

## 【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25年1月25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】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	小濱 公哉
【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25年1月26日から平成26年1月24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		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## ファンドの特色

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

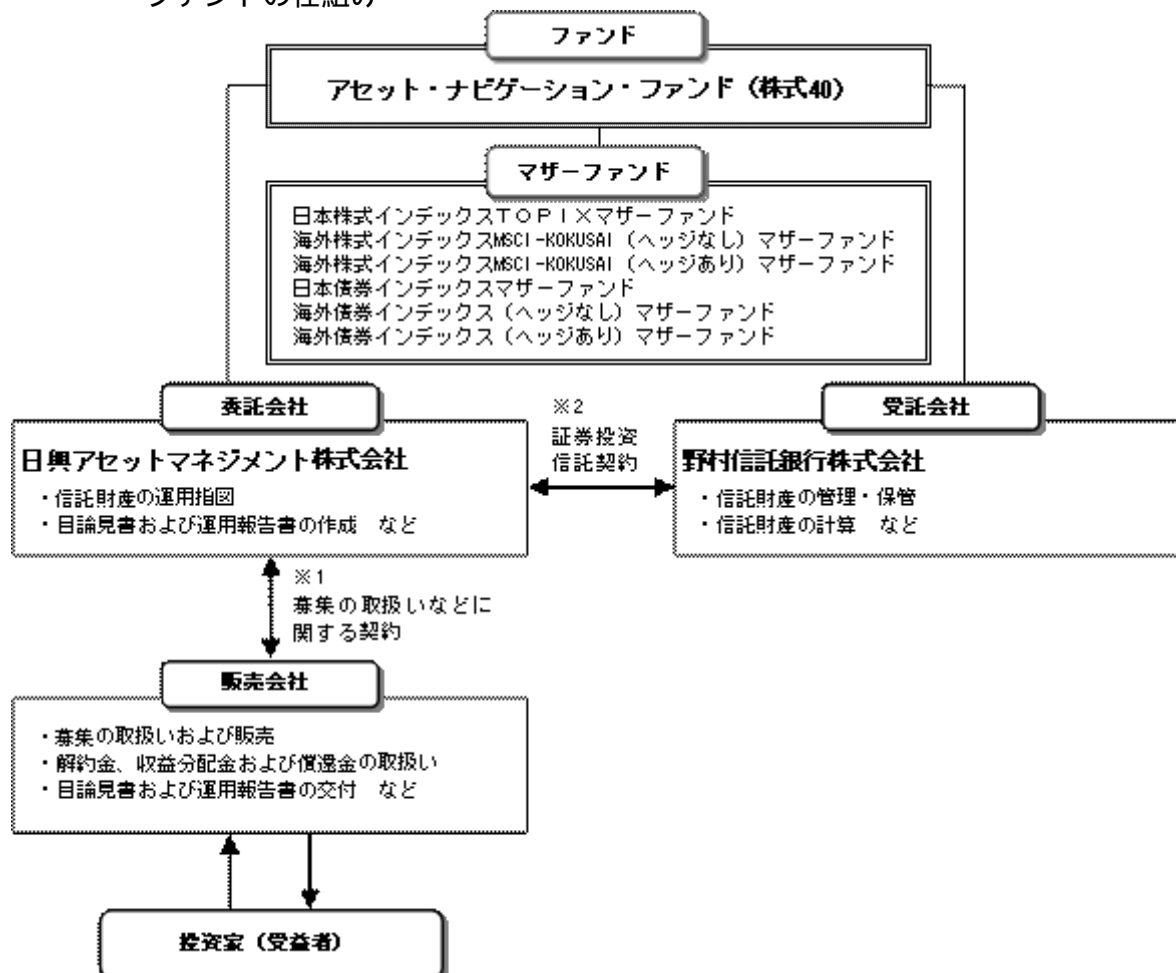
- ・ ファンド名称変更

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を、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を、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24年11月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

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

株式の標準実質組入比率.....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もあります。

- ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

## &lt;アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）&gt;

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

## 1) 有価証券

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

## 3) 金銭債権

## 4) 約束手形

## 5) 為替手形

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

1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券

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

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

4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券

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

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



- 7) 株券または新株引受権証書
  - 8) 国債証券
  - 9) 地方債証券
  - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 13) コマーシャル・ペーパー
  - 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
  - 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
  - 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、）
  - 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、）
  - 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、）
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券

- 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
  - 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  - 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せん。）
  - 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せん。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 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、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、有価証券に係るものに限ります。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 為替先渡取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>  
わが国の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限り、有価証券に係るものに限ります。)
  - 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) 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、有価証券に係るものに限ります。)
  - 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。)

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。）には投資しません。

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

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

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

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

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

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

- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

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） <sup>*</sup> 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul>
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。



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

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） <sup>*</sup> 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
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。

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

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） <sup>*</sup> 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
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。

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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） <sup>*</sup> 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成10年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMB C日興証券株式会社に帰属します。また、SMB 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。

## &lt; 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド &gt;

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） <sup>*</sup> 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
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）

<sup>\*</sup>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。

## &lt; 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド &gt;

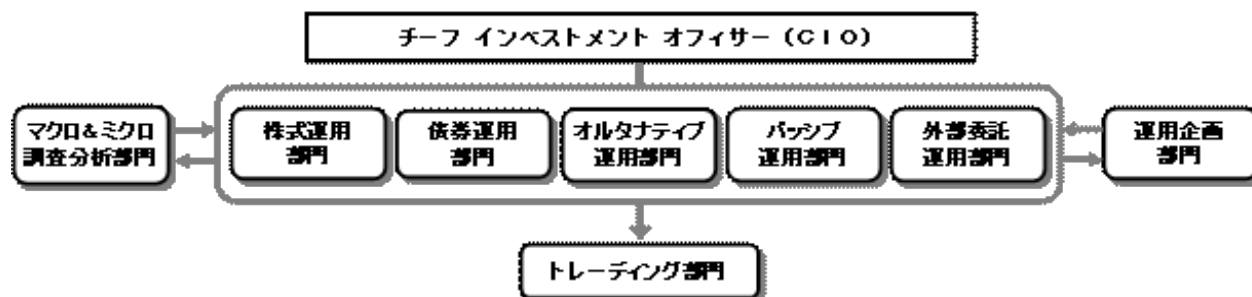
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
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。

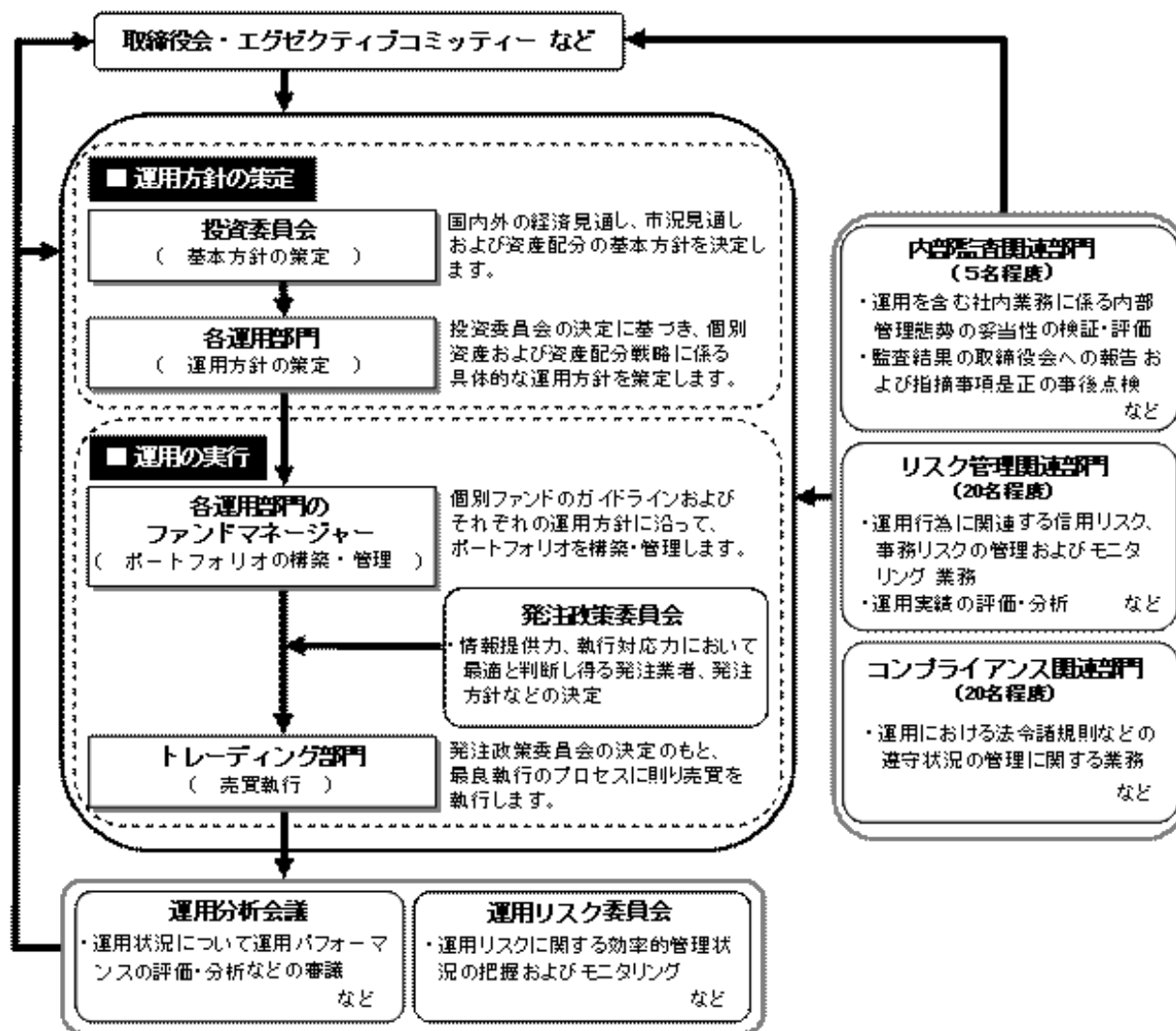
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## (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24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TOPIXマザーファンド>
- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保



有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- < 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す。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

- ・ 一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生

じるリスクがあります。

- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

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

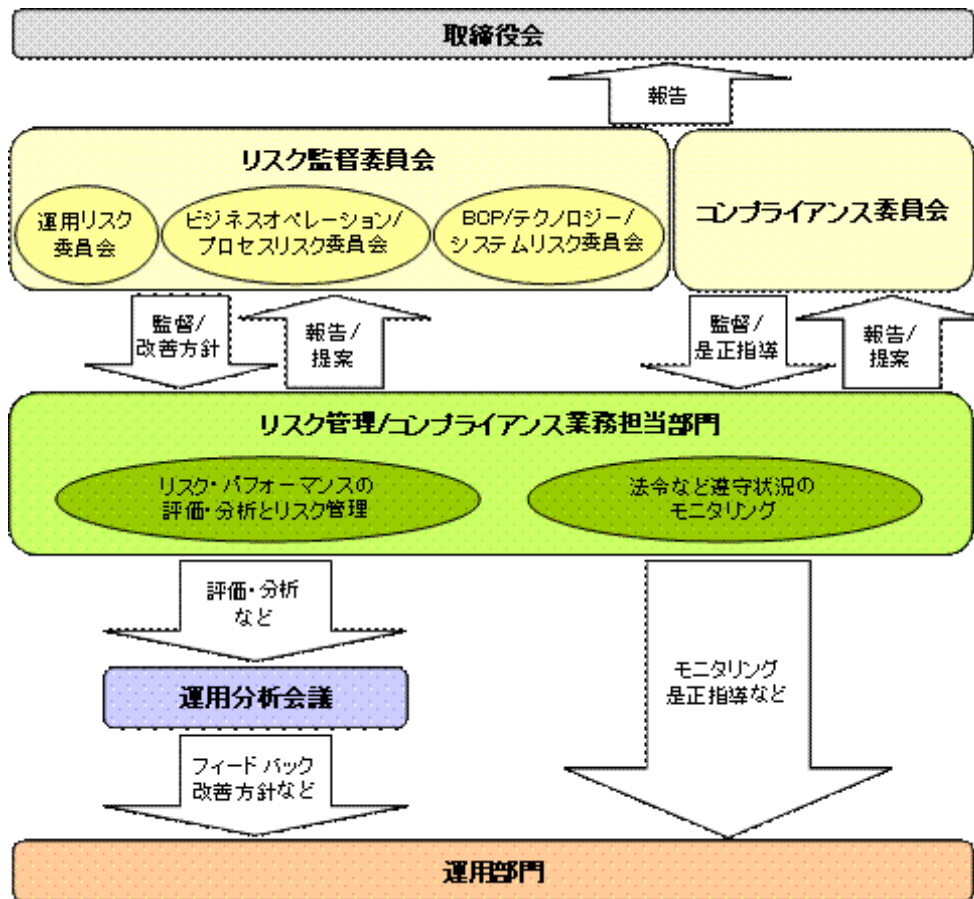
##### ・ 運用制限や規制上の制限に関する事項

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24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、10.147%（所得税7.147%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、上記の10.147%の税率は、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率となる予定です。
- 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）<sup>\*</sup>については譲渡所得として、10.147%（所得税7.147%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、10.147%（所得税7.147%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、上記の10.147%の税率は、平成26年1月1日以降は20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率となる予定です。

