20	216,000,000	106.99	231,102,720	106.57	230,182,560	0.73
日本	国債証券	第251回利付国債(10年)	0.900	2013/06/20	227,000,000	101.24	229,832,960	101.19	229,701,300	0.73
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1.500	2014/09/20	221,000,000	103.77	229,347,170	103.67	229,101,860	0.73
日本	国債証券	第70回利付国債(5年)	0.800	2013/03/20	227,000,000	100.93	229,115,640	100.87	228,968,090	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	2.400	2034/03/20	208,000,000	110.72	230,299,680	109.72	228,213,440	0.72
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	2.100	2026/12/20	210,000,000	108.13	227,083,500	107.17	225,048,600	0.71

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.32
地方債証券	6.97
特殊債券	9.21
社債券	8.04
合計	99.53

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2011年11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

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	179,754,258,956	41.06
	カナダ	12,746,010,989	2.91
	ドイツ	42,582,861,237	9.73
	イタリア	36,602,240,907	8.36
	フランス	42,196,978,386	9.64
	オーストラリア	6,315,233,451	1.44
	イギリス	39,186,080,218	8.95
	スイス	2,006,037,999	0.46
	シンガポール	1,707,741,462	0.39
	マレーシア	2,313,090,414	0.53
	オランダ	12,048,660,662	2.75
	スペイン	17,877,619,341	4.08
	ベルギー	10,485,575,518	2.40
	スウェーデン	2,667,777,719	0.61
	ノルウェー	1,301,714,314	0.30
	オーストリア	7,924,803,938	1.81
	フィンランド	2,988,720,525	0.68
	デンマーク	4,114,039,570	0.94
	メキシコ	3,787,951,062	0.87
	ポーランド	2,999,639,030	0.69
	小計	431,607,035,698	98.59
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	6,190,000,117	1.41
合計(純資産総額)		437,797,035,815	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	売建		2,258,670,840	0.52

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	46,300,000	8,904.38	4,122,727,216	8,981.29	4,158,336,184	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	40,000,000	8,874.94	3,549,974,742	8,973.96	3,589,585,186	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/05/15	43,200,000	8,224.40	3,552,942,217	8,198.77	3,541,867,290	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/08/31	41,100,000	8,225.01	3,380,480,618	8,208.53	3,373,707,114	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	37,200,000	8,872.64	3,300,621,382	8,864.09	3,297,442,468	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	34,500,000	8,825.03	3,044,634,541	8,903.16	3,071,589,391	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	36,280,000	8,472.22	3,073,722,096	8,453.91	3,067,078,604	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	33,500,000	9,035.00	3,026,725,680	9,039.89	3,028,361,526	0.69
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.500	2016/01/04	26,100,000	11,459.00	2,990,798,754	11,433.03	2,984,020,479	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	34,400,000	8,373.34	2,880,428,476	8,346.48	2,871,189,603	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	30,400,000	8,986.17	2,731,795,917	8,989.83	2,732,909,270	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2014/05/15	30,550,000	8,682.20	2,652,410,954	8,660.22	2,645,697,877	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2013/06/30	31,650,000	8,225.01	2,603,216,826	8,205.48	2,597,034,790	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5.125	2016/05/15	27,000,000	9,298.69	2,510,646,510	9,306.02	2,512,624,176	0.57
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.250	2016/04/25	22,700,000	10,951.89	2,486,079,425	10,749.48	2,440,131,418	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2012/12/31	29,800,000	8,133.46	2,423,769,612	8,104.16	2,415,038,585	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	27,000,000	8,753.00	2,363,310,421	8,827.47	2,383,416,689	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	26,200,000	8,897.05	2,331,028,082	8,967.86	2,349,579,074	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2013/09/30	27,400,000	8,241.49	2,258,169,415	8,223.18	2,253,152,005	0.51
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.500	2013/01/04	20,300,000	10,916.33	2,216,014,029	10,915.35	2,215,816,751	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2041/02/15	20,300,000	10,250.66	2,080,883,168	10,637.89	2,159,491,225	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2039/08/15	21,000,000	9,833.39	2,065,012,523	10,206.95	2,143,459,926	0.49
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.000	2013/10/25	19,400,000	10,987.46	2,131,566,893	10,883.50	2,111,399,055	0.48

フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.750	2021/04/25	19,500,000	10,944.24	2,134,126,651	10,618.73	2,070,653,313	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	22,000,000	9,347.52	2,056,454,846	9,396.35	2,067,197,721	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	22,400,000	9,141.21	2,047,631,040	9,207.13	2,062,397,610	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2019/05/15	23,400,000	8,607.58	2,014,174,211	8,682.20	2,031,633,922	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	23,100,000	8,788.40	2,030,121,374	8,781.08	2,028,429,371	0.46
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2013/08/01	20,150,000	10,374.22	2,090,405,616	9,978.06	2,010,578,105	0.46
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	3.500	2013/04/12	18,500,000	10,866.64	2,010,328,190	10,867.82	2,010,546,514	0.46

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.59
合計	98.59

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>

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	ユーロ	売建	11,350,000	1,174,102,355	1,182,102,500	0.27
	米ドル	売建	9,900,000	770,427,650	773,365,000	0.18
	英ポンド	売建	941,000	113,730,460	114,710,090	0.03
	加ドル	売建	1,265,000	94,198,098	95,798,450	0.02
	デンマーククローネ	売建	3,324,000	46,500,433	46,536,000	0.01
	ノルウェークローネ	売建	3,455,000	45,437,050	46,158,800	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(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2011年11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

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	10,962,603,475	40.13
	カナダ	800,654,980	2.93
	ドイツ	2,630,296,365	9.63
	イタリア	2,198,495,649	8.05
	フランス	2,513,346,017	9.20
	オーストラリア	377,725,433	1.38
	イギリス	2,375,550,955	8.70
	スイス	126,392,759	0.46
	シンガポール	119,851,852	0.44
	マレーシア	169,737,670	0.62
	オランダ	746,893,489	2.73
	スペイン	1,082,093,454	3.96
	ベルギー	643,278,065	2.36
	スウェーデン	150,302,970	0.55
	ノルウェー	71,289,626	0.26
	オーストリア	442,048,545	1.62
	フィンランド	224,998,364	0.82
	デンマーク	273,051,788	1.00
	メキシコ	219,937,365	0.81
	ポーランド	181,694,183	0.67
	小計	26,310,243,004	96.32
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	1,004,233,046	3.68
合計(純資産総額)		27,314,476,050	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約先物取引	売建		26,746,192,350	97.92

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率 (%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	3,400,000	8,904.38	302,748,866	8,981.29	305,363,780	1.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2012/11/30	3,650,000	7,840.46	286,176,768	7,839.25	286,132,507	1.05
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.000	2016/07/04	2,190,000	11,753.74	257,406,868	11,707.35	256,390,887	0.94
イギリス	国債証券	UK TREASURY	5.000	2025/03/07	1,630,000	15,191.07	247,614,439	15,602.22	254,316,253	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2013/02/15	3,150,000	7,933.86	249,916,506	7,924.09	249,608,869	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2017/07/31	2,900,000	8,287.88	240,348,632	8,355.03	242,295,779	0.89
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.000	2016/09/07	1,710,000	13,691.60	234,126,409	13,855.08	236,921,871	0.87
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.750	2013/07/04	2,140,000	10,978.88	234,948,000	10,974.81	234,861,024	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	2,500,000	8,472.22	211,805,546	8,453.91	211,347,753	0.77
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.150	2013/01/31	1,960,000	10,681.98	209,366,743	10,479.24	205,393,138	0.75
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2016/08/01	2,190,000	9,751.56	213,559,191	8,896.47	194,832,719	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/09/15	2,500,000	7,775.16	194,378,894	7,784.92	194,623,050	0.71
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2014/08/01	2,000,000	10,222.38	204,447,539	9,632.37	192,647,440	0.71
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.000	2018/04/25	1,750,000	11,284.77	197,483,537	10,996.93	192,446,356	0.70
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.000	2014/04/25	1,730,000	11,086.91	191,803,509	10,947.77	189,396,368	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	2,300,000	8,107.82	186,479,829	8,102.33	186,353,478	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	2,000,000	8,753.00	175,060,031	8,827.47	176,549,384	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2039/08/15	1,720,000	9,833.39	169,134,359	10,206.95	175,559,574	0.64
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.250	2014/01/04	1,550,000	11,240.89	174,233,760	11,241.99	174,250,794	0.64
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2.500	2020/10/25	1,800,000	9,945.01	179,010,167	9,657.42	173,833,586	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	1,900,000	8,897.05	169,044,021	8,967.86	170,389,322	0.62
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.250	2015/07/04	1,500,000	11,296.78	169,451,638	11,278.64	169,179,624	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2015/04/30	2,000,000	8,334.27	166,685,471	8,339.16	166,783,134	0.61

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2040/02/15	1,600,000	10,027.50	160,439,955	10,414.48	166,631,757	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2013/06/30	2,000,000	8,225.01	164,500,273	8,205.48	164,109,623	0.60
ドイツ	国債証券	B U N D E S R E P U B . DEUTSCHLAND	3.250	2021/07/04	1,450,000	11,525.97	167,126,634	11,306.20	163,939,949	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2040/05/15	1,630,000	9,662.48	157,498,482	10,027.50	163,448,203	0.60
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.500	2020/02/01	1,890,000	9,536.17	180,233,668	8,597.82	162,498,728	0.59
ドイツ	国債証券	B U N D E S R E P U B . DEUTSCHLAND	5.625	2028/01/04	1,160,000	14,435.80	167,455,281	13,906.09	161,310,657	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2016/06/30	2,000,000	8,018.70	160,374,032	8,051.05	161,021,046	0.59

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.32
合計	96.32

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 >

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約先物取引	米ドル	売建	141,440,000	10,773,789,573	11,035,355,150	40.40
	ユーロ	売建	103,123,000	10,911,400,661	10,733,976,530	39.30
	英ポンド	売建	19,734,000	2,412,681,840	2,400,803,000	8.79
	加ドル	売建	10,785,000	811,829,780	814,595,230	2.98
	豪ドル	売建	4,904,000	383,491,184	382,865,830	1.40
	デンマーククローネ	売建	20,257,000	287,003,082	283,594,410	1.04
	メキシコペソ	売建	40,171,000	224,202,815	226,491,740	0.83
	ポーランドズロチ	売建	9,429,000	226,042,599	215,523,610	0.79
	マレーシアリングgit	売建	7,162,000	173,934,260	175,970,340	0.64
	スウェーデンクローナ	売建	13,597,000	156,322,430	153,629,260	0.56
	スイスフラン	売建	1,528,000	130,673,215	129,759,070	0.48
	シンガポールドル	売建	2,002,000	120,134,686	120,803,530	0.44
	ノルウェークローネ	売建	5,463,000	74,391,218	72,824,650	0.27

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

(参考情報)

運用実績

2011年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....9,466円

純資産総額.....5.47億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金込基準価額は、2001年11月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金込基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2007年10月	2008年10月	2009年10月	2010年10月	2011年10月	設定来累計
10円	0円	0円	0円	0円	30円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30.47%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.18%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5.12%
日本債券インデックスマザーファンド	44.35%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.01%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.94%
現金その他	4.93%

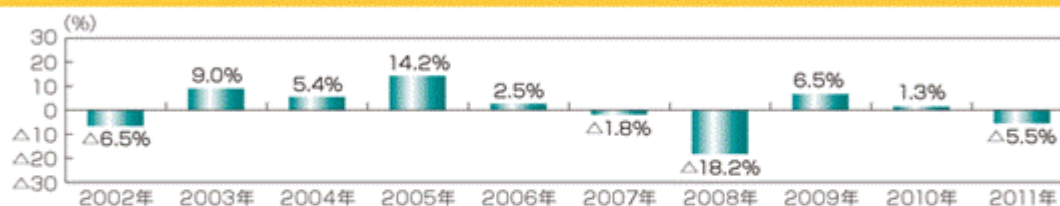
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	通貨	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	日本円	輸送用機器	3.20%
	2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本円	銀行業	2.44%
	3 キヤノン	日本円	電気機器	2.11%
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 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.88%
	2 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.71%
	3 INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	1.09%
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 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.81%
	2 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.65%
	3 INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	1.05%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第299回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2.48%
	2 第69回利付国債(5年)	日本円	国債証券	2.02%
	3 第60回利付国債(20年)	日本円	国債証券	1.77%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカドル	国債証券	0.95%
	2 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカドル	国債証券	0.82%
	3 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカドル	国債証券	0.81%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	アメリカドル	国債証券	1.12%
	2 US TREASURY N/B(クーポン0.5%)	アメリカドル	国債証券	1.05%
	3 BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND(クーポン4%)	ユーロ	国債証券	0.94%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2011年は、2011年11月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

(4) 申込金額

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

(5) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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る場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(9) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金(解約)手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、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。

(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0.2%の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

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

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

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

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

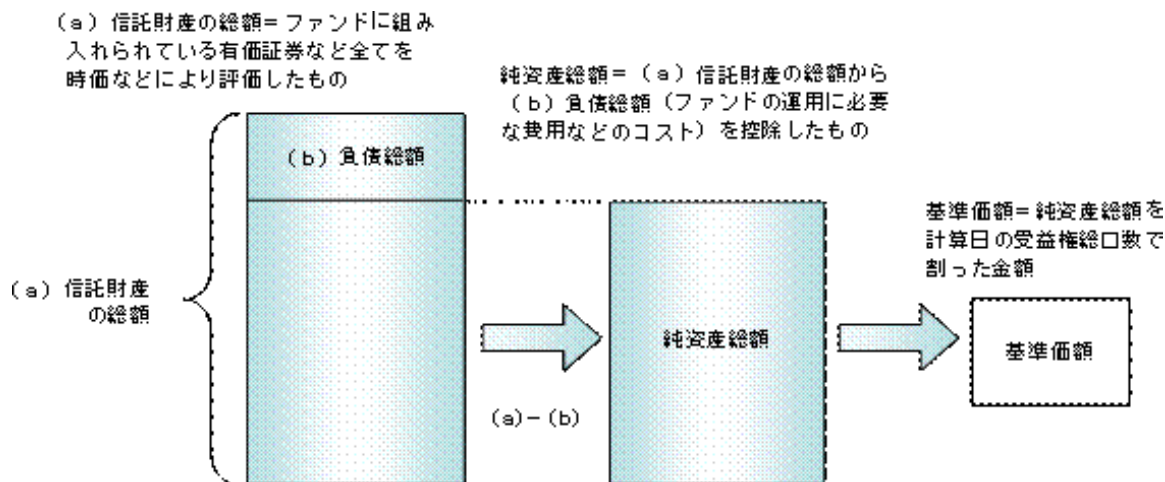
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

< 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せん。

^{*} 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10億口を下回るようになった場合
 - 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。）に異議を述べるすることができます。（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。

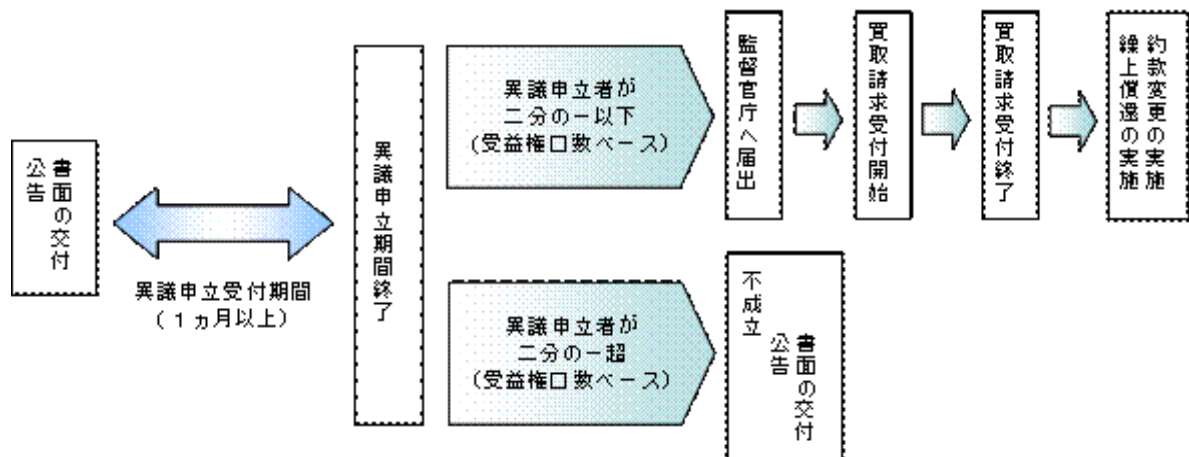
信託約款の変更

- 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することができます。（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、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

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。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、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11期計算期間（平成21年10月27日から平成22年10月26日まで）及び第12期計算期間（平成22年10月27日から平成23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40）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 平成22年10月26日現在	第12期 平成23年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,522,094	29,792,965
親投資信託受益証券	615,623,369	533,256,284
未収入金	561,891	862,294
未収利息	79	55
流動資産合計	649,707,433	563,911,598
資産合計	649,707,433	563,911,598
負債の部		
流動負債		
未払解約金	879,858	1,134,480
未払受託者報酬	138,035	124,258
未払委託者報酬	1,967,844	1,771,596
その他未払費用	27,559	24,807
流動負債合計	3,013,296	3,055,141
負債合計	3,013,296	3,055,141
純資産の部		
元本等		
元本	662,492,179	586,000,661
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,798,042	25,144,204
（分配準備積立金）	70,888,056	59,083,966
元本等合計	646,694,137	560,856,457
純資産合計	646,694,137	560,856,457
負債純資産合計	649,707,433	563,911,598

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期	第12期
	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
営業収益		
受取利息	32,448	21,484
有価証券売買等損益	534,164	6,006,027
営業収益合計	501,716	5,984,543
営業費用		
受託者報酬	280,111	258,684
委託者報酬	3,993,230	3,688,042
その他費用	55,923	51,643
営業費用合計	4,329,264	3,998,369
営業利益又は営業損失（ ）	4,830,980	9,982,912
経常利益又は経常損失（ ）	4,830,980	9,982,912
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,830,980	9,982,912
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（ ）	533,947	1,825,911
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,066,541	15,798,042
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,265,268	2,844,260
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,265,268	2,844,260
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	631,842	381,599
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	631,842	381,599
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,798,042	25,144,204

（ 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11期	第12期
		自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
有価証券の評価基準及び評価方法		親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

（貸借対照表に関する注記）

	第11期 平成22年10月26日現在	第12期 平成23年10月26日現在
1. 期首元本額	689,241,984円	662,492,179円
期中追加設定元本額	44,772,360円	38,817,760円
期中一部解約元本額	71,522,165円	115,309,278円
2. 計算期間末日における受益権の総数	662,492,179口	586,000,661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15,798,042円であります。		25,144,204円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

	第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	第12期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
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	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	0円
C 信託約款に定める収益調整金	58,973,675円	55,955,837円
D 信託約款に定める分配準備積立金	70,888,056円	59,083,966円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	129,861,731円	115,039,803円
F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.1960円 1,960円	0.1963円 1,963円
G 分配金額	0円	0円
H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0円 0円	0円 0円

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	第12期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	第12期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第11期(自平成21年10月27日至平成22年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,221,999
合計	3,221,999

第12期(自平成22年10月27日至平成23年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	10,634,727
合計	10,634,727

(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11期 平成22年10月26日現在		第12期 平成23年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.9762円	1口当たり純資産額	0.9571円
(1万口当たり純資産額)	(9,762円)	(1万口当たり純資産額)	(9,571円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	35,365,046	28,288,500	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジあり) マザーファンド	37,805,820	28,547,174	
	日本債券インデックスマザーファンド	206,207,797	253,408,761	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	20,058,227	28,029,366	
	海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド	22,267,796	28,128,679	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	287,530,250	166,853,804	
親投資信託受益証券 合計		609,234,936	533,256,284	
合計		609,234,936	533,256,284	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[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とおりです。

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22年10月26日現在	平成23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		59,190,968	97,008,505
株式		30,129,031,406	25,002,989,937
派生商品評価勘定			2,439,771
未収入金		43,341,343	22,128,060
未収配当金		261,028,706	254,754,516
未収利息		140	180
差入委託証拠金		6,879,000	
流動資産合計		30,499,471,563	25,379,320,969
資産合計		30,499,471,563	25,379,320,969
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,474,682	332,599
前受金			3,855,000
未払解約金		16,048,391	22,875,026
流動負債合計		25,523,073	27,062,625
負債合計		25,523,073	27,062,625
純資産の部			
元本等			
元本		49,105,983,953	43,690,469,568
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,632,035,463	18,338,211,224
元本等合計		30,473,948,490	25,352,258,344
純資産合計		30,473,948,490	25,352,258,344
負債純資産合計		30,499,471,563	25,379,320,969

(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21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23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）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られ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られた価額で評価しております。</p>	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</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 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 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1. 期首	平成21年10月27日	1. 期首	平成22年10月27日
期首元本額	47,548,685,652円	期首元本額	49,105,983,953円
期首からの追加設定元本額	5,523,889,970円	期首からの追加設定元本額	5,609,550,412円
期首からの一部解約元本額	3,966,591,669円	期首からの一部解約元本額	11,025,064,797円
平成22年10月26日現在の元本の内訳		平成23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)	172,322,155円	DCインデックスバランス(株式20)	206,215,746円
DCインデックスバランス(株式40)	629,565,241円	DCインデックスバランス(株式40)	727,392,748円
DCインデックスバランス(株式60)	1,189,744,460円	DCインデックスバランス(株式60)	1,350,038,732円
DCインデックスバランス(株式80)	1,316,027,100円	DCインデックスバランス(株式80)	1,458,941,916円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	813,409,526円	インデックスファンド日本株式(DC専用)	858,875,812円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,716,643,805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	17,904,058,440円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	16,256,389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	18,463,705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)	210,234,997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)	115,263,678円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	204,289,499円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	189,329,485円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	183,434,010円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	179,388,657円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	307,907,482円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	287,530,250円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	395,508,371円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	370,262,226円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	15,717,656,118円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	15,412,394,449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)	107,980,343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)	100,153,698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)	137,633,484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)	119,668,905円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	149,865,311円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	87,210,578円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	86,264,583円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	80,792,748円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	363,391,246円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	415,732,657円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	941,367,712円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	1,073,051,458円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	1,223,412,493円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	1,386,467,143円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	1,223,069,628円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	1,349,236,537円
計	49,105,983,953円	計	43,690,469,568円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	49,105,983,953口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	43,690,469,568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18,632,035,463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18,338,211,224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とおりであります。		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とおりでありま す。	
株式	215,771,500円	株式	205,666,000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

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

対象期間(自平成21年10月27日 至 平成22年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,167,182,823
合計	3,167,182,823

対象期間(自平成22年10月27日 至 平成23年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,394,301,466
合計	2,394,301,466

(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)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	335,774,000		326,400,000	9,374,000
	合計	335,774,000		326,400,000	9,374,000

(平成23年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	347,470,000		349,680,000	2,210,000
	合計	347,470,000		349,680,000	2,210,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.6206円	1口当たり純資産額	0.5803円
(1万口当たり純資産額)	(6,206円)	(1万口当たり純資産額)	(5,803円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位 : 円)

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	11,000	176.00	1,936,000	
1332	日本水産	32,300	263.00	8,494,900	
1334	マルハニチロホールディングス	55,000	144.00	7,920,000	
1377	サカタのタネ	4,100	1,092.00	4,477,200	
1379	ホクト	2,800	1,624.00	4,547,200	
1514	住石ホールディングス	8,400	69.00	579,600	
1515	日鉄鉱業	7,000	319.00	2,233,000	
1518	三井松島産業	16,000	137.00	2,192,000	
1605	国際石油開発帝石	282	521,000.00	146,922,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,509.00	1,756,300	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	413.00	1,239,000	
1662	石油資源開発	4,400	3,050.00	13,420,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,500	1,730.00	4,325,000	
1417	ミライト・ホールディングス	7,200	613.00	4,413,600	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	181,500.00	544,500	
1719	間組	11,000	137.00	1,507,000	
1720	東急建設	9,730	212.00	2,062,760	
1721	コムシスホールディングス	13,600	776.00	10,553,600	
1722	ミサワホーム	3,300	472.00	1,557,600	
1762	高松コンストラクショングループ	2,100	1,254.00	2,633,400	
1766	東建コーポレーション	1,040	2,916.00	3,032,640	
1780	ヤマウラ	1,500	220.00	330,000	
1801	大成建設	132,000	208.00	27,456,000	
1802	大林組	84,000	361.00	30,324,000	
1803	清水建設	79,000	335.00	26,465,000	
1808	長谷工コーポレーション	174,500	50.00	8,725,000	
1810	松井建設	3,000	303.00	909,000	
1812	鹿島建設	123,000	249.00	30,627,000	
1813	不動テトラ	20,100	160.00	3,216,000	
1814	大末建設	11,000	46.00	506,000	
1815	鉄建建設	18,000	90.00	1,620,000	
1816	安藤建設	10,000	104.00	1,040,000	
1819	太平工業	6,000	408.00	2,448,000	
1820	西松建設	37,000	135.00	4,995,000	
1821	三井住友建設	15,700	53.00	832,100	
1822	大豊建設	9,000	97.00	873,000	

[次へ](#)

1824	前田建設工業	17,000	280.00	4,760,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	181.00	362,000	
1833	奥村組	26,000	308.00	8,008,000	
1834	大和小田急建設	1,500	199.00	298,500	
1835	東鉄工業	4,000	673.00	2,692,000	
1852	浅沼組	10,000	84.00	840,000	
1860	戸田建設	30,000	283.00	8,490,000	
1861	熊谷組	22,000	70.00	1,540,000	
1865	青木あすなろ建設	2,000	395.00	790,000	
1866	北野建設	6,000	167.00	1,002,000	
1867	植木組	4,000	165.00	660,000	
1868	三井ホーム	3,000	392.00	1,176,000	
1870	矢作建設工業	3,500	386.00	1,351,000	
1871	ピーエス三菱	2,000	230.00	460,000	
1878	大東建託	10,900	6,930.00	75,537,000	
1879	新日本建設	3,300	202.00	666,600	
1881	N I P P O	6,000	687.00	4,122,000	
1882	東亜道路工業	5,000	142.00	710,000	
1883	前田道路	8,000	793.00	6,344,000	
1884	日本道路	8,000	204.00	1,632,000	
1885	東亜建設工業	23,000	140.00	3,220,000	
1888	若築建設	16,000	123.00	1,968,000	
1890	東洋建設	41,000	81.00	3,321,000	
1893	五洋建設	35,000	253.00	8,855,000	
1896	大林道路	3,000	186.00	558,000	
1899	福田組	4,000	265.00	1,060,000	
1911	住友林業	19,200	652.00	12,518,400	
1914	日本基礎技術	3,800	268.00	1,018,400	
1916	日成ビルド工業	9,000	136.00	1,224,000	
1919	エス・バイ・エル	13,000	148.00	1,924,000	
1921	巴コーポレーション	4,000	272.00	1,088,000	
1924	パナホーム	9,000	532.00	4,788,000	
1925	大和ハウス工業	70,000	978.00	68,460,000	
1926	ライト工業	6,000	328.00	1,968,000	
1928	積水ハウス	83,000	692.00	57,436,000	
1929	日特建設	10,000	95.00	950,000	
1930	北陸電気工事	2,000	214.00	428,000	
1934	ユアテック	4,000	409.00	1,636,000	
1937	西部電気工業	2,000	331.00	662,000	
1939	四電工	2,000	313.00	626,000	
1941	中電工	4,100	887.00	3,636,700	
1942	関電工	13,000	336.00	4,368,000	
1944	きんでん	18,000	656.00	11,808,000	
1945	東京エネシス	3,000	334.00	1,002,000	
1946	トーエネック	4,000	400.00	1,600,000	
1949	住友電設	2,000	438.00	876,000	
1950	日本電設工業	5,000	761.00	3,805,000	
1951	協和エクシオ	9,900	695.00	6,880,500	
1952	新日本空調	2,100	390.00	819,000	

1956	日本電話施設	4,000	259.00	1,036,000	
1959	九電工	5,000	473.00	2,365,000	
1961	三機工業	6,000	402.00	2,412,000	
1963	日揮	28,000	2,127.00	59,556,000	
1964	中外炉工業	9,000	239.00	2,151,000	
1967	ヤマト	3,000	305.00	915,000	
1968	太平電業	4,000	495.00	1,980,000	
1969	高砂熱学工業	8,000	617.00	4,936,000	
1972	三晃金属工業	3,000	251.00	753,000	
1975	朝日工業社	3,000	328.00	984,000	
1979	大気社	4,300	1,649.00	7,090,700	
1980	ダイダシ	4,000	514.00	2,056,000	
1982	日比谷総合設備	3,700	775.00	2,867,500	
1983	東芝プラントシステム	4,000	814.00	3,256,000	
6330	東洋エンジニアリング	16,000	275.00	4,400,000	
6366	千代田化工建設	18,000	929.00	16,722,000	
6379	新興プランテック	5,300	675.00	3,577,500	
2001	日本製粉	16,000	354.00	5,664,000	
2002	日清製粉グループ本社	25,000	966.00	24,150,000	
2003	日東富士製粉	2,000	310.00	620,000	
2004	昭和産業	10,000	241.00	2,410,000	
2009	鳥越製粉	2,400	692.00	1,660,800	
2052	協同飼料	10,000	87.00	870,000	
2053	中部飼料	2,500	479.00	1,197,500	
2056	日本配合飼料	9,000	104.00	936,000	
2107	東洋精糖	4,000	91.00	364,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	161.00	2,415,000	
2109	三井製糖	11,000	329.00	3,619,000	
2201	森永製菓	27,000	184.00	4,968,000	
2204	中村屋	6,000	401.00	2,406,000	
2206	江崎グリコ	10,000	934.00	9,340,000	
2207	名糖産業	1,300	1,002.00	1,302,600	
2211	不二家	16,000	157.00	2,512,000	
2212	山崎製パン	20,000	1,045.00	20,900,000	
2215	第一屋製パン	5,000	77.00	385,000	
2217	モロゾフ	4,000	275.00	1,100,000	
2229	カルビー	1,700	3,680.00	6,256,000	
2264	森永乳業	23,000	319.00	7,337,000	
2267	ヤクルト本社	14,900	2,205.00	32,854,500	
2269	明治ホールディングス	8,300	3,430.00	28,469,000	
2270	雪印メグミルク	5,500	1,496.00	8,228,000	
2281	プリマハム	16,000	105.00	1,680,000	
2282	日本ハム	19,000	952.00	18,088,000	
2284	伊藤ハム	15,000	266.00	3,990,000	
2286	林兼産業	10,000	63.00	630,000	
2288	丸大食品	12,000	264.00	3,168,000	
2290	米久	2,500	672.00	1,680,000	
2292	S Foods	1,500	585.00	877,500	
2501	サッポロホールディングス	46,000	282.00	12,972,000	

2502	アサヒグループホールディングス	52,200	1,610.00	84,042,000	
2503	キリンホールディングス	112,000	962.00	107,744,000	
2531	宝ホールディングス	24,000	449.00	10,776,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	179.00	1,253,000	
2540	養命酒製造	2,000	708.00	1,416,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,900	676.00	1,960,400	
2579	コカ・コーラウエスト	9,400	1,391.00	13,075,400	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,200	1,034.00	3,308,800	
2590	ダイドードリンコ	1,100	3,010.00	3,311,000	
2593	伊藤園	8,400	1,369.00	11,499,600	
2594	キーコーヒー	2,500	1,416.00	3,540,000	
2597	ユニカフェ	800	347.00	277,600	
2599	ジャパンフーズ	400	798.00	319,200	
2602	日清オイリオグループ	12,000	345.00	4,140,000	
2607	不二製油	6,800	1,104.00	7,507,200	
2613	J - オイルミルズ	10,000	231.00	2,310,000	
2801	キッコーマン	23,000	858.00	19,734,000	
2802	味の素	76,000	867.00	65,892,000	
2809	キューピー	14,100	1,066.00	15,030,600	
2810	ハウス食品	9,900	1,434.00	14,196,600	
2811	カゴメ	10,000	1,465.00	14,650,000	
2812	焼津水産化学工業	1,300	729.00	947,700	
2815	アリアケジャパン	2,300	1,343.00	3,088,900	
2871	ニチレイ	31,000	345.00	10,695,000	
2875	東洋水産	12,000	2,009.00	24,108,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,000	3,045.00	30,450,000	
2899	永谷園	3,000	845.00	2,535,000	
2908	フジッコ	3,000	951.00	2,853,000	
2910	ロック・フィールド	1,400	1,301.00	1,821,400	
2914	日本たばこ産業	579	377,500.00	218,572,500	
2918	わらべや日洋	1,600	979.00	1,566,400	
2922	なとり	1,300	840.00	1,092,000	
4404	ミヨシ油脂	9,000	104.00	936,000	
3001	片倉工業	3,300	764.00	2,521,200	
3002	ゲンゼ	18,000	238.00	4,284,000	
3101	東洋紡績	110,000	110.00	12,100,000	
3103	ユニチカ	72,000	44.00	3,168,000	
3104	富士紡ホールディングス	12,000	151.00	1,812,000	
3105	日清紡ホールディングス	17,000	701.00	11,917,000	
3106	倉敷紡績	25,000	150.00	3,750,000	
3109	シキボウ	16,000	90.00	1,440,000	
3201	日本毛織	9,000	631.00	5,679,000	
3202	大東紡織	5,000	56.00	280,000	
3204	トーア紡コーポレーション	11,000	52.00	572,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,200	772.00	2,470,400	
3302	帝国繊維	3,000	502.00	1,506,000	
3401	帝人	99,000	275.00	27,225,000	

3402	東レ	202,000	558.00	112,716,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	110.00	880,000	
3501	住江織物	7,000	131.00	917,000	
3512	日本フェルト	1,400	376.00	526,400	
3513	イチカワ	2,000	151.00	302,000	
3514	日本バイリーン	3,000	324.00	972,000	
3524	日東製網	3,000	106.00	318,000	
3526	芦森工業	6,000	105.00	630,000	
3529	アツギ	20,000	91.00	1,820,000	
3551	ダイニック	5,000	134.00	670,000	
3569	セーレン	6,500	463.00	3,009,500	
3577	東海染工	4,000	84.00	336,000	
3580	小松精練	4,000	347.00	1,388,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	941.00	14,115,000	
3593	ホギメディカル	1,400	3,220.00	4,508,000	
3606	レナウン	5,300	147.00	779,100	
3607	クラウドディア	300	1,009.00	302,700	
3608	T S Iホールディングス	11,600	391.00	4,535,600	
8011	三陽商会	13,000	184.00	2,392,000	
8013	ナイガイ	8,000	35.00	280,000	
8016	オンワードホールディングス	17,000	560.00	9,520,000	
8029	ルック	4,000	173.00	692,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	258.00	1,548,000	
8114	デサント	6,000	436.00	2,616,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,500	348.00	522,000	
3708	特種東海製紙	16,000	166.00	2,656,000	
3861	王子製紙	115,000	403.00	46,345,000	
3864	三菱製紙	38,000	73.00	2,774,000	
3865	北越紀州製紙	16,000	529.00	8,464,000	
3877	中越パルプ工業	10,000	120.00	1,200,000	
3878	巴川製紙所	5,000	170.00	850,000	
3880	大王製紙	11,000	618.00	6,798,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,600	1,800.00	22,680,000	
3941	レンゴー	21,000	539.00	11,319,000	
3946	トーモク	8,000	207.00	1,656,000	
3950	ザ・バック	1,500	1,218.00	1,827,000	
3405	クラレ	38,400	1,091.00	41,894,400	
3407	旭化成	152,000	467.00	70,984,000	
3553	共和レザー	1,600	259.00	414,400	
4003	コープケミカル	4,000	94.00	376,000	
4004	昭和電工	162,000	148.00	23,976,000	
4005	住友化学	179,000	285.00	51,015,000	
4007	日本化成	5,000	145.00	725,000	
4008	住友精化	6,000	335.00	2,010,000	
4021	日産化学工業	18,500	784.00	14,504,000	
4022	ラサ工業	10,000	127.00	1,270,000	
4023	クレハ	17,000	349.00	5,933,000	
4027	テイカ	4,000	335.00	1,340,000	
4028	石原産業	44,000	97.00	4,268,000	

4031	片倉チッカリン	2,000	183.00	366,000	
4041	日本曹達	15,000	354.00	5,310,000	
4042	東ソー	65,000	254.00	16,510,000	
4043	トクヤマ	41,000	271.00	11,111,000	
4044	セントラル硝子	25,000	357.00	8,925,000	
4045	東亜合成	33,000	340.00	11,220,000	
4046	ダイソー	10,000	257.00	2,570,000	
4047	関東電化工業	6,000	385.00	2,310,000	
4061	電気化学工業	55,000	289.00	15,895,000	
4063	信越化学工業	43,300	3,945.00	170,818,500	
4064	日本カーバイド工業	8,000	110.00	880,000	
4078	堺化学工業	8,000	313.00	2,504,000	
4088	エア・ウォーター	21,000	998.00	20,958,000	
4091	大陽日酸	34,000	569.00	19,346,000	
4092	日本化学工業	10,000	139.00	1,390,000	
4095	日本パーカライズニング	6,000	1,058.00	6,348,000	
4097	高压ガス工業	4,000	444.00	1,776,000	
4099	四国化成工業	4,000	428.00	1,712,000	
4100	戸田工業	4,000	561.00	2,244,000	
4109	ステラ ケミファ	1,100	2,165.00	2,381,500	
4112	保土谷化学工業	6,000	259.00	1,554,000	
4114	日本触媒	21,000	820.00	17,220,000	
4116	大日精化工業	9,000	365.00	3,285,000	
4118	カネカ	32,000	425.00	13,600,000	
4182	三菱瓦斯化学	41,000	497.00	20,377,000	
4183	三井化学	119,000	256.00	30,464,000	
4185	J S R	21,700	1,456.00	31,595,200	
4186	東京応化工業	4,700	1,599.00	7,515,300	
4188	三菱ケミカルホールディングス	151,000	485.00	73,235,000	
4201	日本合成化学工業	6,000	392.00	2,352,000	
4202	ダイセル	34,000	447.00	15,198,000	
4203	住友ベークライト	24,000	424.00	10,176,000	
4204	積水化学工業	54,000	621.00	33,534,000	
4205	日本ゼオン	24,000	733.00	17,592,000	
4206	アイカ工業	7,600	1,057.00	8,033,200	
4208	宇部興産	109,000	237.00	25,833,000	
4212	積水樹脂	4,000	756.00	3,024,000	
4215	タキロン	6,000	263.00	1,578,000	
4216	旭有機材工業	9,000	201.00	1,809,000	
4217	日立化成工業	11,300	1,392.00	15,729,600	
4218	ニチバン	3,000	266.00	798,000	
4220	リケンテクノス	5,000	238.00	1,190,000	
4221	大倉工業	6,000	288.00	1,728,000	
4228	積水化成成品工業	6,000	311.00	1,866,000	
4229	群栄化学工業	7,000	212.00	1,484,000	
4231	タイガースポリマー	1,300	311.00	404,300	
4271	日本カーリット	2,100	403.00	846,300	
4272	日本化薬	18,000	759.00	13,662,000	
4362	日本精化	2,200	500.00	1,100,000	

4401	A D E K A	10,400	768.00	7,987,200	
4403	日油	22,000	370.00	8,140,000	
4410	ハリマ化成	2,200	660.00	1,452,000	
4452	花王	69,000	2,030.00	140,070,000	
4461	第一工業製薬	5,000	234.00	1,170,000	
4471	三洋化成工業	7,000	499.00	3,493,000	
4611	大日本塗料	16,000	78.00	1,248,000	
4612	日本ペイント	23,000	576.00	13,248,000	
4613	関西ペイント	30,000	706.00	21,180,000	
4614	トウベ	3,000	65.00	195,000	
4617	中国塗料	7,000	530.00	3,710,000	
4619	日本特殊塗料	2,000	306.00	612,000	
4620	藤倉化成	3,200	376.00	1,203,200	
4626	太陽ホールディングス	1,900	2,014.00	3,826,600	
4631	D I C	100,000	145.00	14,500,000	
4633	サカタインクス	5,000	348.00	1,740,000	
4634	東洋インキ S C ホールディングス	23,000	303.00	6,969,000	
4901	富士フイルムホールディングス	55,600	1,930.00	107,308,000	
4911	資生堂	43,200	1,429.00	61,732,800	
4912	ライオン	30,000	446.00	13,380,000	
4914	高砂香料工業	9,000	370.00	3,330,000	
4917	マンダム	2,600	2,151.00	5,592,600	
4919	ミルボン	1,400	2,390.00	3,346,000	
4921	ファンケル	5,000	1,092.00	5,460,000	
4922	コーセー	4,700	1,865.00	8,765,500	
4924	ドクターシーラボ	16	420,500.00	6,728,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	2,194.00	5,704,400	
4951	エステー	1,300	1,022.00	1,328,600	
4956	コニシ	2,000	1,106.00	2,212,000	
4958	長谷川香料	3,300	1,241.00	4,095,300	
4967	小林製薬	3,600	3,935.00	14,166,000	
4968	荒川化学工業	2,000	649.00	1,298,000	
4971	メック	1,800	269.00	484,200	
4973	日本高純度化学	7	193,000.00	1,351,000	
4975	荏原ユーヅライト	400	1,982.00	792,800	
4985	アース製薬	1,800	2,825.00	5,085,000	
4989	イハラケミカル工業	4,000	288.00	1,152,000	
4992	北興化学工業	3,000	222.00	666,000	
4994	大成ラミック	700	2,355.00	1,648,500	
4996	クミアイ化学工業	6,000	289.00	1,734,000	
4997	日本農薬	6,000	343.00	2,058,000	
5142	アキレス	21,000	109.00	2,289,000	
5208	有沢製作所	4,100	343.00	1,406,300	
6988	日東電工	21,500	3,460.00	74,390,000	
7874	レック	700	1,514.00	1,059,800	
7908	きもと	2,300	592.00	1,361,600	
7917	藤森工業	1,900	1,282.00	2,435,800	

7925	前澤化成工業	1,900	848.00	1,611,200	
7942	J S P	1,700	1,179.00	2,004,300	
7947	エフピコ	1,300	5,180.00	6,734,000	
7958	天馬	2,300	668.00	1,536,400	
7970	信越ポリマー	5,100	374.00	1,907,400	
7971	東リ	7,000	141.00	987,000	
7988	ニフコ	5,000	1,999.00	9,995,000	
7995	日本バルカー工業	11,000	194.00	2,134,000	
8113	ユニ・チャーム	14,400	3,490.00	50,256,000	
4151	協和発酵キリン	36,000	861.00	30,996,000	
4502	武田薬品工業	97,500	3,510.00	342,225,000	代用有価証券10,000株
4503	アステラス製薬	57,800	2,819.00	162,938,200	
4506	大日本住友製薬	18,500	847.00	15,669,500	
4507	塩野義製薬	37,900	1,054.00	39,946,600	
4508	田辺三菱製薬	21,700	1,385.00	30,054,500	
4512	わかもと製薬	3,000	230.00	690,000	
4514	あすか製薬	3,000	575.00	1,725,000	
4516	日本新薬	6,000	910.00	5,460,000	
4519	中外製薬	30,200	1,199.00	36,209,800	
4521	科研製薬	11,000	992.00	10,912,000	
4523	エーザイ	32,000	3,060.00	97,920,000	
4527	ロート製薬	12,000	890.00	10,680,000	
4528	小野薬品工業	12,700	4,250.00	53,975,000	
4530	久光製薬	7,400	3,175.00	23,495,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	159.00	318,000	
4534	持田製薬	10,000	812.00	8,120,000	
4536	参天製薬	8,100	3,165.00	25,636,500	
4538	扶桑薬品工業	9,000	206.00	1,854,000	
4539	日本ケミファ	4,000	323.00	1,292,000	
4540	ツムラ	7,100	2,242.00	15,918,200	
4541	日医工	4,400	1,801.00	7,924,400	
4547	キッセイ薬品工業	5,300	1,474.00	7,812,200	
4548	生化学工業	5,000	843.00	4,215,000	
4549	栄研化学	2,000	965.00	1,930,000	
4550	日水製薬	1,100	679.00	746,900	
4551	鳥居薬品	1,800	1,518.00	2,732,400	
4553	東和薬品	1,300	3,465.00	4,504,500	
4555	沢井製薬	1,700	7,470.00	12,699,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,197.00	4,788,000	
4568	第一三共	87,600	1,541.00	134,991,600	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	7,000	1,447.00	10,129,000	
4574	大幸薬品	1,200	808.00	969,600	
4577	ダイト	700	1,293.00	905,100	
4578	大塚ホールディングス	60,200	2,016.00	121,363,200	
4581	大正製薬ホールディングス	6,300	5,700.00	35,910,000	
3315	日本コークス工業	21,500	105.00	2,257,500	
5002	昭和シェル石油	23,300	566.00	13,187,800	
5007	コスモ石油	72,000	202.00	14,544,000	

5011	ニチレキ	3,000	400.00	1,200,000	
5012	東燃ゼネラル石油	39,000	883.00	34,437,000	
5013	ユシロ化学工業	1,300	866.00	1,125,800	
5015	ビービー・カストロール	1,000	327.00	327,000	
5017	AOCホールディングス	6,700	455.00	3,048,500	
5018	MORESCO	500	755.00	377,500	
5019	出光興産	3,100	7,360.00	22,816,000	
5020	JXホールディングス	288,600	451.00	130,158,600	
5101	横浜ゴム	29,000	440.00	12,760,000	
5105	東洋ゴム工業	22,000	186.00	4,092,000	
5108	ブリヂストン	81,500	1,768.00	144,092,000	
5110	住友ゴム工業	20,300	954.00	19,366,200	
5121	藤倉ゴム工業	1,600	293.00	468,800	
5122	オカモト	9,000	325.00	2,925,000	
5185	フコク	1,100	680.00	748,000	
5186	ニッタ	2,300	1,362.00	3,132,600	
5191	東海ゴム工業	4,000	1,079.00	4,316,000	
5192	三ツ星ベルト	6,000	411.00	2,466,000	
5195	バンドー化学	9,000	299.00	2,691,000	
3110	日東紡績	21,000	241.00	5,061,000	
5201	旭硝子	128,000	721.00	92,288,000	
5202	日本板硝子	112,000	170.00	19,040,000	
5204	石塚硝子	4,000	148.00	592,000	
5210	日本山村硝子	11,000	183.00	2,013,000	
5214	日本電気硝子	54,000	816.00	44,064,000	
5218	オハラ	1,000	751.00	751,000	
5232	住友大阪セメント	50,000	242.00	12,100,000	
5233	太平洋セメント	139,000	150.00	20,850,000	
5234	デイ・シイ	2,800	221.00	618,800	
5262	日本ヒューム	2,000	301.00	602,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	178.00	712,000	
5301	東海カーボン	22,000	386.00	8,492,000	
5302	日本カーボン	12,000	236.00	2,832,000	
5310	東洋炭素	1,400	3,735.00	5,229,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	252.00	3,276,000	
5332	TOTO	37,000	645.00	23,865,000	
5333	日本碍子	31,000	915.00	28,365,000	
5334	日本特殊陶業	22,000	1,029.00	22,638,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	73.00	292,000	
5344	MARUWA	700	3,255.00	2,278,500	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	222.00	1,332,000	
5352	黒崎播磨	6,000	264.00	1,584,000	
5363	東京窯業	3,000	157.00	471,000	
5367	ニッカトー	900	470.00	423,000	
5384	フジインコーポレーテッド	2,400	928.00	2,227,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	81.00	486,000	
5393	ニチアス	12,000	400.00	4,800,000	
7943	ニチハ	2,600	861.00	2,238,600	
5401	新日本製鐵	683,000	204.00	139,332,000	

5405	住友金属工業	482,000	146.00	70,372,000	
5406	神戸製鋼所	360,000	127.00	45,720,000	
5407	日新製鋼	100,000	126.00	12,600,000	
5408	中山製鋼所	14,000	77.00	1,078,000	
5410	合同製鐵	15,000	180.00	2,700,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディ ングス	61,700	1,459.00	90,020,300	
5423	東京製鐵	14,400	653.00	9,403,200	

[次へ](#)

5440	共英製鋼	2,800	1,444.00	4,043,200	
5444	大和工業	5,900	1,988.00	11,729,200	
5445	東京鐵鋼	6,000	210.00	1,260,000	
5449	大阪製鐵	1,600	1,347.00	2,155,200	
5451	淀川製鋼所	20,000	313.00	6,260,000	
5453	東洋鋼鈹	6,000	302.00	1,812,000	
5457	住友鋼管	1,800	479.00	862,200	
5463	丸一鋼管	8,700	1,789.00	15,564,300	
5464	モリ工業	4,000	284.00	1,136,000	
5471	大同特殊鋼	44,000	479.00	21,076,000	
5476	日本高周波鋼業	11,000	83.00	913,000	
5479	日本金属工業	21,000	76.00	1,596,000	
5480	日本冶金工業	16,500	134.00	2,211,000	
5481	山陽特殊製鋼	13,000	426.00	5,538,000	
5482	愛知製鋼	14,000	428.00	5,992,000	
5486	日立金属	17,000	944.00	16,048,000	
5491	日本金属	7,000	132.00	924,000	
5541	大平洋金属	18,000	442.00	7,956,000	
5563	日本電工	9,000	407.00	3,663,000	
5602	栗本鐵工所	14,000	120.00	1,680,000	
5606	旭テック	26,000	23.00	598,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	170.00	510,000	
5632	三菱製鋼	16,000	221.00	3,536,000	
5658	日亜鋼業	4,000	204.00	816,000	
5659	日本精線	2,000	396.00	792,000	
6319	シンニッタン	2,500	295.00	737,500	
7305	新家工業	6,000	120.00	720,000	
5701	日本輕金属	59,000	121.00	7,139,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	261.00	1,044,000	
5706	三井金属鈹業	75,000	212.00	15,900,000	
5707	東邦亜鉛	15,000	314.00	4,710,000	
5711	三菱マテリアル	163,000	211.00	34,393,000	
5713	住友金属鈹山	72,000	1,068.00	76,896,000	
5714	DOWAホールディングス	31,000	476.00	14,756,000	
5715	古河機械金属	44,000	75.00	3,300,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	3,925.00	10,990,000	
5727	東邦チタニウム	4,200	1,517.00	6,371,400	
5738	住友輕金属工業	57,000	68.00	3,876,000	
5741	古河スカイ	10,000	216.00	2,160,000	
5801	古河電気工業	82,000	220.00	18,040,000	
5802	住友電気工業	91,900	860.00	79,034,000	
5803	フジクラ	39,000	247.00	9,633,000	
5805	昭和電線ホールディングス	32,000	74.00	2,368,000	
5809	タツタ電線	5,000	354.00	1,770,000	
5812	日立電線	21,000	195.00	4,095,000	
5815	沖電線	3,000	146.00	438,000	
5819	カナレ電気	300	1,230.00	369,000	
5821	平河ヒューテック	500	736.00	368,000	
5851	リョービ	14,000	316.00	4,424,000	

5857	アサヒホールディングス	3,600	1,521.00	5,475,600	
3421	稲葉製作所	1,300	890.00	1,157,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,000	75.00	675,000	
3432	三協・立山ホールディングス	35,000	101.00	3,535,000	
3433	トーカロ	1,300	1,525.00	1,982,500	
3434	アルファC o	800	868.00	694,400	
3436	SUMCO	16,000	756.00	12,096,000	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,165.00	699,000	
5901	東洋製罐	18,400	1,139.00	20,957,600	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	244.00	1,464,000	
5909	コロナ	1,200	1,466.00	1,759,200	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	443.00	2,215,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	191.00	955,000	
5929	三和ホールディングス	26,000	233.00	6,058,000	
5930	文化シャッター	7,000	232.00	1,624,000	
5936	東洋シャッター	700	336.00	235,200	
5938	住生活グループ	31,700	1,663.00	52,717,100	
5942	日本フィルコン	2,000	416.00	832,000	
5943	ノーリツ	5,100	1,573.00	8,022,300	
5946	長府製作所	2,500	1,980.00	4,950,000	
5947	リンナイ	4,200	5,740.00	24,108,000	
5951	ダイニチ工業	1,400	887.00	1,241,800	
5957	日東精工	4,000	201.00	804,000	
5958	三洋工業	3,000	139.00	417,000	
5959	岡部	5,100	377.00	1,922,700	
5974	中国工業	5,000	86.00	430,000	
5975	東プレ	5,000	723.00	3,615,000	
5976	高周波熱錬	3,500	593.00	2,075,500	
5981	東京製綱	18,000	175.00	3,150,000	
5988	パイオラックス	1,100	1,700.00	1,870,000	
5991	日本発條	18,800	719.00	13,517,200	
5992	中央発條	3,000	278.00	834,000	
5998	アドバネクス	5,000	60.00	300,000	
8155	三益半導体工業	2,200	657.00	1,445,400	
1978	アタカ大機	2,000	243.00	486,000	
5631	日本製鋼所	40,000	519.00	20,760,000	
5963	日立ツール	1,500	787.00	1,180,500	
6005	三浦工業	4,200	2,212.00	9,290,400	
6013	タクマ	10,000	383.00	3,830,000	
6101	ツガミ	7,000	455.00	3,185,000	
6103	オークマ	17,000	589.00	10,013,000	
6104	東芝機械	16,000	382.00	6,112,000	
6113	アマダ	37,000	527.00	19,499,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,800	381.00	2,590,800	
6135	牧野フライス製作所	12,000	567.00	6,804,000	
6136	オーエスジー	11,500	1,025.00	11,787,500	
6138	ダイジェット工業	3,000	144.00	432,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	5,500	1,196.00	6,578,000	
6141	森精機製作所	13,800	733.00	10,115,400	

6146	ディスコ	2,600	4,210.00	10,946,000	
6151	日東工器	1,500	1,795.00	2,692,500	
6203	豊和工業	14,000	64.00	896,000	
6205	大阪機工	9,000	91.00	819,000	
6210	東洋機械金属	2,200	188.00	413,600	
6217	津田駒工業	7,000	151.00	1,057,000	
6222	島精機製作所	3,400	1,440.00	4,896,000	
6247	日阪製作所	3,000	869.00	2,607,000	
6250	やまびこ	1,000	902.00	902,000	
6262	ベガサスミシン製造	2,700	214.00	577,800	
6268	ナブテスコ	9,900	1,741.00	17,235,900	
6269	三井海洋開発	2,100	1,333.00	2,799,300	
6272	レオン自動機	3,000	170.00	510,000	
6273	S M C	7,800	12,420.00	96,876,000	
6274	新川	2,000	415.00	830,000	
6277	ホソカワミクロン	4,000	333.00	1,332,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,402.00	1,962,800	
6282	オイレス工業	2,600	1,422.00	3,697,200	
6287	サトーホールディングス	2,500	979.00	2,447,500	
6291	日本エアージェット	800	325.00	260,000	
6293	日精樹脂工業	2,100	235.00	493,500	
6298	ワイエイシイ	1,200	636.00	763,200	
6301	小松製作所	123,300	1,843.00	227,241,900	
6302	住友重機械工業	67,000	452.00	30,284,000	
6305	日立建機	11,600	1,426.00	16,541,600	
6306	日工	4,000	284.00	1,136,000	
6309	巴工業	1,000	1,469.00	1,469,000	
6310	井関農機	27,000	174.00	4,698,000	
6315	T O W A	2,600	342.00	889,200	
6316	丸山製作所	6,000	174.00	1,044,000	
6317	北川鉄工所	12,000	115.00	1,380,000	
6326	クボタ	109,000	636.00	69,324,000	
6328	荏原実業	600	1,210.00	726,000	
6331	三菱化工機	8,000	149.00	1,192,000	
6332	月島機械	4,000	625.00	2,500,000	
6333	帝国電機製作所	900	1,651.00	1,485,900	
6339	新東工業	5,200	727.00	3,780,400	
6340	澁谷工業	1,500	774.00	1,161,000	
6345	アイチ コーポレーション	4,200	311.00	1,306,200	
6349	小森コーポレーション	7,000	500.00	3,500,000	
6351	鶴見製作所	2,000	646.00	1,292,000	
6355	住友精密工業	4,000	513.00	2,052,000	
6358	酒井重工業	5,000	134.00	670,000	
6361	荏原製作所	42,000	323.00	13,566,000	
6362	石井鐵工所	4,000	137.00	548,000	
6363	西島製作所	3,000	1,104.00	3,312,000	
6367	ダイキン工業	27,100	2,239.00	60,676,900	
6368	オルガノ	4,000	613.00	2,452,000	
6369	トーヨーカネツ	14,000	144.00	2,016,000	

6370	栗田工業	14,400	2,177.00	31,348,800	
6371	椿本チエイン	13,000	409.00	5,317,000	
6373	大同工業	5,000	140.00	700,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	72.00	576,000	
6378	木村化工機	2,400	308.00	739,200	
6381	アネスト岩田	4,000	317.00	1,268,000	
6383	ダイフク	10,500	404.00	4,242,000	
6390	加藤製作所	6,000	202.00	1,212,000	
6393	油研工業	5,000	170.00	850,000	
6395	タダノ	11,000	493.00	5,423,000	
6406	フジテック	7,000	371.00	2,597,000	
6407	シーケーディ	7,000	527.00	3,689,000	
6409	キトー	7	55,800.00	390,600	
6412	平和	5,400	1,426.00	7,700,400	
6413	理想科学工業	1,900	1,403.00	2,665,700	
6417	SANKYO	7,500	4,075.00	30,562,500	
6418	日本金銭機械	2,300	653.00	1,501,900	
6419	マースエンジニアリング	1,200	1,230.00	1,476,000	
6420	福島工業	800	872.00	697,600	
6428	オーイズミ	1,000	288.00	288,000	
6430	ダイコク電機	1,100	647.00	711,700	
6436	アマノ	6,900	669.00	4,616,100	
6440	JUKI	15,000	179.00	2,685,000	
6444	サンデン	14,000	256.00	3,584,000	
6445	蛇の目シン工業	25,000	55.00	1,375,000	
6454	マックス	4,000	913.00	3,652,000	
6457	グローリー	6,900	1,670.00	11,523,000	
6459	大和冷機工業	3,000	385.00	1,155,000	
6460	セガサミーホールディングス	24,700	1,695.00	41,866,500	
6461	日本ピストンリング	10,000	154.00	1,540,000	
6462	リケン	10,000	313.00	3,130,000	
6463	T P R	3,000	877.00	2,631,000	
6465	ホシザキ電機	5,000	1,747.00	8,735,000	
6470	大豊工業	1,800	673.00	1,211,400	
6471	日本精工	55,000	584.00	32,120,000	
6472	N T N	58,000	352.00	20,416,000	
6473	ジェイテクト	26,400	894.00	23,601,600	
6474	不二越	25,000	451.00	11,275,000	
6480	日本トムソン	8,000	465.00	3,720,000	
6481	T H K	16,600	1,548.00	25,696,800	
6482	ユーシン精機	1,300	1,503.00	1,953,900	
6485	前澤給装工業	900	1,080.00	972,000	
6486	イーグル工業	3,000	821.00	2,463,000	
6489	前澤工業	2,000	177.00	354,000	
6490	日本ピラー工業	3,000	527.00	1,581,000	
6498	キッツ	10,200	353.00	3,600,600	
6581	日立工機	6,700	588.00	3,939,600	
6586	マキタ	16,200	2,953.00	47,838,600	
7004	日立造船	104,500	106.00	11,077,000	

7011	三菱重工業	417,000	315.00	131,355,000	
7013	I H I	170,000	177.00	30,090,000	
4062	イビデン	15,200	1,955.00	29,716,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	65,500	548.00	35,894,000	
6448	ブラザー工業	32,100	1,007.00	32,324,700	
6479	ミネベア	37,000	286.00	10,582,000	
6501	日立製作所	558,000	424.00	236,592,000	
6502	東芝	491,000	350.00	171,850,000	
6503	三菱電機	249,000	730.00	181,770,000	
6504	富士電機	75,000	217.00	16,275,000	
6505	東洋電機製造	4,000	360.00	1,440,000	
6506	安川電機	27,000	663.00	17,901,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	15,000	190.00	2,850,000	
6508	明電舎	25,000	292.00	7,300,000	
6513	オリジン電気	3,000	289.00	867,000	
6517	デンヨー	2,400	1,059.00	2,541,600	
6588	東芝テック	16,000	300.00	4,800,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	253.00	1,012,000	
6592	マブチモーター	3,400	3,505.00	11,917,000	
6594	日本電産	12,300	6,540.00	80,442,000	
6621	高岳製作所	10,000	207.00	2,070,000	
6622	ダイヘン	14,000	279.00	3,906,000	
6632	J V C ケンウッド	12,000	282.00	3,384,000	
6640	第一精工	700	2,139.00	1,497,300	
6641	日新電機	4,000	500.00	2,000,000	
6644	大崎電気工業	3,000	717.00	2,151,000	
6645	オムロン	27,700	1,780.00	49,306,000	
6651	日東工業	3,700	920.00	3,404,000	
6652	I D E C	3,000	799.00	2,397,000	
6665	エルピーダメモリ	28,100	499.00	14,021,900	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,000	402.00	19,296,000	
6675	サクサホールディングス	6,000	117.00	702,000	
6676	メルコホールディングス	1,400	2,188.00	3,063,200	
6678	テクノメディカ	2	271,200.00	542,400	
6701	日本電気	322,000	173.00	55,706,000	
6702	富士通	240,000	414.00	99,360,000	
6703	沖電気工業	91,000	68.00	6,188,000	
6704	岩崎通信機	11,000	65.00	715,000	
6706	電気興業	8,000	292.00	2,336,000	
6707	サンケン電気	15,000	306.00	4,590,000	
6715	ナカヨ通信機	3,000	171.00	513,000	
6718	アイホン	1,600	1,344.00	2,150,400	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,500	557.00	3,620,500	
6724	セイコーエプソン	17,000	1,064.00	18,088,000	
6727	ワコム	49	104,200.00	5,105,800	
6728	アルバック	4,600	1,113.00	5,119,800	
6730	アクセル	1,100	1,803.00	1,983,300	

6737	ナナオ	2,100	1,449.00	3,042,900	
6741	日本信号	5,800	576.00	3,340,800	
6742	京三製作所	5,000	354.00	1,770,000	
6744	能美防災	3,000	490.00	1,470,000	
6745	ホーチキ	2,000	378.00	756,000	
6749	マスプロ電工	200	1,060.00	212,000	
6751	日本無線	7,000	195.00	1,365,000	
6752	パナソニック	289,400	782.00	226,310,800	
6753	シャープ	112,000	669.00	74,928,000	
6754	アンリツ	11,000	861.00	9,471,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	459.00	2,754,000	
6756	日立国際電気	6,000	571.00	3,426,000	
6758	ソニー	139,600	1,565.00	218,474,000	
6762	T D K	14,000	3,310.00	46,340,000	
6763	帝国通信工業	6,000	135.00	810,000	
6767	ミツミ電機	8,900	624.00	5,553,600	
6768	タムラ製作所	8,000	197.00	1,576,000	
6770	アルプス電気	19,700	639.00	12,588,300	
6771	池上通信機	9,000	47.00	423,000	
6773	パイオニア	35,400	314.00	11,115,600	
6779	日本電波工業	1,900	988.00	1,877,200	
6788	日本トリム	300	1,826.00	547,800	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	844.00	928,400	
6794	フォスター電機	2,400	1,139.00	2,733,600	
6796	クラリオン	13,000	134.00	1,742,000	
6798	S M K	7,000	246.00	1,722,000	
6800	ヨコオ	2,100	416.00	873,600	
6801	東光	12,000	171.00	2,052,000	
6803	ティアック	15,000	28.00	420,000	
6804	ホシデン	6,200	522.00	3,236,400	
6806	ヒロセ電機	4,000	7,540.00	30,160,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	538.00	3,228,000	
6809	T O A	3,000	427.00	1,281,000	
6815	ユニデン	7,000	316.00	2,212,000	
6816	アルパイン	4,900	959.00	4,699,100	
6817	スミダコーポレーション	1,500	658.00	987,000	
6820	アイコム	1,400	1,978.00	2,769,200	
6839	船井電機	2,300	1,638.00	3,767,400	
6841	横河電機	24,900	733.00	18,251,700	
6844	新電元工業	9,000	324.00	2,916,000	
6845	山武	6,900	1,646.00	11,357,400	
6849	日本光電工業	4,600	1,812.00	8,335,200	
6850	チノー	5,000	190.00	950,000	
6853	共和電業	2,000	252.00	504,000	
6855	日本電子材料	1,100	402.00	442,200	
6856	堀場製作所	4,600	2,490.00	11,454,000	
6857	アドバンテスト	17,000	923.00	15,691,000	
6858	小野測器	3,000	216.00	648,000	
6859	エスベック	2,600	484.00	1,258,400	

6860	パナソニック電工SUNX	2,200	430.00	946,000	
6861	キーエンス	5,500	20,440.00	112,420,000	
6866	日置電機	1,200	1,434.00	1,720,800	
6869	シスメックス	8,700	2,497.00	21,723,900	
6875	メガチップス	2,200	1,092.00	2,402,400	
6877	OBARA GROUP	1,800	908.00	1,634,400	
6883	日本電産コパル電子	2,500	520.00	1,300,000	
6885	ミヤチテクノス	1,200	639.00	766,800	
6900	東京電波	800	377.00	301,600	
6901	澤藤電機	2,000	237.00	474,000	
6905	コーセル	3,600	1,091.00	3,927,600	
6910	日立メディコ	2,000	822.00	1,644,000	
6911	新日本無線	2,000	124.00	248,000	
6914	オブテックス	1,700	982.00	1,669,400	
6915	千代田インテグレ	1,200	1,010.00	1,212,000	
6921	東光電気	1,000	345.00	345,000	
6923	スタンレー電気	16,800	1,096.00	18,412,800	
6924	岩崎電気	9,000	180.00	1,620,000	
6925	ウシオ電機	15,100	1,157.00	17,470,700	
6926	岡谷電機産業	1,300	347.00	451,100	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,400	155.00	372,000	
6929	日本セラミック	1,600	1,392.00	2,227,200	
6934	新神戸電機	2,000	1,290.00	2,580,000	
6935	日本デジタル研究所	2,100	720.00	1,512,000	
6937	古河電池	2,000	379.00	758,000	
6938	双信電機	1,300	361.00	469,300	
6941	山一電機	2,600	194.00	504,400	
6947	函研	1,500	583.00	874,500	
6951	日本電子	9,000	214.00	1,926,000	
6952	カシオ計算機	23,700	469.00	11,115,300	
6954	ファナック	25,900	12,510.00	324,009,000	
6958	日本シイエムケイ	4,900	290.00	1,421,000	
6961	エンプラス	1,300	1,538.00	1,999,400	
6963	ローム	12,200	4,050.00	49,410,000	
6965	浜松ホトニクス	9,700	3,035.00	29,439,500	
6966	三井ハイテック	2,900	349.00	1,012,100	
6967	新光電気工業	6,300	606.00	3,817,800	
6971	京セラ	20,700	7,090.00	146,763,000	
6976	太陽誘電	11,200	633.00	7,089,600	
6981	村田製作所	26,100	4,570.00	119,277,000	
6985	ユーション	3,500	664.00	2,324,000	
6986	双葉電子工業	4,200	1,497.00	6,287,400	
6989	北陸電気工業	10,000	121.00	1,210,000	
6996	ニチコン	7,800	898.00	7,004,400	
6997	日本ケミコン	15,000	307.00	4,605,000	
6999	K O A	3,100	758.00	2,349,800	
7244	市光工業	6,000	131.00	786,000	
7276	小糸製作所	12,000	1,174.00	14,088,000	

7280	ミツバ	4,000	623.00	2,492,000	
7718	スター精密	4,500	755.00	3,397,500	
7735	大日本スクリーン製造	27,000	614.00	16,578,000	
7739	キヤノン電子	2,300	1,951.00	4,487,300	
7751	キヤノン	154,400	3,510.00	541,944,000	代用有価証券10,000株
7752	リコー	75,000	670.00	50,250,000	

[次へ](#)

7757	日本電産サンキョー	6,000	492.00	2,952,000	
7999	MUTOHホールディングス	3,000	126.00	378,000	
8035	東京エレクトロン	19,500	4,265.00	83,167,500	
3116	トヨタ紡織	8,700	970.00	8,439,000	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	593.00	3,558,000	
5949	ユニプレス	3,600	2,154.00	7,754,400	
6201	豊田自動織機	22,600	2,136.00	48,273,600	
6455	モリタホールディングス	4,000	413.00	1,652,000	
6584	三櫻工業	2,900	675.00	1,957,500	
6902	デンソー	54,600	2,314.00	126,344,400	
6995	東海理化電機製作所	5,800	1,263.00	7,325,400	
7003	三井造船	96,000	125.00	12,000,000	
7007	佐世保重工業	16,000	120.00	1,920,000	
7012	川崎重工業	194,000	198.00	38,412,000	
7102	日本車輛製造	9,000	311.00	2,799,000	
7105	日本輸送機	3,000	210.00	630,000	
7122	近畿車輛	4,000	258.00	1,032,000	
7201	日産自動車	314,000	690.00	216,660,000	
7202	いすゞ自動車	144,000	315.00	45,360,000	
7203	トヨタ自動車	319,300	2,528.00	807,190,400	代用有価証券35,000株
7205	日野自動車	31,000	441.00	13,671,000	
7211	三菱自動車工業	513,000	103.00	52,839,000	
7212	エフテック	900	924.00	831,600	
7220	武蔵精密工業	2,400	1,857.00	4,456,800	
7221	トヨタ車体	4,500	1,133.00	5,098,500	
7222	日産車体	10,000	714.00	7,140,000	
7223	関東自動車工業	3,800	629.00	2,390,200	
7224	新明和工業	11,000	268.00	2,948,000	
7226	極東開発工業	4,700	406.00	1,908,200	
7230	日信工業	5,000	1,129.00	5,645,000	
7231	トビー工業	21,000	197.00	4,137,000	
7236	ティラド	9,000	271.00	2,439,000	
7238	曙ブレーキ工業	11,600	359.00	4,164,400	
7239	タチエス	3,200	1,382.00	4,422,400	
7240	NOK	12,000	1,356.00	16,272,000	
7241	フタバ産業	7,100	563.00	3,997,300	
7242	カヤバ工業	15,000	445.00	6,675,000	
7243	シロキ工業	5,000	227.00	1,135,000	
7245	大同メタル工業	4,000	829.00	3,316,000	
7246	プレス工業	11,000	363.00	3,993,000	
7248	カルソニックカンセイ	13,000	455.00	5,915,000	
7250	太平洋工業	5,000	380.00	1,900,000	
7251	ケーヒン	5,100	1,356.00	6,915,600	
7256	河西工業	3,000	434.00	1,302,000	
7259	アイシン精機	20,400	2,470.00	50,388,000	
7260	富士機工	3,000	232.00	696,000	
7261	マツダ	193,000	159.00	30,687,000	
7262	ダイハツ工業	26,000	1,344.00	34,944,000	
7263	愛知機械工業	6,000	223.00	1,338,000	

7266	今仙電機製作所	1,700	910.00	1,547,000	
7267	本田技研工業	209,700	2,329.00	488,391,300	
7269	スズキ	52,000	1,653.00	85,956,000	
7270	富士重工業	78,000	478.00	37,284,000	
7272	ヤマハ発動機	40,500	1,078.00	43,659,000	
7274	ショーワ	5,400	469.00	2,532,600	
7277	T B K	2,000	325.00	650,000	
7278	エクセディ	3,000	2,723.00	8,169,000	
7282	豊田合成	7,000	1,339.00	9,373,000	
7283	愛三工業	3,000	699.00	2,097,000	
7294	ヨロズ	1,500	1,878.00	2,817,000	
7296	エフ・シー・シー	3,600	1,576.00	5,673,600	
7309	シマノ	9,400	3,915.00	36,801,000	
7312	タカタ	3,800	1,855.00	7,049,000	
7313	テイ・エス テック	4,700	1,107.00	5,202,900	
7728	日本電産トーソク	1,500	965.00	1,447,500	
4543	テルモ	19,500	3,780.00	73,710,000	
5187	クリエートメディック	700	800.00	560,000	
6376	日機装	9,000	618.00	5,562,000	
7701	島津製作所	30,000	652.00	19,560,000	
7702	J M S	4,000	229.00	916,000	
7714	モリテックス	600	294.00	176,400	
7715	長野計器	1,600	741.00	1,185,600	
7717	ブイ・テクノロジー	4	369,000.00	1,476,000	
7721	東京計器	9,000	117.00	1,053,000	
7723	愛知時計電機	3,000	239.00	717,000	
7729	東京精密	4,800	1,448.00	6,950,400	
7731	ニコン	43,300	1,687.00	73,047,100	
7732	トプコン	5,800	393.00	2,279,400	
7733	オリンパス	29,300	1,099.00	32,200,700	
7734	理研計器	2,000	541.00	1,082,000	
7740	タムロン	2,200	2,091.00	4,600,200	
7741	H O Y A	57,100	1,775.00	101,352,500	
7744	ノーリツ鋼機	2,300	356.00	818,800	
7745	エー・アンド・デイ	2,500	294.00	735,000	
7756	日本電産コパル	2,000	818.00	1,636,000	
7762	シチズンホールディングス	27,200	417.00	11,342,400	
7769	リズム時計工業	12,000	107.00	1,284,000	
7775	大研医器	400	846.00	338,400	
8050	セイコーホールディングス	13,000	188.00	2,444,000	
8086	ニプロ	9,800	671.00	6,575,800	
7817	パラマウントベッドホールディングス	1,900	1,958.00	3,720,200	
7825	S R I スポーツ	1,500	831.00	1,246,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	26,600	1,054.00	28,036,400	
7838	共立印刷	3,200	161.00	515,200	
7840	フランスベッドホールディングス	17,000	109.00	1,853,000	
7846	パイロットコーポレーション	22	157,400.00	3,462,800	

7862	トッパン・フォームズ	5,300	602.00	3,190,600	
7864	フジシールインターナショナル	2,600	1,435.00	3,731,000	
7867	タカラトミー	7,400	547.00	4,047,800	
7868	廣済堂	2,100	179.00	375,900	
7885	タカノ	1,000	461.00	461,000	
7893	プロネクサス	2,800	384.00	1,075,200	
7897	ホクシン	2,000	142.00	284,000	
7898	ウッドワン	4,000	290.00	1,160,000	
7905	大建工業	10,000	237.00	2,370,000	
7911	凸版印刷	70,000	580.00	40,600,000	
7912	大日本印刷	76,000	787.00	59,812,000	
7913	図書印刷	4,000	145.00	580,000	
7914	共同印刷	8,000	179.00	1,432,000	
7915	日本写真印刷	4,600	889.00	4,089,400	
7916	光村印刷	3,000	246.00	738,000	
7921	宝印刷	1,400	607.00	849,800	
7936	アシックス	23,200	1,004.00	23,292,800	
7937	ツツミ	1,100	1,890.00	2,079,000	
7944	ローランド	2,400	650.00	1,560,000	
7949	小松ウオール工業	900	717.00	645,300	
7951	ヤマハ	19,900	782.00	15,561,800	
7952	河合楽器製作所	9,000	161.00	1,449,000	
7955	クリナップ	2,600	463.00	1,203,800	
7956	ビジョン	1,700	2,792.00	4,746,400	
7961	兼松日産農林	4,000	133.00	532,000	
7962	キングジム	2,100	565.00	1,186,500	
7966	リンテック	5,300	1,637.00	8,676,100	
7968	田崎真珠	6,000	50.00	300,000	
7972	イトーキ	5,500	171.00	940,500	
7974	任天堂	14,200	11,180.00	158,756,000	
7976	三菱鉛筆	2,100	1,310.00	2,751,000	
7981	タカラスタンダード	11,000	570.00	6,270,000	
7984	コクヨ	13,000	581.00	7,553,000	
7987	ナカバヤシ	6,000	178.00	1,068,000	
7994	岡村製作所	10,000	460.00	4,600,000	
8022	美津濃	12,000	369.00	4,428,000	
8170	アデランス	2,800	784.00	2,195,200	
9501	東京電力	183,200	320.00	58,624,000	
9502	中部電力	76,100	1,462.00	111,258,200	
9503	関西電力	101,400	1,192.00	120,868,800	
9504	中国電力	34,400	1,212.00	41,692,800	
9505	北陸電力	24,400	1,328.00	32,403,200	
9506	東北電力	62,100	941.00	58,436,100	
9507	四国電力	24,700	2,075.00	51,252,500	
9508	九州電力	54,900	1,067.00	58,578,300	
9509	北海道電力	23,300	1,027.00	23,929,100	
9511	沖縄電力	1,500	3,200.00	4,800,000	
9513	電源開発	15,400	2,003.00	30,846,200	
9531	東京瓦斯	300,000	339.00	101,700,000	

9532	大阪瓦斯	241,000	299.00	72,059,000	
9533	東邦瓦斯	63,000	450.00	28,350,000	
9534	北海道瓦斯	5,000	262.00	1,310,000	
9536	西部瓦斯	28,000	192.00	5,376,000	
9543	静岡瓦斯	6,500	481.00	3,126,500	
9001	東武鉄道	130,000	369.00	47,970,000	
9003	相鉄ホールディングス	39,000	243.00	9,477,000	
9005	東京急行電鉄	136,000	371.00	50,456,000	
9006	京浜急行電鉄	64,000	699.00	44,736,000	
9007	小田急電鉄	80,000	721.00	57,680,000	
9008	京王電鉄	65,000	531.00	34,515,000	
9009	京成電鉄	40,000	506.00	20,240,000	
9010	富士急行	7,000	456.00	3,192,000	
9020	東日本旅客鉄道	43,200	4,525.00	195,480,000	
9021	西日本旅客鉄道	23,200	3,230.00	74,936,000	
9022	東海旅客鉄道	216	654,000.00	141,264,000	
9031	西日本鉄道	32,000	352.00	11,264,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,256.00	1,579,200	
9039	サカイ引越センター	400	1,671.00	668,400	
9041	近畿日本鉄道	225,000	273.00	61,425,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	167,000	325.00	54,275,000	
9044	南海電気鉄道	52,000	320.00	16,640,000	
9045	京阪電気鉄道	56,000	355.00	19,880,000	
9047	名糖運輸	1,000	597.00	597,000	
9048	名古屋鉄道	87,000	205.00	17,835,000	
9062	日本通運	98,000	308.00	30,184,000	
9064	ヤマトホールディングス	50,600	1,349.00	68,259,400	
9065	山九	30,000	311.00	9,330,000	
9067	丸運	1,300	190.00	247,000	
9068	丸全昭和運輸	8,000	259.00	2,072,000	
9069	センコー	10,000	288.00	2,880,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	154.00	770,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,500	805.00	6,037,500	
9074	日本石油輸送	3,000	185.00	555,000	
9075	福山通運	17,000	397.00	6,749,000	
9076	セイノーホールディングス	19,000	591.00	11,229,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	413.00	1,239,000	
9086	日立物流	4,300	1,396.00	6,002,800	
9101	日本郵船	210,000	194.00	40,740,000	
9104	商船三井	121,000	299.00	36,179,000	
9107	川崎汽船	77,000	149.00	11,473,000	
9110	NSユナイテッド海運	9,000	118.00	1,062,000	
9113	乾汽船	3,000	305.00	915,000	
9115	明治海運	2,300	218.00	501,400	
9119	飯野海運	12,100	378.00	4,573,800	
9130	共栄タンカー	2,000	110.00	220,000	
9132	第一中央汽船	16,000	109.00	1,744,000	
9202	全日本空輸	332,000	236.00	78,352,000	
9232	パスコ	3,000	258.00	774,000	