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

#### 法人受益者の場合

- 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税
- ・収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、7.147%（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、上記の7.147%の税率は、平成26年1月1日以降は15.315%（所得税のみ）の税率となる予定です。
- 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。

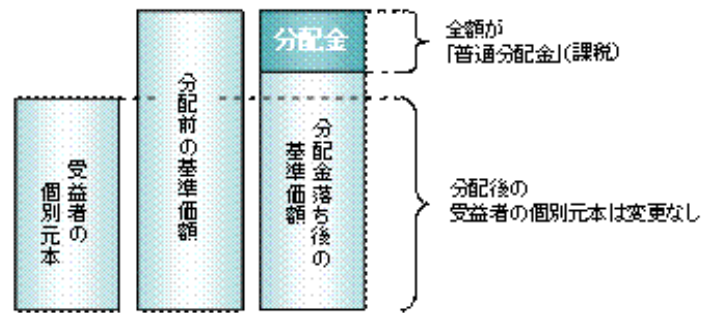
#### 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

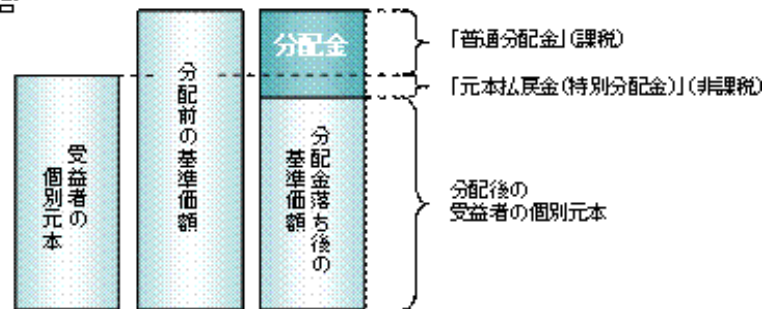


## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成25年1月25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2012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	496,018,831	95.22
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	24,911,883	4.78
合計(純資産総額)		520,930,714	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	184,317,932	1.2562	231,540,359	1.2585	231,964,117	44.53
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	256,054,447	0.5902	151,123,335	0.6226	159,419,498	30.60
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	26,731,874	0.9564	25,566,365	0.9904	26,475,248	5.08
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	16,720,468	1.5185	25,390,031	1.5754	26,341,425	5.06
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	29,734,340	0.8624	25,644,849	0.8715	25,913,477	4.97
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	19,254,546	1.3284	25,577,816	1.3454	25,905,066	4.97

## 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	95.22
合計	95.22

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

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
第13計算期間末	2012年10月26日	515	515	0.9913	0.9913
	2011年11月末日	547	-	0.9466	-
	12月末日	542	-	0.9544	-
	2012年1月末日	548	-	0.9690	-
	2月末日	567	-	1.0116	-
	3月末日	571	-	1.0231	-
	4月末日	560	-	1.0051	-
	5月末日	530	-	0.9648	-
	6月末日	536	-	0.9865	-
	7月末日	530	-	0.9788	-
	8月末日	528	-	0.9787	-
	9月末日	524	-	0.9882	-
	10月末日	514	-	0.9913	-
	11月末日	520	-	1.0124	-

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
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
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	0

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
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
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	3.57

(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
第13期	2011年10月27日～2012年10月26日	27,776,150	93,719,970

## (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2012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	24,730,626,110	98.79
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	303,913,808	1.21
合計(純資産総額)		25,034,539,918	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	265,540,000	1.06

(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	295,100	3,080.00	908,908,000	3,535.00	1,043,178,500	4.17
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,717,100	362.00	621,590,200	377.00	647,346,700	2.59
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	193,800	2,516.00	487,600,800	2,732.00	529,461,600	2.11
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	171,500	2,400.00	411,600,000	2,654.00	455,161,000	1.82
日本	株式	キヤノン	電気機器	142,700	2,560.00	365,312,000	2,883.00	411,404,100	1.64
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,917,200	125.00	364,650,000	132.00	385,070,400	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	95,500	3,695.00	352,872,500	3,685.00	351,917,500	1.41
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	90,100	3,695.00	332,919,500	3,770.00	339,677,000	1.36
日本	株式	ファナック	電気機器	23,900	12,570.00	300,423,000	13,900.00	332,210,000	1.33
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	103,500	2,599.56	269,054,600	3,090.00	319,815,000	1.28
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	114,100	2,299.00	262,315,900	2,470.00	281,827,000	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	176,900	1,395.28	246,825,032	1,561.00	276,140,900	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	538,000	410.00	220,580,000	476.00	256,088,000	1.02
日本	株式	三菱地所	不動産業	159,000	1,560.00	248,040,000	1,589.00	252,651,000	1.01
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	290,200	685.00	198,787,000	799.00	231,869,800	0.93
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	42,800	5,494.25	235,153,900	5,410.00	231,548,000	0.92
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	94,800	2,505.00	237,474,000	2,402.00	227,709,600	0.91
日本	株式	三井物産	卸売業	195,700	1,130.00	221,141,000	1,139.00	222,902,300	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	53,400	3,975.00	212,265,000	4,170.00	222,678,000	0.89
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	1,868	123,400.00	230,511,200	118,900.00	222,105,200	0.89
日本	株式	信越化学工業	化学	43,200	4,495.00	194,184,000	4,850.00	209,520,000	0.84
日本	株式	小松製作所	機械	112,200	1,647.00	184,793,400	1,847.00	207,233,400	0.83
日本	株式	KDDI	情報・通信業	32,000	6,280.00	200,960,000	6,100.00	195,200,000	0.78
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	1,017,000	171.84	174,761,280	189.00	192,213,000	0.77

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	87,800	2,149.17	188,697,126	2,114.00	185,609,200	0.74
日本	株式	三井不動産	不動産業	107,000	1,616.06	172,918,420	1,719.00	183,933,000	0.73
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	463,700	285.00	132,154,500	341.00	158,121,700	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	56,800	2,464.00	139,955,200	2,709.00	153,871,200	0.61
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	75,400	1,859.00	140,168,600	1,989.00	149,970,600	0.60
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	180,900	786.00	142,187,400	824.00	149,061,600	0.60

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.63
		建設業	2.55
		食料品	4.12
		繊維製品	0.84
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.78
		医薬品	5.23
		石油・石炭製品	0.76
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.58
		非鉄金属	1.05
		金属製品	0.69
		機械	4.99
		電気機器	11.72
		輸送用機器	10.86
		精密機器	1.42
		その他製品	1.47
		電気・ガス業	2.45
		陸運業	4.17
		海運業	0.28
		空運業	0.62
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.37
		卸売業	5.24
		小売業	4.21
		銀行業	9.82
		証券、商品先物取引業	1.23
		保険業	2.29
その他金融業	0.93		
不動産業	2.95		
サービス業	2.14		
合計			98.79

## 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 2012年12月	買建	34	日本円	251,864,877	265,540,000	1.06

(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2012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	35,023,989,117	53.66
	カナダ	3,416,045,788	5.23
	ドイツ	2,522,030,036	3.86
	イタリア	633,831,410	0.97
	フランス	2,619,364,256	4.01
	オーストラリア	2,374,085,259	3.64
	イギリス	6,509,038,779	9.97
	スイス	2,807,457,363	4.30
	バミューダ	127,942,430	0.20
	香港	831,533,269	1.27
	シンガポール	529,761,110	0.81
	ニュージーランド	37,800,893	0.06
	オランダ	818,648,264	1.25
	スペイン	853,430,908	1.31
	ベルギー	346,733,467	0.53
	スウェーデン	902,092,724	1.38
	ノルウェー	226,094,753	0.35
	オーストリア	79,652,819	0.12
	ルクセンブルグ	124,061,945	0.19
	フィンランド	232,732,154	0.36
	デンマーク	348,957,364	0.53
	アイルランド	428,467,679	0.66
	ギリシャ	5,639,180	0.01
	イスラエル	170,723,664	0.26
	ポルトガル	46,081,453	0.07
	中国	3,141,840	0.00
	ケイマン島	61,012,097	0.09
	モーリシャス	9,845,990	0.02
	ジャージー	198,716,803	0.30
	ガーンジー	16,183,327	0.02
小計	62,305,096,141	95.46	
投資証券	アメリカ	975,172,770	1.49
	カナダ	11,585,047	0.02
	フランス	90,016,175	0.14
	オーストラリア	217,630,089	0.33
	イギリス	84,454,849	0.13
	香港	33,246,370	0.05
	シンガポール	19,975,043	0.03
	オランダ	7,291,376	0.01
	小計	1,439,371,719	2.21
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	1,525,261,078	2.34
合計(純資産総額)		65,269,728,938	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,017,251,235	1.56
	買建	ドイツ	476,784,612	0.73

(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		1,019,307,830	1.56

(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	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	31,466	50,076.78	1,575,715,833	48,398.24	1,522,899,120	2.33
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	157,081	7,426.11	1,166,501,036	7,236.41	1,136,703,210	1.74
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	356,253	1,745.87	621,971,852	1,735.20	618,168,638	0.95
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	111,283	5,307.37	590,620,445	5,400.33	600,964,923	0.92
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	36,812	15,734.19	579,207,075	15,728.44	578,995,465	0.89
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	66,301	9,112.04	604,137,045	8,687.47	575,988,266	0.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	253,954	2,289.51	581,429,105	2,213.13	562,034,231	0.86
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	197,416	2,833.14	559,307,166	2,786.33	550,066,439	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	92,029	5,754.15	529,548,523	5,707.34	525,240,792	0.80
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	92,201	5,842.02	538,639,790	5,684.35	524,102,422	0.80
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	251,720	2,103.09	529,390,620	2,040.68	513,680,473	0.79
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	608,831	808.88	492,473,411	832.07	506,589,911	0.78
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	8,756	55,657.65	487,338,393	56,818.01	497,498,467	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	170,030	2,797.01	475,575,134	2,723.10	463,008,556	0.71
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	127,850	3,421.94	437,495,080	3,384.99	432,770,511	0.66
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	57,458	7,204.39	413,949,702	7,417.90	426,217,675	0.65
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	136,382	3,045.83	415,396,496	3,118.10	425,252,223	0.65
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	77,463	5,028.50	389,523,005	5,103.75	395,352,134	0.61
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	23,678	16,006.22	378,995,371	16,130.17	381,930,070	0.59

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	102,103	3,802.16	388,211,534	3,671.59	374,879,863	0.57
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	62,962	6,185.28	389,437,498	5,816.56	366,222,225	0.56
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	637,768	567.93	362,208,306	567.87	362,166,296	0.55
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,662,495	224.81	373,752,665	211.18	351,084,396	0.54
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	133,593	2,534.22	338,554,479	2,614.70	349,305,723	0.54
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	95,733	3,633.81	347,875,532	3,614.10	345,988,750	0.53
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	122,938	2,751.39	338,250,371	2,750.07	338,088,413	0.52
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	108,206	2,944.48	318,610,175	2,930.77	317,126,974	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	52,651	5,657.25	297,859,701	5,773.86	303,999,355	0.47
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	168,611	1,852.92	312,423,216	1,779.81	300,095,105	0.46
アメリカ	株式	QUALCOMM INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	57,262	4,716.15	270,056,272	5,202.30	297,894,217	0.46

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	10.96
		素材	6.67
		資本財	7.18
		商業・専門サービス	0.93
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	1.31
		耐久消費財・アパレル	1.33
		消費者サービス	1.64
		メディア	2.73
		小売	3.01
		食品・生活必需品小売り	2.29
		食品・飲料・タバコ	6.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.87
		ヘルスケア機器・サービス	2.60
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.17
		銀行	7.53
		各種金融	4.63
		保険	4.16
		不動産	0.71
		ソフトウェア・サービス	5.97
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.54		
電気通信サービス	3.73		
公益事業	3.41		

		半導体・半導体製造装置	1.35
投資証券		-	2.21
合計			97.66

## 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

## &lt;有価証券先物取引等&gt;

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 1212	買建	35	米ドル	12,297,400	1,017,251,235	1.56
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1212	買建	175	ユーロ	4,404,450	476,784,612	0.73

(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。

## &lt;為替予約取引&gt;

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	7,916,000	635,208,582	649,720,570	1.00
	ユーロ	買建	3,469,000	359,783,656	369,587,260	0.57