9234	国際航業ホールディングス	2,000	208.00	416,000	
9066	日新	9,000	182.00	1,638,000	
9301	三菱倉庫	18,000	831.00	14,958,000	
9302	三井倉庫	11,000	272.00	2,992,000	
9303	住友倉庫	18,000	344.00	6,192,000	
9304	澁澤倉庫	7,000	228.00	1,596,000	
9306	東陽倉庫	4,000	167.00	668,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	234.00	1,170,000	
9312	ケイヒン	5,000	90.00	450,000	
9324	安田倉庫	2,100	454.00	953,400	
9351	東洋埠頭	7,000	129.00	903,000	
9358	宇徳	2,000	243.00	486,000	
9364	上組	27,000	662.00	17,874,000	
9366	サンリツ	700	524.00	366,800	
9368	キムラユニティ	500	687.00	343,500	
9369	キューソー流通システム	800	869.00	695,200	
9370	郵船ロジスティクス	2,000	1,020.00	2,040,000	
9375	近鉄エクスプレス	2,200	2,426.00	5,337,200	
9380	東海運	1,400	186.00	260,400	
1973	NEC ネットエスアイ	2,300	1,154.00	2,654,200	
2317	システナ	24	53,400.00	1,281,600	
2327	新日鉄ソリューションズ	2,000	1,662.00	3,324,000	
2359	コア	900	631.00	567,900	
3371	ソフトクリエイト	200	1,079.00	215,800	
3620	デジタルハーツ	2	138,300.00	276,600	
3626	ITホールディングス	8,100	811.00	6,569,100	
3632	グリー	10,700	2,426.00	25,958,200	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,900	712.00	3,488,800	
3636	三菱総合研究所	900	1,368.00	1,231,200	
3639	ボルテージ	200	1,205.00	241,000	
3715	ダウンゴ	12	137,300.00	1,647,600	
3724	ベリサーブ	2	151,100.00	302,200	
3730	マクロミル	2,900	918.00	2,662,200	
3738	ティーガイア	20	149,900.00	2,998,000	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	5	334,000.00	1,670,000	
3770	ザッパラス	14	78,000.00	1,092,000	
3774	インターネットイニシアティブ	14	289,200.00	4,048,800	
3789	ソネットエンタテインメント	14	322,500.00	4,515,000	
3817	SRAホールディングス	1,300	746.00	969,800	
3820	JBISホールディングス	2,600	252.00	655,200	
3834	朝日ネット	2,000	348.00	696,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステム	500	2,120.00	1,060,000	
4295	フェイス	86	7,960.00	684,560	
4307	野村総合研究所	13,900	1,777.00	24,700,300	
4312	サイバネットシステム	21	19,960.00	419,160	
4326	インテージ	700	1,492.00	1,044,400	
4340	シンプレクス・ホールディングス	41	26,550.00	1,088,550	

4344	ソースネクスト	7	16,800.00	117,600	
4674	クレスコ	800	489.00	391,200	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	255	112,300.00	28,636,500	
4684	オービック	840	14,320.00	12,028,800	
4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	600	716.00	429,600	
4689	ヤフー	1,794	24,910.00	44,688,540	
4704	トレンドマイクロ	10,800	2,690.00	29,052,000	
4716	日本オラクル	3,900	2,739.00	10,682,100	
4719	アルファシステムズ	700	1,128.00	789,600	
4722	フューチャーアーキテクト	29	32,800.00	951,200	
4725	シーエーシー	1,700	584.00	992,800	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	610.00	366,000	
4728	トーセ	600	488.00	292,800	
4733	オービックビジネスコンサルタント	600	4,005.00	2,403,000	
4738	日立ビジネスソリューション	800	647.00	517,600	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	3,400	3,270.00	11,118,000	
4743	アイティフォー	2,800	275.00	770,000	
4746	東計電算	400	1,102.00	440,800	
4762	エクスネット	2	115,600.00	231,200	
4768	大塚商会	1,900	5,410.00	10,279,000	
4776	サイボウズ	35	16,790.00	587,650	
4779	ソフトブレーン	40	7,410.00	296,400	
4799	アグレックス	600	746.00	447,600	
4812	電通国際情報サービス	1,500	668.00	1,002,000	
4825	ウェザーニューズ	800	2,394.00	1,915,200	
4826	C I J	2,400	253.00	607,200	
4839	WOWOW	8	165,100.00	1,320,800	
6791	日本コロムビア	22,000	29.00	638,000	
7518	ネットワンシステムズ	60	194,200.00	11,652,000	
7595	アルゴグラフィックス	900	990.00	891,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,600	936.00	4,305,600	
8056	日本ユニシス	6,800	444.00	3,019,200	
8096	兼松エレクトロニクス	1,500	790.00	1,185,000	
9401	東京放送ホールディングス	13,200	937.00	12,368,400	
9404	日本テレビ放送網	2,150	10,980.00	23,607,000	
9409	テレビ朝日	62	121,200.00	7,514,400	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	186	39,050.00	7,263,300	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,100	1,071.00	1,178,100	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,200	481.00	1,058,200	
9427	イー・アクセス	135	20,410.00	2,755,350	
9430	N E Cモバイリング	900	2,625.00	2,362,500	
9432	日本電信電話	92,100	3,820.00	351,822,000	代用有価証券12,300株
9433	K D D I	381	562,000.00	214,122,000	
9435	光通信	3,100	1,729.00	5,359,900	

9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,021	135,800.00	274,451,800	
9449	GMOインターネット	7,400	332.00	2,456,800	
9470	学研ホールディングス	7,000	148.00	1,036,000	
9474	ゼンリン	3,600	707.00	2,545,200	
9475	昭文社	1,500	562.00	843,000	
9477	角川グループホールディングス	2,300	2,512.00	5,777,600	
9479	インプレスホールディングス	2,300	83.00	190,900	
9600	アイネット	1,200	455.00	546,000	
9601	松竹	15,000	692.00	10,380,000	
9602	東宝	16,000	1,316.00	21,056,000	
9605	東映	10,000	351.00	3,510,000	
9607	葵プロモーション	1,000	406.00	406,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	173	255,900.00	44,270,700	
9682	D T S	2,400	962.00	2,308,800	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	1,455.00	11,640,000	
9692	シーイーシー	1,700	373.00	634,100	
9697	カプコン	5,300	2,052.00	10,875,600	
9717	ジャステック	1,600	508.00	812,800	
9719	S C S K	5,400	1,234.00	6,663,600	
9739	日本システムウエア	900	293.00	263,700	
9742	アイネス	3,400	506.00	1,720,400	
9746	T K C	2,000	1,489.00	2,978,000	
9749	富士ソフト	3,300	1,202.00	3,966,600	
9759	N S D	4,700	628.00	2,951,600	
9766	コナミ	11,300	2,477.00	27,990,100	
9790	福井コンピュータ	500	340.00	170,000	
9889	J B C Cホールディングス	2,000	511.00	1,022,000	
9984	ソフトバンク	111,200	2,428.00	269,993,600	
1352	ハウスイ	2,000	89.00	178,000	
2657	インターニックス	1,000	355.00	355,000	
2676	高千穂交易	1,000	850.00	850,000	
2692	伊藤忠食品	600	2,705.00	1,623,000	
2715	エレマテック	2,000	1,297.00	2,594,000	
2729	J A L U X	700	734.00	513,800	
2737	トーメンデバイス	300	1,806.00	541,800	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	137,400.00	687,000	
2768	双日	164,300	134.00	22,016,200	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,400	2,926.00	18,726,400	
2874	横浜冷凍	5,700	579.00	3,300,300	
3004	神栄	3,000	137.00	411,000	
3022	山下医科器械	200	977.00	195,400	
3023	ラサ商事	1,100	333.00	366,300	
3036	アルコニックス	500	1,699.00	849,500	
3076	あい ホールディングス	4,200	333.00	1,398,600	
3107	ダイワボウホールディングス	24,000	179.00	4,296,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,600	635.00	2,921,000	
3156	U K Cホールディングス	1,400	734.00	1,027,600	

3167	T O K A Iホールディングス	12,000	399.00	4,788,000	
3321	ミタチ産業	500	395.00	197,500	
3332	J F E 商事ホールディングス	16,000	352.00	5,632,000	

[次へ](#)

3360	シップヘルスケアホールディングス	3,200	1,866.00	5,971,200	
5009	富士興産	10,000	68.00	680,000	
6973	協栄産業	3,000	133.00	399,000	
7414	小野建	2,100	641.00	1,346,100	
7420	佐鳥電機	1,800	480.00	864,000	
7427	エコートレーディング	600	698.00	418,800	
7433	伯東	1,400	706.00	988,400	
7438	コンドーテック	900	864.00	777,600	
7442	中山福	1,300	591.00	768,300	
7447	ナガイレーベン	3,200	1,065.00	3,408,000	
7451	三菱食品	2,400	1,771.00	4,250,400	
7456	松田産業	1,800	1,137.00	2,046,600	
7459	メディパルホールディングス	22,700	740.00	16,798,000	
7463	アドヴァン	1,500	711.00	1,066,500	
7466	S P K	500	1,259.00	629,500	
7476	アズワン	1,600	1,538.00	2,460,800	
7480	スズデン	800	511.00	408,800	
7482	シモジマ	1,700	963.00	1,637,100	
7483	ドウシシャ	1,200	1,942.00	2,330,400	
7504	高速	1,500	594.00	891,000	
7517	黒田電気	3,200	852.00	2,726,400	
7537	丸文	1,900	302.00	573,800	
7552	ハピネット	700	1,269.00	888,300	
7558	トーメンエレクトロニクス	1,000	926.00	926,000	
7591	エクセル	1,200	720.00	864,000	
7594	マルカキカイ	800	649.00	519,200	
7599	ガリバーインターナショナル	660	3,335.00	2,201,100	
7600	日本エム・ディ・エム	2,200	175.00	385,000	
7607	進和	1,400	859.00	1,202,600	
7608	エスケイジャパン	700	242.00	169,400	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	605.00	665,500	
7613	シークス	1,600	986.00	1,577,600	
7619	田中商事	800	409.00	327,200	
7628	オーハシテクニカ	1,400	536.00	750,400	
7631	マクニカ	1,100	1,477.00	1,624,700	
7637	白銅	800	767.00	613,600	
8001	伊藤忠商事	171,100	764.00	130,720,400	
8002	丸紅	215,000	433.00	93,095,000	
8007	高島	4,000	166.00	664,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,900	750.00	1,425,000	
8012	長瀬産業	13,900	903.00	12,551,700	
8014	蝶理	17,000	86.00	1,462,000	
8015	豊田通商	27,300	1,242.00	33,906,600	
8018	三共生興	4,200	259.00	1,087,800	
8020	兼松	55,000	66.00	3,630,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	77.00	385,000	
8031	三井物産	211,700	1,107.00	234,351,900	
8032	日本紙パルプ商事	14,000	266.00	3,724,000	

8036	日立ハイテクノロジーズ	7,500	1,676.00	12,570,000	
8037	カメイ	3,000	558.00	1,674,000	
8038	東都水産	4,000	128.00	512,000	
8043	スターゼン	8,000	231.00	1,848,000	
8051	山善	9,500	550.00	5,225,000	
8052	椿本興業	3,000	206.00	618,000	
8053	住友商事	135,000	954.00	128,790,000	
8057	内田洋行	6,000	213.00	1,278,000	
8058	三菱商事	191,400	1,526.00	292,076,400	
8059	第一実業	5,000	311.00	1,555,000	
8060	キャノンマーケティングジャパ ン	8,200	939.00	7,699,800	
8061	西華産業	9,000	206.00	1,854,000	
8065	佐藤商事	2,100	451.00	947,100	
8068	菱洋エレクトロ	3,000	719.00	2,157,000	
8070	東京産業	2,500	244.00	610,000	
8074	ユアサ商事	25,000	109.00	2,725,000	
8075	神鋼商事	6,000	184.00	1,104,000	
8078	阪和興業	23,000	326.00	7,498,000	
8081	カナデン	2,000	493.00	986,000	
8084	菱電商事	4,000	444.00	1,776,000	
8087	フルサト工業	1,500	548.00	822,000	
8088	岩谷産業	27,000	271.00	7,317,000	
8089	すてきナイスグループ	11,000	157.00	1,727,000	
8090	昭光通商	9,000	117.00	1,053,000	
8091	ニチモウ	4,000	137.00	548,000	
8093	極東貿易	3,000	197.00	591,000	
8095	イワキ	4,000	202.00	808,000	
8097	三愛石油	6,000	337.00	2,022,000	
8098	稲畑産業	6,500	424.00	2,756,000	
8101	G S Iクレオス	7,000	97.00	679,000	
8103	明和産業	2,000	220.00	440,000	
8129	東邦ホールディングス	7,500	988.00	7,410,000	
8130	サンゲツ	4,300	2,034.00	8,746,200	
8131	ミツウロコグループホールディ ングス	4,000	460.00	1,840,000	
8132	シナネン	5,000	342.00	1,710,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,400	415.00	2,241,000	
8136	サンリオ	6,900	3,755.00	25,909,500	
8137	サンワテクノス	1,200	644.00	772,800	
8140	リョーサン	4,000	1,599.00	6,396,000	
8141	新光商事	2,300	607.00	1,396,100	
8142	トーヨー	5,000	306.00	1,530,000	
8150	三信電気	3,000	651.00	1,953,000	
8151	東陽テクニカ	3,500	819.00	2,866,500	
8153	モスフードサービス	3,200	1,500.00	4,800,000	
8154	加賀電子	2,400	785.00	1,884,000	
8158	ソーダニッカ	3,000	334.00	1,002,000	
8159	立花エレクトック	1,400	609.00	852,600	

8283	P a l t a c	2,000	1,392.00	2,784,000	
8835	太平洋興発	9,000	66.00	594,000	
9305	ヤマタネ	13,000	118.00	1,534,000	
9763	丸紅建材リース	3,000	140.00	420,000	
9810	日鐵商事	5,000	213.00	1,065,000	
9830	トラスコ中山	3,100	1,426.00	4,420,600	
9832	オートバックスセブン	2,900	3,620.00	10,498,000	
9869	加藤産業	3,500	1,549.00	5,421,500	
9880	イノテック	1,500	527.00	790,500	
9882	イエローハット	2,300	1,001.00	2,302,300	
9883	富士エレクトロニクス	1,400	1,030.00	1,442,000	
9896	J Kホールディングス	2,300	350.00	805,000	
9902	日伝	1,000	2,585.00	2,585,000	
9930	北沢産業	2,000	152.00	304,000	
9932	杉本商事	1,300	722.00	938,600	
9934	因幡電機産業	2,900	2,240.00	6,496,000	
9938	住金物産	11,000	164.00	1,804,000	
9962	ミスミグループ本社	8,400	1,645.00	13,818,000	
9963	江守商事	400	834.00	333,600	
9972	アルテック	1,300	178.00	231,400	
9982	タキヒヨー	4,000	422.00	1,688,000	
9987	スズケン	10,100	1,876.00	18,947,600	
9991	ジェコス	1,700	304.00	516,800	
2651	ローソン	8,500	4,445.00	37,782,500	
2659	サンエー	800	2,995.00	2,396,000	
2660	キリン堂	1,100	479.00	526,900	
2662	ダイユーエイト	400	656.00	262,400	
2664	カワチ薬品	1,700	1,425.00	2,422,500	
2670	エービーシー・マート	2,900	3,045.00	8,830,500	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	421.00	505,200	
2678	アスクル	1,900	1,101.00	2,091,900	
2681	ゲオ	40	77,000.00	3,080,000	
2685	ポイント	2,070	3,300.00	6,831,000	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	97.00	194,000	
2695	くらコーポレーション	1,300	1,000.00	1,300,000	
2698	キャンドゥ	14	83,800.00	1,173,200	
2726	パル	700	2,915.00	2,040,500	
2730	エディオン	9,000	606.00	5,454,000	
2734	サーラコーポレーション	2,000	465.00	930,000	
2738	バルス	12	98,700.00	1,184,400	
2753	あみやき亭	4	185,100.00	740,400	
2764	ひらまつ	11	53,100.00	584,100	
2772	ゲンキー	200	1,673.00	334,600	
2792	ハニーズ	2,180	1,144.00	2,493,920	
3028	アルペン	1,600	1,360.00	2,176,000	
3048	ビックカメラ	93	40,200.00	3,738,600	
3050	D C Mホールディングス	11,600	615.00	7,134,000	
3064	M o n o t a R O	1,400	773.00	1,082,200	
3086	J . フロント リテイリング	58,000	343.00	19,894,000	

3087	ドトール・日レスホールディングス	4,300	945.00	4,063,500	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,500	1,478.00	6,651,000	
3097	物語コーポレーション	300	1,283.00	384,900	
3098	ココカラファイン	2,400	1,939.00	4,653,600	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	48,700	786.00	38,278,200	
3148	クリエイイトSDホールディングス	1,000	1,660.00	1,660,000	
3159	丸善CHIホールディングス	1,500	208.00	312,000	
3313	ブックオフコーポレーション	1,500	636.00	954,000	
3333	あさひ	1,000	1,650.00	1,650,000	
3337	サークルKサンクス	5,300	1,282.00	6,794,600	
3341	日本調剤	310	2,798.00	867,380	
3349	コスモス薬品	1,200	3,620.00	4,344,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	102,600	2,085.00	213,921,000	
3391	ツルハホールディングス	2,200	3,965.00	8,723,000	
3395	サンマルクホールディングス	800	2,904.00	2,323,200	
3396	フェリシモ	700	1,044.00	730,800	
3397	トリドール	1,900	756.00	1,436,400	
3398	クスリのアオキ	400	1,221.00	488,400	
4350	メディカルシステムネットワーク	400	839.00	335,600	
4775	総合メディカル	500	2,669.00	1,334,500	
7416	はるやま商事	1,200	359.00	430,800	
7421	カップ・クリエイト	1,800	1,661.00	2,989,800	
7445	ライトオン	1,900	531.00	1,008,900	
7448	ジーンズメイト	1,100	187.00	205,700	
7453	良品計画	2,800	3,720.00	10,416,000	
7455	三城ホールディングス	3,100	622.00	1,928,200	
7494	コナカ	3,000	284.00	852,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,212.00	363,600	
7508	G-7ホールディングス	600	375.00	225,000	
7512	イオン北海道	1,800	331.00	595,800	
7513	コジマ	3,000	512.00	1,536,000	
7516	コーナン商事	2,500	1,325.00	3,312,500	
7520	エコス	900	455.00	409,500	
7522	ワタミ	2,900	1,801.00	5,222,900	
7524	マルシェ	700	691.00	483,700	
7532	ドン・キホーテ	4,800	2,863.00	13,742,400	
7541	メガネトップ	3,900	854.00	3,330,600	
7545	西松屋チェーン	5,400	585.00	3,159,000	
7550	ゼンショーホールディングス	9,300	972.00	9,039,600	
7554	幸楽苑	1,500	1,131.00	1,696,500	
7561	ハークスレイ	600	498.00	298,800	
7581	サイゼリヤ	3,600	1,265.00	4,554,000	
7601	ポプラ	900	438.00	394,200	
7606	ユナイテッドアローズ	2,300	1,499.00	3,447,700	
7611	ハイデイ日高	1,000	1,196.00	1,196,000	

7615	京都きもの友禅	1,600	905.00	1,448,000	
7616	コロワイド	8,000	496.00	3,968,000	
7630	吉番屋	1,000	2,333.00	2,333,000	
7640	トップカルチャー	900	380.00	342,000	
7649	スギホールディングス	3,900	2,073.00	8,084,700	
8005	スクロール	3,400	277.00	941,800	
8028	ファミリーマート	8,300	3,075.00	25,522,500	
8160	木曽路	2,800	1,402.00	3,925,600	
8165	千趣会	4,400	526.00	2,314,400	
8166	タカキュー	2,000	136.00	272,000	
8168	ケーヨー	4,600	465.00	2,139,000	
8173	上新電機	5,000	803.00	4,015,000	
8174	日本瓦斯	2,400	1,220.00	2,928,000	
8175	ベスト電器	8,000	215.00	1,720,000	
8178	マルエツ	5,000	272.00	1,360,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,100	866.00	3,550,600	
8181	東天紅	2,000	116.00	232,000	
8182	いなげや	2,800	876.00	2,452,800	
8184	島忠	5,500	1,714.00	9,427,000	
8185	チヨダ	3,200	1,332.00	4,262,400	
8194	ライフコーポレーション	1,600	1,362.00	2,179,200	
8196	カスミ	5,000	512.00	2,560,000	
8200	リンガーハット	1,900	1,037.00	1,970,300	
8201	さが美	2,000	77.00	154,000	
8203	MrMax	2,500	299.00	747,500	
8207	テンアライド	1,800	263.00	473,400	
8214	AOKIホールディングス	2,300	1,041.00	2,394,300	
8217	オークワ	4,000	1,100.00	4,400,000	
8218	コメリ	3,400	2,397.00	8,149,800	
8219	青山商事	6,300	1,232.00	7,761,600	
8227	しまむら	2,600	7,810.00	20,306,000	
8229	CFSコーポレーション	2,500	348.00	870,000	
8233	高島屋	33,000	560.00	18,480,000	
8237	松屋	4,600	454.00	2,088,400	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	14,000	573.00	8,022,000	
8245	丸栄	5,000	82.00	410,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,900	485.00	2,376,500	
8251	バルコ	6,400	622.00	3,980,800	
8252	丸井グループ	32,200	603.00	19,416,600	
8255	原信ナルスホールディングス	1,500	1,214.00	1,821,000	
8263	ダイエー	11,650	296.00	3,448,400	
8266	イズミヤ	9,000	348.00	3,132,000	
8267	イオン	86,500	1,029.00	89,008,500	
8270	ユニー	20,000	702.00	14,040,000	
8273	イズミ	5,900	1,192.00	7,032,800	
8274	東武ストア	3,000	260.00	780,000	
8276	平和堂	5,000	952.00	4,760,000	
8278	フジ	2,700	1,710.00	4,617,000	

8279	ヤオコー	1,100	2,546.00	2,800,600	
8281	ゼビオ	3,000	1,907.00	5,721,000	
8282	ケースホールディングス	5,700	3,165.00	18,040,500	
8289	O l y m p i c	1,700	678.00	1,152,600	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	105.00	420,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	3,270.00	4,251,000	
9828	元気寿司	800	956.00	764,800	
9831	ヤマダ電機	11,180	5,480.00	61,266,400	
9842	アークランドサカモト	1,500	1,410.00	2,115,000	
9843	ニトリホールディングス	4,850	7,490.00	36,326,500	
9854	愛眼	2,100	370.00	777,000	
9861	吉野家ホールディングス	66	98,700.00	6,514,200	
9887	松屋フーズ	1,200	1,480.00	1,776,000	
9900	サガミチェーン	3,000	491.00	1,473,000	
9945	ブレナス	3,100	1,213.00	3,760,300	
9946	ミニストップ	1,800	1,412.00	2,541,600	
9948	アークス	3,682	1,406.00	5,176,892	
9956	パロー	4,900	1,171.00	5,737,900	
9974	ベルク	1,200	1,134.00	1,360,800	
9979	大庄	1,200	918.00	1,101,600	
9983	ファーストリテイリング	5,700	13,890.00	79,173,000	
9989	サンドラッグ	4,700	2,340.00	10,998,000	
9993	ヤマザワ	600	1,357.00	814,200	
9994	やまや	400	767.00	306,800	
9997	ベルーナ	3,100	613.00	1,900,300	
8303	新生銀行	170,000	84.00	14,280,000	
8304	あおぞら銀行	89,000	189.00	16,821,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,857,000	331.00	614,667,000	
8308	りそなホールディングス	151,400	333.00	50,416,200	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	464,000	249.00	115,536,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	187,000	2,126.00	397,562,000	
8324	第四銀行	32,000	248.00	7,936,000	
8325	北越銀行	28,000	150.00	4,200,000	
8327	西日本シティ銀行	86,000	217.00	18,662,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	37,000	249.00	9,213,000	
8331	千葉銀行	97,000	492.00	47,724,000	
8332	横浜銀行	168,000	360.00	60,480,000	
8333	常陽銀行	95,000	329.00	31,255,000	
8334	群馬銀行	56,000	407.00	22,792,000	
8336	武蔵野銀行	4,000	2,504.00	10,016,000	
8337	千葉興業銀行	4,700	432.00	2,030,400	
8338	筑波銀行	10,900	257.00	2,801,300	
8339	東京都民銀行	4,700	936.00	4,399,200	
8341	七十七銀行	42,000	306.00	12,852,000	
8342	青森銀行	20,000	226.00	4,520,000	
8343	秋田銀行	17,000	221.00	3,757,000	
8344	山形銀行	15,000	370.00	5,550,000	

8345	岩手銀行	1,700	3,450.00	5,865,000	
8346	東邦銀行	21,000	203.00	4,263,000	
8349	東北銀行	14,000	124.00	1,736,000	
8350	みちのく銀行	12,000	151.00	1,812,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	302.00	29,898,000	
8355	静岡銀行	74,000	769.00	56,906,000	
8356	十六銀行	31,000	233.00	7,223,000	
8358	スルガ銀行	26,000	658.00	17,108,000	
8359	八十二銀行	45,000	435.00	19,575,000	
8360	山梨中央銀行	15,000	317.00	4,755,000	
8361	大垣共立銀行	33,000	246.00	8,118,000	
8362	福井銀行	21,000	219.00	4,599,000	
8363	北國銀行	27,000	267.00	7,209,000	
8364	清水銀行	900	3,080.00	2,772,000	
8366	滋賀銀行	23,000	495.00	11,385,000	
8367	南都銀行	23,000	421.00	9,683,000	
8368	百五銀行	22,000	301.00	6,622,000	
8369	京都銀行	44,000	653.00	28,732,000	
8374	三重銀行	11,000	181.00	1,991,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	172,000	151.00	25,972,000	
8379	広島銀行	72,000	352.00	25,344,000	
8381	山陰合同銀行	15,000	558.00	8,370,000	
8382	中国銀行	20,000	1,041.00	20,820,000	
8383	鳥取銀行	8,000	160.00	1,280,000	
8385	伊予銀行	26,000	724.00	18,824,000	
8386	百十四銀行	29,000	315.00	9,135,000	
8387	四国銀行	18,000	272.00	4,896,000	
8388	阿波銀行	20,000	515.00	10,300,000	
8390	鹿児島銀行	16,000	514.00	8,224,000	
8392	大分銀行	16,000	220.00	3,520,000	
8393	宮崎銀行	16,000	169.00	2,704,000	
8394	肥後銀行	19,000	427.00	8,113,000	
8395	佐賀銀行	15,000	188.00	2,820,000	
8396	十八銀行	16,000	201.00	3,216,000	
8397	沖縄銀行	1,900	3,175.00	6,032,500	
8399	琉球銀行	5,100	969.00	4,941,900	
8409	八千代銀行	1,300	1,947.00	2,531,100	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,292,000	108.00	355,536,000	
8415	紀陽ホールディングス	97,000	111.00	10,767,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	25,000	711.00	17,775,000	
8521	長野銀行	9,000	161.00	1,449,000	
8522	名古屋銀行	22,000	247.00	5,434,000	
8527	愛知銀行	800	4,270.00	3,416,000	
8529	第三銀行	15,000	165.00	2,475,000	
8530	中京銀行	10,000	191.00	1,910,000	
8536	東日本銀行	13,000	159.00	2,067,000	
8537	大光銀行	9,000	216.00	1,944,000	

8541	愛媛銀行	15,000	227.00	3,405,000	
8542	トマト銀行	9,000	138.00	1,242,000	
8543	みなと銀行	25,000	136.00	3,400,000	
8544	京葉銀行	20,000	383.00	7,660,000	

[次へ](#)

8545	関西アーバン銀行	34,000	139.00	4,726,000	
8550	栃木銀行	12,000	271.00	3,252,000	
8551	北日本銀行	800	1,757.00	1,405,600	
8558	東和銀行	26,000	93.00	2,418,000	
8562	福島銀行	31,000	38.00	1,178,000	
8563	大東銀行	17,000	56.00	952,000	
8600	トモニホールディングス	18,900	313.00	5,915,700	
8713	フィデアホールディングス	14,100	205.00	2,890,500	
8714	池田泉州ホールディングス	91,700	111.00	10,178,700	
8473	S B Iホールディングス	2,998	6,570.00	19,696,860	
8595	ジャフコ	3,500	1,566.00	5,481,000	
8601	大和証券グループ本社	243,000	274.00	66,582,000	
8604	野村ホールディングス	516,700	287.00	148,292,900	
8609	岡三証券グループ	21,000	252.00	5,292,000	
8613	丸三証券	7,800	291.00	2,269,800	
8614	東洋証券	9,000	115.00	1,035,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,000	217.00	6,076,000	
8617	光世証券	6,000	59.00	354,000	
8622	水戸証券	7,000	98.00	686,000	
8624	いちよし証券	5,600	449.00	2,514,400	
8628	松井証券	14,600	355.00	5,183,000	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	242.00	338,800	
8698	マネックスグループ	147	11,230.00	1,650,810	
8703	カブドットコム証券	10,000	215.00	2,150,000	
8706	極東証券	3,200	510.00	1,632,000	
8707	岩井コスモホールディングス	2,400	266.00	638,400	
8742	小林洋行	1,000	175.00	175,000	
8630	N K S Jホールディングス	51,300	1,559.00	79,976,700	
8725	M S & A D インシュアランスグループホール	73,300	1,507.00	110,463,100	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	23,500	1,239.00	29,116,500	
8750	第一生命保険	1,313	85,400.00	112,130,200	
8766	東京海上ホールディングス	93,100	1,810.00	168,511,000	
8795	T & Dホールディングス	89,500	757.00	67,751,500	
8253	クレディセゾン	18,700	1,500.00	28,050,000	
8424	芙蓉総合リース	2,400	2,743.00	6,583,200	
8425	興銀リース	3,500	1,709.00	5,981,500	
8439	東京センチュリーリース	5,800	1,555.00	9,019,000	
8511	日本証券金融	10,500	371.00	3,895,500	
8512	大阪証券金融	4,200	142.00	596,400	
8519	ポケットカード	2,900	275.00	797,500	
8566	リコーリース	1,800	1,695.00	3,051,000	
8570	イオンクレジットサービス	11,100	1,193.00	13,242,300	
8572	アコム	5,020	1,360.00	6,827,200	
8574	プロミス	12,650	776.00	9,816,400	
8584	ジャックス	17,000	257.00	4,369,000	
8585	オリエントコーポレーション	35,000	73.00	2,555,000	

8586	日立キャピタル	6,000	923.00	5,538,000	
8591	オリックス	12,780	6,920.00	88,437,600	
8593	三菱UFJリース	6,280	3,045.00	19,122,600	
8772	アサックス	4	99,000.00	396,000	
8793	NECキャピタルソリューション	800	1,086.00	868,800	
2353	日本駐車場開発	270	3,515.00	949,050	
3003	昭栄	4,500	570.00	2,565,000	
3225	東京建物不動産販売	1,000	227.00	227,000	
3231	野村不動産ホールディングス	10,300	1,299.00	13,379,700	
3258	常和ホールディングス	400	1,218.00	487,200	
3265	ヒューリック	7,900	894.00	7,062,600	
4666	パーク24	12,600	944.00	11,894,400	
8801	三井不動産	116,000	1,283.00	148,828,000	
8802	三菱地所	172,000	1,329.00	228,588,000	
8803	平和不動産	22,500	168.00	3,780,000	
8804	東京建物	47,000	247.00	11,609,000	
8806	ダイビル	7,200	532.00	3,830,400	
8809	サンケイビル	4,800	327.00	1,569,600	
8815	東急不動産	49,000	326.00	15,974,000	
8818	京阪神ビルディング	2,900	365.00	1,058,500	
8830	住友不動産	59,000	1,581.00	93,279,000	
8833	東宝不動産	2,600	407.00	1,058,200	
8840	大京	41,000	131.00	5,371,000	
8841	テーオーシー	9,500	363.00	3,448,500	
8842	東京楽天地	4,000	270.00	1,080,000	
8848	レオパレス21	15,000	203.00	3,045,000	
8860	フジ住宅	2,500	371.00	927,500	
8864	空港施設	2,600	298.00	774,800	
8869	明和地所	1,500	370.00	555,000	
8870	住友不動産販売	880	3,310.00	2,912,800	
8871	ゴールドクレスト	2,230	1,494.00	3,331,620	
8875	東栄住宅	1,900	773.00	1,468,700	
8877	日本エスリード	1,100	631.00	694,100	
8879	東急リパブル	2,600	718.00	1,866,800	
8880	飯田産業	2,800	660.00	1,848,000	
8881	日神不動産	1,500	440.00	660,000	
8895	アーネストワン	4,600	787.00	3,620,200	
8897	タカラレーベン	2,400	420.00	1,008,000	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	73,900.00	739,000	
8905	イオンモール	11,200	1,801.00	20,171,200	
8907	フージャースコーポレーション	39	27,860.00	1,086,540	
8915	タクトホーム	12	65,900.00	790,800	
8918	ランド	4,100	26.00	106,600	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	178	54,800.00	9,754,400	
8934	サンフロンティア不動産	26	8,230.00	213,980	
8944	ランドビジネス	18	15,600.00	280,800	
9706	日本空港ビルデング	7,800	1,045.00	8,151,000	
1954	日本工営	9,000	280.00	2,520,000	

2120	ネクスト	900	351.00	315,900	
2127	日本M&Aセンター	6	439,000.00	2,634,000	
2128	ノバレーゼ	5	50,400.00	252,000	
2131	アコーディア・ゴルフ	73	56,600.00	4,131,800	
2168	パソナグループ	26	77,000.00	2,002,000	
2170	リンクアンドモチベーション	6	53,400.00	320,400	
2181	テンプホールディングス	3,600	684.00	2,462,400	
2301	学情	1,000	269.00	269,000	
2305	スタジオアリス	1,200	1,393.00	1,671,600	
2309	シミック	900	1,277.00	1,149,300	
2322	NECフィールドディング	2,100	915.00	1,921,500	
2331	総合警備保障	9,500	825.00	7,837,500	
2371	カカクコム	3,600	3,120.00	11,232,000	
2378	ルネサンス	1,200	360.00	432,000	
2395	新日本科学	1,800	218.00	392,400	
2413	エムスリー	20	376,000.00	7,520,000	
2418	ベストプライダル	6	75,700.00	454,200	
2432	ディー・エヌ・エー	10,100	3,215.00	32,471,500	
2433	博報堂DYホールディングス	3,610	4,185.00	15,107,850	
2440	ぐるなび	1,800	973.00	1,751,400	
2450	一休	19	35,200.00	668,800	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	70,900.00	283,600	
2462	ジェイコムホールディングス	500	797.00	398,500	
2466	PGMホールディングス	63	39,850.00	2,510,550	
4282	イーピーエス	14	160,900.00	2,252,600	
4301	アミューズ	700	996.00	697,200	
4310	ドリームインキュベータ	8	61,500.00	492,000	
4319	TAC	1,400	175.00	245,000	
4321	ケネディクス	288	11,240.00	3,237,120	
4324	電通	23,600	2,368.00	55,884,800	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	134	4,725.00	633,150	
4337	ぴあ	800	783.00	626,400	
4343	イオンファンタジー	900	1,037.00	933,300	
4544	みらかホールディングス	6,300	3,060.00	19,278,000	
4641	アルプス技研	1,200	654.00	784,800	
4651	サニックス	4,000	253.00	1,012,000	
4653	ダイオーズ	500	475.00	237,500	
4658	日本空調サービス	600	681.00	408,600	
4661	オリエンタルランド	7,000	7,690.00	53,830,000	
4665	ダスキン	7,300	1,503.00	10,971,900	
4668	明光ネットワークジャパン	2,300	654.00	1,504,200	
4671	ファルコSDホールディングス	1,300	723.00	939,900	
4678	秀英予備校	500	309.00	154,500	
4679	田谷	400	643.00	257,200	
4680	ラウンドワン	6,700	563.00	3,772,100	
4681	リゾートトラスト	4,000	1,163.00	4,652,000	
4694	ビー・エム・エル	1,500	1,917.00	2,875,500	
4696	ワタベウエディング	800	622.00	497,600	

4708	もしもしホットライン	3,200	725.00	2,320,000	
4711	東急コミュニティー	700	2,493.00	1,745,100	
4714	リソー教育	261	4,305.00	1,123,605	
4724	ウェアハウス	800	214.00	171,200	
4732	ユー・エス・エス	3,380	6,410.00	21,665,800	
4745	東京個別指導学院	1,900	123.00	233,700	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	443.00	354,400	
4801	セントラルスポーツ	800	938.00	750,400	
5261	リゾートソリューション	2,000	141.00	282,000	
9603	エイチ・アイ・エス	2,600	2,055.00	5,343,000	
9616	共立メンテナンス	1,200	1,280.00	1,536,000	
9619	イチネンホールディングス	2,700	380.00	1,026,000	
9621	建設技術研究所	1,500	550.00	825,000	
9628	燦ホールディングス	500	1,253.00	626,500	
9632	スバル興業	2,000	227.00	454,000	
9633	東京テアトル	11,000	113.00	1,243,000	
9667	ホリプロ	800	674.00	539,200	
9671	よみうりランド	6,000	254.00	1,524,000	
9672	東京都競馬	20,000	106.00	2,120,000	
9675	常磐興産	8,000	77.00	616,000	
9678	カナモト	3,000	533.00	1,599,000	
9681	東京ドーム	19,000	172.00	3,268,000	
9715	トランス・コスモス	3,400	895.00	3,043,000	
9716	乃村工藝社	5,000	230.00	1,150,000	
9722	藤田観光	7,000	258.00	1,806,000	
9726	近畿日本ツーリスト	9,000	85.00	765,000	
9728	日本管財	900	1,425.00	1,282,500	
9729	トーカイ	1,200	1,721.00	2,065,200	
9731	白洋舎	3,000	213.00	639,000	
9735	セコム	27,000	3,640.00	98,280,000	
9740	セントラル警備保障	1,200	776.00	931,200	
9743	丹青社	3,000	227.00	681,000	
9744	メイテック	3,800	1,460.00	5,548,000	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,600	1,858.00	8,546,800	
9755	応用地質	2,800	756.00	2,116,800	
9757	船井総合研究所	2,700	525.00	1,417,500	
9760	進学会	1,400	271.00	379,400	
9783	ベネッセホールディングス	8,000	3,390.00	27,120,000	
9787	イオンディライト	2,900	1,602.00	4,645,800	
9788	ナック	600	1,447.00	868,200	
9792	ニチイ学館	4,500	800.00	3,600,000	
9793	ダイセキ	3,800	1,440.00	5,472,000	
	合計	37,697,495		25,002,989,937	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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22年10月26日現在	平成23年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		1,151,205,573	56,660,481
コール・ローン		302,487,637	168,254,680
株式		67,507,160,823	59,798,526,901
投資証券		1,132,774,504	1,084,330,074
派生商品評価勘定		32,312,950	40,122,151
未収入金		6,420,863	600,899
未収配当金		56,114,448	60,563,021
未収利息		717	313
差入委託証拠金		459,629,159	244,496,151
流動資産合計		70,648,106,674	61,453,554,671
資産合計		70,648,106,674	61,453,554,671
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,639,953	629,031
未払金		2,355,711	214,611
未払解約金		161,136,873	85,692,961
流動負債合計		169,132,537	86,536,603
負債合計		169,132,537	86,536,603
純資産の部			
元本等			
元本		83,174,708,677	76,714,471,608
剰余金			
剰余金又は欠損金()		12,695,734,540	15,347,453,540
元本等合計		70,478,974,137	61,367,018,068
純資産合計		70,478,974,137	61,367,018,068
負債純資産合計		70,648,106,674	61,453,554,671

(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21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23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）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られ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られ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 同左</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 「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22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1. 期首	平成21年10月27日	1. 期首	平成22年10月27日
期首元本額	81,113,705,231円	期首元本額	83,174,708,677円
期首からの追加設定元本額	10,617,791,534円	期首からの追加設定元本額	8,821,496,739円
期首からの一部解約元本額	8,556,788,088円	期首からの一部解約元本額	15,281,733,808円
平成22年10月26日現在の元本の内訳		平成23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)	11,060,121,732円	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	13,020,522,405円
DCインデックスバランス(株式20)	42,762,889円	DCインデックスバランス(株式20)	52,196,228円
DCインデックスバランス(株式40)	157,619,037円	DCインデックスバランス(株式40)	180,368,648円
DCインデックスバランス(株式60)	306,043,383円	DCインデックスバランス(株式60)	343,215,260円
DCインデックスバランス(株式80)	326,203,319円	DCインデックスバランス(株式80)	372,128,636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	17,717,955,512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	13,165,638,067円
日興五大陸株式ファンド	24,118,120,284円	日興五大陸株式ファンド	21,218,914,066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	88,481,960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	88,370,502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)	202,197,283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)	110,905,796円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	25,396,885円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	24,035,758円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	22,762,971円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	21,998,238円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	38,818,023円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	35,365,046円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	49,240,747円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	45,817,851円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	20,467,941,165円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	19,220,442,153円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	112,146,456円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	65,065,502円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	26,468,943円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	24,949,275円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	45,396,324円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,872,631円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	118,980,185円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	136,092,266円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	159,499,292円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	176,692,155円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	154,166,467円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	171,518,965円
年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	7,934,385,820円	年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	8,188,362,160円
計	83,174,708,677円	計	76,714,471,608円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	83,174,708,677口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	76,714,471,608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12,695,734,540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15,347,453,540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

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,946,342,631
投資証券	165,947,165
合計	5,112,289,796

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,777,614,578
投資証券	12,726,172
合計	1,790,340,750

(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)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,690,354,555		1,719,808,469	29,453,914
	合計	1,690,354,555		1,719,808,469	29,453,914

(平成23年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	419,633,379		459,514,145	39,880,766
	合計	419,633,379		459,514,145	39,880,766

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	887,671,925		884,307,100	3,364,825
	米ドル	745,117,205		740,744,340	4,372,865
	ユーロ	142,554,720		143,562,760	1,008,040
	売建	696,703,710		696,119,800	583,910
	米ドル	646,000,000		645,680,000	320,000
	香港ドル	35,553,800		35,360,000	193,800
	スウェーデンクローナ	15,149,910		15,079,800	70,110
	合計	1,584,375,635		1,580,426,900	2,780,915

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建	138,110,896		137,723,250	387,646
	米ドル	126,187,581		125,558,550	629,031
	ユーロ	11,923,315		12,164,700	241,385
	合計	138,110,896		137,723,250	387,646

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成22年10月26日現在	平成23年10月26日現在
1口当たり純資産額	0.8474円	1口当たり純資産額 0.7999円
（1万口当たり純資産額）	（8,474円）	（1万口当たり純資産額）（7,999円）

(3) 附属明細表
第1 有価証券明細表
(1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,280	22.26	184,312.80	
ANADARKO PETROLEUM CORP	19,288	77.55	1,495,784.40	
APACHE CORP	14,869	94.53	1,405,566.57	
ARCH COAL INC	7,385	16.50	121,852.50	
BAKER HUGHES INC	16,730	55.41	927,009.30	
CABOT OIL & GAS CORP	4,570	66.12	302,168.40	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,281	50.86	472,031.66	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	25,475	27.31	695,722.25	
CHEVRON CORP	77,836	104.50	8,133,862.00	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	61.21	205,359.55	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	88.93	324,149.85	
CONOCOPHILLIPS	51,995	70.68	3,675,006.60	
CONSOL ENERGY INC	8,638	40.76	352,084.88	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	58.51	95,371.30	
DENBURY RESOURCES INC	15,145	15.33	232,172.85	
DEVON ENERGY CORPORATION	15,641	61.60	963,485.60	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	64.15	165,827.75	
EL PASO CORP	29,960	25.55	765,478.00	
ENERGEN CORP	2,310	49.17	113,582.70	
EOG RESOURCES INC	10,451	87.52	914,671.52	
EQT CORP	5,345	66.02	352,876.90	
EXXON MOBIL CORP	190,736	79.44	15,152,067.84	
FMC TECHNOLOGIES INC	9,065	44.97	407,653.05	
HALLIBURTON CO	35,477	35.12	1,245,952.24	
HELMERICH & PAYNE	4,470	49.07	219,342.90	
HESS CORP	11,830	58.78	695,367.40	
HOLLYFRONTIER CORP	7,800	28.61	223,158.00	
KINDER MORGAN INC	4,900	30.11	147,539.00	
MARATHON OIL CORP	27,472	25.74	707,129.28	
MARATHON PETROLEUM CORP	14,081	32.97	464,250.57	
MURPHY OIL CORP	6,965	54.48	379,453.20	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	15.80	169,707.80	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	16,406	67.99	1,115,443.94	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	37.19	184,090.50	
NOBLE CORP	9,482	34.94	331,301.08	
NOBLE ENERGY INC	6,736	87.25	587,716.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	31,516	85.14	2,683,272.24	
PEABODY ENERGY CORP	10,365	39.66	411,075.90	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,615	82.82	382,214.30	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	6,500	29.25	190,125.00	
QEP RESOURCES INC	7,365	31.40	231,261.00	
RANGE RESOURCES CORP	6,505	70.37	457,756.85	
ROWAN COMPANIES INC	5,425	34.31	186,131.75	
SCHLUMBERGER LTD	52,539	68.03	3,574,228.17	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	13,265	40.18	532,987.70	
SPECTRA ENERGY CORP	25,424	28.15	715,685.60	
SUNOCO INC	5,563	35.81	199,211.03	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	31.14	172,017.36	
VALERO ENERGY CORP	21,922	21.84	478,776.48	

WEATHERFORD INTL LTD	28,429	14.67	417,053.43
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	44.89	192,353.65
WILLIAMS COS INC	22,669	29.57	670,322.33
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,350	82.45	688,457.50
AIRGAS INC	3,745	67.98	254,585.10
ALCOA INC	39,339	10.14	398,897.46
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	40.26	161,442.60
BALL CORP	7,273	34.41	250,263.93
CELANESE CORP-SERIES A	6,785	41.34	280,491.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,695	157.90	425,540.50
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	60.42	323,247.00
CROWN HOLDINGS INC	6,890	32.61	224,682.90
DOW CHEMICAL	45,583	26.49	1,207,493.67
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	36,008	44.94	1,618,199.52
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,090	36.96	225,086.40
ECOLAB INC	8,685	52.66	457,352.10
FMC CORP	3,085	75.92	234,213.20
FREEMONT-MCMORAN COPPER	36,728	38.21	1,403,376.88
INTERNATIONAL PAPER CO	15,520	26.28	407,865.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,764	59.38	223,506.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	30.73	321,128.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,070	70.78	146,514.60
MEADWESTVACO CORP	7,454	27.79	207,146.66
MONSANTO CO	20,781	72.96	1,516,181.76
MOSAIC CO/THE	11,800	57.84	682,512.00
NEWMONT MINING CORP	19,140	64.84	1,241,037.60
NUCOR CORP	12,224	36.56	446,909.44
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	19.15	123,996.25
PPG INDUSTRIES INC	5,937	82.53	489,980.61
PRAXAIR INC	11,790	101.65	1,198,453.50
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	55.95	139,875.00
SEALED AIR CORP	4,356	17.61	76,709.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,327	83.15	276,640.05
SIGMA-ALDRICH	4,395	66.41	291,871.95
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	22.40	117,308.80
VULCAN MATERIALS CO	4,443	30.83	136,977.69
WALTER ENERGY INC	2,240	74.42	166,700.80
3M CO	26,176	77.04	2,016,599.04
AGCO CORP	4,355	40.96	178,380.80
AMETEK INC	7,042	38.83	273,440.86
BOEING CO	27,192	63.72	1,732,674.24
CATERPILLAR INC	24,996	89.89	2,246,890.44
COOPER INDUSTRIES PLC	6,093	52.40	319,273.20
CUMMINS INC	7,215	93.81	676,839.15
DANAHER CORP	21,884	47.42	1,037,739.28
DEERE & CO	16,275	73.12	1,190,028.00
DOVER CORP	7,065	54.66	386,172.90
EATON CORP	12,221	43.14	527,213.94
EMERSON ELECTRIC CO	29,145	46.52	1,355,825.40
FASTENAL CO	10,363	35.88	371,824.44
FLOWSERVE CORP	2,455	86.76	212,995.80
FLUOR CORP	6,508	55.79	363,081.32
FOSTER WHEELER AG	5,590	20.97	117,222.30
GENERAL DYNAMICS CORP	12,242	65.26	798,912.92

GENERAL ELECTRIC CO.	410,638	16.22	6,660,548.36	
----------------------	---------	-------	--------------	--

[次へ](#)

GOODRICH CORP	4,615	122.06	563,306.90
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,991	50.71	1,470,133.61
ILLINOIS TOOL WORKS	17,365	45.65	792,712.25
INGERSOLL-RAND PLC	12,586	29.62	372,797.32
ITT CORP	6,518	44.02	286,922.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	38.01	198,412.20
JOY GLOBAL INC	3,935	85.32	335,734.20
KBR INC	6,600	28.60	188,760.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,156	68.81	285,974.36
LOCKHEED MARTIN CORP	11,436	78.89	902,186.04
MASCO CORP	16,804	9.50	159,638.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,579	56.57	598,454.03
PACCAR INC	12,589	41.50	522,443.50
PALL CORP	5,116	50.64	259,074.24
PARKER HANNIFIN CORP	6,120	77.55	474,606.00
PENTAIR INC	3,864	36.64	141,576.96
PRECISION CASTPARTS CORP	5,510	171.26	943,642.60
QUANTA SERVICES INC	8,315	20.30	168,794.50
RAYTHEON COMPANY	13,612	43.86	597,022.32
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,398	64.60	348,710.80
ROCKWELL COLLINS INC.	5,725	54.63	312,756.75
ROPER INDUSTRIES INC	3,990	78.50	313,215.00
SPX CORP	2,362	52.73	124,548.26
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,081	60.98	370,819.38
TEXTRON INC	10,336	18.77	194,006.72
TYCO INTERNATIONAL LTD	18,030	45.13	813,693.90
UNITED TECHNOLOGIES CORP	33,715	75.28	2,538,065.20
URS CORP	3,890	34.50	134,205.00
WW GRAINGER INC	2,157	168.25	362,915.25
AVERY DENNISON CORP	4,680	26.27	122,943.60
CINTAS CORP	5,942	29.55	175,586.10
DUN & BRADSTREET CORP	2,367	63.41	150,091.47
EQUIFAX INC	5,914	33.21	196,403.94
IHS INC-CLASS A	1,970	81.18	159,924.60
IRON MOUNTAIN INC	7,807	32.41	253,024.87
MANPOWERGROUP	3,767	41.35	155,765.45
NIelsen HOLDINGS NV	3,245	28.18	91,444.10
PITNEY BOWES INC	8,543	20.39	174,191.77
REPUBLIC SERVICES INC	12,800	29.44	376,832.00
ROBERT HALF INTL INC	6,630	25.27	167,540.10
RR DONNELLEY & SONS CO	9,760	15.88	154,988.80
STERICYCLE INC	3,555	84.20	299,331.00
VERISK ANALYTICS INC	4,000	33.97	135,880.00
WASTE MANAGEMENT INC	16,644	33.88	563,898.72
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,095	74.88	456,393.60
CSX CORP	42,303	21.17	895,554.51
DELTA AIR LINES INC	6,905	8.44	58,278.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,907	45.38	358,819.66
FEDEX CORP	11,548	80.72	932,154.56
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	10.89	106,504.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,415	41.84	184,723.60
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.67	135,000.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,705	69.38	950,852.90
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	8.72	61,301.60

UNION PACIFIC CORP	19,023	95.68	1,820,120.64
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	20.01	49,924.95
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,607	69.35	1,983,895.45
AUTOLIV INC	3,510	55.76	195,717.60
BORGWARNER INC	4,810	72.91	350,697.10
FORD MOTOR COMPANY	137,295	12.43	1,706,576.85
GENERAL MOTORS CORP	30,270	24.86	752,512.20
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,915	13.34	145,606.10
HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	37.89	336,993.66
JOHNSON CONTROLS INC	26,158	32.38	846,996.04
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	40.78	155,167.90
COACH INC	11,426	61.56	703,384.56
DR HORTON INC	13,551	11.10	150,416.10
FOSSIL INC	2,035	96.86	197,110.10
GARMIN LTD	4,625	34.62	160,117.50
HASBRO INC	4,903	36.08	176,900.24
LEGGETT & PLATT INC	4,468	23.45	104,774.60
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	51.75	186,300.00
MATTEL INC	12,894	27.95	360,387.30
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,758	54.38	149,980.04
NEWELL RUBBERMAID INC	12,735	13.21	168,229.35
NIKE INC -CL B	14,147	93.75	1,326,281.25
PULTE GROUP INC	16,294	4.81	78,374.14
RALPH LAUREN CORP	2,385	153.61	366,359.85
TOLL BROTHERS INC	4,501	17.78	80,027.78
VF CORP	3,315	132.90	440,563.50
WHIRLPOOL CORP	2,934	57.22	167,883.48
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	47.46	218,885.52
CARNIVAL CORP	17,977	35.14	631,711.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,235	334.18	412,712.30
DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	47.09	245,951.07
DEVRY INC	2,085	46.08	96,076.80
H&R BLOCK INC	14,360	14.55	208,938.00
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	16.35	191,066.10
LAS VEGAS SANDS CORP	13,990	42.05	588,279.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,746	31.11	334,308.06
MCDONALD'S CORP	40,176	91.77	3,686,951.52
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	10.72	150,080.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	27.94	137,129.52
STARBUCKS CORP	29,062	41.28	1,199,679.36
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,417	48.92	362,839.64
WYNN RESORTS LTD	3,060	123.18	376,930.80
YUM! BRANDS INC	17,839	52.84	942,612.76
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,425	17.49	147,353.25
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	23,738	24.63	584,666.94
COMCAST CORP-CLASS A	80,816	24.21	1,956,555.36
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	25,841	23.85	616,307.85
DIRECTV-CLASS A	29,824	47.02	1,402,324.48
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,500	42.15	231,825.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	39.79	184,426.65
DISH NETWORK CORP-A	7,659	25.82	197,755.38
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	21,146	8.39	177,414.94
LIBERTY GLOBAL INC-A	3,743	41.38	154,885.34
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,683	39.56	185,259.48

MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,657	43.23	503,932.11
NEWS CORP-CL A	70,057	16.88	1,182,562.16
NEWS CORP-CLASS B	17,844	17.15	306,024.60
OMNICOM GROUP	10,892	43.00	468,356.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	42.14	139,904.80
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	1.80	243,954.00
THE WALT DISNEY CO.	69,623	34.49	2,401,297.27
TIME WARNER CABLE	13,522	70.31	950,731.82
TIME WARNER INC	41,208	34.01	1,401,484.08
VIACOM INC-CLASS B	21,113	43.07	909,336.91
VIRGIN MEDIA INC	12,675	27.60	349,830.00
WASHINGTON POST-CLASS B	212	345.22	73,186.64
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,856	73.47	283,300.32
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,798	63.54	241,324.92
AMAZON.COM INC	14,000	227.15	3,180,100.00
AUTOZONE INC	932	327.93	305,630.76
BED BATH & BEYOND INC	9,467	61.02	577,676.34
BEST BUY CO INC	13,299	26.05	346,438.95
CARMAX INC	9,764	30.73	300,047.72
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	4,840	40.36	195,342.40
DOLLAR TREE INC	5,302	81.08	429,886.16
EXPEDIA INC	7,285	27.98	203,834.30
FAMILY DOLLAR STORES	5,308	59.78	317,312.24
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	25.60	131,840.00
GAP INC/THE	15,821	18.65	295,061.65
GENUINE PARTS CO	5,771	56.84	328,023.64
HOME DEPOT INC	61,960	36.04	2,233,038.40
J.C. PENNEY CO INC	7,036	33.02	232,328.72
KOHL'S CORP	10,432	52.88	551,644.16
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	22,020	15.76	347,035.20
LIMITED INC/THE	10,023	43.07	431,690.61
LOWE'S COS INC	51,069	21.51	1,098,494.19
MACY'S INC	16,209	30.56	495,347.04
NETFLIX INC	1,830	77.37	141,587.10
NORDSTROM INC	6,625	50.63	335,423.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,135	70.91	364,122.85
PETSMART INC	5,540	46.65	258,441.00
PRICELINE.COM INC	1,925	505.06	972,240.50
ROSS STORES INC	4,328	87.65	379,349.20
SEARS HOLDINGS CORP	1,516	74.89	113,533.24
STAPLES INC	26,819	14.47	388,070.93
TARGET CORP	25,330	54.40	1,377,952.00
TIFFANY & CO	5,030	74.42	374,332.60
TJX COMPANIES INC	15,224	59.11	899,890.64
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	26.19	124,926.30
COSTCO WHOLESALE CORP	16,939	83.23	1,409,832.97
CVS CAREMARK CORP	52,572	35.70	1,876,820.40
KROGER CO	22,540	22.92	516,616.80
SAFEWAY INC	13,113	18.98	248,884.74
SYSCO CORP	22,761	26.74	608,629.14
WALGREEN CO	35,497	33.82	1,200,508.54
WAL-MART STORES INC	73,952	56.71	4,193,817.92
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	70.22	389,369.90
ALTRIA GROUP INC	81,168	27.00	2,191,536.00

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,373	28.15	686,099.95
BEAM INC	5,276	48.65	256,677.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,145	73.59	231,440.55
BUNGE LTD	5,487	58.17	319,178.79
CAMPBELL SOUP CO	7,215	33.32	240,403.80
COCA-COLA CO/THE	79,776	66.95	5,341,003.20
COCA-COLA ENTERPRISES	13,680	25.06	342,820.80
CONAGRA FOODS INC	15,880	25.00	397,000.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,855	19.79	175,240.45
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	8,259	39.34	324,909.06
GENERAL MILLS INC	24,449	38.82	949,110.18
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	64.75	315,656.25
HANSEN NATURAL CORPORATION	3,545	84.47	299,446.15
HERSHEY CO/THE	6,065	59.93	363,475.45
HJ HEINZ CO	12,205	52.65	642,593.25
HORMEL FOODS CORP	6,860	28.84	197,842.40
JM SMUCKER CO/THE	4,230	76.08	321,818.40
KELLOGG CO	9,653	53.87	520,007.11
KRAFT FOODS INC-CLASS A	64,750	34.93	2,261,717.50
LORILLARD INC	5,470	113.47	620,680.90
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,285	48.49	256,269.65
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,816	71.80	561,188.80
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,920	41.44	245,324.80
PEPSICO INC	61,201	61.82	3,783,445.82
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,858	68.84	4,740,184.72
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	79.53	144,744.60
REYNOLDS AMERICAN INC	13,220	38.04	502,888.80
SARA LEE CORP	21,913	17.36	380,409.68
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	18.66	209,103.96
AVON PRODUCTS	15,953	23.06	367,876.18
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,490	43.96	285,300.40
CLOROX COMPANY	4,926	67.35	331,766.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,955	89.98	1,705,570.90
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,106	74.15	230,309.90
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,525	96.61	437,160.25
KIMBERLY-CLARK CORP	15,118	69.55	1,051,456.90
PROCTER & GAMBLE CO	108,079	64.51	6,972,176.29
AETNA INC	14,378	38.31	550,821.18
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,214	39.60	404,474.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,114	54.16	1,197,694.24
BECTON DICKINSON AND CO	8,576	76.72	657,950.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	58,938	5.42	319,443.96
CARDINAL HEALTH INC	13,270	43.03	571,008.10
CAREFUSION CORP	8,275	24.49	202,654.75
CERNER CORP	5,335	66.91	356,964.85
CIGNA CORP	10,330	44.92	464,023.60
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	32.00	162,400.00
COVIDIEN PLC	19,160	45.35	868,906.00
CR BARD INC	3,174	87.70	278,359.80
DAVITA INC	4,024	67.99	273,591.76
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,312	34.70	219,026.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,560	72.94	332,606.40
EXPRESS SCRIPTS INC	19,427	38.51	748,133.77
HCA HOLDINGS INC	6,715	22.16	148,804.40

HENRY SCHEIN INC	4,060	66.14	268,528.40
HOLOGIC INC	11,938	15.56	185,755.28
HUMANA INC	6,315	79.70	503,305.50
INTUITIVE SURGICAL INC	1,495	419.37	626,958.15
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,685	84.07	309,797.95
MCKESSON CORP	9,704	76.13	738,765.52
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	15,497	46.94	727,429.18
MEDTRONIC INC	41,492	33.73	1,399,525.16
OMNICARE INC	3,640	27.18	98,935.20
PATTERSON COS INC	3,142	30.58	96,082.36
QUEST DIAGNOSTICS	6,136	56.50	346,684.00
ST JUDE MEDICAL INC	12,605	40.66	512,519.30
STRYKER CORP	11,148	48.24	537,779.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,010	48.76	2,048,407.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,304	57.60	247,910.40
WELLPOINT INC	14,136	67.00	947,112.00
ZIMMER HOLDINGS INC	7,277	53.58	389,901.66
ABBOTT LABORATORIES	60,182	52.99	3,189,044.18
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,235	35.93	475,533.55
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,150	66.91	478,406.50
ALLERGAN INC	11,805	86.96	1,026,562.80
AMGEN INC	36,046	56.45	2,034,796.70
BIOGEN IDEC INC	8,902	106.87	951,356.74
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	66,146	32.11	2,123,948.06
CELGENE CORP	17,942	65.89	1,182,198.38
COVANCE INC	2,000	51.24	102,480.00
ELI LILLY & CO	40,398	37.42	1,511,693.16
FOREST LABORATORIES INC	10,990	30.85	339,041.50
GILEAD SCIENCES INC	30,517	41.09	1,253,943.53
HOSPIRA INC	6,181	30.32	187,407.92
HUMAN GENOME SCIENCES INC	8,535	12.73	108,650.55
ILLUMINA INC	5,280	30.80	162,624.00
JOHNSON & JOHNSON	106,134	63.69	6,759,674.46
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,776	40.48	274,292.48
MERCK & CO. INC.	119,508	32.91	3,933,008.28
MYLAN INC	16,250	18.20	295,750.00
PERRIGO CO	3,705	98.19	363,793.95
PFIZER INC	305,925	18.87	5,772,804.75
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	3,080	33.11	101,978.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,224	53.23	810,373.52
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,990	43.42	346,925.80
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	17.60	79,200.00
WATERS CORP	3,791	78.90	299,109.90
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	68.69	323,186.45
BB&T CORP	26,548	22.87	607,152.76
CIT GROUP INC	7,175	34.45	247,178.75
COMERICA INC	7,190	24.26	174,429.40
FIFTH THIRD BANCORP	35,519	11.69	415,217.11
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	6.03	119,816.10
KEYCORP	34,838	6.94	241,775.72
M & T BANK CORP	4,273	74.96	320,304.08
NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	200,000	0.55	110,000.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	12.62	202,727.68
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,980	12.13	181,707.40

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,405	53.02	1,081,873.10	
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	3.71	170,192.54	
SUNTRUST BANKS INC	20,582	18.77	386,324.14	
US BANCORP	74,701	24.84	1,855,572.84	
WELLS FARGO & CO	194,550	25.55	4,970,752.50	

[次へ](#)

AMERICAN EXPRESS CO	41,949	49.42	2,073,119.58
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,035	42.05	379,921.75
BANK OF AMERICA CORPORATION	392,889	6.46	2,538,062.94
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	48,487	20.74	1,005,620.38
BLACKROCK INC	3,565	150.38	536,104.70
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,685	43.41	767,705.85
CITIGROUP INC	112,517	30.90	3,476,775.30
CME GROUP INC	2,456	258.43	634,704.08
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,765	22.92	475,933.80
EATON VANCE CORP	3,790	23.95	90,770.50
FRANKLIN RESOURCES INC	6,035	101.04	609,776.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,068	100.44	1,915,189.92
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,760	124.12	342,571.20
INVESCO LTD	17,862	18.80	335,805.60
JEFFERIES GROUP INC	5,280	12.76	67,372.80
JPMORGAN CHASE & CO	153,860	33.49	5,152,771.40
LEGG MASON INC	6,730	26.20	176,326.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	25.52	186,423.60
MOODY'S CORP	8,597	32.09	275,877.73
MORGAN STANLEY	54,455	16.52	899,596.60
NASDAQ OMX GROUP/THE	6,235	24.45	152,445.75
NORTHERN TRUST CORP	8,255	39.38	325,081.90
NYSE EURONEXT	9,700	25.95	251,715.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	41,574	12.19	506,787.06
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	15.78	68,248.50
SLM CORP	19,832	12.36	245,123.52
STATE STREET CORP	19,522	38.75	756,477.50
T ROWE PRICE GROUP INC	9,945	51.08	507,990.60
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	15.69	133,835.70
ACE LTD	12,978	69.00	895,482.00
AFLAC INC	18,192	41.74	759,334.08
ALLSTATE CORP	19,838	26.50	525,707.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	18,650	24.18	450,957.00
AON CORP	11,457	49.09	562,424.13
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,570	35.91	235,928.70
ASSURANT INC	3,640	38.05	138,502.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,390	30.37	163,694.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	34,945	75.74	2,646,734.30
CHUBB CORP	11,193	67.27	752,953.11
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	28.40	180,056.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,459	85.99	211,449.41
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	15.08	88,685.48
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	5.73	106,835.85
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	16,187	17.95	290,556.65
LINCOLN NATIONAL CORP	11,528	18.50	213,268.00
LOEWS CORP	12,900	38.75	499,875.00
MARSH & MCLENNAN COS	21,123	30.03	634,323.69
METLIFE INC	40,985	32.83	1,345,537.55
OLD REPUBLIC INTL CORP	6,703	9.96	66,761.88
PARTNERRE LTD	2,372	59.85	141,964.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,120	25.19	305,302.80
PROGRESSIVE CORP	23,685	18.47	437,461.95
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,742	51.90	972,709.80
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	66.56	99,640.32

TORCHMARK CORP	5,611	38.98	218,716.78
TRAVELERS COS INC/THE	17,034	56.34	959,695.56
UNUM GROUP	10,918	23.58	257,446.44
WILLIS GROUP HOLDING	6,770	37.08	251,031.60
WR BERKLEY CORP	6,018	33.13	199,376.34
XL GROUP PLC	13,665	21.82	298,170.30
CBRE GROUP INC	11,490	16.09	184,874.10
ACCENTURE PLC-CL A	25,173	58.17	1,464,313.41
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	13.53	259,370.10
ADOBE SYSTEMS INC	19,369	27.85	539,426.65
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,210	23.30	167,993.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,490	98.97	246,435.30
AUTODESK INC	8,720	32.36	282,179.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,376	52.07	1,008,908.32
BMC SOFTWARE INC	6,394	39.44	252,179.36
CA INC	14,815	22.18	328,596.70
CITRIX SYSTEMS INC	7,178	65.29	468,651.62
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,654	70.13	817,295.02
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	30.19	168,550.77
EBAY INC	45,292	31.67	1,434,397.64
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	24.47	308,664.58
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,650	25.91	250,031.50
FISERV INC	5,139	57.70	296,520.30
GOOGLE INC-CL A	9,796	583.16	5,712,635.36
INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,897	180.36	8,458,342.92
INTUIT INC	10,826	53.32	577,242.32
MASTERCARD INC-CLASS A	4,175	327.51	1,367,354.25
MICROSOFT CORP	293,859	26.82	7,881,298.38
NUANCE COMMUNICATIONS INC	10,635	25.47	270,926.62
ORACLE CORP	156,753	32.37	5,074,094.61
PAYCHEX INC	11,862	28.61	339,371.82
RED HAT INC	7,790	46.46	361,923.40
SAIC INC	13,260	12.54	166,280.40
SALESFORCE.COM INC	4,870	129.56	630,957.20
SYMANTEC CORP	28,310	18.54	524,867.40
SYNOPSYS INC	4,627	26.56	122,893.12
TERADATA CORP	7,150	56.05	400,757.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	18.71	84,307.26
VERISIGN INC	7,695	30.76	236,698.20
VISA INC-CLASS A SHARES	20,285	90.68	1,839,443.80
VMWARE INC	3,115	95.70	298,105.50
WESTERN UNION CO	23,401	17.07	399,455.07
YAHOO! INC	47,740	16.24	775,297.60
AMPHENOL CORP-CL A	6,660	46.12	307,159.20
APPLE COMPUTER INC	35,806	397.77	14,242,552.62
ARROW ELECTRONICS INC	5,205	33.19	172,753.95
AVNET INC	6,935	29.54	204,859.90
CISCO SYSTEMS INC	212,965	17.60	3,748,184.00
CORNING INC	60,123	13.72	824,887.56
DELL INC	67,241	15.61	1,049,632.01
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	29.03	60,963.00
EMC CORP/MASS	79,779	23.87	1,904,324.73
F5 NETWORKS INC	3,005	88.76	266,723.80
FLEXTRONICS INTL LTD	30,311	6.61	200,507.26

FLIR SYSTEMS INC	5,565	26.43	147,082.95
HARRIS CORP	5,500	36.96	203,280.00
HEWLETT-PACKARD CO	83,905	25.03	2,100,142.15
JUNIPER NETWORKS INC	20,573	22.77	468,447.21
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	11,108	38.81	431,101.48
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,725	45.27	530,790.75
NETAPP INC	13,921	38.17	531,364.57
QUALCOMM INC	64,642	52.32	3,382,069.44
SANDISK CORP	8,963	49.84	446,715.92
SEAGATE TECHNOLOGY	16,314	15.61	254,661.54
TE CONNECTIVITY LTD	16,850	33.98	572,563.00
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	26.36	225,509.80
XEROX CORP	52,349	8.02	419,838.98
AMERICAN TOWER CORP-CL A	15,529	55.95	868,847.55
AT&T INC	229,296	28.41	6,514,299.36
CENTURYLINK INC	24,276	34.12	828,297.12
CROWN CASTLE INTL CORP	11,535	43.15	497,735.25
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	5.95	236,417.30
METROPCS COMMUNICATIONS INC	11,720	9.10	106,652.00
NII HOLDINGS INC	6,497	30.84	200,367.48
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	5,020	38.39	192,717.80
SPRINT NEXTEL CORP	119,037	2.70	321,399.90
VERIZON COMMUNICATIONS INC	109,538	36.19	3,964,180.22
WINDSTREAM CORP	20,465	11.83	242,100.95
AES CORP	24,528	10.82	265,392.96
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	40.42	145,916.20
AMEREN CORPORATION	8,922	31.49	280,953.78
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,478	38.65	714,174.70
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,075	29.90	241,442.50
CALPINE CORP	14,055	13.82	194,240.10
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	20.91	308,673.42
CONSOLIDATED EDISON INC	11,191	58.18	651,092.38
CONSTELLATION ENERGY GROUP	7,810	37.76	294,905.60
DOMINION RESOURCES INC/VA	22,327	50.70	1,131,978.90
DTE ENERGY COMPANY	6,843	51.13	349,882.59
DUKE ENERGY CORP	51,618	20.14	1,039,586.52
EDISON INTERNATIONAL	11,819	39.53	467,205.07
ENTERGY CORP	6,757	68.27	461,300.39
EXELON CORP	25,684	42.31	1,086,690.04
FIRSTENERGY CORP	16,180	44.92	726,805.60
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	52.11	126,106.20
MDU RESOURCES GROUP INC	8,455	20.71	175,103.05
NEXTERA ENERGY INC	15,470	55.20	853,944.00
NISOURCE INC	12,795	22.61	289,294.95
NORTHEAST UTILITIES	6,920	33.42	231,266.40
NRG ENERGY INC	9,360	20.92	195,811.20
NSTAR	3,415	43.79	149,542.85
ONEOK INC	4,310	73.81	318,121.10
P G & E CORP	15,211	42.18	641,599.98
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.34	139,093.28
PINNACLE WEST CAPITAL	5,044	45.43	229,148.92
PPL CORPORATION	22,173	28.80	638,582.40
PROGRESS ENERGY INC	11,073	51.47	569,927.31
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,263	33.95	653,978.85

SCANA CORP	4,853	41.68	202,273.04	
SEMPRA ENERGY	8,592	53.86	462,765.12	
SOUTHERN CO	32,925	43.12	1,419,726.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	10,254	32.47	332,947.38	
XCEL ENERGY INC	18,014	25.29	455,574.06	
ADVANCED MICRO DEVICES	26,706	4.91	131,126.46	
ALTERA CORPORATION	12,226	38.25	467,644.50	
ANALOG DEVICES INC	11,196	35.94	402,384.24	
APPLIED MATERIALS INC	50,278	11.78	592,274.84	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	34.44	280,341.60	
BROADCOM CORP-CL A	18,361	35.80	657,323.80	
CREE INC	3,840	24.90	95,616.00	
FIRST SOLAR INC	2,040	43.27	88,270.80	
INTEL CORP	205,292	24.63	5,056,341.96	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,579	44.82	294,870.78	
LAM RESEARCH CORP	5,417	42.42	229,789.14	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	31.42	279,763.68	
LSI CORP	20,595	5.79	119,245.05	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	20,184	13.40	270,465.60	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,465	25.91	322,968.15	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	34.53	256,523.37	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	5.50	180,713.50	
NVIDIA CORP	22,805	14.46	329,760.30	
TEXAS INSTRUMENTS INC	45,022	30.95	1,393,430.90	
XILINX INC	9,885	31.56	311,970.60	
米ドル小計	12,159,875		441,953,731.59 (33,641,518,048)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	24.88	264,101.20	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	11,180	12.64	141,315.20	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	52.32	231,516.00	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	25.54	127,316.90	
CAMECO CORP	15,332	20.88	320,132.16	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,384	33.84	1,434,274.56	
CANADIAN OIL SANDS LTD	18,725	23.39	437,977.75	
CENOVUS ENERGY INC	29,228	35.42	1,035,255.76	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	43.44	405,078.00	
ENBRIDGE INC	28,530	35.07	1,000,547.10	
ENCANA CORP	28,598	20.72	592,550.56	
ENERPLUS CORP	6,630	27.50	182,325.00	
HUSKY ENERGY INC	10,659	25.12	267,754.08	
IMPERIAL OIL LTD	12,402	41.45	514,062.90	
MEG ENERGY CORP	4,510	42.60	192,126.00	
NEXEN INC	20,125	16.68	335,685.00	
NIKO RESOURCES LTD	1,695	54.00	91,530.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	24.37	228,834.30	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	10.40	132,912.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	17,873	17.72	316,709.56	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	2,800	8.47	23,716.00	
PRECISION DRILLING CORP	8,865	11.79	104,518.35	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	8,615	14.50	124,917.50	
SUNCOR ENERGY INC	60,925	31.14	1,897,204.50	
TALISMAN ENERGY INC	39,372	13.79	542,939.88	
TOURMALINE OIL CORP	4,005	33.45	133,967.25	
TRANSCANADA CORP	27,238	43.23	1,177,498.74	

VERMILION ENERGY INC	3,000	47.51	142,530.00
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	46.03	293,441.25
AGRIUM INC	5,965	78.98	471,115.70
BARRICK GOLD CORP	38,749	48.05	1,861,889.45
CENTERRA GOLD INC	6,530	20.40	133,212.00
ELDORADO GOLD CORP	20,510	18.61	381,691.10
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	17.23	305,315.60
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	40.77	183,261.15
GOLDCORP INC	30,977	48.34	1,497,428.18
IAMGOLD CORP	14,165	20.45	289,674.25
INMET MINING CORPORATION	2,390	53.83	128,653.70
IVANHOE MINES LTD	11,025	17.75	195,693.75
KINROSS GOLD CORP	43,535	14.64	637,352.40
NEW GOLD INC	16,160	12.42	200,707.20
OSISKO MINING CORP	13,590	12.04	163,623.60
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,805	30.20	145,111.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	33,142	49.21	1,630,917.82
SILVER WHEATON CORP	13,240	32.68	432,683.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	22,380	35.82	801,651.60
YAMANA GOLD INC	27,931	15.83	442,147.73
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	4.00	211,264.00
CAE INC	12,135	10.66	129,359.10
FINNING INTERNATIONAL INC	7,925	22.48	178,154.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	49.42	282,435.30
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,495	19.41	87,247.95
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,669	75.13	1,327,471.97
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,245	59.52	371,702.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,149	37.20	303,142.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	25.53	100,077.60
TIM HORTONS INC	6,045	50.77	306,904.65
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	19.84	263,971.20
THOMSON REUTERS CORP	14,689	29.05	426,715.45
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,340	59.56	198,930.40
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	6,060	30.52	184,951.20
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	58.90	58,900.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	37.98	146,185.02
METRO INC -A	4,960	47.88	237,484.80
SHOPPERS DRUG MART INC	8,180	41.83	342,169.40
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	68.60	128,419.20
SAPUTO INC	5,200	41.44	215,488.00
VITERRA INC	17,580	10.42	183,183.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,754	38.88	418,115.52
BANK OF MONTREAL	24,666	59.50	1,467,627.00
BANK OF NOVA SCOTIA	41,774	51.43	2,148,436.82
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,390	74.02	1,139,167.80
NATIONAL BANK OF CANADA	6,080	71.46	434,476.80
ROYAL BANK OF CANADA	55,259	47.70	2,635,854.30
TORONTO-DOMINION BANK	34,355	73.68	2,531,276.40
CI FINANCIAL CORP	5,690	20.21	114,994.90
IGM FINANCIAL INC	4,295	42.50	182,537.50
ONEX CORPORATION	4,475	33.71	150,852.25
TMX GROUP INC	2,295	41.93	96,229.35
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	752	409.99	308,312.48
GREAT-WEST LIFECO INC	11,859	21.73	257,696.07

INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,955	31.41	124,226.55	
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	57.70	232,242.50	
MANULIFE FINANCIAL CORP	69,076	13.00	897,988.00	
POWER CORP OF CANADA	12,990	24.57	319,164.30	

[次へ](#)

POWER FINANCIAL CORP	10,315	26.87	277,164.05	
SUN LIFE FINANCIAL INC	22,399	24.15	540,935.85	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,397	28.42	608,102.74	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	15.84	137,237.76	
CGI GROUP INC - CL A	10,630	20.14	214,088.20	
OPEN TEXT CORPORATION	2,690	54.43	146,416.70	
RESEARCH IN MOTION	18,038	22.58	407,298.04	
BCE INC	10,310	39.21	404,255.10	
BELL ALIANT INC	2,800	27.73	77,644.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,815	35.52	597,268.80	
TELUS CORP	2,500	54.71	136,775.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	51.67	290,798.76	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,115	61.10	190,326.50	
FORTIS INC	7,570	33.54	253,897.80	
TRANSALTA CORP	9,680	22.12	214,121.60	
加ドル小計	1,453,285		46,234,554.41 (3,457,882,324)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,385	14.08	89,900.80	
ORIGIN ENERGY LTD	41,320	14.38	594,181.60	
PALADIN ENERGY LTD	18,790	1.54	28,936.60	
SANTOS LTD	33,605	12.43	417,710.15	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	24,798	34.48	855,035.04	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	28.06	203,715.60	
ALUMINA LTD	104,667	1.47	153,860.49	
AMCOR LIMITED	44,030	7.24	318,777.20	
BHP BILLITON LTD	124,346	37.17	4,621,940.82	
BLUESCOPE STEEL LTD	72,831	0.87	63,727.12	
BORAL LTD	32,450	3.78	122,661.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	49,920	4.55	227,136.00	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	15.54	235,974.90	
INCITEC PIVOT LTD	64,675	3.43	221,835.25	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	13,935	6.08	84,724.80	
LYNAS CORP LTD	61,300	1.20	73,866.50	
MACARTHUR COAL LTD	6,700	16.21	108,607.00	
NEWCREST MINING LTD	29,679	33.25	986,826.75	
ONESTEEL LTD	33,285	1.25	41,772.67	
ORICA LIMITED	13,435	25.41	341,383.35	
OZ MINERALS LTD	14,421	11.26	162,380.46	
RIO TINTO LTD	16,893	66.63	1,125,580.59	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	13.93	90,475.35	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	21.80	127,900.60	
BRAMBLES LTD	53,968	6.70	361,585.60	
ASCIANO LTD	109,000	1.49	162,410.00	
MAP GROUP	16,920	3.34	56,512.80	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.50	51,538.72	
QR NATIONAL LTD	59,950	3.27	196,036.50	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	4.81	119,023.45	
TRANSURBAN GROUP	47,535	5.44	258,590.40	
CROWN LTD	17,690	7.95	140,635.50	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	23,977	3.86	92,551.22	
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.82	67,615.14	
TATTS GROUP LTD	60,640	2.35	142,504.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	100,125	0.87	87,609.37	

HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	2.28	58,174.20	
METCASH LTD	36,285	4.19	152,034.15	
WESFARMERS LTD	38,540	31.73	1,222,874.20	
WESFARMERS LTD-PPS	5,907	32.05	189,319.35	
WOOLWORTHS LTD	47,162	24.04	1,133,774.48	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	12.14	250,448.20	
FOSTER'S GROUP LTD	72,680	5.30	385,204.00	
COCHLEAR LTD	2,157	58.34	125,839.38	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	18.70	91,536.50	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	10.97	161,917.20	
CSL LTD	21,062	29.14	613,746.68	
AUST AND NZ BANKING GROUP	100,689	21.55	2,169,847.95	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	17,263	9.20	158,819.60	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	60,347	48.72	2,940,105.84	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	84,133	24.67	2,075,561.11	
WESTPAC BANKING CORP	116,696	22.00	2,567,312.00	
ASX LTD	6,590	30.18	198,886.20	
MACQUARIE GROUP LTD	13,366	23.10	308,754.60	
AMP LTD	110,137	4.17	459,271.29	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	77,998	3.12	243,353.76	
QBE INSURANCE GROUP LTD	42,490	13.95	592,735.50	
SUNCORP GROUP LTD	49,265	8.33	410,377.45	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	7.31	131,287.60	
TELSTRA CORPORATION LTD	172,719	3.14	542,337.66	
AGL ENERGY LTD	17,300	14.60	252,580.00	
豪ドル小計	2,591,590		30,471,622.24 (2,405,125,143)	
英bond				
AMEC PLC	14,735	9.11	134,309.52	
BG GROUP PLC	131,229	13.78	1,808,335.62	
BP PLC	730,748	4.57	3,340,979.85	
CAIRN ENERGY PLC	54,760	2.97	162,637.20	
ESSAR ENERGY PLC	10,660	2.93	31,265.78	
PETROFAC LTD	9,765	14.07	137,393.55	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	139,198	22.31	3,105,507.38	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	104,379	22.93	2,393,932.36	
TULLOW OIL PLC	34,455	14.23	490,294.65	
ANGLO AMERICAN PLC	51,279	22.99	1,179,160.60	
ANTOFAGASTA PLC	14,880	11.52	171,417.60	
BHP BILLITON PLC	82,911	19.60	1,625,470.15	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	6.76	69,476.55	
FRESNILLO PLC	6,750	15.84	106,920.00	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	32,380	4.08	132,110.40	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,179	18.33	168,251.07	
KAZAKHMYS PLC-	7,325	9.18	67,280.12	
LONMIN PLC	7,445	10.80	80,406.00	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,455	67.10	231,830.50	
REXAM PLC	32,225	3.38	109,146.07	
RIO TINTO PLC	55,200	33.02	1,822,980.00	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	12.63	48,120.30	
XSTRATA PLC	80,465	10.14	816,317.42	
BAE SYSTEMS PLC ORD	129,800	2.81	364,997.60	
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.57	48,196.96	
BUNZL PLC	10,376	8.13	84,408.76	
COBHAM PLC	34,695	1.80	62,451.00	

INVENSYS PLC	27,080	2.12	57,626.24
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,705	7.23	518,427.15
SMITHS GROUP PLC	15,713	9.71	152,573.23
WEIR GROUP PLC/THE	8,360	18.70	156,332.00
WOLSELEY PLC	10,805	18.16	196,218.80
AGGREKO PLC	10,021	17.10	171,359.10
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	6.95	67,936.25
CAPITA GROUP PLC	25,499	7.30	186,270.19
EXPERIAN PLC	37,623	7.80	293,647.51
G4S PLC	59,864	2.40	143,673.60
INTERTEK GROUP PLC	6,595	19.71	129,987.45
SERCO GROUP PLC	19,895	5.18	103,155.57
GKN PLC	58,715	1.94	114,318.10
BURBERRY GROUP PLC	17,989	12.76	229,539.64
CARNIVAL PLC	6,710	22.77	152,786.70
COMPASS GROUP PLC	71,918	5.62	404,538.75
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13,032	11.23	146,349.36
TUI TRAVEL PLC	21,725	1.67	36,476.27
WHITBREAD PLC	6,950	16.96	117,872.00
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	43,129	7.21	311,175.73
ITV PLC	147,795	0.62	91,780.69
PEARSON PLC	31,114	11.74	365,278.36
REED ELSEVIER PLC	46,281	5.40	249,917.40
WPP PLC	47,769	6.50	310,737.34
KINGFISHER PLC	88,782	2.62	232,608.84
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.32	193,340.40
NEXT PLC	7,872	26.11	205,537.92
SAINSBURY (J) PLC	44,131	3.03	133,716.93
TESCO PLC	312,079	4.02	1,257,522.33
WM MORRISON SUPERMARKETS	84,045	3.00	252,723.31
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	10.85	145,010.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	76,967	28.52	2,195,483.67
DIAGEO PLC	97,072	13.07	1,268,731.04
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	39,497	22.09	872,488.73
SABMILLER PLC	36,931	22.62	835,379.22
UNILEVER PLC	49,762	20.79	1,034,551.98
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,000	33.30	799,200.00
SMITH & NEPHEW PLC	33,686	5.69	191,841.77
ASTRAZENECA PLC	53,463	30.17	1,612,978.71
GLAXOSMITHKLINE PLC	199,776	13.82	2,760,904.32
SHIRE PLC	21,315	19.52	416,068.80
BARCLAYS PLC	448,946	1.80	808,102.80
HSBC HOLDINGS PLC	689,881	5.25	3,621,875.25
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,589,276	0.34	555,849.28
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681,204	0.25	170,914.08
STANDARD CHARTERED PLC	92,179	14.12	1,302,028.37
3I GROUP PLC	45,264	2.08	94,239.64
ICAP PLC	26,160	4.10	107,465.28
INVESTEC PLC	13,185	3.75	49,536.04
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	9.06	36,876.42
MAN GROUP PLC	68,256	1.56	106,479.36
SCHRODERS PLC	4,981	13.63	67,891.03
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	12.20	84,973.00
AVIVA PLC	109,870	3.40	374,327.09

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	224,901	1.05	236,595.85	
OLD MUTUAL PLC	208,740	1.09	228,570.30	
PRUDENTIAL PLC	98,782	6.49	641,095.18	
RESOLUTION LTD	59,463	2.81	167,507.27	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.11	138,316.23	
STANDARD LIFE PLC	87,275	2.13	186,593.95	
SAGE GROUP PLC/THE	58,790	2.77	163,201.04	
BT GROUP PLC	304,977	1.83	560,852.70	
INMARSAT PLC	16,910	4.78	80,897.44	
VODAFONE GROUP PLC	1,985,305	1.74	3,456,416.00	
CENTRICA PLC	198,755	3.01	599,246.32	
INTERNATIONAL POWER PLC	58,505	3.32	194,470.62	
NATIONAL GRID PLC	136,145	6.34	863,159.30	
SEVERN TRENT PLC	10,908	15.16	165,365.28	
SSE PLC	35,702	13.45	480,191.90	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	6.13	163,885.55	
ARM HOLDINGS PLC	53,210	5.90	313,939.00	
英ボンド小計	11,347,034		53,930,524.23 (6,574,130,903)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	12,320	49.50	609,840.00	
GIVAUDAN-REG	353	796.50	281,164.50	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	9,383	55.20	517,941.60	
SIKA AG-BR	85	1,775.00	150,875.00	
SYNGENTA AG-REG	3,666	270.80	992,752.80	
ABB LTD-REG	84,995	17.20	1,461,914.00	
GEBERIT AG-REG	1,610	182.10	293,181.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	105.60	82,368.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	103.40	196,460.00	
SULZER AG-REG	870	98.90	86,043.00	
ADECCO SA-REG	4,757	41.95	199,556.15	
SGS SA-REG	201	1,503.00	302,103.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	106.10	214,322.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	20,239	49.04	992,520.56	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,220	366.40	447,008.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	64.80	98,496.00	
ARYZTA AG	2,630	41.55	109,276.50	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	40	2,700.00	108,000.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	32,400.00	162,000.00	
NESTLE SA-REG	134,163	51.00	6,842,313.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	90.90	176,346.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	157.00	33,127.00	
SYNTHES INC	2,494	148.50	370,359.00	
ACTELION LTD-REG	4,640	32.02	148,572.80	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	58.70	96,855.00	
NOVARTIS AG-REG	90,363	50.10	4,527,186.30	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,203	141.20	3,841,063.60	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	44,240	24.32	1,075,916.80	
GAM HOLDING LTD	5,635	10.60	59,731.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,750	34.44	301,350.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,280	67.50	86,400.00	
UBS AG-REG	141,112	11.11	1,567,754.32	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	71.30	99,107.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	107.30	91,205.00	
SWISS RE LTD	13,409	47.69	639,475.21	

ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,646	202.00	1,140,492.00	
SWISSCOM AG-REG	964	359.00	346,076.00	
スイスフラン小計	634,534		28,749,152.14 (2,491,114,032)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	81,823	71.20	5,825,797.60	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	11.44	554,840.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	14.12	522,440.00	
MTR CORP	65,500	25.20	1,650,600.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	10,500	35.50	372,750.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	21.75	532,875.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	15.42	693,900.00	
SANDS CHINA LTD	108,000	21.70	2,343,600.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	15.34	736,320.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	13.12	747,840.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	20.25	1,178,550.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	43,575	10.42	454,051.50	
LI & FUNG LTD	218,000	14.08	3,069,440.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	26,500	19.96	528,940.00	
BANK OF EAST ASIA	60,440	27.95	1,689,298.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	137,500	18.32	2,519,000.00	
HANG SENG BANK LTD	28,600	96.95	2,772,770.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	71.50	536,250.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	39,600	118.10	4,676,760.00	
AIA GROUP LTD	326,800	23.55	7,696,140.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	52,682	92.65	4,880,987.30	
HANG LUNG GROUP LTD	36,000	46.70	1,681,200.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	27.40	2,685,200.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	47,426	41.00	1,944,466.00	
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	20.45	593,050.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	26.20	576,400.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	28.55	797,972.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	75,000	7.50	562,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT-RTS(N)	37,500	1.82	68,250.00	
SINO LAND CO	95,500	12.06	1,151,730.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	53,480	104.20	5,572,616.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	31,017	92.40	2,865,970.80	
WHARF HOLDINGS LTD	57,800	38.05	2,199,290.00	
WHEELOCK & CO LTD	34,000	21.35	725,900.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	5.27	400,520.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	42.10	631,500.00	
CLP HOLDINGS LTD	75,000	70.70	5,302,500.00	
HONG KONG & CHINA GAS	191,156	17.50	3,345,230.00	
POWER ASSETS HOLDINGS	52,500	60.40	3,171,000.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	85.85	558,025.00	
香港ドル小計	2,586,049		78,816,469.70 (771,613,238)	
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	47,000	1.01	47,470.00	
FRASER AND NEAVE LTD	43,000	6.11	262,730.00	
KEPPEL CORP LTD	55,660	9.17	510,402.20	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.48	209,943.92	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	32,000	4.09	130,880.00	
SEBACORP MARINE LTD	27,000	3.95	106,650.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	2.87	183,680.00	

YANGZIJIANG SHIPBUILDING	71,000	0.92	65,320.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.39	107,030.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.09	32,850.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	23,800	11.29	268,702.00	
GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.63	362,970.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	3.85	211,942.50	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,000	43.20	216,000.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	2.40	112,800.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.64	140,800.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	5.19	384,060.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,625	12.25	803,906.25	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	96,240	8.35	803,604.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	48,300	17.03	822,549.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	6.44	225,400.00	
CAPITALAND LTD	112,000	2.52	282,240.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.25	62,500.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	23,000	10.20	234,600.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.59	95,700.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	2.69	80,700.00	
UOL GROUP LTD	22,250	4.22	93,895.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	320,810	3.19	1,023,383.90	
シンガポールドル小計	2,098,589		7,882,708.77 (474,223,759)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	31,065	6.38	198,194.70	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,390	2.34	101,749.55	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.45	68,965.50	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.56	186,616.32	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.69	53,656.70	
ニュージーランドドル小計	176,772		609,182.77 (36,940,843)	
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	10,875	91.35	993,431.25	
HOLMEN AB-B SHS	2,500	178.00	445,000.00	
SSAB AB-A SHARES	6,295	57.35	361,018.25	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	23,220	93.80	2,178,036.00	
ALFA LAVAL AB	12,110	118.50	1,435,035.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	154.70	1,805,349.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	25,890	138.30	3,580,587.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	14,760	122.70	1,811,052.00	
SANDVIK AB	38,860	85.45	3,320,587.00	
SCANIA AB-B SHS	13,665	109.60	1,497,684.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,750	105.00	1,548,750.00	
SKF AB-B SHS	14,614	141.40	2,066,419.60	
VOLVO AB-B SHARES	52,490	78.45	4,117,840.50	
SECURITAS AB-B SHS	14,469	57.15	826,903.35	
ELECTROLUX AB - B	8,875	113.50	1,007,312.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	32.54	462,718.80	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	2,085	339.40	707,649.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	39,203	216.60	8,491,369.80	
SWEDISH MATCH AB	9,670	230.90	2,232,803.00	
GETINGE AB-B SHS	8,670	167.10	1,448,757.00	
NORDEA BANK AB	100,363	57.80	5,800,981.40	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	55,960	41.43	2,318,422.80	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	19,085	188.50	3,597,522.50	

SWEDBANK AB - A SHARES	30,470	90.05	2,743,823.50	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	81.80	359,102.00	
INVESTOR AB-B SHS	18,275	128.90	2,355,647.50	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	133.00	893,095.00	
RATOS AB-B SHS	7,000	83.15	582,050.00	
ERICSSON LM-B SHS	116,770	66.45	7,759,366.50	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	92.45	829,276.50	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,970	707.00	2,099,790.00	
TELE2 AB-B SHS	12,235	135.00	1,651,725.00	
TELIASONERA AB	86,440	45.56	3,938,206.40	
スウェーデンクローナ小計	808,534		75,267,312.15 (873,853,494)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	66.10	449,480.00	
SEADRILL LTD	12,500	185.50	2,318,750.00	
STATOIL ASA	44,469	142.20	6,323,491.80	
SUBSEA 7 SA	10,615	126.60	1,343,859.00	
NORSK HYDRO A S	34,250	29.44	1,008,320.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	7,150	257.70	1,842,555.00	
ORKLA ASA	28,690	49.78	1,428,188.20	
DNB NOR ASA	38,240	64.15	2,453,096.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	61.00	442,250.00	
TELENOR ASA	31,650	92.50	2,927,625.00	
ノルウェークローネ小計	221,614		20,537,615.00 (282,802,958)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,655	847.00	1,401,785.00	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	7,500	106.00	795,000.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	35,400.00	814,200.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	52	37,040.00	1,926,080.00	
DSV A/S	7,370	103.80	765,006.00	
CARLSBERG AS-B	4,275	358.20	1,531,305.00	
COLOPLAST-B	1,041	788.00	820,308.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	412.60	412,600.00	
NOVO NORDISK A/S-B	16,490	539.50	8,896,355.00	
DANSKE BANK A/S	25,125	74.35	1,868,043.75	
TRYG A/S	1,045	307.70	321,546.50	
TDC A/S	14,545	45.10	655,979.50	
デンマーククローネ小計	80,121		20,208,208.75 (287,562,810)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	20,140	44.70	900,258.00	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	108	2,705.00	292,140.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	36,445	145.10	5,288,169.50	
BANK HAPOALIM BM	50,865	13.90	707,023.50	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,605	12.27	694,543.35	
NICE SYSTEMS LTD	2,860	127.30	364,078.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	81,755	7.70	629,513.50	
イスラエルシュケル小計	248,778		8,875,725.85 (185,058,883)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	5,990	16.73	100,212.70	
ENI SPA	93,181	15.93	1,484,373.33	
FUGRO NV-CVA	2,640	44.09	116,397.60	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	14.70	136,930.50	

NESTE OIL OYJ	3,590	9.06	32,525.40
OMV AG	6,300	24.69	155,578.50
REPSOL YPF SA	30,771	21.89	673,577.19
SAIPEM SPA	10,135	31.77	321,988.95
SBM OFFSHORE NV	7,930	15.87	125,888.75
TECHNIP SA	3,748	68.78	257,787.44
TENARIS SA	18,855	11.26	212,307.30
TOTAL SA	82,187	37.73	3,101,326.44
ACERINOX SA	4,717	9.52	44,943.57
AIR LIQUIDE	10,992	92.12	1,012,583.04
AKZO NOBEL NV	8,978	37.20	333,981.60
ARCELORMITTAL	32,966	14.14	466,139.24
ARKEMA	2,005	48.38	97,011.92
BASF SE	35,610	51.85	1,846,378.50
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	5,550	5.23	29,026.50
CRH PLC	27,255	13.65	372,030.75
ERAMET SLN	170	107.15	18,215.50
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	31.69	160,218.22
IMERYS SA	1,785	40.31	71,962.27
K+S AG	6,500	46.34	301,210.00
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	37.02	210,376.05
LAFARGE SA	7,458	29.36	219,004.17
LANXESS AG	3,300	42.17	139,161.00
LINDE AG	6,555	114.35	749,564.25
OUTOKUMPU OYJ	4,060	6.26	25,415.60
RAUTARUUKKI OYJ	3,980	7.44	29,611.20
SALZGITTER AG	1,990	41.14	81,878.55
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	75.08	163,749.48
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.76	96,985.00
THYSSENKRUPP AG	14,570	20.91	304,731.55
UMICORE	4,975	31.25	155,468.75
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	8.77	163,542.96
VOESTALPINE AG	5,104	23.51	119,995.04
WACKER CHEMIE AG	580	79.25	45,965.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	27.99	144,036.54
ALSTOM	7,905	27.03	213,672.15
BEKAERT NV	1,540	32.94	50,735.30
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	25.62	73,159.37
BOUYGUES SA	9,250	28.08	259,740.00
BRENTAG AG	1,125	71.26	80,167.50
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	15,171	32.92	499,429.32
EADS NV	15,598	21.00	327,558.00
EIFFAGE	1,915	24.29	46,524.92
FERROVIAL SA	13,715	9.58	131,513.13
FIAT INDUSTRIAL	28,270	6.20	175,415.35
FINMECCANICA SPA	14,290	5.06	72,307.40
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,535	19.56	49,597.27
GEA GROUP AG	7,530	20.04	150,901.20
HOCHTIEF AG	2,000	52.49	104,980.00
KONE OYJ-B	6,372	39.65	252,649.80
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	39,381	14.97	589,730.47
LEGRAND SA	7,405	26.17	193,788.85
MAN SE	2,414	63.27	152,733.78
METSO OYJ	4,900	26.39	129,311.00

PRYSMIAN SPA	8,610	11.09	95,484.90
SAFRAN SA	6,190	23.00	142,370.00
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,978	42.79	812,068.62
SIEMENS AG-REG	31,856	75.51	2,405,446.56
THALES SA	3,505	25.51	89,412.55
VALLOUREC	4,265	45.79	195,315.67
VINCI SA	17,250	35.08	605,216.25
WARTSILA OYJ	6,100	21.61	131,821.00
WENDEL	1,190	54.88	65,307.20
ZARDOYA OTIS SA	5,219	9.59	50,050.21
BUREAU VERITAS SA	1,770	55.65	98,500.50
EDENRED	6,096	19.80	120,700.80
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	25.79	113,626.97
SOCIETE BIC SA	1,265	64.44	81,516.60
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,551	12.45	181,159.95
ADP	1,210	58.05	70,240.50
AIR FRANCE-KLM	6,390	5.57	35,637.03
ATLANTIA SPA	11,496	11.65	133,928.40
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	10.13	79,723.10
DEUTSCHE POST AG	32,798	10.98	360,122.04
FRAPORT AG	1,740	45.89	79,848.60
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	22,420	6.46	144,967.72
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	1.90	60,335.24
POSTNL	13,270	3.59	47,758.73
RYANAIR HOLDINGS PLC	16,845	3.24	54,594.64
TNT EXPRESS NV	13,270	5.53	73,383.10
VOPAK	2,440	37.25	90,890.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,835	57.80	741,863.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,470	39.38	97,268.60
CONTINENTAL AG	2,915	54.31	158,313.65
DAIMLER AG	35,122	37.75	1,325,855.50
FIAT SPA	26,775	4.92	131,786.55
MICHELIN (CGDE)-B	6,704	52.02	348,742.08
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	26.93	114,317.85
PEUGEOT SA	6,717	17.06	114,625.60
PIRELLI & C.	11,251	6.40	72,006.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,740	40.86	234,565.10
RENAULT SA	7,317	28.19	206,266.23
VOLKSWAGEN AG	1,396	105.35	147,068.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,473	120.65	660,317.45
ADIDAS AG	7,991	51.22	409,299.02
CHRISTIAN DIOR	2,000	97.47	194,940.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	21.08	83,814.08
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,824	117.40	1,153,337.60
ACCOR SA	5,606	23.18	129,975.11
AUTOGRILL SPA	6,045	8.57	51,805.65
OPAP SA	8,450	6.80	57,460.00
SODEXO	3,470	51.45	178,531.50
TUI AG	3,775	4.63	17,512.22
AXEL SPRINGER AG	1,665	29.20	48,618.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,400	30.39	133,738.00
JC DECAUX SA .	2,520	19.29	48,610.80
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	42.25	130,145.40
LAGARDERE S.C.A.	5,040	19.20	96,768.00

M6-METROPOLE TELEVISION	1,760	12.22	21,507.20
MEDIASET ESPANA COMUNICACION	6,845	4.55	31,144.75
MEDIASET SPA	25,926	2.61	67,874.26
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	15.76	45,009.07
PUBLICIS GROUPE	4,725	34.94	165,115.12
REED ELSEVIER NV	25,748	8.91	229,569.16
SANOMA OYJ	3,275	9.86	32,307.87
SES	11,190	18.54	207,462.60
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	5,550	9.40	52,197.75
WOLTERS KLUWER	11,107	13.00	144,391.00
INDITEX	8,240	68.04	560,649.60
PPR	2,892	111.00	321,012.00
CARREFOUR SA	22,688	18.20	413,035.04
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	64.03	128,316.12
COLRUYT SA	2,725	30.31	82,608.37
DELHAIZE GROUP	3,666	46.27	169,625.82
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	3.34	75,777.92
JERONIMO MARTINS	7,685	12.18	93,603.30
KESKO OYJ-B SHS	2,230	25.56	56,998.80
KONINKLIJKE AHOLD NV	46,434	9.33	433,647.12
METRO AG	4,940	33.60	166,008.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	31,126	39.65	1,234,145.90
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	6,798	13.58	92,316.84
DANONE	22,644	47.93	1,085,440.14
HEINEKEN HOLDING NV	4,275	31.35	134,021.25
HEINEKEN NV	10,178	35.46	360,911.88
KERRY GROUP PLC-A	6,445	26.65	171,759.25
PARMALAT SPA	14,290	1.60	22,892.58
PERNOD-RICARD SA	7,656	66.62	510,042.72
SUEDZUCKER AG	2,400	21.10	50,652.00
UNILEVER NV-CVA	63,160	24.36	1,538,577.60
BEIERSDORF AG	3,745	41.72	156,260.12
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	35.84	183,142.40
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,318	44.10	322,760.39
L'OREAL	9,321	78.90	735,426.90
CELESIO AG	3,620	10.93	39,584.70
ESSILOR INTERNATIONAL	7,680	52.45	402,816.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,933	52.21	414,181.93
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,370	71.52	312,542.40
BAYER AG	32,065	44.61	1,430,579.97
ELAN CORP PLC	18,000	7.97	143,460.00
GRIFOLS SA	6,550	13.42	87,901.00
MERCK KGAA	2,405	59.98	144,251.90
ORION OYJ-CLASS B	4,485	15.09	67,678.65
QIAGEN N.V.	7,635	9.82	75,006.24
SANOFI	43,171	50.23	2,168,479.33
UCB SA	3,708	31.86	118,136.88
BANCA CARIGE SPA	28,825	1.41	40,672.07
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.36	55,359.24
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	167,658	6.31	1,057,921.98
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	150,420	0.16	24,217.62
BANCO DE SABADELL SA	41,782	2.63	110,220.91
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	1.46	30,892.84
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	1.16	72,994.53

BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	3.33	122,531.28	
BANCO SANTANDER SA	326,802	6.06	1,982,054.13	
BANKIA SAU	32,000	3.65	116,800.00	
BANKINTER SA	13,435	4.39	58,979.65	
BNP PARIBAS	37,182	30.80	1,145,205.60	
CAIXABANK	26,440	3.48	92,011.20	
COMMERZBANK AG	140,428	1.73	243,221.29	
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	4.91	183,242.58	

[次へ](#)

ERSTE GROUP BANK AG	7,118	16.45	117,091.10
INTESA SANPAOLO	387,223	1.27	492,934.87
INTESA SANPAOLO-RSP	44,110	1.07	47,594.69
KBC GROEP NV	6,119	14.66	89,704.54
NATIONAL BANK OF GREECE	22,263	1.66	36,956.58
NATIXIS	32,490	2.32	75,474.27
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,310	21.68	50,080.80
SOCIETE GENERALE	24,434	19.00	464,246.00
UBI BANCA SCPA	28,684	2.95	84,617.80
UNICREDIT SPA	521,766	0.86	452,110.23
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	36,040	28.55	1,028,942.00
DEUTSCHE BOERSE AG-SHARES	7,595	40.17	305,129.12
EURAZEO	1,442	33.65	48,530.51
EXOR SPA	1,714	16.20	27,766.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	55.35	161,179.20
ING GROEP NV-CVA	148,510	6.49	964,275.43
MEDIOBANCA SPA	19,150	5.98	114,612.75
POHJOLA BANK PLC	6,535	8.31	54,305.85
AEGON NV	66,229	3.42	226,966.78
AGEAS	84,144	1.40	117,885.74
ALLIANZ SE-REG	17,598	79.82	1,404,672.36
ASSICURAZIONI GENERALI	45,188	12.75	576,147.00
AXA	67,112	10.90	731,520.80
CNP ASSURANCES	6,070	11.01	66,830.70
DELTA LLOYD NV	3,600	12.67	45,612.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	37.45	91,939.75
MAPFRE SA	26,034	2.57	67,037.55
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,256	97.98	710,942.88
SAMPO OYJ-A SHS	15,819	19.73	312,108.87
SCOR SE	7,922	16.95	134,277.90
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	29.40	41,454.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	37,225	2.39	89,228.32
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	13.25	133,295.00
ATOS	1,650	36.22	59,763.00
CAP GEMINI SA	5,469	27.11	148,291.93
DASSAULT SYSTEMES SA	2,665	58.84	156,808.60
INDRA SISTEMAS SA	4,269	11.82	50,459.58
SAP AG-COMMON	35,677	42.84	1,528,402.68
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,675	14.24	80,812.00
ALCATEL-LUCENT	91,534	1.98	181,969.59
NEOPOST SA	867	55.25	47,901.75
NOKIA OYJ	144,381	4.82	696,782.70
BELGACOM SA	6,375	22.55	143,788.12
DEUTSCHE TELEKOM AG	108,911	9.10	991,852.47
ELISA OYJ	6,295	15.35	96,628.25
FRANCE TELECOM SA	71,894	13.02	936,059.88
ILIAD SA	815	84.85	69,152.75
KONINKLIJKE KPN NV	59,611	9.40	560,641.45
MOBISTAR SA	1,279	41.07	52,528.53
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	27,363	5.14	140,892.08
TELECOM ITALIA SPA	368,818	0.90	333,964.69
TELECOM ITALIA-RSP	252,797	0.76	193,516.10

TELEFONICA SA	159,043	15.14	2,407,911.02	
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	8.20	115,020.08	
VIVENDI	47,987	16.01	768,511.80	
A2A SPA	50,790	0.99	50,586.84	
ACCIONA SA	1,146	68.74	78,776.04	
E.ON AG	69,829	17.32	1,209,787.42	
EDP RENOVAVEIS SA	8,115	4.23	34,326.45	
ELECTRICITE DE FRANCE	9,395	22.54	211,763.30	
ENAGAS	8,470	14.08	119,299.95	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.63	105,002.88	
ENEL SPA	255,219	3.37	860,598.46	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	80,271	2.38	191,205.52	
FORTUM OYJ	18,055	17.82	321,740.10	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	13.45	160,141.41	
GDF SUEZ	48,004	21.07	1,011,684.30	
IBERDROLA SA	153,057	5.20	796,508.62	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,400	34.63	152,394.00	
RWE AG	15,925	30.60	487,384.62	
RWE AG-NON VTG PFD	1,845	27.42	50,589.90	
SNAM RETE GAS	58,840	3.55	208,882.00	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	11.81	121,918.98	
TERNA SPA	43,127	2.81	121,445.63	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	10.64	141,940.43	
VERBUND AG	2,370	20.87	49,473.75	
ASML HOLDING NV	16,632	29.80	495,633.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	42,120	6.44	271,505.52	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	5.03	118,847.31	
ユーロ小計	7,188,429		78,518,697.76 (8,316,700,466)	
合 計	41,595,204		59,798,526,901 (59,798,526,901)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	36,270	601,356.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	441,429.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,397	501,867.03	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	79,543.75	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,275	635,684.50	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,850	245,385.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	17,145	238,829.85	
		HCP INC	15,380	580,902.60	
		HEALTH CARE REIT INC	6,530	329,373.20	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,659	355,897.65	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	254,911.05	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	95,506.84	
		PLUM CREEK TIMBER CO	7,128	263,237.04	
		PROLOGIS INC	17,827	488,459.80	
		PUBLIC STORAGE	5,389	659,883.05	
		RAYONIER INC	5,632	225,730.56	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	108,890.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	11,374	1,377,505.14	
		THE MACERICH COMPANY	5,795	278,391.80	
	VENTAS INC	10,295	545,943.85		
VORNADO REALTY TRUST	6,396	507,074.88			
WEYERHAEUSER CO	20,336	344,085.12			
	投資証券小計		243,201	9,159,888.66 (697,250,724)	
米ドル合計				9,159,888.66 (697,250,724)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	130,725.00	
	投資証券小計		5,250	130,725.00 (9,776,922)	
加ドル合計				130,725.00 (9,776,922)	
豪ドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	77,145	139,632.45	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	138,330.72	
		GOODMAN GROUP	301,305	182,289.52	
		GPT GROUP	63,695	202,550.10	
		LEND LEASE GROUP	21,287	161,568.33	
		MIRVAC GROUP	137,930	171,722.85	
		STOCKLAND	91,105	286,069.70	
		WESTFIELD GROUP	85,280	644,716.80	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	107,475	278,360.25		
	投資証券小計		1,048,927	2,205,240.72 (174,059,650)	
豪ドル合計				2,205,240.72 (174,059,650)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	37,816	188,588.39	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	24,090	79,087.47	
		HAMMERSON PLC	30,035	117,737.20	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	192,978.52	
	SEGRO PLC	20,223	47,989.17		
	投資証券小計		141,053	626,380.75 (76,355,813)	

英ポンド合計				626,380.75 (76,355,813)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	94,500	2,532,600.00	
	投資証券小計		94,500	2,532,600.00 (24,794,154)	
香港ドル合計				2,532,600.00 (24,794,154)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	122,450.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	134,266.00	
	投資証券小計		133,800	256,716.00 (15,444,034)	
シンガポールドル合計				256,716.00 (15,444,034)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,970	71,382.95	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	52,280.10	
		GECINA SA	740	51,348.60	
		ICADE	1,080	68,385.60	
		KLEPIERRE	3,895	85,728.95	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,475	488,932.50	
投資証券小計		12,165	818,058.70 (86,648,777)		
ユーロ合計				818,058.70 (86,648,777)	
合計				1,084,330,074 (1,084,330,074)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 566銘柄	98.0%		55.2%
	投資証券 22銘柄		2.0%	1.1%
加ドル	株式 100銘柄	99.7%		5.7%
	投資証券 1銘柄		0.3%	0.0%
豪ドル	株式 61銘柄	93.3%		4.0%
	投資証券 9銘柄		6.7%	0.3%
英ポンド	株式 98銘柄	98.9%		10.8%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		4.1%
香港ドル	株式 40銘柄	96.9%		1.3%
	投資証券 1銘柄		3.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 28銘柄	96.8%		0.8%
	投資証券 2銘柄		3.2%	0.0%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%		0.1%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.5%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシケル	株式 7銘柄	100.0%		0.3%
ユーロ	株式 255銘柄	99.0%		13.7%
	投資証券 6銘柄		1.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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22年10月26日現在	平成23年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		4,578,412	2,987,025
コール・ローン		25,171,551	41,328,897
株式		1,090,489,356	1,046,286,605
投資証券		17,736,023	18,959,889
派生商品評価勘定		23,146,729	16,288,542
未収入金		331,150	17,075,502
未収配当金		927,122	1,041,572
未収利息		59	77
差入委託証拠金		23,838,550	21,007,443
流動資産合計		1,186,218,952	1,164,975,552
資産合計		1,186,218,952	1,164,975,552
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,325,250	3,007,395
未払金		42,728	7
未払解約金		1,548,645	1,343,059
流動負債合計		8,916,623	4,350,461
負債合計		8,916,623	4,350,461
純資産の部			
元本等			
元本		1,538,197,145	1,537,000,695
剰余金			
剰余金又は欠損金()		360,894,816	376,375,604
元本等合計		1,177,302,329	1,160,625,091
純資産合計		1,177,302,329	1,160,625,091
負債純資産合計		1,186,218,952	1,164,975,552

(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21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23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）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られ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られた価額で評価しております。</p>	<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 同左</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 「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22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1. 期首	平成21年10月27日	1. 期首	平成22年10月27日
期首元本額	1,614,863,595円	期首元本額	1,538,197,145円
期首からの追加設定元本額	217,142,879円	期首からの追加設定元本額	272,831,118円
期首からの一部解約元本額	293,809,329円	期首からの一部解約元本額	274,027,568円
平成22年10月26日現在の元本の内訳		平成23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)	38,654,679円	インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用)	64,752,515円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	28,632,726円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	25,492,804円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	25,403,258円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	23,400,681円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	43,971,345円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	37,805,820円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	55,609,612円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	48,704,085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)	275,847,116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)	249,152,260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)	175,788,379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)	148,559,996円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	50,868,457円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	55,334,366円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	134,748,767円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	144,048,458円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	179,699,924円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	186,651,352円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	174,322,044円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	181,869,179円
年金積立 インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	354,650,838円	年金積立 インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	371,229,179円
計	1,538,197,145円	計	1,537,000,695円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,538,197,145口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,537,000,695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360,894,816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376,375,604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

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

[次へ](#)

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	75,315,491
投資証券	3,329,565
合計	78,645,056

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	29,640,732
投資証券	65,303
合計	29,575,429

(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)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	59,455,448		61,148,742	1,693,294
合計		59,455,448		61,148,742	1,693,294

(平成23年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	85,587,069		91,902,824	6,315,755
合計		85,587,069		91,902,824	6,315,755

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,150,923,205		1,136,795,020	14,128,185
	米ドル	623,045,598		610,240,350	12,805,248
	加ドル	64,778,941		62,872,240	1,906,701
	豪ドル	48,176,690		49,511,740	1,335,050
	英ポンド	126,889,929		121,961,080	4,928,849
	スイスフラン	46,293,062		46,281,570	11,492
	香港ドル	15,655,976		15,100,800	555,176
	シンガポールドル	9,233,344		9,164,160	69,184
	スウェーデンクローナ	16,419,703		16,800,300	380,597
	ノルウェークローネ	5,865,769		5,842,700	23,069
	デンマーククローネ	5,222,065		5,311,750	89,685
	イスラエルシェケル	2,609,641		2,638,440	28,799
	ユーロ	186,732,487		191,069,890	4,337,403
合計		1,150,923,205		1,136,795,020	14,128,185

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建	1,100,742,862		1,093,777,470	6,965,392
	米ドル	619,262,864		616,893,700	2,369,164
	加ドル	61,381,393		60,276,400	1,104,993
	豪ドル	45,034,837		45,507,200	472,363
	英ポンド	116,308,696		116,669,500	360,804
	スイスフラン	46,508,113		44,888,810	1,619,303
	香港ドル	13,769,960		13,671,400	98,560
	シンガポールドル	8,941,383		8,774,380	167,003
	スウェーデンクローナ	14,770,270		14,810,760	40,490
	ノルウェークローネ	5,420,496		5,482,020	61,524
	デンマーククローネ	5,393,311		5,398,590	5,279
	イスラエルシェケル	1,867,746		1,831,380	36,366
	ユーロ	162,083,793		159,573,330	2,510,463
合計	1,100,742,862		1,093,777,470	6,965,392	

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.7654円	1口当たり純資産額	0.7551円
(1万口当たり純資産額)	(7,654円)	(1万口当たり純資産額)	(7,551円)

(3) 附属明細表
 第1 有価証券明細表
 (1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ANADARKO PETROLEUM CORP	338	77.55	26,211.90	
APACHE CORP	261	94.53	24,672.33	
BAKER HUGHES INC	383	55.41	21,222.03	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	251	50.86	12,765.86	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	578	27.31	15,785.18	
CHEVRON CORP	1,357	104.50	141,806.50	
CONOCOPHILLIPS	905	70.68	63,965.40	
CONSOL ENERGY INC	243	40.76	9,904.68	
DEVON ENERGY CORPORATION	304	61.60	18,726.40	
EOG RESOURCES INC	216	87.52	18,904.32	
EQT CORP	195	66.02	12,873.90	
EXXON MOBIL CORP	3,327	79.44	264,296.88	
FMC TECHNOLOGIES INC	312	44.97	14,030.64	
HALLIBURTON CO	622	35.12	21,844.64	
HESS CORP	236	58.78	13,872.08	
MARATHON OIL CORP	613	25.74	15,778.62	
MARATHON PETROLEUM CORP	373	32.97	12,297.81	
MURPHY OIL CORP	174	54.48	9,479.52	
NABORS INDUSTRIES LTD	440	15.80	6,952.00	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	357	67.99	24,272.43	
NOBLE CORP	245	34.94	8,560.30	
NOBLE ENERGY INC	179	87.25	15,617.75	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	551	85.14	46,912.14	
PEABODY ENERGY CORP	273	39.66	10,827.18	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	160	82.82	13,251.20	
QEP RESOURCES INC	262	31.40	8,226.80	
RANGE RESOURCES CORP	181	70.37	12,736.97	
SCHLUMBERGER LTD	919	68.03	62,519.57	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	328	40.18	13,179.04	
SPECTRA ENERGY CORP	621	28.15	17,481.15	
ULTRA PETROLEUM CORP	208	31.14	6,477.12	
VALERO ENERGY CORP	531	21.84	11,597.04	
WEATHERFORD INTL LTD	710	14.67	10,415.70	
WILLIAMS COS INC	618	29.57	18,274.26	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	179	82.45	14,758.55	
ALCOA INC	1,100	10.14	11,154.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	175	60.42	10,573.50	
DOW CHEMICAL	808	26.49	21,403.92	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	631	44.94	28,357.14	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	644	38.21	24,607.24	
INTERNATIONAL PAPER CO	412	26.28	10,827.36	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	84	70.78	5,945.52	
MONSANTO CO	364	72.96	26,557.44	
MOSAIC CO/THE	216	57.84	12,493.44	
NEWMONT MINING CORP	336	64.84	21,786.24	
NUCOR CORP	285	36.56	10,419.60	
PPG INDUSTRIES INC	171	82.53	14,112.63	
PRAXAIR INC	207	101.65	21,041.55	
SIGMA-ALDRICH	164	66.41	10,891.24	