(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2012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	662,208,907	52.69
	カナダ	64,364,491	5.12
	ドイツ	48,199,061	3.83
	イタリア	11,656,763	0.93
	フランス	49,889,786	3.97
	オーストラリア	46,224,550	3.68
	イギリス	121,645,716	9.68
	スイス	53,794,531	4.28
	バミューダ	2,239,357	0.18
	香港	15,516,278	1.23
	シンガポール	9,721,378	0.77
	オランダ	13,081,665	1.04
	スペイン	15,106,822	1.20
	ベルギー	7,165,670	0.57
	スウェーデン	16,236,767	1.29
	ノルウェー	6,055,121	0.48
	オーストリア	1,246,514	0.10
	ルクセンブルグ	1,834,238	0.15
	フィンランド	4,584,782	0.36
	デンマーク	7,128,908	0.57
	アイルランド	8,352,972	0.66
	イスラエル	2,001,900	0.16
	ポルトガル	453,981	0.04
ジャージー	4,344,977	0.35	
小計		1,173,055,135	93.33
投資証券	アメリカ	17,475,221	1.39
	フランス	1,829,090	0.15
	オーストラリア	3,274,031	0.26
	イギリス	1,830,240	0.15
	香港	1,561,910	0.12
	小計		25,970,492
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	57,802,129	4.60
合計(純資産総額)		1,256,827,756	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	34,877,185	2.78
	買建	ドイツ	16,346,901	1.30

(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		1,233,567,330	98.15

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(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	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェア および機器	592	50,076.78	29,645,451	48,398.24	28,651,759	2.28
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2,961	7,426.11	21,988,716	7,236.41	21,427,023	1.70
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	6,727	1,745.87	11,744,475	1,735.20	11,672,660	0.93
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	2,095	5,307.37	11,118,947	5,400.33	11,313,691	0.90
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	695	15,734.19	10,935,263	15,728.44	10,931,268	0.87
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,252	9,112.04	11,408,268	8,687.47	10,876,718	0.87
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,800	2,289.51	10,989,626	2,213.13	10,623,043	0.85
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	3,723	2,833.14	10,547,780	2,786.33	10,373,512	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	1,740	5,754.15	10,012,218	5,707.34	9,930,771	0.79
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	1,743	5,842.02	10,182,635	5,684.35	9,907,815	0.79
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	4,755	2,103.09	10,000,208	2,040.68	9,703,442	0.77
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	11,535	808.88	9,330,472	832.07	9,597,925	0.76
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	165	55,657.65	9,183,512	56,818.01	9,374,971	0.75
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	3,206	2,797.01	8,967,205	2,723.10	8,730,256	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	2,418	3,421.94	8,274,251	3,384.99	8,184,897	0.65
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,579	3,045.83	7,855,197	3,118.10	8,041,570	0.64
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	1,083	7,204.39	7,802,351	7,417.90	8,033,585	0.64
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	1,461	5,028.50	7,346,644	5,103.75	7,456,585	0.59
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	446	16,006.22	7,138,775	16,130.17	7,194,054	0.57
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス	1,932	3,802.16	7,345,765	3,671.58	7,093,502	0.56
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	1,182	6,185.28	7,310,999	5,816.56	6,875,173	0.55
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	12,089	567.93	6,865,718	567.87	6,864,922	0.55
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	31,355	224.81	7,049,051	211.18	6,621,523	0.53
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	2,529	2,534.22	6,409,050	2,614.70	6,612,578	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	1,805	3,633.81	6,559,027	3,614.10	6,523,452	0.52
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	2,348	2,751.39	6,460,263	2,750.07	6,457,170	0.51
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	2,049	2,944.48	6,033,235	2,930.77	6,005,149	0.48
アメリカ	株式	QUALCOMM INC	テクノロジー・ハードウェア および機器	1,123	4,716.15	5,296,238	5,202.30	5,842,185	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	994	5,657.25	5,623,303	5,773.86	5,739,214	0.46
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	3,188	1,852.92	5,907,118	1,779.81	5,674,025	0.45

## 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	10.71
		素材	6.68
		資本財	7.23
		商業・専門サービス	0.83
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.25
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	1.66
		メディア	2.60
		小売	3.00
		食品・生活必需品小売り	2.17
		食品・飲料・タバコ	6.75
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	2.61
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.87
		銀行	7.44
		各種金融	4.68
		保険	3.99
		不動産	0.75
		ソフトウェア・サービス	5.92
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.46		
電気通信サービス	3.52		
公益事業	3.21		
半導体・半導体製造装置	1.39		
投資証券		-	2.07
合計			95.40

## 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	S P EMINI1212	買建	6	米ドル	421,880	34,877,185	2.78
	ドイツ	ユーレックス・ド イツ金融先物取引 所	DJSTX5 1212	買建	6	ユーロ	151,320	16,346,901	1.30

(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。

[次へ](#)



## &lt; 為替予約取引 &gt;

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	8,695,000	709,552,263	713,398,180	56.76
	ユーロ	売建	1,606,000	168,645,800	171,103,240	13.61
	英ポンド	売建	965,000	125,740,053	127,010,250	10.11
	加ドル	売建	781,000	63,659,896	64,471,530	5.13
	スイスフラン	売建	560,000	48,070,327	49,574,570	3.94
	豪ドル	売建	578,000	48,248,689	49,250,700	3.92
	香港ドル	売建	1,592,000	16,488,244	16,859,080	1.34
	スウェーデンクローナ	売建	1,318,000	15,730,864	16,199,640	1.29
	シンガポールドル	売建	156,000	10,249,010	10,491,860	0.83
	デンマーククローネ	売建	500,000	6,945,272	7,143,090	0.57
	ノルウェークローネ	売建	420,000	5,823,317	6,051,290	0.48
	イスラエルシケル	売建	94,000	1,924,059	2,013,900	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2012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	24,354,013,965	77.17
地方債証券	日本	2,100,271,604	6.66
特殊債券	日本	2,801,360,000	8.88
社債券	日本	1,962,181,000	6.22
	オーストラリア	203,075,000	0.64
	小計	2,165,256,000	6.86
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	136,569,953	0.43
合計(純資産総額)		31,557,471,522	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	106.10	795,750,000	106.31	797,287,500	2.53
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	1.400	2022/12/20	545,000,000	105.97	577,563,750	106.47	580,250,600	1.84
日本	国債証券	第314回利付国債(2年)	0.100	2014/03/15	550,000,000	100.00	550,033,000	100.01	550,033,000	1.74
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1.400	2019/09/20	511,000,000	106.81	545,814,430	107.11	547,332,100	1.73
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	0.800	2014/03/20	494,000,000	100.97	498,791,800	100.91	498,485,520	1.58
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1.400	2018/03/20	446,000,000	106.30	474,138,140	106.37	474,387,900	1.50
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1.700	2017/03/20	361,000,000	106.73	385,298,910	106.63	384,934,300	1.22
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	1.500	2015/03/20	361,000,000	103.34	373,075,450	103.21	372,591,710	1.18
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	343,000,000	106.13	364,046,480	106.46	365,147,510	1.16
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	340,000,000	105.84	359,862,800	106.33	361,508,400	1.15
日本	国債証券	第101回利付国債(5年)	0.400	2016/12/20	350,000,000	101.04	353,671,500	101.05	353,657,500	1.12
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	2.300	2026/06/20	300,000,000	114.29	342,894,000	114.62	343,848,000	1.09
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	1.300	2018/03/20	287,000,000	105.74	303,499,630	105.84	303,763,670	0.96
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	1.700	2016/09/20	274,000,000	106.05	290,593,440	105.95	290,297,520	0.92
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	268,000,000	103.67	277,854,360	104.14	279,097,880	0.88

日本	国債証券	第261回利付国債(10年)	1.800	2014/06/20	270,000,000	102.78	277,530,300	102.63	277,090,200	0.88
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	2.400	2038/09/20	246,000,000	111.28	273,758,640	111.06	273,202,680	0.87
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	1.900	2021/03/22	237,000,000	110.78	262,558,080	111.24	263,638,800	0.84
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1.700	2018/03/20	241,000,000	107.90	260,055,870	107.94	260,128,170	0.82
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	2.000	2042/03/20	255,000,000	101.76	259,485,550	101.69	259,309,500	0.82
日本	国債証券	第311回利付国債(2年)	0.200	2013/12/15	250,000,000	100.11	250,295,000	100.11	250,270,000	0.79
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	1.500	2019/06/20	223,000,000	107.45	239,612,150	107.70	240,168,770	0.76
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1.300	2018/12/20	221,000,000	106.06	234,392,600	106.22	234,743,990	0.74
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	2.400	2034/03/20	208,000,000	111.94	232,843,520	111.90	232,760,320	0.74
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	2.300	2026/09/20	200,000,000	114.11	228,230,000	114.44	228,882,000	0.73
日本	国債証券	第33回利付国債(20年)	3.800	2016/09/20	200,000,000	114.20	228,410,000	113.90	227,800,000	0.72
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	225,000,000	101.25	227,814,750	101.21	227,729,250	0.72
日本	国債証券	第95回利付国債(5年)	0.600	2016/03/20	220,000,000	101.63	223,597,000	101.61	223,533,200	0.71
日本	国債証券	第286回利付国債(10年)	1.800	2017/06/20	201,000,000	107.50	216,075,000	107.42	215,914,200	0.68
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1.500	2017/12/20	199,000,000	106.61	212,153,900	106.62	212,181,760	0.67

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.17
地方債証券	6.66
特殊債券	8.88
社債券	6.86
合計	99.57

### 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2012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	94,979,428,706	41.38
	カナダ	6,423,407,971	2.80
	ドイツ	20,184,479,995	8.79
	イタリア	21,003,288,488	9.15
	フランス	22,124,927,045	9.64
	オーストラリア	3,572,799,185	1.56
	イギリス	17,956,623,524	7.82
	スイス	963,233,703	0.42
	シンガポール	920,855,649	0.40
	マレーシア	1,215,090,736	0.53
	オランダ	6,242,570,238	2.72
	スペイン	9,844,424,857	4.29
	ベルギー	6,019,249,870	2.62
	スウェーデン	1,275,522,861	0.56
	ノルウェー	577,122,932	0.25
	オーストリア	4,015,747,047	1.75
	フィンランド	1,645,168,497	0.72
	デンマーク	1,997,608,666	0.87
	メキシコ	2,195,363,916	0.96
	ポーランド	1,710,899,833	0.75
南アフリカ	1,415,383,858	0.62	
	小計	226,283,197,577	98.58
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	3,257,623,564	1.42
合計(純資産総額)		229,540,821,141	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		832,476,747	0.36

(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	4.750	2014/05/15	40,550,000	8,779.14	3,559,941,776	8,748.99	3,547,714,557	1.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2014/08/15	38,700,000	8,792.29	3,402,616,921	8,772.73	3,395,044,816	1.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	36,280,000	8,611.69	3,124,322,378	8,585.39	3,114,779,265	1.36

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2014/11/15	33,800,000	8,869.60	2,997,925,327	8,849.71	2,991,203,036	1.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5.125	2016/05/15	28,500,000	9,533.62	2,717,081,343	9,538.11	2,718,361,260	1.18
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2015/02/15	26,700,000	8,895.26	2,375,035,504	8,880.51	2,371,095,668	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	22,500,000	9,570.83	2,153,436,608	9,725.45	2,188,225,335	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/11/15	24,700,000	8,558.78	2,114,017,546	8,529.57	2,106,804,638	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	23,100,000	8,988.29	2,076,295,133	8,980.27	2,074,442,623	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	20,500,000	9,748.54	1,998,451,147	9,799.87	2,008,972,772	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2018/08/15	17,900,000	9,615.10	1,721,102,396	9,701.07	1,736,490,914	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	17,900,000	9,600.80	1,718,542,895	9,662.57	1,729,600,532	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2013/11/30	20,300,000	8,369.67	1,699,043,091	8,358.92	1,696,860,315	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.250	2016/05/31	18,600,000	8,997.27	1,673,492,685	9,018.44	1,677,430,595	0.73
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.250	2016/04/25	14,300,000	11,652.67	1,666,331,239	11,686.83	1,671,217,023	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2040/02/15	14,700,000	10,981.09	1,614,219,700	11,353.09	1,668,904,230	0.73
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.250	2014/01/04	14,500,000	11,186.60	1,622,057,047	11,147.37	1,616,368,912	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.750	2018/11/15	16,500,000	9,514.37	1,569,871,358	9,616.38	1,586,702,751	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	16,300,000	9,529.13	1,553,247,832	9,675.40	1,577,090,861	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	12,000,000	12,656.10	1,518,732,412	12,833.82	1,540,057,950	0.67
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.250	2021/07/04	12,200,000	12,296.47	1,500,168,934	12,478.14	1,522,333,440	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	15,700,000	9,317.34	1,462,821,626	9,391.83	1,474,517,849	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2015/01/31	16,800,000	8,562.29	1,438,465,245	8,560.37	1,438,141,897	0.63
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5.000	2016/10/25	11,500,000	12,453.55	1,432,158,389	12,490.46	1,436,403,160	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2014/12/31	16,000,000	8,620.03	1,379,205,400	8,614.26	1,378,281,550	0.60
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2016/08/01	12,500,000	10,841.21	1,355,151,646	11,005.12	1,375,640,279	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2017/05/15	14,100,000	9,597.13	1,353,195,814	9,640.76	1,359,347,115	0.59
イギリス	国債証券	UK TREASURY	5.000	2014/09/07	9,450,000	14,333.47	1,354,513,221	14,264.51	1,347,995,733	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2040/05/15	12,200,000	10,578.70	1,290,601,204	10,942.49	1,334,983,780	0.58