UNITED STATES STEEL CORP	205	22.40	4,592.00
VULCAN MATERIALS CO	174	30.83	5,364.42
3M CO	454	77.04	34,976.16
BOEING CO	476	63.72	30,330.72
CATERPILLAR INC	437	89.89	39,281.93
COOPER INDUSTRIES PLC	201	52.40	10,532.40
CUMMINS INC	174	93.81	16,322.94
DANAHER CORP	445	47.42	21,101.90
DEERE & CO	285	73.12	20,839.20
DOVER CORP	225	54.66	12,298.50
EATON CORP	315	43.14	13,589.10
EMERSON ELECTRIC CO	511	46.52	23,771.72
FASTENAL CO	376	35.88	13,490.88
FLUOR CORP	198	55.79	11,046.42
GENERAL DYNAMICS CORP	197	65.26	12,856.22
GENERAL ELECTRIC CO.	7,157	16.22	116,086.54
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	508	50.71	25,760.68
ILLINOIS TOOL WORKS	340	45.65	15,521.00
INGERSOLL-RAND PLC	292	29.62	8,649.04
ITT CORP	171	44.02	7,527.42
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	169	38.01	6,423.69
JOY GLOBAL INC	151	85.32	12,883.32
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	108	68.81	7,431.48
LOCKHEED MARTIN CORP	180	78.89	14,200.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	225	56.57	12,728.25
PACCAR INC	288	41.50	11,952.00
PARKER HANNIFIN CORP	161	77.55	12,485.55
PRECISION CASTPARTS CORP	125	171.26	21,407.50
RAYTHEON COMPANY	230	43.86	10,087.80
ROCKWELL COLLINS INC.	158	54.63	8,631.54
STANLEY BLACK & DECKER INC	162	60.98	9,878.76
TEXTRON INC	395	18.77	7,414.15
TYCO INTERNATIONAL LTD	366	45.13	16,517.58
UNITED TECHNOLOGIES CORP	589	75.28	44,339.92
EQUIFAX INC	284	33.21	9,431.64
IRON MOUNTAIN INC	302	32.41	9,787.82
ROBERT HALF INTL INC	303	25.27	7,656.81
WASTE MANAGEMENT INC	411	33.88	13,924.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	74.88	11,606.40
CSX CORP	963	21.17	20,386.71
EXPEDITORS INTL WASH INC	230	45.38	10,437.40
FEDEX CORP	212	80.72	17,112.64
NORFOLK SOUTHERN CORP	309	69.38	21,438.42
UNION PACIFIC CORP	333	95.68	31,861.44
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	496	69.35	34,397.60
AUTOLIV INC	134	55.76	7,471.84
BORGWARNER INC	162	72.91	11,811.42
FORD MOTOR COMPANY	2,405	12.43	29,894.15
GENERAL MOTORS CORP	381	24.86	9,471.66
HARLEY-DAVIDSON INC	281	37.89	10,647.09
JOHNSON CONTROLS INC	597	32.38	19,330.86
COACH INC	282	61.56	17,359.92
MATTEL INC	416	27.95	11,627.20
NEWELL RUBBERMAID INC	396	13.21	5,231.16

NIKE INC -CL B	248	93.75	23,250.00
VF CORP	105	132.90	13,954.50
WHIRLPOOL CORP	98	57.22	5,607.56
CARNIVAL CORP	336	35.14	11,807.04
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	321	31.11	9,986.31
MCDONALD'S CORP	700	91.77	64,239.00
STARBUCKS CORP	510	41.28	21,052.80
STARWOOD HOTELS & RESORTS	242	48.92	11,838.64
YUM! BRANDS INC	366	52.84	19,339.44
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	769	24.63	18,940.47
COMCAST CORP-CLASS A	1,402	24.21	33,942.42
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	627	23.85	14,953.95
DIRECTV-CLASS A	522	47.02	24,544.44
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	304	39.79	12,096.16
DISH NETWORK CORP-A	360	25.82	9,295.20
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	298	43.23	12,882.54
NEWS CORP-CL A	1,243	16.88	20,981.84
OMNICOM GROUP	341	43.00	14,663.00
THE WALT DISNEY CO.	1,218	34.49	42,008.82
TIME WARNER CABLE	299	70.31	21,022.69
TIME WARNER INC	728	34.01	24,759.28
VIACOM INC-CLASS B	468	43.07	20,156.76
AMAZON.COM INC	245	227.15	55,651.75
AUTOZONE INC	30	327.93	9,837.90
BED BATH & BEYOND INC	233	61.02	14,217.66
BEST BUY CO INC	277	26.05	7,215.85
GAP INC/THE	379	18.65	7,068.35
GENUINE PARTS CO	189	56.84	10,742.76
HOME DEPOT INC	1,084	36.04	39,067.36
J.C. PENNEY CO INC	225	33.02	7,429.50
KOHL'S CORP	220	52.88	11,633.60
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	566	15.76	8,920.16
LIMITED INC/THE	320	43.07	13,782.40
LOWE'S COS INC	911	21.51	19,595.61
MACY'S INC	413	30.56	12,621.28
NORDSTROM INC	216	50.63	10,936.08
PRICELINE.COM INC	37	505.06	18,687.22
ROSS STORES INC	141	87.65	12,358.65
STAPLES INC	489	14.47	7,075.83
TARGET CORP	440	54.40	23,936.00
TIFFANY & CO	146	74.42	10,865.32
TJX COMPANIES INC	313	59.11	18,501.43
COSTCO WHOLESALE CORP	297	83.23	24,719.31
CVS CAREMARK CORP	916	35.70	32,701.20
KROGER CO	493	22.92	11,299.56
SAFEWAY INC	328	18.98	6,225.44
SYSCO CORP	439	26.74	11,738.86
WALGREEN CO	622	33.82	21,036.04
WAL-MART STORES INC	1,288	56.71	73,042.48
ALTRIA GROUP INC	1,419	27.00	38,313.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	484	28.15	13,624.60
BEAM INC	175	48.65	8,513.75
BUNGE LTD	152	58.17	8,841.84
COCA-COLA CO/THE	1,394	66.95	93,328.30

COCA-COLA ENTERPRISES	389	25.06	9,748.34
CONAGRA FOODS INC	463	25.00	11,575.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	342	19.79	6,768.18
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	242	39.34	9,520.28
GENERAL MILLS INC	479	38.82	18,594.78
HANSEN NATURAL CORPORATION	132	84.47	11,150.04
HJ HEINZ CO	296	52.65	15,584.40
KELLOGG CO	238	53.87	12,821.06
KRAFT FOODS INC-CLASS A	1,132	34.93	39,540.76
LORILLARD INC	139	113.47	15,772.33
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	221	71.80	15,867.80
PEPSICO INC	1,066	61.82	65,900.12
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,204	68.84	82,883.36
REYNOLDS AMERICAN INC	371	38.04	14,112.84
SARA LEE CORP	706	17.36	12,256.16
TYSON FOODS INC-CL A	392	18.66	7,314.72
AVON PRODUCTS	368	23.06	8,486.08
COLGATE-PALMOLIVE CO	332	89.98	29,873.36
KIMBERLY-CLARK CORP	259	69.55	18,013.45
PROCTER & GAMBLE CO	1,884	64.51	121,536.84
AETNA INC	340	38.31	13,025.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	301	39.60	11,919.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	388	54.16	21,014.08
BECTON DICKINSON AND CO	172	76.72	13,195.84
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,316	5.42	7,132.72
CARDINAL HEALTH INC	322	43.03	13,855.66
CAREFUSION CORP	293	24.49	7,175.57
CIGNA CORP	275	44.92	12,353.00
COVIDIEN PLC	383	45.35	17,369.05
DAVITA INC	128	67.99	8,702.72
EXPRESS SCRIPTS INC	391	38.51	15,057.41
HUMANA INC	171	79.70	13,628.70
INTUITIVE SURGICAL INC	35	419.37	14,677.95
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	108	84.07	9,079.56
MCKESSON CORP	204	76.13	15,530.52
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	304	46.94	14,269.76
MEDTRONIC INC	719	33.73	24,251.87
QUEST DIAGNOSTICS	126	56.50	7,119.00
ST JUDE MEDICAL INC	293	40.66	11,913.38
STRYKER CORP	242	48.24	11,674.08
UNITEDHEALTH GROUP INC	735	48.76	35,838.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	141	57.60	8,121.60
WELLPOINT INC	275	67.00	18,425.00
ZIMMER HOLDINGS INC	169	53.58	9,055.02
ABBOTT LABORATORIES	1,053	52.99	55,798.47
AGILENT TECHNOLOGIES INC	380	35.93	13,653.40
ALLERGAN INC	262	86.96	22,783.52
AMGEN INC	631	56.45	35,619.95
BIOGEN IDEC INC	200	106.87	21,374.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,157	32.11	37,151.27
CELGENE CORP	315	65.89	20,755.35
ELI LILLY & CO	706	37.42	26,418.52
FOREST LABORATORIES INC	303	30.85	9,347.55
GILEAD SCIENCES INC	535	41.09	21,983.15

HOSPIRA INC	212	30.32	6,427.84
JOHNSON & JOHNSON	1,850	63.69	117,826.50
MERCK & CO. INC.	2,081	32.91	68,485.71
PFIZER INC	5,332	18.87	100,614.84
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	351	53.23	18,683.73
WATERS CORP	151	78.90	11,913.90
BB&T CORP	507	22.87	11,595.09
COMERICA INC	234	24.26	5,676.84
FIFTH THIRD BANCORP	733	11.69	8,568.77
KEYCORP	1,033	6.94	7,169.02
M & T BANK CORP	105	74.96	7,870.80
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	353	12.62	4,454.86
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	332	53.02	17,602.64
SUNTRUST BANKS INC	412	18.77	7,733.24
US BANCORP	1,296	24.84	32,192.64
WELLS FARGO & CO	3,390	25.55	86,614.50
AMERICAN EXPRESS CO	734	49.42	36,274.28
AMERIPRISE FINANCIAL INC	253	42.05	10,638.65
BANK OF AMERICA CORPORATION	6,827	6.46	44,102.42
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	777	20.74	16,114.98
BLACKROCK INC	72	150.38	10,827.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	350	43.41	15,193.50
CITIGROUP INC	1,958	30.90	60,502.20
CME GROUP INC	48	258.43	12,404.64
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	646	22.92	14,806.32
FRANKLIN RESOURCES INC	159	101.04	16,065.36
GOLDMAN SACHS GROUP INC	331	100.44	33,245.64
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	85	124.12	10,550.20
INVESCO LTD	557	18.80	10,471.60
JPMORGAN CHASE & CO	2,681	33.49	89,786.69
MOODY'S CORP	293	32.09	9,402.37
MORGAN STANLEY	902	16.52	14,901.04
NORTHERN TRUST CORP	191	39.38	7,521.58
SCHWAB (CHARLES) CORP	865	12.19	10,544.35
STATE STREET CORP	362	38.75	14,027.50
T ROWE PRICE GROUP INC	265	51.08	13,536.20
ACE LTD	246	69.00	16,974.00
AFLAC INC	327	41.74	13,648.98
ALLSTATE CORP	360	26.50	9,540.00
AON CORP	289	49.09	14,187.01
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	247	30.37	7,501.39
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	608	75.74	46,049.92
CHUBB CORP	226	67.27	15,203.02
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	395	17.95	7,090.25
MARSH & MCLENNAN COS	551	30.03	16,546.53
METLIFE INC	709	32.83	23,276.47
OLD REPUBLIC INTL CORP	564	9.96	5,617.44
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	325	25.19	8,186.75
PROGRESSIVE CORP	543	18.47	10,029.21
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	352	51.90	18,268.80
TRAVELERS COS INC/THE	245	56.34	13,803.30
UNUM GROUP	412	23.58	9,714.96
WR BERKLEY CORP	271	33.13	8,978.23
ACCENTURE PLC-CL A	441	58.17	25,652.97

ADOBE SYSTEMS INC	428	27.85	11,919.80	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	237	23.30	5,522.10	
AUTODESK INC	290	32.36	9,384.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	418	52.07	21,765.26	

[次へ](#)

BMC SOFTWARE INC	228	39.44	8,992.32
CA INC	477	22.18	10,579.86
CITRIX SYSTEMS INC	222	65.29	14,494.38
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	295	70.13	20,688.35
COMPUTER SCIENCES CORP	169	30.19	5,102.11
EBAY INC	793	31.67	25,114.31
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	350	25.91	9,068.50
FISERV INC	208	57.70	12,001.60
GOOGLE INC-CL A	171	583.16	99,720.36
INTL BUSINESS MACHINES CORP	819	180.36	147,714.84
INTUIT INC	296	53.32	15,782.72
MASTERCARD INC-CLASS A	74	327.51	24,235.74
MICROSOFT CORP	5,133	26.82	137,667.06
ORACLE CORP	2,740	32.37	88,693.80
PAYCHEX INC	388	28.61	11,100.68
SYMANTEC CORP	788	18.54	14,609.52
VISA INC-CLASS A SHARES	355	90.68	32,191.40
WESTERN UNION CO	766	17.07	13,075.62
YAHOO! INC	1,015	16.24	16,483.60
AMPHENOL CORP-CL A	210	46.12	9,685.20
APPLE COMPUTER INC	625	397.77	248,606.25
CISCO SYSTEMS INC	3,714	17.60	65,366.40
CORNING INC	1,138	13.72	15,613.36
DELL INC	1,317	15.61	20,558.37
EMC CORP/MASS	1,396	23.87	33,322.52
F5 NETWORKS INC	94	88.76	8,343.44
HARRIS CORP	181	36.96	6,689.76
HEWLETT-PACKARD CO	1,456	25.03	36,443.68
JUNIPER NETWORKS INC	475	22.77	10,815.75
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	226	38.81	8,771.06
MOTOROLA SOLUTIONS INC	295	45.27	13,354.65
NETAPP INC	335	38.17	12,786.95
QUALCOMM INC	1,131	52.32	59,173.92
SEAGATE TECHNOLOGY	463	15.61	7,227.43
TE CONNECTIVITY LTD	430	33.98	14,611.40
XEROX CORP	1,337	8.02	10,722.74
AMERICAN TOWER CORP-CL A	381	55.95	21,316.95
AT&T INC	3,997	28.41	113,554.77
CENTURYLINK INC	386	34.12	13,170.32
NII HOLDINGS INC	255	30.84	7,864.20
SPRINT NEXTEL CORP	2,810	2.70	7,587.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,908	36.19	69,050.52
AES CORP	820	10.82	8,872.40
AMERICAN ELECTRIC POWER	400	38.65	15,460.00
CENTERPOINT ENERGY INC	725	20.91	15,159.75
CONSOLIDATED EDISON INC	262	58.18	15,243.16
CONSTELLATION ENERGY GROUP	247	37.76	9,326.72
DOMINION RESOURCES INC/VA	392	50.70	19,874.40
DUKE ENERGY CORP	933	20.14	18,790.62
EDISON INTERNATIONAL	316	39.53	12,491.48
ENERGY CORP	134	68.27	9,148.18
EXELON CORP	445	42.31	18,827.95
FIRSTENERGY CORP	347	44.92	15,587.24
NEXTERA ENERGY INC	304	55.20	16,780.80

P G & E CORP	261	42.18	11,008.98	
PINNACLE WEST CAPITAL	235	45.43	10,676.05	
PPL CORPORATION	433	28.80	12,470.40	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	406	33.95	13,783.70	
SEMPRA ENERGY	215	53.86	11,579.90	
SOUTHERN CO	577	43.12	24,880.24	
WISCONSIN ENERGY CORP	367	32.47	11,916.49	
XCEL ENERGY INC	485	25.29	12,265.65	
ALTERA CORPORATION	363	38.25	13,884.75	
ANALOG DEVICES INC	289	35.94	10,386.66	
APPLIED MATERIALS INC	1,068	11.78	12,581.04	
BROADCOM CORP-CL A	383	35.80	13,711.40	
INTEL CORP	3,577	24.63	88,101.51	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	304	31.42	9,551.68	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	515	13.40	6,901.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	309	34.53	10,669.77	
TEXAS INSTRUMENTS INC	789	30.95	24,419.55	
XILINX INC	312	31.56	9,846.72	
米ドル小計	200,233		7,732,679.81 (588,611,587)	
加ドル				
CAMECO CORP	350	20.88	7,308.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	743	33.84	25,143.12	
CANADIAN OIL SANDS LTD	466	23.39	10,899.74	
CENOVUS ENERGY INC	625	35.42	22,137.50	
ENBRIDGE INC	646	35.07	22,655.22	
ENCANA CORP	619	20.72	12,825.68	
ENERPLUS CORP	346	27.50	9,515.00	
HUSKY ENERGY INC	279	25.12	7,008.48	
IMPERIAL OIL LTD	228	41.45	9,450.60	
NEXEN INC	539	16.68	8,990.52	
PENN WEST PETROLEUM LTD	518	17.72	9,178.96	
SUNCOR ENERGY INC	1,067	31.14	33,226.38	
TALISMAN ENERGY INC	920	13.79	12,686.80	
TRANSCANADA CORP	478	43.23	20,663.94	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	172	46.03	7,917.16	
AGRIUM INC	156	78.98	12,320.88	
BARRICK GOLD CORP	678	48.05	32,577.90	
ELDORADO GOLD CORP	598	18.61	11,128.78	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	698	17.23	12,026.54	
GOLDCORP INC	543	48.34	26,248.62	
KINROSS GOLD CORP	888	14.64	13,000.32	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	580	49.21	28,541.80	
SILVER WHEATON CORP	414	32.68	13,529.52	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	533	35.82	19,092.06	
YAMANA GOLD INC	857	15.83	13,566.31	
BOMBARDIER INC 'B'	1,955	4.00	7,820.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	229	49.42	11,317.18	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	310	75.13	23,290.30	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	193	59.52	11,487.36	
MAGNA INTERNATIONAL INC	219	37.20	8,146.80	
TIM HORTONS INC	257	50.77	13,047.89	
THOMSON REUTERS CORP	340	29.05	9,877.00	
BANK OF MONTREAL	432	59.50	25,704.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	731	51.43	37,595.33	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	264	74.02	19,541.28	
NATIONAL BANK OF CANADA	186	71.46	13,291.56	
ROYAL BANK OF CANADA	962	47.70	45,887.40	
TORONTO-DOMINION BANK	601	73.68	44,281.68	
IGM FINANCIAL INC	291	42.50	12,367.50	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,334	13.00	17,342.00	
POWER CORP OF CANADA	445	24.57	10,933.65	
SUN LIFE FINANCIAL INC	499	24.15	12,050.85	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	676	28.42	19,211.92	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	757	15.84	11,990.88	
RESEARCH IN MOTION	345	22.58	7,790.10	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	429	35.52	15,238.08	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	287	51.67	14,829.29	
TRANSALTA CORP	508	22.12	11,236.96	
加ドル小計	26,191		805,918.84 (60,274,670)	
豪ドル				
ORIGIN ENERGY LTD	944	14.38	13,574.72	
SANTOS LTD	807	12.43	10,031.01	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	477	34.48	16,446.96	
WORLEYPARSONS LTD	285	28.06	7,997.10	
BHP BILLITON LTD	2,174	37.17	80,807.58	
NEWCREST MINING LTD	538	33.25	17,888.50	
ORICA LIMITED	377	25.41	9,579.57	
RIO TINTO LTD	310	66.63	20,655.30	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	266	21.80	5,798.80	
BRAMBLES LTD	1,733	6.70	11,611.10	
CROWN LTD	846	7.95	6,725.70	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,652	3.86	6,376.72	
TABCORP HOLDINGS LTD	1,303	2.82	3,674.46	
FAIRFAX MEDIA LTD	4,742	0.87	4,149.25	
WESFARMERS LTD	684	31.73	21,703.32	
WOOLWORTHS LTD	827	24.04	19,881.08	
COCA-COLA AMATIL LTD	768	12.14	9,323.52	
FOSTER'S GROUP LTD	2,264	5.30	11,999.20	
CSL LTD	517	29.14	15,065.38	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,748	21.55	37,669.40	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,050	48.72	51,156.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,472	24.67	36,314.24	
WESTPAC BANKING CORP	2,027	22.00	44,594.00	
MACQUARIE GROUP LTD	306	23.10	7,068.60	
AMP LTD	2,598	4.17	10,833.66	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,897	3.12	9,038.64	
QBE INSURANCE GROUP LTD	853	13.95	11,899.35	
SUNCORP GROUP LTD	1,427	8.33	11,886.91	
COMPUTERSHARE LTD	820	7.31	5,994.20	
TELSTRA CORPORATION LTD	3,619	3.14	11,363.66	
AGL ENERGY LTD	726	14.60	10,599.60	
豪ドル小計	41,057		541,707.53 (42,756,975)	
英ポンド				
BG GROUP PLC	2,297	13.78	31,652.66	
BP PLC	12,731	4.57	58,206.13	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,425	22.31	54,101.75	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,817	22.93	41,672.89	

ANGLO AMERICAN PLC	897	22.99	20,626.51
ANTOFAGASTA PLC	713	11.52	8,213.76
BHP BILLITON PLC	1,449	19.60	28,407.64
RANDGOLD RESOURCES LTD	93	67.10	6,240.30
RIO TINTO PLC	966	33.02	31,902.15
XSTRATA PLC	1,492	10.14	15,136.34
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,945	2.81	5,469.34
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,525	7.23	11,025.75
SMITHS GROUP PLC	447	9.71	4,340.37
WOLSELEY PLC	297	18.16	5,393.52
CAPITA GROUP PLC	748	7.30	5,464.14
EXPERIAN PLC	1,266	7.80	9,881.13
G4S PLC	2,141	2.40	5,138.40
CARNIVAL PLC	225	22.77	5,123.25
COMPASS GROUP PLC	1,687	5.62	9,489.37
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	474	11.23	5,323.02
WHITBREAD PLC	221	16.96	3,748.16
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	1,034	7.21	7,460.31
REED ELSEVIER PLC	1,234	5.40	6,663.60
WPP PLC	1,237	6.50	8,046.68
KINGFISHER PLC	2,317	2.62	6,070.54
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,326	3.32	4,404.97
NEXT PLC	193	26.11	5,039.23
TESCO PLC	5,416	4.02	21,823.77
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,346	28.52	38,394.65
DIAGEO PLC	1,698	13.07	22,192.86
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	692	22.09	15,286.28
SABMILLER PLC	648	22.62	14,657.76
UNILEVER PLC	871	20.79	18,108.09
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	421	33.30	14,019.30
SMITH & NEPHEW PLC	824	5.69	4,692.68
ASTRAZENECA PLC	929	30.17	28,027.93
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,492	13.82	48,259.44
SHIRE PLC	617	19.52	12,043.84
BARCLAYS PLC	7,423	1.80	13,361.40
HSBC HOLDINGS PLC	12,022	5.25	63,115.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	28,127	0.34	9,837.41
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	16,304	0.25	4,090.67
STANDARD CHARTERED PLC	1,613	14.12	22,783.62
MAN GROUP PLC	2,201	1.56	3,433.56
AVIVA PLC	2,301	3.40	7,839.50
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,712	1.05	7,061.02
OLD MUTUAL PLC	5,463	1.09	5,981.98
PRUDENTIAL PLC	1,922	6.49	12,473.78
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	3,732	1.11	4,176.10
STANDARD LIFE PLC	2,723	2.13	5,821.77
SAGE GROUP PLC/THE	2,006	2.77	5,568.65
BT GROUP PLC	7,097	1.83	13,051.38
VODAFONE GROUP PLC	34,594	1.74	60,228.15
CENTRICA PLC	3,917	3.01	11,809.75
INTERNATIONAL POWER PLC	1,920	3.32	6,382.08
NATIONAL GRID PLC	2,386	6.34	15,127.24
SEVERN TRENT PLC	442	15.16	6,700.72
SSE PLC	838	13.45	11,271.10

ARM HOLDINGS PLC	1,448	5.90	8,543.20	
英ポンド小計	205,342		940,407.09 (114,635,624)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	253	49.50	12,523.50	
GIVAUDAN-REG	13	796.50	10,354.50	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	225	55.20	12,420.00	
SYNGENTA AG-REG	73	270.80	19,768.40	
ABB LTD-REG	1,489	17.20	25,610.80	
GEBERIT AG-REG	62	182.10	11,290.20	
ADECCO SA-REG	213	41.95	8,935.35	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	104	106.10	11,034.40	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	385	49.04	18,880.40	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	44	366.40	16,121.60	
NESTLE SA-REG	2,344	51.00	119,544.00	
ACTELION LTD-REG	195	32.02	6,243.90	
NOVARTIS AG-REG	1,579	50.10	79,107.90	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	476	141.20	67,211.20	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	761	24.32	18,507.52	
GAM HOLDING LTD	550	10.60	5,830.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	290	34.44	9,987.60	
UBS AG-REG	2,470	11.11	27,441.70	
SWISS RE LTD	365	47.69	17,406.85	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	98	202.00	19,796.00	
スイスフラン小計	11,989		518,015.82 (44,886,070)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	2,146	71.20	152,795.20	
ESPRIT HOLDINGS LTD	1,129	10.42	11,764.18	
LI & FUNG LTD	4,000	14.08	56,320.00	
BANK OF EAST ASIA	1,880	27.95	52,546.00	
HANG SENG BANK LTD	550	96.95	53,322.50	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	900	118.10	106,290.00	
AIA GROUP LTD	6,600	23.55	155,430.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1,044	92.65	96,726.60	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	27.40	82,200.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	1,000	41.00	41,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	933	104.20	97,218.60	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	754	92.40	69,669.60	
WHARF HOLDINGS LTD	2,100	38.05	79,905.00	
CLP HOLDINGS LTD	2,000	70.70	141,400.00	
HONG KONG & CHINA GAS	5,719	17.50	100,082.50	
香港ドル小計	33,755		1,296,670.18 (12,694,401)	
シンガポールドル				
KEPPEL CORP LTD	2,100	9.17	19,257.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,000	11.29	11,290.00	
GENTING SINGAPORE PLC	7,000	1.63	11,445.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	4,000	3.85	15,400.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,423	12.25	17,431.75	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,000	17.03	17,030.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,000	6.44	12,880.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	1,500	10.20	15,300.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,000	3.19	25,520.00	

シンガポールドル小計	28,023		145,553.75 (8,756,513)	
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	662	91.35	60,473.70	
ASSA ABLOY AB-B	435	154.70	67,294.50	
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,003	138.30	138,714.90	
SANDVIK AB	1,031	85.45	88,098.95	
SKANSKA AB-B SHS	622	105.00	65,310.00	
SKF AB-B SHS	482	141.40	68,154.80	
VOLVO AB-B SHARES	1,299	78.45	101,906.55	
SECURITAS AB-B SHS	911	57.15	52,063.65	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	695	216.60	150,537.00	
NORDEA BANK AB	1,654	57.80	95,601.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,670	41.43	69,188.10	
SWEDBANK AB - A SHARES	1,034	90.05	93,111.70	
ERICSSON LM-B SHS	2,048	66.45	136,089.60	
TELIASONERA AB	2,102	45.56	95,767.12	
スウェーデンクローナ小計	15,648		1,282,311.77 (14,887,639)	
ノルウェークローネ				
STATOIL ASA	715	142.20	101,673.00	
NORSK HYDRO A S	1,642	29.44	48,340.48	
YARA INTERNATIONAL ASA	199	257.70	51,282.30	
ORKLA ASA	1,079	49.78	53,712.62	
DNB NOR ASA	1,017	64.15	65,240.55	
TELENOR ASA	857	92.50	79,272.50	
ノルウェークローネ小計	5,509		399,521.45 (5,501,410)	
デンマーククローネ				
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	2	37,040.00	74,080.00	
DSV A/S	493	103.80	51,173.40	
CARLSBERG AS-B	137	358.20	49,073.40	
NOVO NORDISK A/S-B	289	539.50	155,915.50	
DANSKE BANK A/S	677	74.35	50,334.95	
デンマーククローネ小計	1,598		380,577.25 (5,415,614)	
イスラエルシェケル				
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	601	145.10	87,205.10	
イスラエルシェケル小計	601		87,205.10 (1,818,226)	
ユーロ				
ENI SPA	1,631	15.93	25,981.83	
OMV AG	232	24.69	5,729.24	
REPSOL YPF SA	718	21.89	15,717.02	
SAIPEM SPA	351	31.77	11,151.27	
TECHNIP SA	138	68.78	9,491.64	
TOTAL SA	1,431	37.73	53,998.78	
AIR LIQUIDE	193	92.12	17,779.16	
AKZO NOBEL NV	194	37.20	7,216.80	
ARCELORMITTAL	647	14.14	9,148.58	
BASF SE	623	51.85	32,302.55	
CRH PLC	643	13.65	8,776.95	
K+S AG	204	46.34	9,453.36	
KONINKLIJKE DSM NV	158	37.02	5,849.95	
LAFARGE SA	188	29.36	5,520.62	

LANXESS AG	171	42.17	7,211.07
LINDE AG	144	114.35	16,466.40
SOLVAY ET CIE SA -A	85	75.08	6,381.80
THYSSENKRUPP AG	462	20.91	9,662.73
UMICORE	201	31.25	6,281.25
UPM-KYMMENE OYJ	563	8.77	4,937.51
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	184	27.99	5,150.16
ALSTOM	186	27.03	5,027.58
BOUYGUES SA	212	28.08	5,952.96
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	366	32.92	12,048.72
EADS NV	402	21.00	8,442.00
KONE OYJ-B	204	39.65	8,088.60
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	673	14.97	10,078.17
MAN SE	109	63.27	6,896.43
SCHNEIDER ELECTRIC SA	374	42.79	16,003.46
SIEMENS AG-REG	557	75.51	42,059.07
VALLOUREC	115	45.79	5,266.42
VINCI SA	356	35.08	12,490.26
WARTSILA OYJ	272	21.61	5,877.92
EDENRED	335	19.80	6,633.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	659	12.45	8,204.55
ATLANTIA SPA	469	11.65	5,463.85
DEUTSCHE POST AG	724	10.98	7,949.52
POSTNL	382	3.59	1,374.81
TNT EXPRESS NV	579	5.53	3,201.87
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	270	57.80	15,606.00
DAIMLER AG	615	37.75	23,216.25
MICHELIN (CGDE)-B	160	52.02	8,323.20
PEUGEOT SA	168	17.06	2,866.92
RENAULT SA	154	28.19	4,341.26
VOLKSWAGEN AG-PFD	125	120.65	15,081.25
ADIDAS AG	229	51.22	11,729.38
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	172	117.40	20,192.80
ACCOR SA	246	23.18	5,703.51
SODEXO	131	51.45	6,739.95
LAGARDERE S.C.A.	211	19.20	4,051.20
MEDIASET SPA	1,605	2.61	4,201.89
SES	443	18.54	8,213.22
WOLTERS KLUWER	443	13.00	5,759.00
INDITEX	196	68.04	13,335.84
PPR	80	111.00	8,880.00
CARREFOUR SA	401	18.20	7,300.20
DELHAIZE GROUP	124	46.27	5,737.48
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	1,731	3.34	5,781.54
KONINKLIJKE AHOLD NV	825	9.33	7,704.67
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	545	39.65	21,609.25
DANONE	397	47.93	19,030.19
HEINEKEN NV	256	35.46	9,077.76
PARMALAT SPA	1,127	1.60	1,805.45
PERNOD-RICARD SA	180	66.62	11,991.60
UNILEVER NV-CVA	1,097	24.36	26,722.92
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	271	44.10	11,952.45
L'OREAL	171	78.90	13,491.90
ESSILOR INTERNATIONAL	198	52.45	10,385.10

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	229	52.21	11,956.09
FRESENIUS SE & CO KGAA	141	71.52	10,084.32
BAYER AG	561	44.61	25,029.01
SANOFI	755	50.23	37,923.65
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,905	6.31	18,330.55
BANCO POPULAR ESPANOL	1,264	3.33	4,220.49
BANCO SANTANDER SA	5,686	6.06	34,485.59
BNP PARIBAS	644	30.80	19,835.20
CREDIT AGRICOLE SA	812	4.91	3,994.22
ERSTE GROUP BANK AG	396	16.45	6,514.20
INTESA SANPAOLO	8,260	1.27	10,514.98
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782		
SOCIETE GENERALE	433	19.00	8,227.00
UBI BANCA SCPA	825	2.95	2,433.75
UNICREDIT SPA	10,313	0.86	8,936.21
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	624	28.55	17,815.20
ING GROEP NV-CVA	2,735	6.49	17,758.35
MEDIOBANCA SPA	1,046	5.98	6,260.31
AGEAS	3,106	1.40	4,351.50
ALLIANZ SE-REG	308	79.82	24,584.56
ASSICURAZIONI GENERALI	1,034	12.75	13,183.50
AXA	1,224	10.90	13,341.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	134	97.98	13,129.32
SAMPO OYJ-A SHS	410	19.73	8,089.30
CAP GEMINI SA	226	27.11	6,127.99
SAP AG-COMMON	624	42.84	26,732.16
NOKIA OYJ	2,577	4.82	12,436.60
BELGACOM SA	221	22.55	4,984.65
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,909	9.10	17,385.26
FRANCE TELECOM SA	1,247	13.02	16,235.94
KONINKLIJKE KPN NV	1,060	9.40	9,969.30
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	1,177	5.14	6,060.37
TELECOM ITALIA SPA	11,938	0.90	10,809.85
TELEFONICA SA	2,782	15.14	42,119.48
TELEKOM AUSTRIA AG	997	8.20	8,179.38
VIVENDI	842	16.01	13,484.63
ACCIONA SA	76	68.74	5,224.24
E.ON AG	1,218	17.32	21,101.85
ELECTRICITE DE FRANCE	161	22.54	3,628.94
ENEL SPA	4,836	3.37	16,306.99
FORTUM OYJ	403	17.82	7,181.46
GDF SUEZ	832	21.07	17,534.40
IBERDROLA SA	2,969	5.20	15,450.67
RWE AG	300	30.60	9,181.50
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	414	11.81	4,891.41
VEOLIA ENVIRONNEMENT	397	10.64	4,226.06
ASML HOLDING NV	355	29.80	10,579.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,256	6.44	8,096.17
STMICROELECTRONICS NV	760	5.03	3,823.56
ユーロ小計	114,910		1,378,850.80 (146,047,876)
合計	684,856		1,046,286,605 (1,046,286,605)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	134	17,022.02	
		BOSTON PROPERTIES INC	201	18,690.99	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	358	20,184.04	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	889	11,868.15	
		KIMCO REALTY CORPORATION	712	11,897.52	
		PUBLIC STORAGE	167	20,449.15	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	253	9,821.46	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	199	24,100.89	
		VORNADO REALTY TRUST	208	16,490.24	
	WEYERHAEUSER CO	619	10,473.48		
	投資証券小計		3,740	160,997.94 (12,255,163)	
米ドル合計				160,997.94 (12,255,163)	
豪ドル	投資証券	LEND LEASE GROUP	1,164	8,834.76	
		WESTFIELD GROUP	1,450	10,962.00	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	4,464	11,561.76	
		投資証券小計		7,078	31,358.52 (2,475,127)
豪ドル合計				31,358.52 (2,475,127)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,364	6,802.26	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,218	8,136.24	
		投資証券小計		2,582	14,938.50 (1,821,003)
英ポンド合計				14,938.50 (1,821,003)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	3,500	93,800.00	
		投資証券小計		3,500	93,800.00 (918,302)
香港ドル合計				93,800.00 (918,302)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	100	14,070.00	
		投資証券小計		100	14,070.00 (1,490,294)
ユーロ合計				14,070.00 (1,490,294)	
合計				18,959,889 (18,959,889)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 341銘柄	98.0%		55.2%
	投資証券 10銘柄		2.0%	1.2%
加ドル	株式 48銘柄	100.0%		5.7%
豪ドル	株式 31銘柄	94.5%		4.0%
	投資証券 3銘柄		5.5%	0.2%
英ポンド	株式 59銘柄	98.4%		10.8%
	投資証券 2銘柄		1.6%	0.2%
スイスフラン	株式 20銘柄	100.0%		4.2%
香港ドル	株式 15銘柄	93.3%		1.2%
	投資証券 1銘柄		6.7%	0.1%
シンガポールドル	株式 9銘柄	100.0%		0.8%
スウェーデンクローナ	株式 14銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.5%
デンマーククローネ	株式 5銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシェケル	株式 1銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 117銘柄	99.0%		13.7%
	投資証券 1銘柄		1.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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22年10月26日現在	平成23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		14,267,461	12,239,439
国債証券		27,754,346,676	23,977,123,895
地方債証券		2,632,304,000	2,205,615,000
特殊債券		3,554,777,000	3,112,968,968
社債券		3,344,688,000	2,535,618,000
未収入金		126,824,740	30,972,000
未収利息		114,979,217	96,696,343
前払費用		2,027,180	700,244
流動資産合計		37,544,214,274	31,971,933,889
資産合計		37,544,214,274	31,971,933,889
負債の部			
流動負債			
未払解約金		71,607,336	35,375,353
流動負債合計		71,607,336	35,375,353
負債合計		71,607,336	35,375,353
純資産の部			
元本等			
元本		30,762,768,556	25,987,788,436
剰余金			
剰余金又は欠損金()		6,709,838,382	5,948,770,100
元本等合計		37,472,606,938	31,936,558,536
純資産合計		37,472,606,938	31,936,558,536
負債純資産合計		37,544,214,274	31,971,933,889

(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21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23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）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 同左</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22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1. 期首	平成21年10月27日	1. 期首	平成22年10月27日
期首元本額	32,047,347,137円	期首元本額	30,762,768,556円
期首からの追加設定元本額	3,350,844,157円	期首からの追加設定元本額	1,834,319,535円
期首からの一部解約元本額	4,635,422,738円	期首からの一部解約元本額	6,609,299,655円
平成22年10月26日現在の元本の内訳		平成23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)	388,029,008円	DCインデックスバランス(株式20)	423,709,192円
DCインデックスバランス(株式40)	489,494,266円	DCインデックスバランス(株式40)	516,868,348円
DCインデックスバランス(株式60)	343,462,663円	DCインデックスバランス(株式60)	356,183,324円
DCインデックスバランス(株式80)	56,702,947円	DCインデックスバランス(株式80)	57,515,142円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,007,601,193円	インデックスファンド日本債券(DC専用)	942,608,257円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	12,249,463,950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	8,531,446,815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	8,345,587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	8,870,100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)	325,399,586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)	107,254,030円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,799,680円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,509,748円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,735,661円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	47,227,701円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	240,783,526円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	206,207,797円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	886,263,682円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	763,311,408円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	8,271,026,934円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,235,704,540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)	139,502,268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)	120,739,574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)	248,939,352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)	202,158,237円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	79,034,403円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	43,921,010円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	35,012,949円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	31,153,491円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	812,888,389円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	859,272,618円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	730,770,394円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	766,664,045円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	348,506,290円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	362,585,917円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	52,952,859円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	53,116,546円
年金積立 インデックスファンド日本債券	3,884,998,668円	年金積立 インデックスファンド日本債券	4,227,032,466円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	102,054,301円	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	116,728,130円
計	30,762,768,556円	計	25,987,788,436円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	30,762,768,556口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	25,987,788,436口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

[次へ](#)

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	800,205,260
地方債証券	57,427,000
特殊債券	52,026,000
社債券	72,296,000
合計	981,954,260

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	44,567,740
地方債証券	21,255,000
特殊債券	24,866,000
社債券	88,142,000
合計	178,830,740

(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22年10月26日現在	平成23年10月26日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2181円 (12,181円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2289円 (12,289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