イタリ ア	国債証 券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2015/08/01	12,000,000	10,897.36	1,307,683,419	11,016.62	1,321,994,661	0.58
----------	----------	-----------------------------	-------	------------	------------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.58
合 計	98.58

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの <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	3,300,000	351,010,010	351,582,000	0.15
	米ドル	売建	3,500,000	287,436,550	287,385,000	0.13
	英ポンド	売建	640,000	84,134,912	84,304,800	0.04
	デンマーククローネ	売建	2,811,000	40,057,593	40,141,080	0.02
	マレーシアリングgit	売建	1,161,667	31,291,586	31,318,537	0.01
	南アフリカランド	売建	2,033,000	18,973,175	18,967,890	0.01
	加ドル	売建	227,000	18,767,792	18,777,440	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2012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	11,526,192,007	41.91
	カナダ	786,627,195	2.86
	ドイツ	2,420,263,891	8.80
	イタリア	2,501,837,593	9.10
	フランス	2,687,001,764	9.77
	オーストラリア	465,942,100	1.69
	イギリス	2,166,751,291	7.88
	スイス	112,772,274	0.41
	シンガポール	105,081,855	0.38
	マレーシア	133,482,397	0.49
	オランダ	779,898,289	2.84
	スペイン	1,194,917,886	4.35
	ベルギー	733,240,314	2.67
	スウェーデン	163,773,318	0.60
	ノルウェー	78,977,757	0.29
	オーストリア	518,735,690	1.89
	フィンランド	201,824,893	0.73
	デンマーク	257,809,244	0.94
	メキシコ	254,873,911	0.93
	ポーランド	188,871,281	0.69
南アフリカ	162,886,155	0.59	
	小計	27,441,761,105	99.79
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	58,138,386	0.21
合計(純資産総額)		27,499,899,491	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		28,287,546,130	102.86

(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(%)
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.150	2016/01/31	2,900,000	10,423.87	302,292,342	10,522.41	305,149,835	1.11
イギリス	国債証券	UK TREASURY	5.000	2025/03/07	1,680,000	17,285.61	290,398,170	17,512.14	294,203,970	1.07
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.250	2018/07/04	2,000,000	12,722.23	254,444,536	12,816.43	256,328,634	0.93

イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.000	2016/09/07	1,710,000	14,910.13	254,963,198	14,885.42	254,540,638	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2042/02/15	2,850,000	8,490.44	241,977,486	8,809.94	251,083,182	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/06/30	3,000,000	8,205.58	246,167,531	8,211.36	246,340,752	0.90
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2014/08/01	2,000,000	11,001.51	220,030,118	11,065.47	221,309,336	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2019/04/30	2,600,000	8,254.34	214,612,921	8,374.96	217,748,878	0.79
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.000	2016/07/04	1,790,000	12,093.09	216,466,299	12,117.74	216,907,578	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	2,500,000	8,611.69	215,292,335	8,585.39	214,634,733	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/04/30	2,500,000	8,206.87	205,171,687	8,212.00	205,300,000	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/05/31	2,500,000	8,206.23	205,155,647	8,211.36	205,283,960	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2017/07/31	2,300,000	8,825.98	202,997,431	8,888.21	204,428,757	0.74
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.750	2019/01/04	1,610,000	12,496.82	201,198,819	12,610.82	203,034,151	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6.250	2023/08/15	1,680,000	11,709.80	196,724,619	11,926.65	200,367,667	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	2,300,000	8,408.96	193,406,072	8,399.98	193,199,489	0.70
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2015/08/01	1,640,000	10,897.36	178,716,733	11,016.62	180,672,602	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2040/05/15	1,630,000	10,579.37	172,443,659	10,942.49	178,362,587	0.65
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.750	2023/08/01	1,600,000	10,648.34	170,373,512	10,887.13	174,194,009	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2014/03/31	2,100,000	8,209.11	172,391,371	8,213.92	172,492,417	0.63
イギリス	国債証券	UK TREASURY	6.000	2028/12/07	870,000	19,394.40	168,731,311	19,717.90	171,545,741	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2016/06/30	2,000,000	8,487.87	169,757,437	8,526.37	170,527,312	0.62
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2015/02/01	1,530,000	11,063.64	169,273,748	11,144.34	170,508,473	0.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.750	2021/04/25	1,380,000	12,165.10	167,878,410	12,353.68	170,480,721	0.62
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.850	2020/10/31	1,620,000	10,271.94	166,405,392	10,457.40	169,409,842	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2017/03/31	2,000,000	8,314.01	166,280,168	8,377.52	167,550,462	0.61
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5.000	2016/10/25	1,340,000	12,453.55	166,877,586	12,490.46	167,372,194	0.61
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.500	2018/08/01	1,500,000	10,957.64	164,364,525	11,142.52	167,137,776	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2015/05/15	2,000,000	8,180.56	163,611,268	8,199.81	163,996,206	0.60



イタリ ア	国債証 券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2016/08/01	1,490,000	10,841.21	161,534,075	11,005.12	163,976,321	0.60
----------	----------	-----------------------------	-------	------------	-----------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.79
合 計	99.79

## 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	143,683,000	11,519,028,567	11,792,206,740	42.88
	ユーロ	売建	106,703,000	11,082,502,658	11,368,137,620	41.34
	英ポンド	売建	16,992,000	2,179,346,511	2,236,729,750	8.13
	加ドル	売建	10,419,000	835,477,356	860,808,640	3.13
	豪ドル	売建	5,557,000	458,502,499	474,418,840	1.73
	デンマーククローネ	売建	18,710,000	259,644,409	267,339,180	0.97
	メキシコペソ	売建	41,530,000	253,886,644	261,958,000	0.95
	マレーシアリングット	売建	7,386,000	193,892,925	199,126,560	0.72
	ポーランドズロチ	売建	7,335,000	181,737,502	190,097,120	0.69
	スウェーデンクローナ	売建	13,648,000	162,898,158	167,752,240	0.61
	南アフリカランド	売建	18,002,000	163,673,229	167,040,990	0.61
	スイスフラン	売建	1,305,000	111,777,863	115,538,680	0.42
	シンガポールドル	売建	1,574,000	103,237,381	105,848,960	0.38
	ノルウェークローネ	売建	5,588,000	77,444,674	80,542,810	0.29

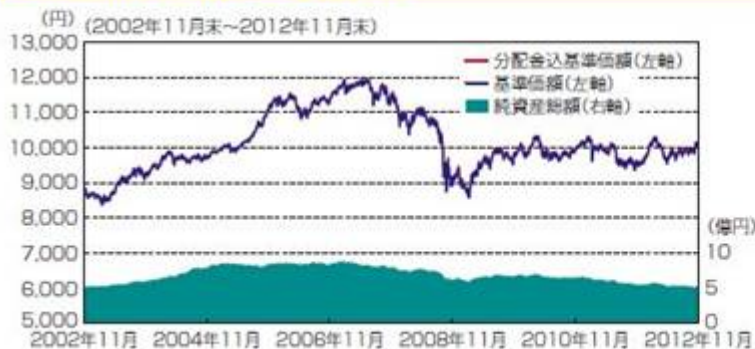
(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考情報)

## 運用実績

2012年11月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,124円

純資産総額…………… 5.20億円

※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、2002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)

2008年10月	2009年10月	2010年10月	2011年10月	2012年10月	設定来累計
0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	30.60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.08%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	4.97%
日本債券インデックスマザーファンド	44.53%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.06%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.97%
現金その他	4.79%

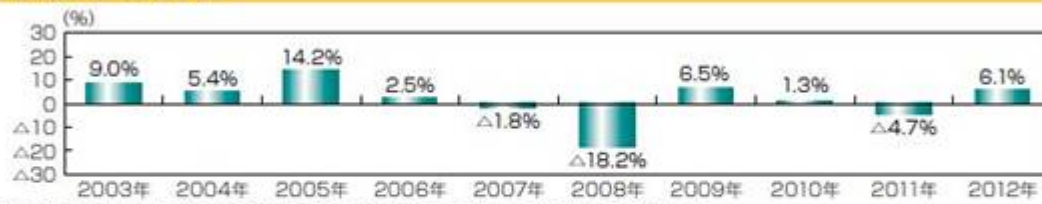
※当ファンドの対純資産総額比です。

## ＜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	4.17%
	2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本円	銀行業	2.59%
	3 本田技研工業	日本円	輸送用機器	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 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	2.33%
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.74%
	3 GENERAL ELECTRIC CO.	アメリカドル	資本財	0.95%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE 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	2.28%
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.70%
	3 GENERAL ELECTRIC CO.	アメリカドル	資本財	0.93%
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	2.53%
	2 第60回利付国債(20年)	日本円	国債証券	1.84%
	3 第314回利付国債(2年)	日本円	国債証券	1.74%
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4.75%)	アメリカドル	国債証券	1.55%
	2 US TREASURY N/B(クーポン4.25%)	アメリカドル	国債証券	1.48%
	3 US TREASURY N/B(クーポン4.00%)	アメリカドル	国債証券	1.36%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 BONOS Y OBLIG DEL ESTADO(クーポン3.15%)	ユーロ	国債証券	1.11%
	2 UK TREASURY(クーポン5.00%)	イギリスポンド	国債証券	1.07%
	3 BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND(クーポン4.25%)	ユーロ	国債証券	0.93%

※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。

※2012年は、2012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。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

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。

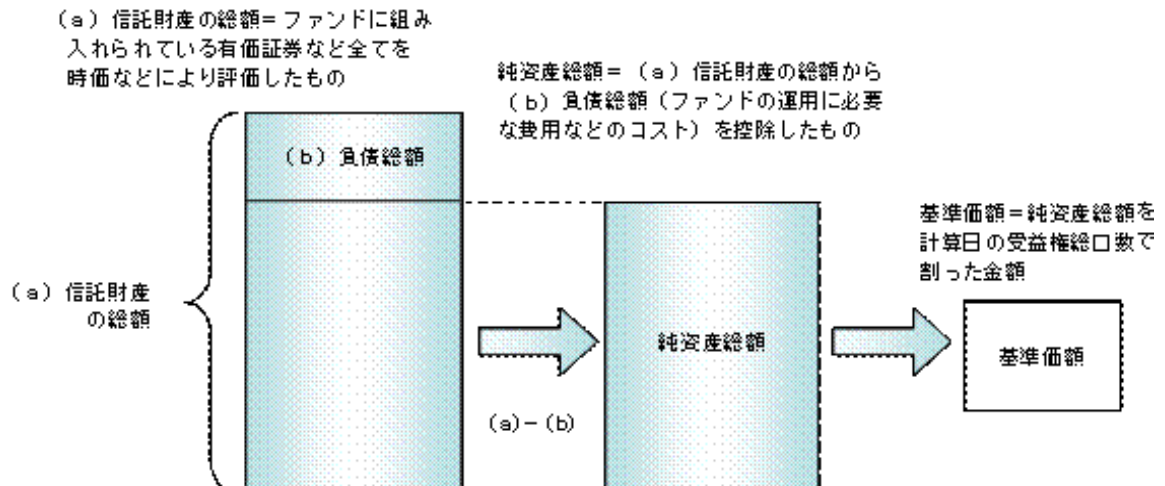
## 3 【資産管理等の概要】

## (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。

## &lt; 基準価額算出の流れ &gt;



## 有価証券などの評価基準

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

## &lt; 主な資産の評価方法 &gt;

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<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

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

<sup>\*</sup>外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

#### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

#### < 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

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

#### (4) 【計算期間】

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

#### (5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べる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

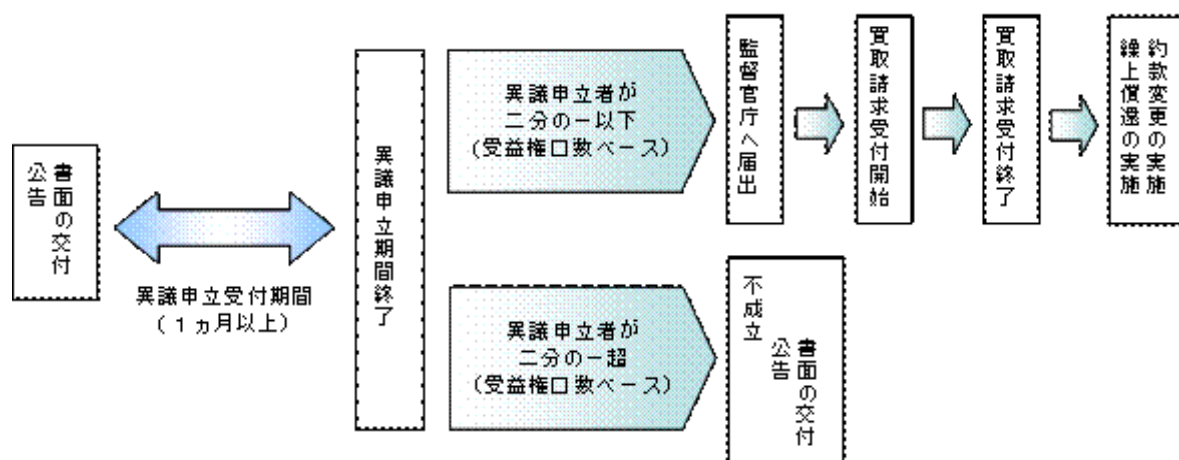
を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 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）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（平成23年10月27日から平成24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せん。



## 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12期 平成23年10月26日現在	第13期 平成24年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	29,792,965	27,035,853
親投資信託受益証券	533,256,284	490,346,178
未収入金	862,294	214,713
未収利息	55	51
流動資産合計	563,911,598	517,596,795
資産合計	563,911,598	517,596,795
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,134,480	362,826
未払受託者報酬	124,258	111,764
未払委託者報酬	1,771,596	1,593,531
その他未払費用	24,807	13,637
流動負債合計	3,055,141	2,081,758
負債合計	3,055,141	2,081,758
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	586,000,661	520,056,841
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,144,204	4,541,804
（分配準備積立金）	59,083,966	50,020,383
元本等合計	560,856,457	515,515,037
純資産合計	560,856,457	515,515,037
負債純資産合計	563,911,598	517,596,795

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期	第13期
	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	21,484	18,507
有価証券売買等損益	6,006,027	22,528,647
営業収益合計	5,984,543	22,547,154
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	258,684	228,334
委託者報酬	3,688,042	3,255,600
その他費用	51,643	27,861
営業費用合計	3,998,369	3,511,795
営業利益又は営業損失（ ）	9,982,912	19,035,359
経常利益又は経常損失（ ）	9,982,912	19,035,359
当期純利益又は当期純損失（ ）	9,982,912	19,035,359
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（ ）	1,825,911	1,981,184
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	15,798,042	25,144,204
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,844,260	4,106,640
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,844,260	4,106,640
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	381,599	558,415
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	381,599	558,415
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,144,204	4,541,804

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき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。
-----------------	--

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		第12期 平成23年10月26日現在	第13期 平成24年10月26日現在
1.	期首元本額	662,492,179円	586,000,661円
	期中追加設定元本額	38,817,760円	27,776,150円
	期中一部解約元本額	115,309,278円	93,719,970円
2.	受益権の総数	586,000,661口	520,056,841口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	25,144,204円	4,541,804円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日		第13期 自 平成23年10月27日 至 平成24年10月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配 当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益 15,275円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有 価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有 価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	55,955,837円	C 信託約款に定める収益調整金 52,222,644円
D	信託約款に定める分配準備積立金	59,083,966円	D 信託約款に定める分配準備積立金 50,005,108円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	115,039,803円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 102,243,027円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.1963円 1,963円	F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) 0.1965円 1,965円
G	分配金額	0円	G 分配金額 0円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0円 0円	H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり) 0円 0円

## (金融商品に関する注記)

## I 金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	第13期 自 平成23年10月27日 至 平成24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12期 平成23年10月26日現在	第13期 平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 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12期（平成23年10月26日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

第13期（平成24年10月26日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	18,565,914
合計	18,565,914

## (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12期 平成23年10月26日現在		第13期 平成24年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.9571円	1口当たり純資産額	0.9913円
（ 1万口当たり純資産額）	（ 9,571円）	（ 1万口当たり純資産額）	（ 9,913円）

## （ 4 ） 【 附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（ 単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	26,841,375	25,676,459	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	29,459,396	25,408,729	
	日本債券インデックスマザーファンド	185,939,603	233,595,923	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	17,186,845	26,098,224	
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	19,454,343	25,843,149	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	260,372,111	153,723,694	
親投資信託受益証券 合計		539,253,673	490,346,178	
	合計	539,253,673	490,346,178	

(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通りです。

### 1. 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

### （1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成23年10月26日現在	平成24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		97,008,505	69,564,544
株式		25,002,989,937	23,856,717,830
派生商品評価勘定		2,439,771	665,282
未収入金		22,128,060	39,525,306
未収配当金		254,754,516	247,545,320
未収利息		180	132
流動資産合計		25,379,320,969	24,214,018,414
資産合計		25,379,320,969	24,214,018,414
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		332,599	3,477,158
前受金		3,855,000	2,462,000
未払解約金		22,875,026	9,694,077
流動負債合計		27,062,625	15,633,235
負債合計		27,062,625	15,633,235
純資産の部			
元本等			
元本		43,690,469,568	40,986,230,601
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,338,211,224	16,787,845,422
元本等合計		25,352,258,344	24,198,385,179
純資産合計		25,352,258,344	24,198,385,179
負債純資産合計		25,379,320,969	24,214,018,414

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
1.	期首	平成22年10月27日	平成23年10月27日
	期首元本額	49,105,983,953円	43,690,469,568円
	期首からの追加設定元本額	5,609,550,412円	2,790,629,343円
	期首からの一部解約元本額	11,025,064,797円	5,494,868,310円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	206,215,746円	228,900,360円
	DCインデックスバランス（株式40）	727,392,748円	813,948,519円
	DCインデックスバランス（株式60）	1,350,038,732円	1,495,692,940円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,458,941,916円	1,627,089,818円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	858,875,812円	965,266,890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	15,155,628,928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	17,437,461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	123,014,080円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	189,329,485円	188,919,142円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	179,388,657円	161,781,734円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	287,530,250円	260,372,111円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	370,262,226円	332,442,407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	14,763,797,749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	97,392,097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	119,169,389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	44,505,368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	76,809,009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	432,717,850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	1,154,734,144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	1,483,461,174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	1,443,149,431円
	計	43,690,469,568円	40,986,230,601円
2.	受益権の総数	43,690,469,568口	40,986,230,601口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	18,338,211,224円	16,787,845,422円
4.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	205,666,000円	215,798,500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)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24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

	平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）  
（平成23年10月26日現在）  
売買目的有価証券

（単位：円）

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

（平成24年10月26日現在）  
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	145,603,844
合計	145,603,844

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

（デリバティブ取引等に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
（株式関連）  
（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

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

（平成24年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	336,385,000		333,675,000	2,710,000
	合計	336,385,000		333,675,000	2,710,000

## (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23年10月26日現在		平成24年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.5803円	1口当たり純資産額	0.5904円
(1万口当たり純資産額)	(5,803円)	(1万口当たり純資産額)	(5,904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	10,000	176.00	1,760,000	
1332	日本水産	30,400	179.00	5,441,600	
1334	マルハニチロホールディングス	52,000	132.00	6,864,000	
1377	サカタのタネ	3,900	1,053.00	4,106,700	
1379	ホクト	2,700	1,570.00	4,239,000	
1514	住石ホールディングス	7,800	70.00	546,000	
1515	日鉄鉱業	7,000	316.00	2,212,000	
1518	三井松島産業	17,000	115.00	1,955,000	
1605	国際石油開発帝石	321	460,500.00	147,820,500	
1606	日本海洋掘削	700	2,265.00	1,585,500	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	425.00	1,275,000	
1662	石油資源開発	3,800	3,340.00	12,692,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,300	2,520.00	5,796,000	
1417	ミライト・ホールディングス	7,500	676.00	5,070,000	
1712	ダイセキ環境ソリューション	2	116,600.00	233,200	
1719	間組	9,600	176.00	1,689,600	
1720	東急建設	9,370	143.00	1,339,910	
1721	コムシスホールディングス	12,800	1,103.00	14,118,400	
1722	ミサワホーム	2,600	1,156.00	3,005,600	
1762	高松コンストラクショングループ	2,000	1,352.00	2,704,000	
1766	東建コーポレーション	990	3,355.00	3,321,450	
1780	ヤマウラ	1,500	239.00	358,500	
1801	大成建設	133,000	221.00	29,393,000	
1802	大林組	79,000	359.00	28,361,000	
1803	清水建設	81,000	264.00	21,384,000	
1808	長谷工コーポレーション	165,000	51.00	8,415,000	

1810	松井建設	3,000	318.00	954,000	
1812	鹿島建設	124,000	220.00	27,280,000	
1813	不動テトラ	18,600	108.00	2,008,800	
1814	大末建設	10,000	46.00	460,000	
1815	鉄建建設	15,000	103.00	1,545,000	
1816	安藤建設	9,000	90.00	810,000	
1819	太平工業	5,000	314.00	1,570,000	
1820	西松建設	35,000	122.00	4,270,000	
1821	三井住友建設	20,400	49.00	999,600	
1822	大豊建設	7,000	95.00	665,000	
1824	前田建設工業	16,000	353.00	5,648,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	145.00	290,000	
1833	奥村組	25,000	248.00	6,200,000	
1834	大和小田急建設	1,500	159.00	238,500	
1835	東鉄工業	3,400	935.00	3,179,000	
1847	イチケン	3,000	146.00	438,000	
1852	浅沼組	8,000	55.00	440,000	
1860	戸田建設	28,000	233.00	6,524,000	
1861	熊谷組	19,000	69.00	1,311,000	
1865	青木あすなろ建設	2,000	426.00	852,000	
1866	北野建設	5,000	192.00	960,000	
1867	植木組	3,000	148.00	444,000	
1868	三井ホーム	3,000	393.00	1,179,000	
1870	矢作建設工業	3,300	333.00	1,098,900	
1871	ピーエス三菱	1,700	342.00	581,400	
1878	大東建託	10,000	7,940.00	79,400,000	
1879	新日本建設	3,200	185.00	592,000	
1881	N I P P O	6,000	860.00	5,160,000	
1882	東亜道路工業	5,000	212.00	1,060,000	
1883	前田道路	7,000	961.00	6,727,000	
1884	日本道路	8,000	293.00	2,344,000	
1885	東亜建設工業	23,000	118.00	2,714,000	
1888	若築建設	14,000	71.00	994,000	
1890	東洋建設	8,200	242.00	1,984,400	
1893	五洋建設	33,500	190.00	6,365,000	
1896	大林道路	3,000	198.00	594,000	
1899	福田組	4,000	302.00	1,208,000	
1911	住友林業	18,200	697.00	12,685,400	
1914	日本基礎技術	2,900	263.00	762,700	
1916	日成ビルド工業	8,000	184.00	1,472,000	
1919	エス・バイ・エル	14,000	131.00	1,834,000	
1921	巴コーポレーション	3,300	263.00	867,900	
1924	パナホーム	10,000	478.00	4,780,000	
1925	大和ハウス工業	66,000	1,184.00	78,144,000	
1926	ライト工業	5,500	341.00	1,875,500	
1928	積水ハウス	74,000	794.00	58,756,000	
1929	日特建設	1,600	260.00	416,000	
1930	北陸電気工事	2,000	223.00	446,000	
1934	ユアテック	4,000	265.00	1,060,000	

1937	西部電気工業	2,000	353.00	706,000	
1939	四電工	2,000	292.00	584,000	

[次へ](#)

1941	中電工	3,800	734.00	2,789,200	
1942	関電工	12,000	386.00	4,632,000	
1944	きんでん	18,000	487.00	8,766,000	
1945	東京エネシス	3,000	365.00	1,095,000	
1946	トーエネック	4,000	439.00	1,756,000	
1949	住友電設	1,800	652.00	1,173,600	
1950	日本電設工業	5,000	725.00	3,625,000	
1951	協和エクシオ	8,600	874.00	7,516,400	
1952	新日本空調	2,000	441.00	882,000	
1956	N D S	4,000	238.00	952,000	
1959	九電工	5,000	348.00	1,740,000	
1961	三機工業	6,000	372.00	2,232,000	
1963	日揮	25,000	2,774.00	69,350,000	
1964	中外炉工業	8,000	217.00	1,736,000	
1967	ヤマト	2,000	308.00	616,000	
1968	太平電業	3,000	527.00	1,581,000	
1969	高砂熱学工業	7,500	638.00	4,785,000	
1972	三晃金属工業	3,000	195.00	585,000	
1975	朝日工業社	3,000	283.00	849,000	
1979	大気社	4,000	1,673.00	6,692,000	
1980	ダイダン	3,000	484.00	1,452,000	
1982	日比谷総合設備	3,200	996.00	3,187,200	
1983	東芝プラントシステム	4,000	1,025.00	4,100,000	
6330	東洋エンジニアリング	14,000	334.00	4,676,000	
6366	千代田化工建設	21,000	1,258.00	26,418,000	
6379	新興プラントテック	5,400	659.00	3,558,600	
2001	日本製粉	16,000	339.00	5,424,000	
2002	日清製粉グループ本社	24,000	1,014.00	24,336,000	
2003	日東富士製粉	2,000	298.00	596,000	
2004	昭和産業	11,000	263.00	2,893,000	
2009	鳥越製粉	2,100	634.00	1,331,400	
2052	協同飼料	9,000	92.00	828,000	
2053	中部飼料	2,300	498.00	1,145,400	
2056	日本配合飼料	8,000	105.00	840,000	
2107	東洋精糖	4,000	84.00	336,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	151.00	2,265,000	
2109	三井製糖	9,000	250.00	2,250,000	
2201	森永製菓	26,000	177.00	4,602,000	
2204	中村屋	6,000	396.00	2,376,000	
2206	江崎グリコ	10,000	906.00	9,060,000	
2207	名糖産業	1,200	1,036.00	1,243,200	
2211	不二家	15,000	198.00	2,970,000	
2212	山崎製パン	19,000	991.00	18,829,000	
2215	第一屋製パン	4,000	79.00	316,000	
2217	モロゾフ	4,000	275.00	1,100,000	
2220	亀田製菓	1,500	1,996.00	2,994,000	
2229	カルビー	1,900	7,360.00	13,984,000	
2264	森永乳業	22,000	271.00	5,962,000	
2267	ヤクルト本社	14,100	3,855.00	54,355,500	