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第297回利付国債(2年)	21,000,000	20,997,945	
	第298回利付国債(2年)	260,000,000	259,958,400	
	第301回利付国債(2年)	70,000,000	70,072,100	
	第302回利付国債(2年)	120,000,000	120,122,400	
	第304回利付国債(2年)	70,000,000	70,074,900	
	第307回利付国債(2年)	40,000,000	40,046,400	
	第308回利付国債(2年)	220,000,000	219,854,800	
	第68回利付国債(5年)	170,000,000	171,890,400	
	第69回利付国債(5年)	483,000,000	487,274,550	
	第70回利付国債(5年)	227,000,000	229,115,640	
	第71回利付国債(5年)	45,000,000	45,729,900	
	第72回利付国債(5年)	30,000,000	30,668,100	
	第74回利付国債(5年)	57,000,000	57,804,270	
	第75回利付国債(5年)	176,000,000	179,180,320	
	第76回利付国債(5年)	138,000,000	140,766,900	
	第78回利付国債(5年)	113,000,000	114,804,610	
	第79回利付国債(5年)	143,000,000	144,674,530	
	第81回利付国債(5年)	444,000,000	450,691,080	
	第83回利付国債(5年)	62,000,000	63,179,240	
	第84回利付国債(5年)	27,000,000	27,371,790	
	第85回利付国債(5年)	47,000,000	47,695,130	
	第87回利付国債(5年)	80,000,000	80,735,200	
	第88回利付国債(5年)	245,000,000	247,261,350	
	第89回利付国債(5年)	210,000,000	211,171,800	
	第90回利付国債(5年)	50,000,000	50,099,000	
	第91回利付国債(5年)	80,000,000	80,400,000	
	第92回利付国債(5年)	15,000,000	15,017,250	
	第93回利付国債(5年)	300,000,000	302,574,000	
	第94回利付国債(5年)	70,000,000	70,886,900	
	第95回利付国債(5年)	220,000,000	222,758,800	
	第97回利付国債(5年)	220,000,000	220,701,800	
	第98回利付国債(5年)	55,000,000	54,924,650	
	第99回利付国債(5年)	150,000,000	150,360,000	
	第2回利付国債(40年)	205,000,000	208,419,400	
	第4回利付国債(40年)	30,000,000	30,255,300	
	第245回利付国債(10年)	160,000,000	161,416,000	
	第247回利付国債(10年)	17,000,000	17,158,440	
	第250回利付国債(10年)	285,000,000	286,695,750	
	第251回利付国債(10年)	227,000,000	229,832,960	

第252回利付国債(10年)	228,000,000	231,217,080	
第253回利付国債(10年)	35,000,000	35,965,300	
第254回利付国債(10年)	52,000,000	53,238,120	
第256回利付国債(10年)	88,000,000	90,342,560	
第258回利付国債(10年)	40,000,000	41,082,400	
第259回利付国債(10年)	7,000,000	7,222,670	
第261回利付国債(10年)	270,000,000	281,510,100	
第262回利付国債(10年)	85,000,000	88,846,250	
第264回利付国債(10年)	221,000,000	229,347,170	
第265回利付国債(10年)	100,000,000	104,036,000	
第266回利付国債(10年)	118,000,000	122,394,320	
第268回利付国債(10年)	361,000,000	376,454,410	
第269回利付国債(10年)	90,000,000	93,248,100	
第270回利付国債(10年)	88,000,000	91,344,880	
第271回利付国債(10年)	146,000,000	151,023,860	
第272回利付国債(10年)	178,000,000	185,737,660	
第273回利付国債(10年)	111,000,000	116,252,520	
第274回利付国債(10年)	73,000,000	76,610,580	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	36,874,250	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	85,172,800	
第279回利付国債(10年)	70,000,000	75,132,400	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	167,258,520	
第281回利付国債(10年)	182,000,000	195,921,180	
第282回利付国債(10年)	274,000,000	291,914,120	
第283回利付国債(10年)	50,000,000	53,509,500	
第284回利付国債(10年)	67,000,000	71,545,950	
第285回利付国債(10年)	216,000,000	231,102,720	
第286回利付国債(10年)	156,000,000	168,035,400	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	37,903,600	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,318,140	
第289回利付国債(10年)	254,000,000	269,844,520	
第290回利付国債(10年)	446,000,000	471,413,080	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	301,482,020	
第292回利付国債(10年)	241,000,000	259,289,490	
第293回利付国債(10年)	126,000,000	136,519,740	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,466,240	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,830,440	
第296回利付国債(10年)	196,000,000	208,563,600	
第297回利付国債(10年)	188,000,000	198,836,320	
第298回利付国債(10年)	241,000,000	253,151,220	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	787,395,000	
第300回利付国債(10年)	31,000,000	32,995,780	
第301回利付国債(10年)	148,000,000	157,380,240	
第302回利付国債(10年)	79,000,000	83,431,110	
第303回利付国債(10年)	361,000,000	380,739,480	
第305回利付国債(10年)	358,000,000	374,102,840	
第306回利付国債(10年)	115,000,000	120,847,750	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	145,653,200	
第309回利付国債(10年)	162,000,000	165,790,800	

第310回利付国債(10年)	268,000,000	271,320,520	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	92,538,720	
第312回利付国債(10年)	15,000,000	15,405,900	
第313回利付国債(10年)	340,000,000	351,461,400	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	86,875,100	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	35,447,650	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	166,709,400	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	230,299,680	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	182,437,920	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	61,940,450	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	177,926,960	
第26回利付国債(30年)	140,000,000	154,634,200	
第27回利付国債(30年)	134,000,000	150,830,400	
第28回利付国債(30年)	54,000,000	60,815,880	
第29回利付国債(30年)	246,000,000	272,002,200	
第30回利付国債(30年)	127,000,000	137,511,790	
第31回利付国債(30年)	20,000,000	21,209,600	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	43,269,200	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	50,743,000	
第34回利付国債(30年)	90,000,000	95,180,400	
第35回利付国債(30年)	40,000,000	40,454,000	
第23回利付国債(20年)	100,000,000	110,091,000	
第26回利付国債(20年)	37,000,000	41,582,450	
第27回利付国債(20年)	16,000,000	18,211,680	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	126,667,200	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	45,551,200	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	233,550,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	99,121,050	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	72,783,900	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	97,321,900	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,718,010	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	203,601,740	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	85,419,490	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,085,430	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,411,010	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	112,949,100	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,030,600	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	257,628,480	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	42,728,790	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,718,250	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	72,243,600	
第57回利付国債(20年)	137,000,000	148,424,430	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	146,140,200	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	34,999,140	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	561,219,200	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	26,565,570	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,084,750	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,174,200	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	150,620,400	

第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,199,460	
第67回利付国債(20年)	54,000,000	58,012,740	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	42,142,000	
第70回利付国債(20年)	49,000,000	55,451,340	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	46,039,140	
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,076,270	
第74回利付国債(20年)	78,000,000	85,432,620	
第76回利付国債(20年)	206,000,000	220,214,000	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	333,402,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	171,163,200	
第91回利付国債(20年)	200,000,000	221,902,000	
第92回利付国債(20年)	210,000,000	227,083,500	
第94回利付国債(20年)	100,000,000	107,971,000	
第95回利付国債(20年)	182,000,000	201,204,640	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	105,580,300	
第97回利付国債(20年)	195,000,000	212,649,450	
第98回利付国債(20年)	44,000,000	47,356,320	
第99回利付国債(20年)	97,000,000	104,222,620	
第100回利付国債(20年)	140,000,000	152,187,000	
第101回利付国債(20年)	96,000,000	107,221,440	
第102回利付国債(20年)	106,000,000	118,385,040	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,123,100	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,400,090	
第105回利付国債(20年)	82,000,000	87,859,720	
第106回利付国債(20年)	142,000,000	154,250,340	
第107回利付国債(20年)	30,000,000	32,103,600	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	139,405,560	
第109回利付国債(20年)	119,000,000	123,602,920	
第110回利付国債(20年)	148,000,000	158,172,040	
第111回利付国債(20年)	90,000,000	97,426,800	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	21,316,600	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	55,343,600	
第116回利付国債(20年)	185,000,000	199,633,500	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	31,904,100	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	73,283,000	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	50,743,500	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	68,814,200	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	22,661,320	
第122回利付国債(20年)	80,000,000	81,027,200	
第123回利付国債(20年)	25,000,000	26,501,250	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	52,165,500	
第125回利付国債(20年)	80,000,000	86,082,400	
第126回利付国債(20年)	50,000,000	52,148,500	
第128回利付国債(20年)	20,000,000	20,513,200	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	20,190,200	
第130回利付国債(20年)	100,000,000	100,961,000	
国債証券 合計	22,758,000,000	23,977,123,895	

地方債証券	第597回東京都公募公債	100,000,000	100,644,000	
	第598回東京都公募公債	100,000,000	100,513,000	
	第636回東京都公募公債	100,000,000	107,566,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	103,919,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,673,000	
	第123回神奈川県公募公債	100,000,000	102,667,000	
	第1回大阪府公募公債(7年)	100,000,000	102,757,000	
	第261回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,561,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	107,615,000	
	平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	102,375,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,145,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,482,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	108,043,000	
	平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,158,000	
	平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	104,639,000	
	平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,618,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,842,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,112,000	
	平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,745,000	
	第12回め号名古屋市公募公債	100,000,000	104,230,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	107,311,000	
地方債証券 合計		2,100,000,000	2,205,615,000	
特殊債券	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,385,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,666,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,957,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,616,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	103,703,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,622,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	103,708,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	104,192,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,693,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,744,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	103,570,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	107,401,000	
	第820回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,137,772	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,812,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,161,000	
	第20回中小企業債券	100,000,000	100,648,196	
	第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,687,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,937,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,665,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	207,330,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,086,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,654,000	
	い第709号農林債	100,000,000	102,059,000	
	い第714号農林債	100,000,000	101,521,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,337,000	

	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,267,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,352,000	
	第234回信金中金債(5年)	100,000,000	102,058,000	
特殊債券 合計		3,000,000,000	3,112,968,968	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	114,950,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	99,950,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	97,913,000	
	第32回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,618,000	
	第6回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,501,000	
	第16回太平洋セメント株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,467,000	
	第49回新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,912,000	
	第20回三菱マテリアル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,992,000	
	第15回株式会社豊田自動織機無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,765,000	
	第15回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,423,000	
	第11回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,467,000	
	第17回三菱重工工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,744,000	
	第26回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	107,068,000	
	第65回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	100,505,000	
	第31回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,095,000	
	第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	108,100,000	
	第25回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	111,892,000	
	第47回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	100,900,000	
	第7回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,702,000	
	第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	80,119,000	
	第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	65,024,000	
	第461回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,764,000	
	第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,122,000	
	第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,931,000	
	第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,694,000	

社債券 合計	2,500,000,000	2,535,618,000	
合計	30,358,000,000	31,831,325,863	

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22年10月26日現在	平成23年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		840,571,803	877,024,236
コール・ローン		83,641,208	57,631,052
国債証券		585,998,483,362	451,984,941,922
派生商品評価勘定		4,740,769	954,178
未収入金		716,979,210	919,079,566
未収利息		7,018,318,388	5,712,615,059
前払費用		356,017,201	195,740,478
流動資産合計		595,018,751,941	459,747,986,491
資産合計		595,018,751,941	459,747,986,491
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		82,410	1,216,348
未払解約金		755,304,389	983,367,478
流動負債合計		755,386,799	984,583,826
負債合計		755,386,799	984,583,826
純資産の部			
元本等			
元本		410,189,621,640	328,307,863,758
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		184,073,743,502	130,455,538,907
元本等合計		594,263,365,142	458,763,402,665
純資産合計		594,263,365,142	458,763,402,665
負債純資産合計		595,018,751,941	459,747,986,491

(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21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23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）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られ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られ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 同左</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 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 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 「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>

[次へ](#)

（貸借対照表に関する注記）

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1. 期首	平成21年10月27日	1. 期首	平成22年10月27日
期首元本額	449,277,081,384円	期首元本額	410,189,621,640円
期首からの追加設定元本額	8,920,901,490円	期首からの追加設定元本額	13,628,129,297円
期首からの一部解約元本額	48,008,361,234円	期首からの一部解約元本額	95,509,887,179円
平成22年10月26日現在の元本の内訳		平成23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）	8,849,948,042円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	9,633,553,500円
DCインデックスバランス（株式20）	49,187,094円	DCインデックスバランス（株式20）	57,256,999円
DCインデックスバランス（株式40）	89,554,451円	DCインデックスバランス（株式40）	100,709,226円
DCインデックスバランス（株式60）	112,983,693円	DCインデックスバランス（株式60）	124,636,684円
DCインデックスバランス（株式80）	93,970,833円	DCインデックスバランス（株式80）	100,852,481円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	225,223,007,785円	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	187,390,740,040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	10,242,566,040円	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	7,487,871,813円
日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	144,889,238,618円	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	104,969,488,141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	51,255,807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	48,580,292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）	1,504,839,282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）	1,425,651,209円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	5,135,051円	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	10,057,099円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	222,618,134円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（債券資産）	76,715,712円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,304,227円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,525,478円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	8,756,942円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	8,247,647円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	22,154,363円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	20,058,227円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	56,414,494円	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	51,489,457円
世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	2,818,081,237円	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,462,974,398円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,299,362,018円	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,125,182,549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)	159,927,712円	世界アセットバランス ファンド40(適格機関投 資家向け)	148,756,891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)	232,958,379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)	203,306,467円
3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	64,943,397円	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	37,440,232円
グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	66,195,683円	グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	61,780,456円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式20)	51,923,379円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式20)	57,928,997円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	67,179,164円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	74,856,500円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	57,748,422円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	63,788,903円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	43,776,744円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	46,675,278円
年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし)	12,696,715,761円	年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし)	12,293,693,031円
海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	201,874,888円	海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	219,046,051円
計	410,189,621,640円	計	328,307,863,758円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	410,189,621,640口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	328,307,863,758口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	20,185,980,884
合計	20,185,980,884

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,852,276,907
合計	2,852,276,907

（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）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成22年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,483,043,159		1,478,384,800	4,658,359
	米ドル	296,349,910		294,591,500	1,758,410
	英ポンド	44,878,592		44,704,000	174,592
	デンマーククローネ	35,890,597		35,575,600	314,997
	ポーランドズロチ	78,622,290		78,671,700	49,410
	ユーロ	1,027,301,770		1,024,842,000	2,459,770
合計	1,483,043,159		1,478,384,800	4,658,359	

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建	1,515,052,770		1,515,314,940	262,170
	米ドル	386,694,880		385,877,700	817,180
	英ポンド	98,606,905		98,730,900	123,995
	スウェーデンクローナ	25,222,678		25,183,600	39,078
	ノルウェークローネ	46,320,852		46,632,640	311,788
	ポーランドズロチ	36,295,500		36,465,000	169,500
	ユーロ	921,911,955		922,425,100	513,145
合計	1,515,052,770		1,515,314,940	262,170	

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4488円	1口当たり純資産額	1.3974円
（1万口当たり純資産額）	（14,488円）	（1万口当たり純資産額）	（13,974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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	22,000,000	26,320,937.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000	11,244,195.31	
		US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	37,200,000	42,245,250.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	3,000,000	3,121,406.25	
		US TREASURY N/B-1.875%-15/06/30	14,300,000	14,945,734.37	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	14,300,000	15,077,562.50	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000	25,983,890.62	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	15,000,000	16,000,781.25	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	17,500,000	18,662,109.37	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	20,700,000	21,964,640.62	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	17,000,000	18,933,750.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	22,400,000	26,208,000.00	
		US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,718,125.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	22,400,000	25,242,000.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	15,200,000	16,252,125.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	11,100,000	12,019,218.75	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	11,268,750.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	14,100,000	16,611,562.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000	7,721,875.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	14,200,000	15,753,125.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000	5,918,062.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	15,350,000	18,122,593.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	11,900,000	13,117,890.62	
		US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	18,100,000	19,118,125.00	
		US TREASURY N/B-7.625%-25/02/15	3,000,000	4,742,343.75	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	4,050,468.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-16/03/31	9,200,000	9,813,812.50	
		US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,500,000	10,143,046.87	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	10,300,000	14,411,953.12	
		US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	11,850,000.00	
		US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	5,933,125.00	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000	18,429,375.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	40,500,000	46,005,468.75	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000	2,111,562.50	
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,387,093.75	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	34,500,000	38,968,828.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	46,300,000	52,767,531.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	30,400,000	34,964,750.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	6,800,000	7,328,062.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	22,800,000	25,411,312.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	8,700,000	9,372,890.62	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	33,500,000	38,739,609.37	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	27,000,000	30,248,437.50	
		US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,245,468.75	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	26,200,000	29,835,250.00			
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	32,200,000	35,475,343.75			
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	19,600,000	21,100,625.00			

US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,522,656.25	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	16,500,000	18,887,343.75	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,900,000	20,783,578.12	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	17,550,000	20,204,437.50	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	27,000,000	32,134,218.75	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	16,800,000	20,335,875.00	
US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	18,500,000	19,744,414.06	
US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	10,500,000	11,017,617.18	
US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	27,400,000	28,902,718.75	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,570,625.00	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	6,000,000	6,693,750.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	10,500,000	13,001,953.12	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	19,500,000	23,643,750.00	
US TREASURY N/B-2.5%-13/03/31	12,800,000	13,217,000.00	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	21,500,000	26,589,453.12	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	18,300,000	23,486,906.25	
US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	16,900,000	17,494,140.62	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	21,000,000	26,430,468.75	
US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	16,600,000	17,024,078.12	
US TREASURY N/B-3.125%-13/08/31	41,100,000	43,267,382.81	
US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	34,400,000	36,867,125.00	
US TREASURY N/B-3.375%-13/07/31	12,500,000	13,189,453.12	
US TREASURY N/B-1.0%-13/07/15	8,500,000	8,610,234.37	
US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	31,650,000	33,319,042.96	
US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	9,500,000	9,639,531.25	
US TREASURY N/B-3.5%-13/05/31	22,900,000	24,095,093.75	
US TREASURY N/B-1.375%-13/05/15	11,500,000	11,704,843.75	
US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	43,200,000	45,474,750.00	
US TREASURY N/B-3.125%-13/04/30	14,600,000	15,238,750.00	
US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	16,500,000	16,869,960.93	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	19,000,000	23,462,031.25	
US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	10,700,000	11,728,203.12	
US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	21,200,000	22,419,000.00	
US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	23,100,000	24,404,789.06	
US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	24,000,000	25,325,625.00	
US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	13,000,000	14,399,531.25	
US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	17,000,000	18,037,265.62	
US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	14,000,000	14,835,625.00	
US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	6,600,000	6,918,656.25	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	13,400,000	14,857,250.00	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,600,000	1,733,750.00	
US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	13,457,625.00	
US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	22,000,000	23,790,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	11,900,000	13,117,890.62	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	20,800,000	27,290,250.00	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	9,800,000	10,740,187.50	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	12,000,000	14,214,375.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	12,000,000	13,291,875.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	11,000,000	12,184,218.75	
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	10,600,000	11,731,218.75	
US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	30,550,000	33,948,687.50	
US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	4,000,000	4,150,937.50	
US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	9,700,000	10,028,890.62	
US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	11,300,000	11,704,328.12	

		US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	36,280,000	39,341,125.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,244,187.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	15,000,000	17,643,750.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-12/11/30	13,350,000	13,818,292.96	
		US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	3,987,140.62	
		US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	6,000,000	8,788,125.00	
		US TREASURY N/B-6.375%-27/08/15	4,000,000	5,893,125.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-13/02/15	17,050,000	17,867,867.18	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	21,100,000	21,426,390.62	
		US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	10,000,000	10,340,625.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	24,100,000	24,453,968.75	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	8,300,000	11,643,343.75	
		US TREASURY N/B-1.125%-12/12/15	26,600,000	26,888,859.37	
		US TREASURY N/B-6.75%-26/08/15	3,310,000	4,977,412.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-12/11/15	17,100,000	17,301,726.56	
		US TREASURY N/B-4.0%-12/11/15	14,400,000	14,971,500.00	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	7,100,000	10,612,281.25	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	6,700,000	9,665,796.87	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	4,870,000	6,654,398.43	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	5,100,000	6,801,328.12	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	7,700,000	10,279,500.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-12/12/31	29,800,000	31,022,265.62	
		US TREASURY N/B-4.25%-12/09/30	10,000,000	10,378,906.25	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	9,700,000	11,044,359.37	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	4,500,000	6,176,953.12	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	13,000,000	16,264,218.74	
		US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	7,200,000	9,347,625.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	10,500,000	14,127,421.87	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	10,200,000	12,566,718.75	
		US TREASURY N/B-6.625%-27/02/15	4,000,000	5,986,250.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	4,450,000	4,752,460.93	
		US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,514,062.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-12/10/15	10,000,000	10,115,625.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-12/10/31	9,800,000	10,166,734.37	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	10,000,000	10,162,500.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/02/28	10,900,000	11,273,835.93	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	13,100,000	16,458,921.87	
	国債証券小計		2,089,160,000	2,364,601,974.75 (179,993,502,317)	
米ドル合計				2,364,601,974.75 (179,993,502,317)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	7,350,000	10,027,605.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	6,350,000	9,215,882.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	4,000,000	5,631,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-23/06/01	2,900,000	4,528,495.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,000,000	1,083,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	5,750,000	6,347,195.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	4,600,000	7,718,478.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	8,000,000	8,987,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	1,430,000	2,486,984.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-13/03/01	3,800,000	3,839,976.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	9,150,000	10,172,055.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	8,700,000	9,113,772.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	5,700,000	6,560,358.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	11,600,000	12,744,688.00	

CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	6,700,000	6,854,837.00	
-----------------------------------	-----------	--------------	--

[次へ](#)

		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,395,979.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-13/09/01	6,300,000	6,473,754.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-13/06/01	10,100,000	10,501,778.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,000,000	2,127,500.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	12,350,000	13,734,311.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	5,400,000	6,079,806.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	6,650,000	8,039,850.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/12/01	2,000,000	2,012,140.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	14,500,000	15,477,010.00	
	国債証券小計		148,630,000	172,154,414.00 (12,875,428,623)	
加ドル合計				172,154,414.00 (12,875,428,623)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	4,500,000	4,644,468.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	3,750,000	4,108,863.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-12/11/15	4,300,000	4,328,251.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	4,700,000	4,833,334.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	7,900,000	8,192,750.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	6,200,000	6,560,871.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	2,700,000	2,740,516.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	8,000,000	8,577,672.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	7,600,000	7,635,545.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	6,900,000	7,298,626.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,300,000	1,388,725.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	8,700,000	9,460,884.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	6,450,000	7,066,942.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,800,000	1,935,471.60		
	国債証券小計		74,800,000	78,772,922.25 (6,217,546,753)	
豪ドル合計				78,772,922.25 (6,217,546,753)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.0%-16/01/22	1,900,000	1,958,685.30	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	3,200,000	3,547,696.06	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	8,750,000	10,124,266.42	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	7,000,000	8,101,734.83	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	6,600,000	8,417,499.22	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	14,530,000	16,537,296.83	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	10,000,000	10,572,869.20	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	14,050,000	15,709,330.99	
		UK TREASURY-2.25%-14/03/07	11,300,000	11,713,154.32	
		UK TREASURY-8.0%-13/09/27	2,800,000	3,194,027.73	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	13,200,000	13,902,139.15	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	8,600,000	9,749,134.49	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	1,942,117.40	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	9,700,000	11,545,611.04	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	8,440,000	10,516,127.83	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	6,300,000	8,820,331.69	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	7,900,000	9,734,375.41	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	7,750,000	9,242,483.37	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	8,900,000	10,286,816.77	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	8,100,000	10,120,900.67	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	7,500,000	8,677,979.70	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	8,950,000	10,883,612.67	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	11,000,000	12,932,059.58	

		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	8,400,000	9,919,439.20	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	8,700,000	12,838,340.74	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	4,400,000	4,888,645.69	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	12,100,000	13,588,287.05	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	5,300,000	7,393,906.13	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	5,300,000	6,329,829.22	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	9,300,000	10,873,693.82	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	10,100,000	11,264,699.37	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	11,000,000	13,101,128.26	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	7,450,000	8,593,804.53	
	国債証券小計		270,220,000	317,022,024.68 (38,644,984,808)	
英債券合計				317,022,024.68 (38,644,984,808)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	6,050,000	6,624,828.65	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	1,330,000	1,834,075.32	
		SWITZERLAND-4.0%-13/02/11	890,000	934,490.21	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	2,200,000	2,516,606.40	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	4,070,000	4,445,583.67	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	1,600,000	1,852,422.40	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	4,950,000	6,423,506.10	
	国債証券小計		21,090,000	24,631,512.75 (2,134,320,579)	
スイスフラン合計				24,631,512.75 (2,134,320,579)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	1,950,000	2,253,874.98	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	2,450,000	2,754,861.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-13/04/01	1,300,000	1,326,357.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	1,470,000	1,601,907.99	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	2,300,000	2,581,673.34	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	3,000,000	3,102,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	800,000	857,066.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	2,300,000	2,708,326.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	1,000,000	1,078,033.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	2,750,000	3,139,675.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,950,000	2,116,773.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000	616,999.99	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-12/10/01	2,620,000	2,675,107.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	2,770,000	3,013,113.67	
	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,104,933.33		
国債証券小計		28,260,000	30,931,005.16 (1,860,809,270)		
シンガポールドル合計				30,931,005.16 (1,860,809,270)	
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,800,000	4,329,986.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	7,900,000	8,257,475.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.21%-13/05/31	3,900,000	3,911,380.90	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	2,650,000	3,040,063.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	4,000,000	4,176,200.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,037,474.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	4,800,000	4,959,600.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	6,500,000	6,567,437.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	2,800,000	2,625,274.45	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	4,000,000	4,056,800.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	6,200,000	6,516,500.57	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	9,000,000	9,481,779.81	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	4,000,000	4,104,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	4,500,000	4,566,321.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	6,000,000	6,245,238.48	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	5,000,000	5,050,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	14,900,000	15,608,339.74	
	国債証券小計		91,950,000	95,533,871.00 (2,317,651,710)	
マレーシアリングット合計				95,533,871.00 (2,317,651,710)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	28,380,000	31,488,668.57	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	19,600,000	23,717,639.34	
		SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	38,300,000	43,113,038.44	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	21,900,000	23,453,949.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	23,200,000	25,853,394.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	31,400,000	36,813,531.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	32,500,000	40,962,723.41	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	16,700,000	19,136,262.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.5%-12/10/08	28,600,000	29,898,282.98	
	国債証券小計		240,580,000	274,437,491.24 (3,186,219,273)	
スウェーデンクローナ合計				274,437,491.24 (3,186,219,273)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	12,550,000	13,841,269.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	11,000,000	12,581,459.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	23,900,000	26,430,245.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	16,700,000	18,565,214.81	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	27,400,000	29,370,087.40	
	国債証券小計		91,550,000	100,788,275.91 (1,387,854,559)	
ノルウェークローネ合計				100,788,275.91 (1,387,854,559)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	45,600,000	52,135,574.40	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-12/11/15	31,900,000	32,974,519.60	
		KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	37,600,000	40,793,668.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	54,300,000	60,267,570.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	25,600,000	29,037,516.80	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	13,750,000	20,382,023.75	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	48,400,000	64,542,803.60	
	国債証券小計		257,150,000	300,133,676.95 (4,270,902,222)	
デンマーククローネ合計				300,133,676.95 (4,270,902,222)	

メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	87,000,000	91,483,097.82	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	33,200,000	36,536,168.72	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	31,700,000	40,288,000.42	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	81,300,000	92,166,616.52	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	77,000,000	100,574,397.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	62,500,000	70,631,999.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	48,800,000	54,649,901.95	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	75,000,000	85,369,654.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	73,000,000	78,173,948.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	43,200,000	47,316,245.90		
	国債証券小計		612,700,000	697,190,030.20 (3,918,207,969)	
メキシコペソ合計				697,190,030.20 (3,918,207,969)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	5,000,000	4,912,150.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	8,300,000	8,301,245.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/04/25	35,200,000	35,585,440.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	13,000,000	12,912,250.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	13,500,000	13,478,400.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	11,500,000	11,482,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	10,600,000	10,812,530.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	12,800,000	13,111,680.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	14,300,000	14,421,550.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	12,900,000	13,504,365.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	11,100,000	10,750,350.00		
	国債証券小計		148,200,000	149,272,710.00 (3,630,312,307)	
ポーランドズロチ合計				149,272,710.00 (3,630,312,307)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	4,100,000	4,121,088.35	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	5,900,000	6,065,244.84	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	7,300,000	7,541,201.48	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-12/12/24	4,400,000	4,698,416.80	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	3,950,000	3,984,923.53	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	3,300,000	3,802,464.93	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	5,900,000	6,000,720.08	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,457,185.65	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	5,300,000	5,481,868.44	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	5,600,000	6,069,307.44	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-13/03/28	5,100,000	5,220,215.67	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	4,950,000	4,940,980.11	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	8,200,000	7,942,259.24	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	5,300,000	5,276,464.29	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	5,800,000	5,651,145.90	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,900,000	1,881,373.73	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	7,300,000	8,002,038.08	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	7,250,000	7,466,309.55	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	3,350,000	3,038,354.86	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	7,340,000	7,224,505.83	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	6,000,000	6,060,501.00			

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	13,300,000	12,639,648.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	7,300,000	6,871,876.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	8,850,000	8,620,067.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	2,200,000	2,145,485.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	8,300,000	7,562,964.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	9,300,000	8,936,180.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	4,200,000	3,295,396.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	7,600,000	7,142,742.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	6,300,000	6,053,435.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	8,100,000	7,653,760.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	7,500,000	5,558,335.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	8,150,000	7,761,910.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	4,200,000	4,179,513.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	13,100,000	13,148,025.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	7,000,000	6,813,758.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.75%-14/07/30	9,100,000	9,219,075.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-14/01/31	11,700,000	11,735,243.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-13/10/31	1,000,000	970,951.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-13/07/30	11,450,000	11,487,234.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.3%-13/04/30	4,500,000	4,390,733.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.15%-13/01/31	9,750,000	9,998,970.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-12/10/31	4,500,000	4,497,306.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	8,050,000	8,281,710.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	5,200,000	4,757,985.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,246,094.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	4,100,000	3,601,682.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	7,600,000	6,169,449.72	
BUNDESOBLIGATION-2.25%-15/04/10	5,500,000	5,759,729.80	
BUNDESOBLIGATION-2.25%-14/04/11	7,000,000	7,285,444.60	

BUNDESobligation-2.5%-15/02/27	8,900,000	9,382,313.25	
BUNDESobligation-4.0%-13/10/11	9,800,000	10,451,618.66	
BUNDESobligation-3.5%-13/04/12	18,500,000	19,300,385.85	
BUNDESobligation-2.5%-14/10/10	5,750,000	6,044,406.90	
BUNDESobligation-4.25%-12/10/12	18,600,000	19,271,102.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	9,800,000	11,002,174.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	14,500,000	15,832,980.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	8,900,000	10,404,459.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	10,200,000	11,706,634.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	11,200,000	12,600,328.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	13,600,000	14,813,782.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	12,700,000	13,773,910.73	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	4,780,000	6,073,107.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	12,060,000	13,608,879.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	4,400,000	5,329,804.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	29,200,000	32,124,114.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	12,900,000	14,294,377.77	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	8,750,000	10,106,204.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	8,800,000	9,275,550.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	9,000,000	11,869,226.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	11,300,000	12,881,572.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	13,200,000	14,245,364.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	11,500,000	12,580,602.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	9,800,000	11,867,652.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	8,500,000	10,847,414.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	8,100,000	11,202,947.19	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	7,600,000	10,511,304.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	12,500,000	13,832,055.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	6,550,000	9,112,372.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	4,650,000	6,964,114.35	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	20,300,000	21,275,096.29	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	7,600,000	11,345,456.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	8,200,000	11,538,051.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	5,800,000	6,366,586.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	13,000,000	11,389,917.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	16,000,000	15,600,660.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	10,900,000	10,143,598.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	20,150,000	20,069,178.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	13,500,000	13,306,619.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	9,600,000	9,004,505.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	20,200,000	18,911,437.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	23,200,000	22,200,386.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-12/12/15	5,700,000	5,566,823.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	6,700,000	6,257,525.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	10,290,000	9,294,557.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	15,300,000	15,015,588.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	5,500,000	5,319,801.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	19,300,000	18,894,479.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-13/06/01	2,900,000	2,793,023.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/04/15	12,800,000	12,764,652.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	11,500,000	11,546,063.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	18,800,000	15,865,060.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,488,407.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	7,000,000	7,412,248.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	9,692,605.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	8,400,000	6,686,015.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	12,400,000	9,905,346.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	8,700,000	6,182,042.52	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	9,800,000	7,950,656.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	8,800,000	7,851,267.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	15,800,000	14,592,808.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	10,900,000	9,930,677.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	10,600,000	10,487,714.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	11,600,000	10,723,832.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	15,000,000	13,156,881.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	11,900,000	11,165,038.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	7,700,000	7,080,989.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	11,650,000	10,231,906.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	11,300,000	10,150,700.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	9,700,000	8,880,652.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-12/10/15	8,800,000	8,816,441.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	10,800,000	9,355,345.56	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07/04	3,350,000	3,609,516.46	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	4,350,000	4,839,433.29	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	2,550,000	2,733,186.13	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	2,900,000	3,318,652.41	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	3,550,000	3,927,734.55	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,200,000	1,295,120.99	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,180,000	1,190,664.01	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	4,550,000	5,025,902.70	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	3,100,000	3,283,556.89	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	11,000,000	13,916,795.20	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	12,270,000	14,894,852.38	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	9,800,000	12,389,133.54	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	14,000,000	15,137,165.40	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	9,000,000	13,333,819.50	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	6,000,000	6,035,508.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	7,800,000	8,823,816.30	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	2,300,000	2,195,998.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	8,300,000	8,286,425.35	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	13,900,000	14,409,020.78	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	22,400,000	23,536,219.84	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-12/10/25	8,900,000	9,237,603.70	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	17,550,000	18,615,213.04	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	13,900,000	15,227,260.96	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	8,400,000	9,207,003.12	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	10,500,000	11,375,779.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	10,600,000	11,637,490.90	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	10,000,000	10,712,476.00	

FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	14,600,000	16,514,654.22	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	10,150,000	10,291,889.89	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	18,360,000	19,133,727.12	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	6,550,000	9,143,549.79	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	11,900,000	12,760,327.16	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	12,000,000	12,772,935.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	19,400,000	20,464,351.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	10,900,000	11,387,940.68	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-12/12/26	4,360,000	4,734,025.65	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	3,600,000	3,592,376.28	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	8,700,000	9,556,951.74	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	22,700,000	23,867,890.03	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	9,200,000	9,732,568.68	
FRANCE(GOVT OF)-3.5%-26/04/25	7,000,000	6,890,664.20	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-13/01/12	9,100,000	9,408,096.88	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,611,120.96	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	7,100,000	7,298,464.17	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	6,600,000	6,874,431.30	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	8,810,000	9,043,643.84	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	17,800,000	18,846,408.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	4,450,000	5,247,949.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,000,000	1,065,427.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	6,100,000	8,186,455.59	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	5,650,000	6,766,116.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	6,800,000	7,649,323.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	5,500,000	8,101,618.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	7,200,000	8,078,401.44	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	10,500,000	11,129,761.65	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	9,800,000	10,674,146.28	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	8,100,000	8,991,305.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	4,400,000	4,876,392.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	7,550,000	7,912,803.17	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-13/01/15	5,100,000	5,168,118.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	7,120,000	7,614,390.01	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	8,450,000	9,060,840.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	7,800,000	8,913,714.42	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	5,150,000	5,550,934.19	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	5,600,000	5,908,478.24	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	5,700,000	6,057,958.29	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	5,500,000	5,793,077.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	3,600,000	4,774,595.76	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	6,280,000	6,741,040.54	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	3,550,000	4,083,371.88	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	5,000,000	5,443,975.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	6,300,000	6,568,307.55	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	2,700,000	2,829,047.31	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	3,550,000	3,917,288.68	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	5,600,000	6,287,056.72	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	5,700,000	6,304,265.55	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	3,400,000	3,563,192.86	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	5,350,000	5,800,491.93	
国債証券小計	1,732,110,000	1,808,413,911.75 (191,547,201,532)	
ユーロ合計		1,808,413,911.75 (191,547,201,532)	

合計		451,984,941,922 (451,984,941,922)	
----	--	--------------------------------------	--

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 138銘柄	100.0%	39.8%
加ドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.8%
豪ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	1.4%
英ポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	8.6%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
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git	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 200銘柄	100.0%	42.4%

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22年10月26日現在	平成23年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		67,523,893	64,127,913
コール・ローン		718,308,802	725,396,721
国債証券		29,610,061,407	26,450,255,507
派生商品評価勘定		632,749,845	192,302,571
未収入金		690	185,434,457
未収利息		345,692,679	290,392,138
前払費用		28,371,455	29,301,442
流動資産合計		31,402,708,771	27,937,210,749
資産合計		31,402,708,771	27,937,210,749
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		644,445,478	341,783,049
未払金		154,668	
未払解約金		1,792,188	1,023,347
流動負債合計		646,392,334	342,806,396
負債合計		646,392,334	342,806,396
純資産の部			
元本等			
元本		24,647,191,029	21,844,897,199
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		6,109,125,408	5,749,507,154
元本等合計		30,756,316,437	27,594,404,353
純資産合計		30,756,316,437	27,594,404,353
負債純資産合計		31,402,708,771	27,937,210,749

(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21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23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）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 同左</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 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 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 「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>

[次へ](#)

(貸借対照表に関する注記)

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1. 期首	平成21年10月27日	1. 期首	平成22年10月27日
期首元本額	24,087,399,964円	期首元本額	24,647,191,029円
期首からの追加設定元本額	4,111,777,417円	期首からの追加設定元本額	2,252,487,323円
期首からの一部解約元本額	3,551,986,352円	期首からの一部解約元本額	5,054,781,153円
平成22年10月26日現在の元本の内訳		平成23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)	447,657,497円	インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用)	489,921,232円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,584,894円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,258,683円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	10,283,159円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	9,172,905円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	26,116,094円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	22,267,796円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	66,470,527円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	57,014,826円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	21,639,487,030円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	18,961,230,813円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	60,963,586円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	64,172,278円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	79,166,893円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	82,795,385円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	67,866,539円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	70,067,313円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,684,917円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,247,440円
年金積立 インデックスファンド海外債券(ヘッジあり)	2,188,909,893円	年金積立 インデックスファンド海外債券(ヘッジあり)	2,029,748,528円
計	24,647,191,029円	計	21,844,897,199円
2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	24,647,191,029口	2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	21,844,897,199口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

前期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	903,910,411
合計	903,910,411

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	87,888,283
合計	87,888,283

(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）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成22年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	30,045,637,547		30,057,333,180	11,695,633
	米ドル	12,404,849,565		11,857,766,230	547,083,335
	加ドル	822,831,542		815,097,740	7,733,802
	豪ドル	281,652,588		292,681,270	11,028,682
	英ポンド	2,363,871,699		2,304,153,960	59,717,739
	スイスフラン	178,632,927		178,644,640	11,713
	シンガポールドル	126,742,718		126,049,470	693,248
	マレーシアリングgit	184,455,311		179,717,280	4,738,031
	スウェーデンクローナ	212,390,715		223,156,010	10,765,295
	ノルウェークローネ	73,696,374		74,345,760	649,386
	デンマーククローネ	272,548,252		280,509,090	7,960,838
	メキシコペソ	282,453,600		277,992,000	4,461,600
	ポーランドズロチ	264,502,125		269,561,030	5,058,905
	ユーロ	12,577,010,131		13,177,658,700	600,648,569
合計	30,045,637,547		30,057,333,180	11,695,633	

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建	26,644,563,842		26,794,044,320	149,480,478
	米ドル	10,563,820,037		10,538,340,120	25,479,917
	加ドル	823,934,972		794,987,800	28,947,172
	豪ドル	372,693,532		373,499,510	805,978
	英ポンド	2,329,795,429		2,283,446,990	46,348,439
	スイスフラン	140,106,552		130,674,260	9,432,292
	シンガポールドル	122,974,127		120,751,280	2,222,847
	マレーシアリングギット	178,286,135		172,779,720	5,506,415
	スウェーデンクローナ	200,733,066		197,315,810	3,417,256
	ノルウェークローネ	74,172,971		74,455,660	282,689
	デンマーククローネ	290,151,324		283,280,120	6,871,204
	メキシコペソ	236,774,249		241,053,990	4,279,741
	ポーランドズロチ	229,128,194		227,150,150	1,978,044
ユーロ	11,081,993,254		11,356,308,910	274,315,656	
合計	26,644,563,842		26,794,044,320	149,480,478	

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成22年10月26日現在		平成23年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.2479円	1口当たり純資産額	1.2632円
(1万口当たり純資産額)	(12,479円)	(1万口当たり純資産額)	(12,632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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	210,000	232,607.81	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	1,400,000	1,476,125.00	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	1,580,000	1,777,253.12	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	2,000,000	2,133,437.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	500,000	533,203.12	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	670,000	710,932.81	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	550,000	742,585.93	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	1,450,000	1,523,746.09	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	1,700,000	1,896,562.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	900,000	951,750.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	600,000	633,890.62	
		US TREASURY N/B-0.125%-13/08/31	1,000,000	997,656.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	1,000,000	1,055,234.37	
		US TREASURY N/B-1.25%-15/10/31	1,650,000	1,684,933.59	
		US TREASURY N/B-0.625%-14/07/15	1,100,000	1,106,960.93	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	1,100,000	1,165,656.25	
		US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	1,730,000	1,922,462.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	2,300,000	2,386,789.06	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	1,600,000	1,654,250.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	640,000	800,700.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	1,220,000	1,251,167.18	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	760,000	821,868.75	
		US TREASURY N/B-0.5%-13/10/15	1,000,000	1,004,453.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	1,400,000	1,476,781.25	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/09/15	2,500,000	2,487,890.62	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	1,000,000	1,102,343.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	480,000	561,600.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	1,800,000	1,972,687.50	
		US TREASURY N/B-1.25%-15/08/31	600,000	613,968.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	700,000	780,171.87	
		US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	2,900,000	3,076,265.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	1,000,000	1,082,812.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	820,000	966,062.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	1,050,000	1,158,281.25	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	320,000	355,000.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	1,430,000	1,576,351.56	
		US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	1,700,000	1,768,796.87	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	1,160,000	1,364,450.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-13/05/31	1,200,000	1,205,343.75	
		US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	2,500,000	2,710,937.50	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	1,460,000	1,729,415.62	
		US TREASURY N/B-1.5%-16/07/31	1,900,000	1,948,390.62	
		US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	2,000,000	2,052,656.25	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	1,570,000	1,868,545.31	
		US TREASURY N/B-2.0%-16/04/30	1,300,000	1,365,710.93	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	430,000	497,254.68	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	1,100,000	1,162,476.56	
		US TREASURY N/B-1.375%-15/11/30	1,000,000	1,025,781.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	1,250,000	1,437,695.31	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	1,000,000	1,067,265.62	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	1,250,000	1,385,937.50			

US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000	607,668.75	
US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	300,000	389,484.37	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	130,000	194,309.37	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	660,000	880,171.87	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	980,000	1,413,803.12	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	970,000	1,360,728.12	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	430,000	601,664.06	
US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	950,000	1,407,187.50	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000	1,489,707.81	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	1,100,000	1,099,484.37	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	1,500,000	1,635,937.50	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,000,000	1,232,031.25	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	1,100,000	1,161,359.37	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,900,000	2,163,625.00	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	1,500,000	1,694,296.87	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	3,400,000	3,874,937.50	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	2,000,000	2,240,625.00	
US TREASURY N/B-0.75%-13/08/15	2,000,000	2,017,656.25	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	1,700,000	1,872,921.87	
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	1,300,000	1,447,875.00	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	200,000	228,937.50	
US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	2,000,000	1,991,562.50	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	700,000	738,718.75	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	200,000	230,250.00	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	250,000	281,718.75	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	400,000	454,375.00	
US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	1,000,000	1,034,062.50	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	1,830,000	1,970,109.37	
US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	2,000,000	2,105,468.75	
US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	1,500,000	1,522,031.25	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	310,000	326,323.43	
US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	1,350,000	1,421,085.93	
US TREASURY N/B-0.625%-13/04/30	1,500,000	1,509,257.81	
US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	1,550,000	1,584,753.90	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	1,540,000	1,644,671.87	
US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	3,150,000	3,198,726.56	
US TREASURY N/B-0.375%-13/07/31	1,100,000	1,102,578.12	
US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	2,000,000	2,029,375.00	
US TREASURY N/B-1.125%-12/12/15	1,000,000	1,010,859.37	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,630,000	2,015,851.56	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,720,000	2,164,781.25	
US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	600,000	609,750.00	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,600,000	2,053,500.00	
US TREASURY N/B-1.375%-12/11/15	1,980,000	2,003,357.81	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,320,000	1,502,943.75	
US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	1,600,000	1,714,750.00	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	550,000	666,875.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	650,000	804,882.81	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	770,000	894,042.18	
US TREASURY N/B-4.0%-12/11/15	190,000	197,540.62	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,600,000	1,975,750.00	
国債証券小計	125,550,000	138,039,467.73 (10,507,564,283)	
米ドル合計		138,039,467.73 (10,507,564,283)	

加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	480,000	491,092.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000	394,223.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	910,000	1,241,513.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/12/01	500,000	503,035.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	1,070,000	1,142,096.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-13/11/01	750,000	757,350.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	650,000	677,124.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	400,000	422,960.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	500,000	575,470.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	350,000	393,190.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000	827,895.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	450,000	755,068.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000	241,800.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	1,370,000	1,435,157.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	550,000	611,649.50	
	国債証券小計		9,210,000	10,469,625.30 (783,023,276)	
加ドル合計				10,469,625.30 (783,023,276)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	770,000	843,650.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	760,000	788,163.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	550,000	582,012.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	520,000	557,548.68	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	780,000	848,217.24	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,000,000	1,057,772.00	
	国債証券小計		4,380,000	4,677,364.49 (369,184,379)	
豪ドル合計				4,677,364.49 (369,184,379)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.25%-14/03/07	550,000	570,109.27	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	720,000	1,062,483.37	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	1,050,000	1,174,006.94	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	720,000	758,298.49	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	360,000	429,950.66	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	1,710,000	1,920,328.16	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	1,150,000	1,308,870.70	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	430,000	502,762.18	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	890,000	1,060,000.37	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,630,000	2,030,958.33	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	890,000	1,246,046.85	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	730,000	842,077.48	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	710,000	820,633.69	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	920,000	1,149,534.39	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,000,000	1,175,641.78	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	930,000	1,106,950.33	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	250,000	285,605.50	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	790,000	960,676.42	
UK TREASURY-2.75%-15/01/22	220,000	232,603.12			
	国債証券小計		15,650,000	18,637,538.03 (2,271,915,885)	
英ポンド合計				18,637,538.03 (2,271,915,885)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	450,000	542,466.90	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000	137,900.40	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	350,000	400,369.20	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000	181,674.92	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	200,000	218,456.20	
	国債証券小計		1,240,000	1,480,867.62 (128,317,179)	

スイスフラン合計				1,480,867.62 (128,317,179)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	600,000	685,020.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000	471,013.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000	104,270.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	250,000	288,958.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	420,000	434,322.00	
国債証券小計			1,770,000	1,983,583.66 (119,332,392)	
シンガポールドル合計				1,983,583.66 (119,332,392)	
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	2,200,000	2,222,825.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000	2,265,091.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	600,000	627,150.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	1,700,000	1,769,484.23	
		国債証券小計			6,650,000
マレーシアリングット合計				6,884,551.07 (167,019,208)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-5.5%-12/10/08	2,800,000	2,927,104.62	
		SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	2,250,000	2,532,750.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	3,460,000	3,705,509.87	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	1,500,000	1,758,608.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	1,500,000	1,815,125.46	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	3,100,000	3,907,213.61	
国債証券小計			14,610,000	16,646,312.06 (193,263,683)	
スウェーデンクローナ合計				16,646,312.06 (193,263,683)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	1,200,000	1,286,281.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	1,000,000	1,143,769.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	1,600,000	1,778,703.21	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	1,000,000	1,105,868.00	
		国債証券小計			4,800,000
ノルウェークローネ合計				5,314,621.41 (73,182,336)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000	2,057,983.20	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	650,000	963,513.85	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	1,550,000	1,628,047.15	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	4,000,000	4,537,112.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	750,000	832,425.00	
		KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	3,750,000	4,068,517.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-12/11/15	1,400,000	1,447,157.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,750,000	3,667,204.75	
国債証券小計			16,650,000	19,201,961.05 (273,243,905)	
デンマーククローネ合計				19,201,961.05 (273,243,905)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000	6,780,671.94	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000	6,801,964.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000	4,952,191.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	9,000,000	10,244,358.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	13,000,000	13,669,888.18	
		国債証券小計			38,500,000
メキシコペソ合計				42,449,074.52 (238,563,798)	

ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	800,000	837,480.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	2,150,000	2,168,275.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-12/10/25	2,300,000	2,151,899.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,300,000	2,296,320.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,700,000	1,700,255.00	
	国債証券小計		9,250,000	9,154,229.00 (222,630,849)	
ポーランドズロチ合計				9,154,229.00 (222,630,849)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000	416,544.44	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	950,000	920,139.79	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	400,000	399,271.12	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	1,220,000	1,260,310.38	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	720,000	780,339.52	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	900,000	930,883.32	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	1,200,000	1,220,485.44	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	910,000	937,150.57	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.75%-14/07/30	1,190,000	1,205,571.38	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.2%-37/01/31	1,380,000	1,022,733.73	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.8%-24/01/31	600,000	546,720.29	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.6%-19/07/30	1,460,000	1,402,859.68	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.85%-20/10/31	1,620,000	1,556,624.95	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-6.15%-13/01/31	1,960,000	2,010,049.38	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.2%-13/07/30	600,000	601,951.14	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.25%-14/01/31	200,000	200,602.46	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.5%-17/07/30	130,000	133,741.90	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-6.0%-29/01/31	930,000	905,837.57	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.15%-16/01/31	1,100,000	1,045,384.45	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.1%-18/07/30	450,000	425,208.91	
		BUNDES OBLIGATION-1.75%-15/10/09	600,000	617,943.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	1,450,000	1,604,518.38	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,060,000	1,466,064.69	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	620,000	872,389.29	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	420,000	584,304.79	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	350,000	365,787.52	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	820,000	1,046,456.44	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	750,000	876,780.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	250,000	345,766.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	910,000	1,101,996.25	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	1,340,000	1,465,913.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	620,000	649,781.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	2,140,000	2,255,645.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	200,000	225,005.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	1,550,000	1,672,751.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	790,000	862,624.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	1,500,000	1,626,839.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	530,000	583,074.67	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	2,190,000	2,471,264.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	430,000	482,748.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	250,000	286,927.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	600,000	653,549.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	810,000	923,369.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	450,000	498,641.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	270,000	311,848.59	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-20/09/04	1,000,000	1,025,911.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	500,000	548,843.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	1,890,000	1,730,353.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	750,000	596,965.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,160,000	824,272.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,550,000	1,257,501.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	800,000	738,876.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	650,000	563,053.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,100,000	1,088,347.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	280,000	262,706.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	1,500,000	1,395,908.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	600,000	541,956.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	1,400,000	1,229,585.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	100,000	98,567.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	1,780,000	1,502,117.43	

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	300,000	262,844.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	430,000	507,651.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	260,000	236,878.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	1,640,000	1,569,337.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	2,190,000	2,050,299.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	1,230,000	1,199,300.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	2,000,000	1,962,822.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	200,000	195,797.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	1,580,000	1,573,662.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	1,040,000	1,044,165.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	300,000	281,390.79	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07/04	400,000	430,987.04	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	100,000	111,251.34	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000	375,143.19	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	210,000	240,316.20	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	400,000	442,561.64	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	200,000	220,918.80	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	1,340,000	1,515,728.53	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	1,730,000	1,841,431.54	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	590,000	622,369.46	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	1,120,000	1,170,137.02	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	810,000	859,163.67	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	470,000	469,231.31	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	150,000	149,682.34	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	1,170,000	1,219,306.14	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,360,000	1,379,011.84	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	300,000	321,374.28	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	830,000	938,944.55	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	850,000	881,127.17	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	240,000	303,639.16	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	860,000	1,043,974.98	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	1,250,000	1,351,532.62	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	1,080,000	1,134,782.02	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	900,000	965,066.76	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	1,800,000	1,718,607.60	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	1,750,000	1,895,963.30	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	350,000	383,420.24	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000	823,617.46	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	1,070,000	1,131,940.05	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	1,260,000	1,324,825.61	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	550,000	553,822.83	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	500,000	529,393.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	570,000	639,540.11	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	810,000	858,581.61	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	730,000	782,770.82	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	860,000	954,632.41	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	900,000	980,278.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	650,000	778,402.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	420,000	563,657.59	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	570,000	631,714.52	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	1,020,000	1,090,825.53	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	250,000	260,647.12	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	850,000	903,379.74	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	570,000	620,613.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	670,000	752,201.42	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	300,000	322,024.23	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	740,000	797,609.96	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	700,000	928,393.62	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	300,000	325,261.23	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	200,000	221,202.30	
	国債証券小計	101,120,000	104,824,531.10 (11,103,014,334)	
ユーロ合計			104,824,531.10 (11,103,014,334)	
合計			26,450,255,507 (26,450,255,507)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 102銘柄	100.0%	39.7%
加ドル	国債証券 15銘柄	100.0%	3.0%
豪ドル	国債証券 6銘柄	100.0%	1.4%
英ポンド	国債証券 19銘柄	100.0%	8.6%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%
シンガポールドル	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 4銘柄	100.0%	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	1.0%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 120銘柄	100.0%	42.0%

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2011年11月30日現在です。

【純資産額計算書】

資産総額	549,447,829 円
負債総額	1,667,749 円
純資産総額(-)	547,780,080 円
発行済口数	578,697,693 口
1口当たり純資産額(/)	0.9466 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	24,904,978,794 円
負債総額	86,673,572 円
純資産総額(-)	24,818,305,222 円
発行済口数	43,807,297,125 口
1口当たり純資産額(/)	0.5665 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	59,379,663,243 円
負債総額	77,157,354 円
純資産総額(-)	59,302,505,889 円
発行済口数	75,511,309,186 口
1口当たり純資産額(/)	0.7853 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	1,122,654,830 円
負債総額	17,357,326 円
純資産総額(-)	1,105,297,504 円
発行済口数	1,508,991,585 口
1口当たり純資産額(/)	0.7325 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	31,651,981,733 円
負債総額	97,301,010 円

純資産総額（ - ）	31,554,680,723 円
発行済口数	25,747,841,010 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2255 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	439,765,198,262 円
負債総額	1,968,162,447 円
純資産総額（ - ）	437,797,035,815 円
発行済口数	314,052,972,172 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3940 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	27,837,116,683 円
負債総額	522,640,633 円
純資産総額（ - ）	27,314,476,050 円
発行済口数	21,751,347,466 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2558 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

該当事項はありません。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

平成23年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
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) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更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3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

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定します。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定めることができます。

・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最終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23年11月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

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

（平成23年11月末現在）

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23年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	415	66,993
株式投資信託	349	54,045
単位型	42	1,033
追加型	307	53,012
公社債投資信託	66	12,948
単位型	49	606
追加型	17	12,342
投資法人合計	1	26

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正前の「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52期事業年度（平成22年4月1日から平成23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51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）及び第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23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51期 (平成22年3月31日)		第52期 (平成23年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	23,445	3	21,290
前払費用		359		330
未収入金		2		4
未収委託者報酬		6,451		6,173
未収収益	3	592	3	422
立替金		177		504
繰延税金資産		1,644		1,142
その他	2	30	2	30
流動資産合計		32,703		29,897
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	134	1	67
器具備品	1	215	1	147
有形固定資産合計		350		215
無形固定資産				
ソフトウェア		52		101
無形固定資産合計		52		101
投資その他の資産				
投資有価証券		11,021		7,030
関係会社株式		8,659		16,225
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		1,042		962
繰延税金資産		1,031		868
子会社投資損失引当金		576		-
投資その他の資産合計		21,239		25,147
固定資産合計		21,642		25,463
資産合計		54,345		55,361

(単位:百万円)

	第51期 (平成22年3月31日)		第52期 (平成23年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		645		150
未払金		3,478		3,354
未払収益分配金		8		8
未払償還金		194		181
未払手数料	3	2,872	3	2,870
その他未払金		402		294
未払費用	3	3,804	3	3,253
未払法人税等		404		945
未払消費税等		129		108
賞与引当金		2,015		2,149
特別賞与引当金		1,204		-
役員賞与引当金		235		237
役員特別賞与引当金		106		-
その他		5		-
流動負債合計		12,028		10,199
固定負債				
退職給付引当金		743		818
その他		102		55
固定負債合計		846		874
負債合計		12,875		11,073
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
その他資本剰余金		4		4
資本剰余金合計		5,225		5,225
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		18,814		21,703
利益剰余金合計		18,814		21,703
自己株式		53		68
株主資本合計		41,349		44,224
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		121		63
評価・換算差額等合計		121		63
純資産合計		41,470		44,287
負債純資産合計		54,345		55,361

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第51期 (自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	49,510	52,650
その他営業収益	2,788	2,581
営業収益計	52,298	55,231
営業費用		
支払手数料	24,262	26,518
広告宣伝費	878	803
公告費	11	13
調査費	11,406	11,373
調査費	699	698
委託調査費	10,689	10,654
図書費	17	20
委託計算費	450	335
営業雑経費	585	557
通信費	167	176
印刷費	310	287
協会費	42	41
諸会費	6	8
その他	58	43
営業費用計	37,594	39,601
一般管理費		
給料	6,920	7,045
役員報酬	239	239
役員賞与引当金繰入額	235	237
給料・手当	4,343	4,391
賞与	86	27
賞与引当金繰入額	2,015	2,149
交際費	76	73
寄付金	55	140
旅費交通費	253	389
租税公課	225	133
不動産賃借料	921	921
退職給付費用	315	305
退職金	5	12
固定資産減価償却費	358	175
諸経費	2,710	2,953
一般管理費計	11,842	12,149
営業利益	2,862	3,480

(単位：百万円)

	第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2		2
受取配当金	1	714	1	1,071
有価証券償還益		13		29
時効成立分配金・償還金		23		8
その他		123		10
営業外収益計		876		1,121
営業外費用				
支払利息		9		10
時効成立後支払分配金・償還金		56		34
支払源泉所得税		71		106
為替差損		53		1
弁護士報酬等		37		-
その他		111		0
営業外費用計		340		153
経常利益		3,397		4,448
特別利益				
投資有価証券売却益		84		49
子会社投資損失引当金戻入額		-		576
その他		-		23
特別利益計		84		649
特別損失				
投資有価証券売却損		12		0
固定資産処分損		7		4
特別賞与引当金繰入額		3,742		-
役員特別賞与引当金繰入額		355		-
割増退職金		29		-
過年度敷金償却費用		-		58
その他		246		-
特別損失計		4,393		62
税引前当期純利益又は税引前当期純損失 ()		911		5,034
法人税、住民税及び事業税		482		1,134
法人税等調整額		697		705
法人税等合計		214		1,839
当期純利益又は当期純損失()		696		3,195

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	16,403	17,363
当期変動額		
新株の発行	960	-
当期変動額合計	960	-
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	4,272	5,220
当期変動額		
新株の発行	948	-
当期変動額合計	948	-
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
前期末残高	4	4
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	4	4
資本剰余金合計		
前期末残高	4,277	5,225
当期変動額		
新株の発行	948	-
当期変動額合計	948	-
当期末残高	5,225	5,225
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高	20,593	18,814
当期変動額		
剰余金の配当	1,082	305
当期純利益又は当期純損失()	696	3,195
当期変動額合計	1,779	2,889
当期末残高	18,814	21,703
利益剰余金合計		
前期末残高	20,593	18,814
当期変動額		
剰余金の配当	1,082	305
当期純利益又は当期純損失()	696	3,195
当期変動額合計	1,779	2,889
当期末残高	18,814	21,703

	第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
自己株式		
前期末残高	-	53
当期変動額		
自己株式の取得	223	14
自己株式の処分	170	-
当期変動額合計	53	14
当期末残高	53	68
株主資本合計		
前期末残高	41,273	41,349
当期変動額		
新株の発行	1,908	-
剰余金の配当	1,082	305
当期純利益又は当期純損失()	696	3,195
自己株式の取得	223	14
自己株式の処分	170	-
当期変動額合計	75	2,874
当期末残高	41,349	44,224
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	121
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	148	57
当期変動額合計	148	57
当期末残高	121	63
評価・換算差額等合計		
前期末残高	26	121
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	148	57
当期変動額合計	148	57
当期末残高	121	63
純資産合計		
前期末残高	41,246	41,470
当期変動額		
新株の発行	1,908	-
剰余金の配当	1,082	305
当期純利益又は当期純損失()	696	3,195
自己株式の取得	223	14
自己株式の処分	170	-
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	148	57
当期変動額合計	224	2,817
当期末残高	41,470	44,287

重要な会計方針

	第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23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 5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51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。</p> <p>(5) 特別賞与引当金 従業員に支給する特別賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(6) 役員特別賞与引当金 役員に支給する特別賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>	<p>消費税等の会計処理 同左</p>

会計方針の変更

第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
<p>(「退職給付に係る会計基準」の一部改正) 当事業年度より、「『退職給付に係る会計基準』の一部改正(その3)」(企業会計基準第19号 平成20年7月31日)を適用しております。これにより退職給付債務の差額が26百万円(増加)発生しておりますが、翌事業年度から費用処理されるため当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。</p>	<p>「資産除去債務に関する会計基準」等の適用 当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。これにより、当事業年度の営業利益、経常利益はそれぞれ19百万円減少、税引前当期純利益は78百万円減少しております。</p>

追加情報

第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
	<p>当社は、当社の親会社である住友信託銀行株式会社より当社の発行済株式数の7.25%の株式(14,283,400株)を自己株式として取得することを平成23年1月20日の当社取締役会で決議しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

第51期 (平成22年3月31日)	第52期 (平成23年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建物 905百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 502百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、NCT信託銀行株式会社に信託しております。なお、日興シティ信託銀行株式会社は平成22年3月1日付でNCT信託銀行株式会社に社名変更を行っております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p style="padding-left: 20px;">現金・預金 10,095百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">未収収益 33百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p style="padding-left: 20px;">未払手数料 4百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">未払費用 256百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務32百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務240百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建物 971百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 571百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。なお、野村信託銀行株式会社は平成22年7月20日付でNCT信託銀行株式会社を合併しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p style="padding-left: 20px;">現金・預金 10,013百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">未収収益 31百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p style="padding-left: 20px;">未払手数料 24百万円</p> <p style="padding-left: 20px;">未払費用 226百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務112百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務177百万円に対して保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 20px;">受取配当金 712百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 20px;">受取配当金 1,066百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	185,012,500	12,000,000	-	197,012,500

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

(注) 1 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社へ譲渡され、同日にて同社による行使が行われております。

2 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、当事業年度中に消却されております。

3 平成21年度ストックオプション(1)の増加及び減少は、新株予約権の発行及び失効によるものであります。

4 平成21年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
----	-------	-------	-----------------	-----------------	-----	-------

平成22年5月20日 取締役会	普通株式	利益剰余金	305	1.55	平成22年3月31日	平成22年6月23日
--------------------	------	-------	-----	------	------------	------------

第52期（自平成22年4月1日至平成23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	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	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	85,000	24,600	-	109,600

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
			前事業 年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出会社	平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	19,559,100	-	231,000	19,328,100	-
	平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	1,702,800	-	1,702,800	-
	平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	2,310,000	-	2,310,000	-
合計			19,559,100	4,012,800	231,000	23,340,900	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21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。

3 平成22年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

4 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成22年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年5月20日 取締役会	普通株式	305	1.55	平成22年3月31日	平成22年6月23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23年5月23日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,502	7.63	平成23年3月31日	平成23年6月22日

(リース取引関係)

第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
1 オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		1 オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	906百万円	1年内	731百万円
1年超	35百万円	1年超	2,234百万円
合計	942百万円	合計	2,966百万円

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,445	-	-	-
未収委託者報酬	6,451	-	-	-
未収収益	592	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9,907	354	448
合計	30,489	9,907	354	448

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日(当期の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	21,290	21,290	-
(2) 未収委託者報酬	6,173	6,173	-
(3) 未収収益	422	422	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	6,882	6,882	-
(5) 関係会社株式 子会社株式	1,404	1,672	268
(6) 未払金	(3,354)	(3,354)	-
(7) 未払費用	(3,253)	(3,253)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式(貸借対照表計上額11,928百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,290	-	-	-
未収委託者報酬	6,173	-	-	-
未収収益	422	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	5,733	556	421
合計	27,885	5,733	556	421

(有価証券関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第52期(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	1,404	1,672	268
合計	1,404	1,672	268

(注) 子会社株式（貸借対照表計上額11,928百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	31	7	24
	その他	5,560	5,363	196
	小計	5,591	5,370	220
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	1,291	1,404	113
	小計	1,291	1,404	113
合計		6,882	6,775	107

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	144	49	0
合計	144	49	0

(持分法損益等)

第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,852 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,336	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 4,703 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,054

（退職給付関係）

第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)																																																								
<p>1 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。なお 当社は、当事業年度末に適格退職年金制度を終了し ております。制度終了による影響額は、22百万円の損 失で、内訳は退職給付債務と年金資産の消滅による 利益 3百万円及び数理計算上の未認識差異の一括償 却による損失26百万円であります。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">838</td> </tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">838</td> </tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">94</td> </tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">743</td> </tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td> <td style="text-align: right;">28</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益</td> <td style="text-align: right;">5</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">33</td> </tr> <tr> <td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">162</td> </tr> <tr> <td>ヘ 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">315</td> </tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 退職給付見込額の期間配分方法</td> <td style="text-align: right;">勤続期間比例</td> </tr> <tr> <td>ロ 割引率</td> <td style="text-align: right;">1.7%</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益率</td> <td style="text-align: right;">0.7%</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td> <td style="text-align: right;">10年</td> </tr> </table>	イ 退職給付債務	838	ロ 未積立退職給付債務	838	ハ 未認識数理計算上の差異	94	ニ 退職給付引当金残高	743	イ 勤務費用	96	ロ 利息費用	28	ハ 期待運用収益	5	ニ 数理計算上の差異の費用処理額	33	ホ 確定拠出型企業年金への掛金	162	ヘ 退職給付費用合計	315	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.7%	ハ 期待運用収益率	0.7%	ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年	<p>1 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">890</td> </tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">890</td> </tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">72</td> </tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">818</td> </tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">95</td> </tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td> <td style="text-align: right;">14</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">30</td> </tr> <tr> <td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">165</td> </tr> <tr> <td>ヘ 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">305</td> </tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">イ 退職給付見込額の期間配分方法</td> <td style="text-align: right;">勤続期間比例</td> </tr> <tr> <td>ロ 割引率</td> <td style="text-align: right;">1.6%</td> </tr> <tr> <td>ハ 期待運用収益率</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td> <td style="text-align: right;">10年</td> </tr> </table>	イ 退職給付債務	890	ロ 未積立退職給付債務	890	ハ 未認識数理計算上の差異	72	ニ 退職給付引当金残高	818	イ 勤務費用	95	ロ 利息費用	14	ハ 期待運用収益	-	ニ 数理計算上の差異の費用処理額	30	ホ 確定拠出型企業年金への掛金	165	ヘ 退職給付費用合計	305	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.6%	ハ 期待運用収益率	-	ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	838																																																								
ロ 未積立退職給付債務	838																																																								
ハ 未認識数理計算上の差異	94																																																								
ニ 退職給付引当金残高	743																																																								
イ 勤務費用	96																																																								
ロ 利息費用	28																																																								
ハ 期待運用収益	5																																																								
ニ 数理計算上の差異の費用処理額	33																																																								
ホ 確定拠出型企業年金への掛金	162																																																								
ヘ 退職給付費用合計	315																																																								
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																								
ロ 割引率	1.7%																																																								
ハ 期待運用収益率	0.7%																																																								
ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																								
イ 退職給付債務	890																																																								
ロ 未積立退職給付債務	890																																																								
ハ 未認識数理計算上の差異	72																																																								
ニ 退職給付引当金残高	818																																																								
イ 勤務費用	95																																																								
ロ 利息費用	14																																																								
ハ 期待運用収益	-																																																								
ニ 数理計算上の差異の費用処理額	30																																																								
ホ 確定拠出型企業年金への掛金	165																																																								
ヘ 退職給付費用合計	305																																																								
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																								
ロ 割引率	1.6%																																																								
ハ 期待運用収益率	-																																																								
ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																								

(ストックオプション等関係)

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22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

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

権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで
--------	------------------------------

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

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

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

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

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

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

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

単価情報

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

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

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

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

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

(注) 1 当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。

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

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

4 平成21年度ストックオプション(1)については、公正な評価単価に代え、本源的価値(取引事例比準法による評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。

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

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23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21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利確定条件	平成24年 1 月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から 1 年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から 2 年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の 2 分の 1、4 分の 1、4 分の 1 ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2 年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年 1 月22日から 平成32年 1 月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	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 2,310,000株
付与日	平成22年 8 月20日
権利確定条件	平成24年 1 月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から 1 年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から 2 年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の 2 分の 1、4 分の 1、4 分の 1 ずつ権利確定する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2 年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年 1 月22日から 平成32年 1 月21日まで

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

(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21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利確定前(株)		
期首	19,559,100	-
付与	0	1,702,800
失効	231,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	19,328,100	1,702,800
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	2,310,000
失効	0
権利確定	0
権利未確定残	2,310,000
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) 1 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

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

(税効果会計関係)

第51期 (平成22年3月31日)	第52期 (平成23年3月31日)
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 (単位：百万円)	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 (単位：百万円)
繰延税金資産(流動)	繰延税金資産(流動)
賞与引当金繰入超過額 1,309	賞与引当金繰入超過額 886
その他 334	その他 255
1,644	1,142
繰延税金資産(固定)	繰延税金資産(固定)
投資有価証券等評価損 79	投資有価証券等評価損 60
関係会社株式評価損 185	関係会社株式評価損 185
退職給付引当金超過額 302	退職給付引当金超過額 333
子会社投資損失引当金 234	固定資産減価償却超過額 234
固定資産減価償却超過額 249	その他 99
その他 64	912
1,115	繰延税金資産合計 2,054
繰延税金資産合計 2,759	
繰延税金負債(固定)	繰延税金負債(固定)
その他有価証券評価差額金 83	その他有価証券評価差額金 43
繰延税金負債合計 83	繰延税金負債合計 43
繰延税金資産の純額 2,676	繰延税金資産の純額 2,010
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	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
法定実効税率 40.6%	法定実効税率 40.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 30.3%	交際費等永久に損金に算入されない項目 2.7%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 27.1%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 7.3%
海外子会社の留保利益の影響額等 13.9%	海外子会社の留保利益の影響額等 0.5%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 23.5%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.5%

(関連当事者情報)

第51期(自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社	大阪市中央区	342,037	信託銀行業	(被所有) 直接 98.59	ストックオプション(新株予約権)の行使	ストックオプション(新株予約権)の行使	1,908	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーディアル証券株式会社	東京都千代田区	149,594	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払 (注)1 (注)2	5,068

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社	大阪市中央区	342,037	信託銀行業	(被所有) 直接 98.60 (注2)	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)	308	未払手数料	24

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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 議決権等の被所有割合は、自己株式(109,600株)を控除して計算しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (千SGD)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management Singapore Limited	シンガポール国	115,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受(注1)	7,351

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

Nikko Asset Management Singapore Limitedの行った112,500千株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成22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	9,325百万円
負債合計	1,342百万円
純資産合計	7,982百万円

営業収益	9,228百万円
税引前当期純利益	3,523百万円
当期純利益	2,729百万円

(セグメント情報等)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)		第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	210円58銭	1株当たり純資産額	224円92銭
1株当たり当期純損失	3円64銭	1株当たり当期純利益	16円22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、当事業年度は1株当たり当期純損失であるため、記載しておりません。</p>		<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51期 (平成22年3月31日)	第52期 (平成23年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	41,470	44,287
普通株式に係る純資産額(百万円)	41,470	44,287
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)	197,013	197,013
普通株式の自己株式数(千株)	85	110
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)	196,928	196,903

2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

項目	第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
損益計算書上の当期純利益又は当期純損失() (百万円)	696	3,195
普通株式に係る当期純利益又は当期純損失() (百万円)	696	3,195
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)	190,975	196,926
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21年度ストックオプション(1) 19,559,100株	平成21年度ストックオプション(1) 19,328,100株、平成21年度ストックオプション(2) 1,702,800株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株

(重要な後発事象)

第51期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
-	-

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

- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期中間会計期間(平成23年4月1日から平成23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53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		17,081
未収委託者報酬		5,482
未収収益		589
関係会社短期貸付金		434
繰延税金資産		678
その他	2	1,292
流動資産合計		25,558

固定資産

有形固定資産	1	217
無形固定資産		84
投資その他の資産		
投資有価証券		2,765
関係会社株式		24,320
長期差入保証金		784
繰延税金資産		982
その他		60
投資その他の資産合計		28,913

固定資産合計 29,214

資産合計 54,773

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	2,944
未払費用	3,149
未払法人税等	687
未払消費税等	231
賞与引当金	1,130
役員賞与引当金	100
その他	1,588
流動負債合計	9,831
固定負債	
退職給付引当金	859
その他	55
固定負債合計	915
負債合計	10,746
純資産の部	
株主資本	
資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	21,604
利益剰余金合計	21,604
自己株式	68
株主資本合計	44,119
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	92
評価・換算差額等合計	92
純資産合計	44,027
負債純資産合計	54,773

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(自 平成23年4月1日
至 平成23年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		29,617
その他営業収益		1,070
営業収益合計		30,688
営業費用及び一般管理費	1	28,229
営業利益		2,459
営業外収益	2	814
営業外費用	3	181
経常利益		3,091
特別利益	4	1
特別損失	5	1
税引前中間純利益		3,091
法人税、住民税及び事業税		632
法人税等調整額		456
中間純利益		2,002

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

		第53期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日)	
株主資本			
資本金			
当期首残高		17,363	
当中間期末残高		<u>17,363</u>	
資本剰余金			
資本準備金			
当期首残高		5,220	
当中間期末残高		<u>5,220</u>	
その他資本剰余金			
当期首残高		4	
当中間期変動額			
自己株式の処分		<u>4</u>	
当中間期変動額合計		<u>4</u>	
当中間期末残高		<u>-</u>	
資本剰余金合計			
当期首残高		5,225	
当中間期変動額			
自己株式の処分		<u>4</u>	
当中間期変動額合計		<u>4</u>	
当中間期末残高		<u>5,220</u>	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金			
当期首残高		21,703	
当中間期変動額			
剰余金の配当		1,502	
中間純利益	2,002		
自己株式の処分		<u>599</u>	
当中間期変動額合計		<u>99</u>	
当中間期末残高		<u>21,604</u>	
利益剰余金合計			
当期首残高		21,703	
当中間期変動額			
剰余金の配当		1,502	
中間純利益	2,002		
自己株式の処分		<u>599</u>	
当中間期変動額合計		<u>99</u>	
当中間期末残高		<u>21,604</u>	

自己株式		
当期首残高		68
当中間期変動額		
自己株式の取得	8,700	
自己株式の処分	<u>8,700</u>	
当中間期変動額合計	<u>-</u>	
当中間期末残高		<u>68</u>
株主資本合計		
当期首残高	44,224	
当中間期変動額		
剰余金の配当	1,502	
中間純利益	2,002	
自己株式の取得	8,700	
自己株式の処分	<u>8,095</u>	
当中間期変動額合計	<u>104</u>	
当中間期末残高	<u>44,119</u>	
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高		63
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>156</u>	
当中間期変動額合計	<u>156</u>	
当中間期末残高	<u>92</u>	
評価・換算差額等合計		
当期首残高		63
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>156</u>	
当中間期変動額合計	<u>156</u>	
当中間期末残高	<u>92</u>	
純資産合計		
当期首残高	44,287	
当中間期変動額		
剰余金の配当	1,502	
中間純利益	2,002	
自己株式の取得	8,700	
自己株式の処分	8,095	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>156</u>	
当中間期変動額合計	<u>260</u>	
当中間期末残高	<u>44,027</u>	

重要な会計方針

項目	第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23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>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。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、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 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>
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>

追加情報

第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)
<p>1 第53期中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p> <p>2 平成22年12月6日付Share Purchase Agreementに基づき、平成23年9月30日、当社はDBS Bank Ltd.に対して、第1回新株予約権を付与いたしました。これにより、DBS Bank Ltd.は今後の販売状況に応じ、当社株式を最大で1.5%（第53期中間会計期間末現在2,955,200株に相当）取得する権利を有しております。なお、当中間会計期間末時点において権利確定している新株予約権はありません。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第53期中間会計期間 (平成23年 9月30日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,578 百万円</p> <p>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、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>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101百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務146百万円に対して保証を行っております。</p>

(中間損益計算書関係)

第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	47 百万円
無形固定資産	16 百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	3 百万円
受取配当金	752 百万円
時効成立分配金・償還金	34 百万円
有価証券償還益	19 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	70 百万円
支払源泉所得税	74 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	
固定資産処分損	1 百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第53期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首 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	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首 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	109,600	14,283,400	14,283,400	109,600

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)
		当事業年度期首	当中間会計期 間増加	当中間会計期 間減少	当中間会計期 間末	
平成21年度ストックオプション (1)	普通株式	19,328,100	-	49,500	19,278,600	-
平成21年度ストックオプション (2)	普通株式	1,702,800	-	9,900	1,692,900	-
平成22年度ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	-	2,955,200	-	2,955,200	-
合計		23,340,900	2,955,200	59,400	26,236,700	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)及び平成21年度ストックオプション(2)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

4 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)、平成22年度ストックオプション(1)及び第1回新株予約権は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年5月23日 取締役会	普通株式	1,502	7.63	平成23年3月31日	平成23年6月22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53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)	
1 オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	736 百万円
1年超	1,918 百万円
合計	2,655 百万円

(金融商品関係)

第53期中間会計期間（平成23年9月30日）

1 金融商品の時価等に関する事項

平成23年9月30日（当中間決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（（注）2を参照ください）。

	中間貸借対照表 計上額()(百万円)	時価() (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金及び預金	17,081	17,081	-
(2) 未収委託者報酬	5,482	5,482	-
(3) 未収収益	589	589	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	2,617	2,617	-
(5) 関係会社株式 子会社株式	1,404	1,408	3
(6) 未払金	(2,944)	(2,944)	-
(7) 未払費用	(3,149)	(3,149)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,023百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場

価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

(有価証券関係)

第53期中間会計期間(平成23年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

	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	1,404	1,408	3
合計	1,404	1,408	3

(注) 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,023百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株式	26	7	19
	その他	971	901	69
	小計	997	908	89
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの	その他	1,620	1,864	244
	小計	1,620	1,864	244
合計		2,617	2,773	155

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

2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 147百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(持分法損益等)

第53期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23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	4,320
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	467

(ストックオプション等関係)

第53期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスは単一であるため、記載しておりません。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

国内に所在している有形固定資産の額が有形固定資産の額の90%超であるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

(1株当たり情報)

第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)	
1株当たり純資産額	223円59銭
1株当たり中間純利益	10円23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、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53期中間会計期間 (平成23年 9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	44,027
普通株式に係る純資産額(百万円)	44,027
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)	197,013
普通株式の自己株式数(千株)	110
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)	196,903

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

項目	第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日)
中間純利益(百万円)	2,002
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	2,002
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,654
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21年度ストックオプション(1) 19,278,600株 平成21年度ストックオプション(2) 1,692,900株 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株 第1回新株予約権 2,955,200株

(重要な後発事象)

第53期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

新株予約権（ストックオプション）の付与

当社は、平成23年9月16日開催の臨時株主総会及び取締役会の決議に基づき、平成23年10月7日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員186名に付与いたしました。

新株予約権の数	1,849個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 6,101,700株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金737円（注）
新株予約権の行使期間	平成25年10月7日から平成33年10月6日まで

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

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23年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成23年3月末現在)	事業の内容
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	47,937百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社足利銀行	135,000百万円	
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	
株式会社第三銀行 1	37,461百万円	
株式会社東北銀行	8,233百万円	
株式会社もみじ銀行	87,465百万円	
株式会社琉球銀行 1	54,127百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニー生命保険株式会社 1	70,000百万円	
三井生命保険株式会社	167,280百万円	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
信金中央金庫	490,998百万円 (出資の総額)	

1 募集の取扱いを行いません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
ファンドの基本的性格など
委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
目論見書の使用開始日
- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- (5) 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。
- (6) 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。
- (7) 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。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

平成22年12月8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40）の平成21年10月27日から平成22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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の平成22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X B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年11月30日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の平成22年10月27日から平成23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、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の平成23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X B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成23年6月17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22年4月1日から平成23年3月31日までの第52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23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23年12月9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23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成23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23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注）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。