2269	明治ホールディングス	7,800	3,695.00	28,821,000	
2270	雪印メグミルク	5,700	1,311.00	7,472,700	
2281	プリマハム	15,000	141.00	2,115,000	
2282	日本ハム	20,000	1,021.00	20,420,000	
2284	伊藤ハム	14,000	327.00	4,578,000	
2286	林兼産業	9,000	64.00	576,000	
2288	丸大食品	13,000	282.00	3,666,000	
2290	米久	2,300	646.00	1,485,800	
2292	S Foods	1,500	731.00	1,096,500	
2501	サッポロホールディングス	43,000	228.00	9,804,000	
2502	アサヒグループホールディングス	53,000	1,879.00	99,587,000	
2503	キリンホールディングス	113,000	1,010.00	114,130,000	
2531	宝ホールディングス	22,000	603.00	13,266,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	196.00	1,372,000	
2540	養命酒製造	2,000	715.00	1,430,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,700	669.00	1,806,300	
2579	コカ・コーラウエスト	9,000	1,268.00	11,412,000	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,300	984.00	3,247,200	
2590	ダイドードリンコ	1,200	3,460.00	4,152,000	
2593	伊藤園	7,300	1,547.00	11,293,100	
2594	キーコーヒー	2,300	1,543.00	3,548,900	
2597	ユニカフェ	600	413.00	247,800	
2599	ジャパンフーズ	400	862.00	344,800	
2602	日清オイリオグループ	10,000	295.00	2,950,000	
2607	不二製油	6,400	1,093.00	6,995,200	
2613	J - オイルミルズ	10,000	208.00	2,080,000	
2801	キッコーマン	22,000	1,082.00	23,804,000	
2802	味の素	69,000	1,233.00	85,077,000	
2809	キューピー	13,400	1,342.00	17,982,800	
2810	ハウス食品	9,400	1,306.00	12,276,400	
2811	カゴメ	10,200	1,653.00	16,860,600	
2812	焼津水産化学工業	1,200	739.00	886,800	
2815	アリアケジャパン	2,400	1,734.00	4,161,600	
2871	ニチレイ	30,000	446.00	13,380,000	
2875	東洋水産	11,000	2,040.00	22,440,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,300	3,055.00	31,466,500	
2899	永谷園	2,000	793.00	1,586,000	
2908	フジッコ	3,000	1,028.00	3,084,000	
2910	ロック・フィールド	1,400	1,473.00	2,062,200	
2914	日本たばこ産業	117,000	2,299.00	268,983,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	800	744.00	595,200	
2918	わらべや日洋	1,500	1,653.00	2,479,500	
2922	なとり	1,200	865.00	1,038,000	
4404	ミヨシ油脂	8,000	98.00	784,000	
3001	片倉工業	3,100	689.00	2,135,900	
3002	ゲンゼ	19,000	203.00	3,857,000	
3101	東洋紡	104,000	90.00	9,360,000	
3103	ユニチカ	55,000	38.00	2,090,000	
3104	富士紡ホールディングス	10,000	337.00	3,370,000	

3105	日清紡ホールディングス	16,000	525.00	8,400,000	
3106	倉敷紡績	25,000	128.00	3,200,000	
3109	シキボウ	16,000	93.00	1,488,000	
3201	日本毛織	8,000	567.00	4,536,000	
3202	大東紡織	4,000	62.00	248,000	
3204	トーア紡コーポレーション	11,000	56.00	616,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,000	451.00	1,353,000	
3302	帝国繊維	2,000	600.00	1,200,000	
3401	帝人	101,000	180.00	18,180,000	
3402	東レ	179,000	442.00	79,118,000	
3408	サカイオーベックス	7,000	113.00	791,000	
3501	住江織物	6,000	148.00	888,000	
3512	日本フェルト	1,400	403.00	564,200	
3513	イチカワ	2,000	152.00	304,000	
3514	日本バイリーン	3,000	338.00	1,014,000	
3524	日東製網	3,000	114.00	342,000	
3526	芦森工業	6,000	102.00	612,000	
3529	アツギ	19,000	91.00	1,729,000	
3551	ダイニック	5,000	155.00	775,000	
3569	セーレン	6,200	504.00	3,124,800	
3577	東海染工	4,000	83.00	332,000	
3580	小松精練	4,000	376.00	1,504,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	896.00	13,440,000	
3593	ホギメディカル	1,500	4,120.00	6,180,000	
3606	レナウン	5,300	105.00	556,500	
3607	クラウディア	300	1,000.00	300,000	
3608	T S Iホールディングス	11,000	494.00	5,434,000	
8011	三陽商会	13,000	232.00	3,016,000	
8013	ナイガイ	7,000	47.00	329,000	
8016	オンワードホールディングス	15,000	585.00	8,775,000	
8029	ルック	4,000	414.00	1,656,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	474.00	2,844,000	
8114	デサント	6,000	444.00	2,664,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,400	354.00	495,600	
3708	特種東海製紙	15,000	196.00	2,940,000	
3861	王子ホールディングス	109,000	233.00	25,397,000	
3864	三菱製紙	35,000	69.00	2,415,000	
3865	北越紀州製紙	15,500	403.00	6,246,500	
3877	中越パルプ工業	9,000	137.00	1,233,000	
3878	巴川製紙所	4,000	143.00	572,000	
3880	大王製紙	10,000	445.00	4,450,000	
3893	日本製紙グループ本社	11,900	917.00	10,912,300	
3941	レンゴー	20,000	335.00	6,700,000	
3946	トーモク	8,000	215.00	1,720,000	
3950	ザ・バック	1,700	1,407.00	2,391,900	
3405	クラレ	39,200	907.00	35,554,400	
3407	旭化成	144,000	432.00	62,208,000	
3553	共和レザー	1,500	258.00	387,000	
4003	コープケミカル	4,000	91.00	364,000	



4004	昭和電工	153,000	119.00	18,207,000	
4005	住友化学	169,000	219.00	37,011,000	
4007	日本化成	5,000	100.00	500,000	
4008	住友精化	5,000	284.00	1,420,000	
4021	日産化学工業	18,800	925.00	17,390,000	
4022	ラサ工業	10,000	70.00	700,000	
4023	クレハ	16,000	312.00	4,992,000	
4027	テイカ	4,000	226.00	904,000	
4028	石原産業	41,000	62.00	2,542,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	183.00	366,000	
4041	日本曹達	15,000	349.00	5,235,000	
4042	東ソー	66,000	149.00	9,834,000	
4043	トクヤマ	38,000	153.00	5,814,000	
4044	セントラル硝子	24,000	223.00	5,352,000	
4045	東亜合成	29,000	323.00	9,367,000	
4046	ダイソー	10,000	222.00	2,220,000	
4047	関東電化工業	6,000	126.00	756,000	
4061	電気化学工業	49,000	243.00	11,907,000	
4063	信越化学工業	44,200	4,495.00	198,679,000	
4064	日本カーバイド工業	8,000	173.00	1,384,000	
4078	堺化学工業	8,000	219.00	1,752,000	
4088	エア・ウォーター	20,000	978.00	19,560,000	
4091	大陽日酸	33,000	426.00	14,058,000	
4092	日本化学工業	10,000	97.00	970,000	
4095	日本パーカライジング	6,000	1,186.00	7,116,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	418.00	1,672,000	
4099	四国化成工業	3,000	440.00	1,320,000	
4100	戸田工業	3,000	243.00	729,000	
4109	ステラ ケミファ	1,200	1,429.00	1,714,800	
4112	保土谷化学工業	5,000	148.00	740,000	
4114	日本触媒	18,000	775.00	13,950,000	
4116	大日精化工業	9,000	332.00	2,988,000	
4118	カネカ	31,000	385.00	11,935,000	
4182	三菱瓦斯化学	43,000	376.00	16,168,000	
4183	三井化学	105,000	160.00	16,800,000	
4185	J S R	22,400	1,292.00	28,940,800	
4186	東京応化工業	4,400	1,609.00	7,079,600	
4187	大阪有機化学工業	1,700	345.00	586,500	
4188	三菱ケミカルホールディングス	154,000	302.00	46,508,000	
4201	日本合成化学工業	5,000	506.00	2,530,000	
4202	ダイセル	32,000	465.00	14,880,000	
4203	住友ベークライト	21,000	275.00	5,775,000	
4204	積水化学工業	51,000	625.00	31,875,000	
4205	日本ゼオン	23,000	570.00	13,110,000	
4206	アイカ工業	6,400	1,377.00	8,812,800	
4208	宇部興産	103,000	179.00	18,437,000	
4212	積水樹脂	3,000	769.00	2,307,000	
4215	タキロン	6,000	283.00	1,698,000	
4216	旭有機材工業	9,000	190.00	1,710,000	

4217	日立化成工業	10,700	1,091.00	11,673,700	
4218	ニチバン	3,000	250.00	750,000	
4220	リケンテクノス	4,000	203.00	812,000	
4221	大倉工業	6,000	219.00	1,314,000	
4228	積水化成品工業	6,000	189.00	1,134,000	
4229	群栄化学工業	7,000	195.00	1,365,000	
4231	タイガースポリマー	1,200	268.00	321,600	
4271	日本カーリット	2,000	396.00	792,000	
4272	日本化薬	17,000	881.00	14,977,000	
4362	日本精化	2,000	533.00	1,066,000	
4401	A D E K A	10,600	604.00	6,402,400	
4403	日油	19,000	376.00	7,144,000	
4410	ハリマ化成グループ	2,100	359.00	753,900	
4452	花王	65,400	2,259.00	147,738,600	
4461	第一工業製薬	5,000	198.00	990,000	
4471	三洋化成工業	8,000	449.00	3,592,000	
4611	大日本塗料	14,000	85.00	1,190,000	
4612	日本ペイント	23,000	631.00	14,513,000	
4613	関西ペイント	28,000	865.00	24,220,000	
4614	トウベ	2,000	79.00	158,000	
4617	中国塗料	8,000	399.00	3,192,000	
4619	日本特殊塗料	1,900	340.00	646,000	
4620	藤倉化成	3,100	317.00	982,700	
4626	太陽ホールディングス	2,000	2,226.00	4,452,000	
4631	D I C	94,000	142.00	13,348,000	
4633	サカティンクス	4,000	389.00	1,556,000	
4634	東洋インキS Cホールディングス	22,000	286.00	6,292,000	
4901	富士フイルムホールディングス	52,700	1,323.00	69,722,100	
4911	資生堂	40,900	984.00	40,245,600	
4912	ライオン	29,000	457.00	13,253,000	
4914	高砂香料工業	8,000	413.00	3,304,000	
4917	マンダム	2,500	2,101.00	5,252,500	
4919	ミルボン	1,200	2,636.00	3,163,200	
4921	ファンケル	6,200	867.00	5,375,400	
4922	コーセー	4,000	1,828.00	7,312,000	
4924	ドクターシーラボ	17	255,500.00	4,343,500	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,900	2,504.00	7,261,600	
4928	ノエビアホールディングス	1,400	1,166.00	1,632,400	
4951	エステー	1,500	890.00	1,335,000	
4956	コニシ	1,800	1,219.00	2,194,200	
4958	長谷川香料	3,100	1,013.00	3,140,300	
4963	星光P M C	1,000	285.00	285,000	
4967	小林製薬	3,400	4,330.00	14,722,000	
4968	荒川化学工業	1,900	616.00	1,170,400	
4971	メック	1,800	224.00	403,200	
4973	日本高純度化学	7	181,400.00	1,269,800	
4975	J C U	300	2,743.00	822,900	
4985	アース製薬	1,800	2,988.00	5,378,400	
4989	イハラケミカル工業	4,000	382.00	1,528,000	

4992	北興化学工業	3,000	223.00	669,000	
4994	大成ラミック	700	2,350.00	1,645,000	
4996	クミアイ化学工業	5,000	366.00	1,830,000	
4997	日本農薬	6,000	360.00	2,160,000	
5142	アキレス	20,000	104.00	2,080,000	
5208	有沢製作所	4,100	189.00	774,900	
6988	日東電工	20,300	3,635.00	73,790,500	
7874	レック	700	991.00	693,700	
7908	きもと	2,000	419.00	838,000	
7917	藤森工業	1,800	1,821.00	3,277,800	
7925	前澤化成工業	1,700	878.00	1,492,600	
7942	J S P	1,600	1,040.00	1,664,000	
7947	エフピコ	1,100	5,970.00	6,567,000	
7958	天馬	2,000	800.00	1,600,000	
7970	信越ポリマー	4,800	266.00	1,276,800	
7971	東リ	6,000	172.00	1,032,000	
7988	ニフコ	5,500	1,797.00	9,883,500	
7995	日本バルカー工業	9,000	220.00	1,980,000	
8113	ユニ・チャーム	13,600	4,430.00	60,248,000	
4151	協和発酵キリン	29,000	880.00	25,520,000	
4502	武田薬品工業	92,400	3,695.00	341,418,000	代用有価証券 10,000株
4503	アステラス製薬	54,800	3,975.00	217,830,000	
4506	大日本住友製薬	17,500	905.00	15,837,500	
4507	塩野義製薬	38,500	1,272.00	48,972,000	
4508	田辺三菱製薬	24,600	1,143.00	28,117,800	
4512	わかもと製薬	3,000	216.00	648,000	
4514	あすか製薬	3,000	413.00	1,239,000	
4516	日本新薬	5,000	985.00	4,925,000	
4519	中外製薬	28,600	1,622.00	46,389,200	
4521	科研製薬	10,000	1,256.00	12,560,000	
4523	エーザイ	30,400	3,530.00	107,312,000	
4527	ロート製薬	10,000	1,120.00	11,200,000	
4528	小野薬品工業	12,100	4,755.00	57,535,500	
4530	久光製薬	7,600	4,175.00	31,730,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	223.00	446,000	
4534	持田製薬	8,000	1,031.00	8,248,000	
4536	参天製薬	8,300	3,545.00	29,423,500	
4538	扶桑薬品工業	8,000	265.00	2,120,000	
4539	日本ケミファ	4,000	515.00	2,060,000	
4540	ツムラ	6,700	2,498.00	16,736,600	
4541	日医工	3,900	1,698.00	6,622,200	
4547	キッセイ薬品工業	4,600	1,374.00	6,320,400	
4548	生化学工業	4,700	918.00	4,314,600	
4549	栄研化学	1,900	1,076.00	2,044,400	
4550	日水製薬	1,000	827.00	827,000	
4551	鳥居薬品	1,700	1,719.00	2,922,300	
4553	東和薬品	1,300	5,040.00	6,552,000	
4554	富士製薬工業	600	1,233.00	739,800	

4555	沢井製薬	1,600	8,840.00	14,144,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,277.00	5,108,000	
4568	第一三共	83,000	1,212.00	100,596,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,698.00	10,188,000	
4574	大幸薬品	1,200	734.00	880,800	
4577	ダイト	700	1,349.00	944,300	
4578	大塚ホールディングス	48,900	2,434.00	119,022,600	
4581	大正製薬ホールディングス	5,900	6,440.00	37,996,000	
3315	日本コークス工業	20,000	95.00	1,900,000	
5002	昭和シェル石油	22,100	441.00	9,746,100	
5007	コスモ石油	68,000	146.00	9,928,000	
5011	ニチレキ	3,000	366.00	1,098,000	
5012	東燃ゼネラル石油	37,000	722.00	26,714,000	
5013	ユシロ化学工業	1,300	769.00	999,700	
5015	ビーピー・カストロール	900	349.00	314,100	
5017	AOCホールディングス	5,700	277.00	1,578,900	
5018	MORESCO	500	702.00	351,000	
5019	出光興産	2,900	7,000.00	20,300,000	
5020	JXホールディングス	273,800	420.00	114,996,000	
5101	横浜ゴム	28,000	565.00	15,820,000	
5105	東洋ゴム工業	19,000	196.00	3,724,000	
5108	ブリヂストン	77,300	1,859.00	143,700,700	
5110	住友ゴム工業	19,200	925.00	17,760,000	
5121	藤倉ゴム工業	1,600	263.00	420,800	
5122	オカモト	9,000	313.00	2,817,000	
5185	フコク	1,000	716.00	716,000	
5186	ニッタ	2,400	1,247.00	2,992,800	
5191	東海ゴム工業	4,600	763.00	3,509,800	
5192	三ツ星ベルト	6,000	449.00	2,694,000	
5195	バンドー化学	8,000	246.00	1,968,000	
3110	日東紡績	18,000	260.00	4,680,000	
5201	旭硝子	121,000	527.00	63,767,000	
5202	日本板硝子	106,000	60.00	6,360,000	
5204	石塚硝子	3,000	130.00	390,000	
5210	日本山村硝子	10,000	180.00	1,800,000	
5214	日本電気硝子	47,000	406.00	19,082,000	
5218	オハラ	900	644.00	579,600	
5232	住友大阪セメント	50,000	262.00	13,100,000	
5233	太平洋セメント	145,000	163.00	23,635,000	
5234	デイ・シイ	2,300	231.00	531,300	
5262	日本ヒューム	2,000	404.00	808,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	255.00	1,020,000	
5301	東海カーボン	21,000	250.00	5,250,000	
5302	日本カーボン	13,000	137.00	1,781,000	
5310	東洋炭素	1,200	1,497.00	1,796,400	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	188.00	2,444,000	
5332	TOTO	38,000	600.00	22,800,000	
5333	日本碍子	32,000	873.00	27,936,000	
5334	日本特殊陶業	21,000	863.00	18,123,000	

5337	ダントーホールディングス	4,000	83.00	332,000	
5344	MARUWA	700	2,477.00	1,733,900	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	161.00	966,000	
5352	黒崎播磨	5,000	183.00	915,000	
5363	東京窯業	3,000	151.00	453,000	
5367	ニッカトー	900	432.00	388,800	
5384	フジインコーポレーテッド	2,200	1,559.00	3,429,800	
5391	エーアンドエーマテリアル	5,000	66.00	330,000	
5393	ニチアス	11,000	381.00	4,191,000	
7943	ニチハ	2,700	876.00	2,365,200	
5401	新日鐵住金	983,000	172.00	169,076,000	
5406	神戸製鋼所	342,000	68.00	23,256,000	
5410	合同製鐵	14,000	112.00	1,568,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	62,600	1,128.00	70,612,800	

[次へ](#)

5413	日新製鋼ホールディングス	9,800	496.00	4,860,800	
5423	東京製鐵	12,500	252.00	3,150,000	
5440	共英製鋼	2,600	1,238.00	3,218,800	
5444	大和工業	5,600	2,171.00	12,157,600	
5445	東京鐵鋼	5,000	276.00	1,380,000	
5449	大阪製鐵	1,500	1,227.00	1,840,500	
5451	淀川製鋼所	18,000	255.00	4,590,000	
5453	東洋鋼鈑	6,000	196.00	1,176,000	
5457	住友鋼管	1,400	555.00	777,000	
5463	丸一鋼管	7,600	1,616.00	12,281,600	
5464	モリ工業	4,000	231.00	924,000	
5471	大同特殊鋼	41,000	330.00	13,530,000	
5476	日本高周波鋼業	10,000	75.00	750,000	
5480	日本冶金工業	18,000	67.00	1,206,000	
5481	山陽特殊製鋼	12,000	241.00	2,892,000	
5482	愛知製鋼	13,000	299.00	3,887,000	
5486	日立金属	16,000	728.00	11,648,000	
5491	日本金属	6,000	108.00	648,000	
5541	大平洋金属	17,000	269.00	4,573,000	
5563	日本電工	10,000	188.00	1,880,000	
5602	栗本鐵工所	12,000	242.00	2,904,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	169.00	507,000	
5632	三菱製鋼	15,000	137.00	2,055,000	
5658	日亜鋼業	4,000	189.00	756,000	
5659	日本精線	2,000	301.00	602,000	
6319	シンニッタン	2,100	319.00	669,900	
7305	新家工業	5,000	111.00	555,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	203.00	812,000	
5703	日本輕金属ホールディングス	55,800	73.00	4,073,400	
5706	三井金属鉱業	67,000	165.00	11,055,000	
5707	東邦亜鉛	14,000	272.00	3,808,000	
5711	三菱マテリアル	154,000	229.00	35,266,000	
5713	住友金属鉱山	64,000	1,022.00	65,408,000	
5714	DOWAホールディングス	29,000	529.00	15,341,000	
5715	古河機械金属	42,000	71.00	2,982,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	1,542.00	3,700,800	
5727	東邦チタニウム	4,000	701.00	2,804,000	
5738	住友輕金属工業	60,000	66.00	3,960,000	
5741	古河スカイ	10,000	190.00	1,900,000	
5801	古河電気工業	78,000	161.00	12,558,000	
5802	住友電気工業	87,100	848.00	73,860,800	
5803	フジクラ	37,000	241.00	8,917,000	
5805	昭和電線ホールディングス	32,000	58.00	1,856,000	
5809	タツタ電線	5,000	809.00	4,045,000	
5812	日立電線	19,000	104.00	1,976,000	
5815	沖電線	3,000	116.00	348,000	
5819	カナレ電気	300	1,295.00	388,500	
5821	平河ヒューテック	500	649.00	324,500	
5851	リョービ	14,000	160.00	2,240,000	

5857	アサヒホールディングス	3,500	1,305.00	4,567,500	
3421	稲葉製作所	1,100	1,006.00	1,106,600	
3431	宮地エンジニアリンググループ	8,000	131.00	1,048,000	
3432	三協・立山ホールディングス	33,000	174.00	5,742,000	
3433	トーカロ	1,400	1,205.00	1,687,000	
3434	アルファC o	800	879.00	703,200	
3436	SUMCO	15,100	545.00	8,229,500	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,094.00	656,400	
5901	東洋製罐	17,400	850.00	14,790,000	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	228.00	1,368,000	
5909	コロナ	1,100	1,007.00	1,107,700	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	604.00	3,020,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	214.00	1,070,000	
5923	高田機工	2,000	159.00	318,000	
5929	三和ホールディングス	25,000	320.00	8,000,000	
5930	文化シャッター	6,000	340.00	2,040,000	
5936	東洋シャッター	700	438.00	306,600	
5938	L I X I Lグループ	32,000	1,784.00	57,088,000	
5942	日本ファイルコン	1,800	390.00	702,000	
5943	ノーリツ	4,800	1,319.00	6,331,200	
5946	長府製作所	2,400	1,834.00	4,401,600	
5947	リンナイ	4,000	5,470.00	21,880,000	
5951	ダイニチ工業	1,300	794.00	1,032,200	
5957	日東精工	3,000	205.00	615,000	
5958	三洋工業	3,000	144.00	432,000	
5959	岡部	4,900	495.00	2,425,500	
5974	中国工業	4,000	80.00	320,000	
5975	東プレ	4,800	677.00	3,249,600	
5976	高周波熱錬	3,300	502.00	1,656,600	
5981	東京製綱	16,000	88.00	1,408,000	
5988	パイオラックス	1,100	1,677.00	1,844,700	
5991	日本発條	17,900	656.00	11,742,400	
5992	中央発條	3,000	281.00	843,000	
5998	アドバネクス	5,000	73.00	365,000	
8155	三益半導体工業	2,100	619.00	1,299,900	
1978	アタカ大機	2,000	337.00	674,000	
5631	日本製鋼所	38,000	442.00	16,796,000	
5963	日立ツール	1,400	745.00	1,043,000	
6005	三浦工業	3,700	1,843.00	6,819,100	
6013	タクマ	8,000	397.00	3,176,000	
6101	ツガミ	6,000	497.00	2,982,000	
6103	オークマ	15,000	476.00	7,140,000	
6104	東芝機械	13,000	341.00	4,433,000	
6113	アマダ	35,000	396.00	13,860,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,400	500.00	3,200,000	
6135	牧野フライス製作所	12,000	354.00	4,248,000	
6136	オーエスジー	10,100	1,056.00	10,665,600	
6138	ダイジェット工業	3,000	149.00	447,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	6,100	825.00	5,032,500	

6141	森精機製作所	13,000	505.00	6,565,000	
6146	ディスコ	2,500	3,795.00	9,487,500	
6151	日東工器	1,400	1,816.00	2,542,400	
6203	豊和工業	13,000	73.00	949,000	
6205	大阪機工	10,000	90.00	900,000	
6210	東洋機械金属	1,800	189.00	340,200	
6217	津田駒工業	6,000	103.00	618,000	
6222	島精機製作所	3,200	1,086.00	3,475,200	
6247	日阪製作所	3,000	566.00	1,698,000	
6250	やまびこ	1,000	1,016.00	1,016,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,300	178.00	409,400	
6268	ナプテスコ	10,300	1,497.00	15,419,100	
6269	三井海洋開発	2,000	1,616.00	3,232,000	
6272	レオン自動機	2,000	180.00	360,000	
6273	S M C	7,300	12,270.00	89,571,000	
6274	新川	1,900	348.00	661,200	
6277	ホソカワミクロン	4,000	436.00	1,744,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,224.00	1,713,600	
6282	オイレス工業	2,600	1,529.00	3,975,400	
6287	サトーホールディングス	2,600	1,142.00	2,969,200	
6291	日本エアーテック	700	342.00	239,400	
6293	日精樹脂工業	2,000	303.00	606,000	
6298	ワイエイシイ	1,000	479.00	479,000	
6301	小松製作所	115,000	1,647.00	189,405,000	
6302	住友重機械工業	63,000	281.00	17,703,000	
6305	日立建機	12,600	1,341.00	16,896,600	
6306	日工	3,000	305.00	915,000	
6309	巴工業	900	1,420.00	1,278,000	
6310	井関農機	25,000	178.00	4,450,000	
6315	T O W A	2,200	443.00	974,600	
6316	丸山製作所	6,000	153.00	918,000	
6317	北川鉄工所	11,000	133.00	1,463,000	
6326	クボタ	113,000	824.00	93,112,000	
6328	荏原実業	600	1,215.00	729,000	
6331	三菱化工機	8,000	131.00	1,048,000	
6332	月島機械	4,000	656.00	2,624,000	
6333	帝国電機製作所	800	999.00	799,200	
6339	新東工業	5,400	534.00	2,883,600	
6340	澁谷工業	1,500	907.00	1,360,500	
6345	アイチ コーポレーション	4,100	330.00	1,353,000	
6349	小森コーポレーション	7,000	386.00	2,702,000	
6351	鶴見製作所	2,000	601.00	1,202,000	
6355	住友精密工業	3,000	322.00	966,000	
6358	酒井重工業	5,000	229.00	1,145,000	
6361	荏原製作所	40,000	321.00	12,840,000	
6362	石井鐵工所	4,000	134.00	536,000	
6363	西島製作所	2,900	541.00	1,568,900	
6367	ダイキン工業	30,000	2,203.00	66,090,000	
6368	オルガノ	5,000	470.00	2,350,000	



6369	トーヨーカネツ	13,000	158.00	2,054,000	
6370	栗田工業	13,600	1,767.00	24,031,200	
6371	椿本チエイン	13,000	401.00	5,213,000	
6373	大同工業	5,000	129.00	645,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	73.00	584,000	
6378	木村化工機	2,300	255.00	586,500	
6381	アネスト岩田	4,000	305.00	1,220,000	
6383	ダイフク	11,000	407.00	4,477,000	
6390	加藤製作所	6,000	229.00	1,374,000	
6393	油研工業	4,000	138.00	552,000	
6395	タダノ	11,000	617.00	6,787,000	
6406	フジテック	7,000	467.00	3,269,000	
6407	C K D	6,600	413.00	2,725,800	
6409	キトー	10	67,200.00	672,000	
6412	平和	5,100	1,256.00	6,405,600	
6413	理想科学工業	1,700	1,303.00	2,215,100	
6417	S A N K Y O	7,100	3,465.00	24,601,500	
6418	日本金銭機械	2,200	686.00	1,509,200	
6419	マースエンジニアリング	1,300	1,926.00	2,503,800	
6420	福島工業	700	1,358.00	950,600	
6428	オーイズミ	800	299.00	239,200	
6430	ダイコク電機	1,100	2,105.00	2,315,500	
6436	アマノ	7,100	660.00	4,686,000	
6440	J U K I	15,000	100.00	1,500,000	
6444	サンデン	12,000	238.00	2,856,000	
6445	蛇の目ミシン工業	23,000	55.00	1,265,000	
6454	マックス	4,000	880.00	3,520,000	
6457	グローリー	7,000	1,912.00	13,384,000	
6459	大和冷機工業	4,000	341.00	1,364,000	
6460	セガサミーホールディングス	25,300	1,494.00	37,798,200	
6461	日本ピストンリング	9,000	124.00	1,116,000	
6462	リケン	8,000	276.00	2,208,000	
6463	T P R	2,600	900.00	2,340,000	
6465	ホシザキ電機	5,100	2,176.00	11,097,600	
6470	大豊工業	1,700	790.00	1,343,000	
6471	日本精工	53,000	454.00	24,062,000	
6472	N T N	55,000	144.00	7,920,000	
6473	ジェイテクト	22,500	618.00	13,905,000	
6474	不二越	22,000	248.00	5,456,000	
6480	日本トムソン	8,000	292.00	2,336,000	
6481	T H K	15,700	1,308.00	20,535,600	
6482	ユーシン精機	1,200	1,460.00	1,752,000	
6485	前澤給装工業	900	1,031.00	927,900	
6486	イーグル工業	3,000	485.00	1,455,000	
6489	前澤工業	1,700	181.00	307,700	
6490	日本ピラー工業	2,000	509.00	1,018,000	
6498	キッツ	9,700	341.00	3,307,700	
6581	日立工機	6,300	570.00	3,591,000	
6586	マキタ	15,400	3,090.00	47,586,000	

7004	日立造船	93,000	98.00	9,114,000	
7011	三菱重工業	395,000	352.00	139,040,000	
7013	I H I	161,000	185.00	29,785,000	
4062	イビデン	15,500	1,032.00	15,996,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	62,000	560.00	34,720,000	
6448	ブラザー工業	30,500	748.00	22,814,000	
6479	ミネベア	35,000	257.00	8,995,000	
6501	日立製作所	543,000	410.00	222,630,000	
6502	東芝	496,000	283.00	140,368,000	
6503	三菱電機	236,000	596.00	140,656,000	
6504	富士電機	71,000	161.00	11,431,000	
6505	東洋電機製造	5,000	224.00	1,120,000	
6506	安川電機	28,000	555.00	15,540,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	14,000	138.00	1,932,000	
6508	明電舎	23,000	276.00	6,348,000	
6513	オリジン電気	4,000	302.00	1,208,000	
6517	デンヨー	2,100	808.00	1,696,800	
6588	東芝テック	15,000	370.00	5,550,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	130.00	520,000	
6592	マブチモーター	3,500	3,510.00	12,285,000	
6594	日本電産	13,100	5,640.00	73,884,000	
6617	東光高岳ホールディングス	1,000	1,159.00	1,159,000	
6620	宮越ホールディングス	800	270.00	216,000	
6622	ダイヘン	14,000	212.00	2,968,000	
6630	ヤーマン	200	1,197.00	239,400	
6632	J V C ケンウッド	14,200	279.00	3,961,800	
6640	第一精工	700	1,080.00	756,000	
6641	日新電機	5,000	481.00	2,405,000	
6644	大崎電気工業	3,000	441.00	1,323,000	
6645	オムロン	26,200	1,547.00	40,531,400	
6651	日東工業	3,500	1,207.00	4,224,500	
6652	I D E C	3,000	642.00	1,926,000	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	45,000	314.00	14,130,000	
6675	サクサホールディングス	6,000	132.00	792,000	
6676	メルコホールディングス	1,300	1,614.00	2,098,200	
6678	テクノメディカ	2	435,000.00	870,000	
6701	日本電気	324,000	140.00	45,360,000	
6702	富士通	227,000	302.00	68,554,000	
6703	沖電気工業	91,000	82.00	7,462,000	
6704	岩崎通信機	10,000	57.00	570,000	
6706	電気興業	7,000	364.00	2,548,000	
6707	サンケン電気	12,000	245.00	2,940,000	
6715	ナカヨ通信機	2,000	262.00	524,000	
6718	アイホン	1,300	1,487.00	1,933,100	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,100	296.00	1,805,600	
6724	セイコーエプソン	16,100	453.00	7,293,300	
6727	ワコム	46	213,200.00	9,807,200	
6728	アルバック	4,700	507.00	2,382,900	
6730	アクセル	1,100	1,946.00	2,140,600	

6737	ナナオ	2,000	1,345.00	2,690,000	
6741	日本信号	5,500	449.00	2,469,500	
6742	京三製作所	5,000	262.00	1,310,000	
6744	能美防災	3,000	509.00	1,527,000	
6745	ホーチキ	2,000	400.00	800,000	
6751	日本無線	5,000	189.00	945,000	
6752	パナソニック	269,100	493.00	132,666,300	
6753	シャープ	114,000	166.00	18,924,000	
6754	アンリツ	12,000	1,017.00	12,204,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	696.00	4,176,000	
6756	日立国際電気	5,000	481.00	2,405,000	
6758	ソニー	146,900	946.00	138,967,400	
6762	T D K	12,300	2,932.00	36,063,600	
6763	帝国通信工業	6,000	132.00	792,000	
6767	ミツミ電機	8,300	448.00	3,718,400	
6768	タムラ製作所	8,000	178.00	1,424,000	
6770	アルプス電気	18,600	467.00	8,686,200	
6771	池上通信機	8,000	46.00	368,000	
6773	バイオニア	33,400	189.00	6,312,600	
6779	日本電波工業	1,800	873.00	1,571,400	
6788	日本トリム	300	2,220.00	666,000	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	874.00	961,400	
6794	フォスター電機	2,200	1,146.00	2,521,200	
6796	クラリオン	15,000	123.00	1,845,000	
6798	S M K	7,000	201.00	1,407,000	
6800	ヨコオ	1,800	385.00	693,000	
6801	東光	12,000	190.00	2,280,000	
6803	ティアック	13,000	27.00	351,000	
6804	ホシデン	6,400	460.00	2,944,000	
6806	ヒロセ電機	4,100	8,650.00	35,465,000	
6807	日本航空電子工業	5,000	629.00	3,145,000	
6809	T O A	3,000	569.00	1,707,000	
6815	ユニデン	7,000	196.00	1,372,000	
6816	アルパイン	4,600	653.00	3,003,800	
6817	スミダコーポレーション	1,500	371.00	556,500	
6820	アイコム	1,300	1,725.00	2,242,500	
6823	リオン	500	547.00	273,500	
6839	船井電機	2,100	1,097.00	2,303,700	
6841	横河電機	25,600	901.00	23,065,600	
6844	新電元工業	8,000	177.00	1,416,000	
6845	アズビル	6,100	1,619.00	9,875,900	
6849	日本光電工業	4,700	2,951.00	13,869,700	
6850	チノー	4,000	200.00	800,000	
6853	共和電業	3,000	237.00	711,000	
6855	日本電子材料	900	385.00	346,500	
6856	堀場製作所	4,700	2,206.00	10,368,200	
6857	アドバンテスト	17,500	987.00	17,272,500	
6858	小野測器	3,000	339.00	1,017,000	
6859	エスベック	2,400	655.00	1,572,000	

6860	パナソニック デバイス S U N X	2,000	333.00	666,000	
6861	キーエンス	5,800	19,860.00	115,188,000	
6866	日置電機	1,200	1,347.00	1,616,400	
6869	シスメックス	8,300	3,785.00	31,415,500	
6875	メガチップス	1,900	1,827.00	3,471,300	
6877	O B A R A G R O U P	1,700	900.00	1,530,000	
6883	日本電産コパル電子	2,400	410.00	984,000	
6885	ミヤチテクノス	1,100	517.00	568,700	
6901	澤藤電機	1,000	191.00	191,000	
6905	コーセル	3,400	1,025.00	3,485,000	
6910	日立メディコ	2,000	982.00	1,964,000	
6911	新日本無線	1,000	150.00	150,000	
6914	オプテックス	1,500	857.00	1,285,500	
6915	千代田インテグレ	1,100	822.00	904,200	
6923	スタンレー電気	15,700	1,095.00	17,191,500	
6924	岩崎電気	9,000	117.00	1,053,000	
6925	ウシオ電機	14,300	842.00	12,040,600	
6926	岡谷電機産業	1,300	315.00	409,500	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,000	147.00	294,000	
6929	日本セラミック	1,500	1,020.00	1,530,000	
6935	日本デジタル研究所	2,000	822.00	1,644,000	
6937	古河電池	2,000	345.00	690,000	
6938	双信電機	1,200	309.00	370,800	
6941	山一電機	2,400	136.00	326,400	
6947	函研	1,500	504.00	756,000	
6951	日本電子	9,000	174.00	1,566,000	
6952	カシオ計算機	22,500	619.00	13,927,500	
6954	ファナック	24,500	12,570.00	307,965,000	
6958	日本シイエムケイ	5,100	262.00	1,336,200	
6961	エンブラス	1,200	2,839.00	3,406,800	
6963	ローム	11,600	2,614.00	30,322,400	
6965	浜松ホトニクス	9,200	2,795.00	25,714,000	
6966	三井ハイテック	3,100	579.00	1,794,900	
6967	新光電気工業	7,900	489.00	3,863,100	
6971	京セラ	19,600	7,100.00	139,160,000	
6976	太陽誘電	10,600	687.00	7,282,200	
6981	村田製作所	24,700	3,895.00	96,206,500	
6985	ユーシン	3,300	338.00	1,115,400	
6986	双葉電子工業	4,000	975.00	3,900,000	
6989	北陸電気工業	10,000	87.00	870,000	
6996	ニチコン	7,400	538.00	3,981,200	
6997	日本ケミコン	14,000	112.00	1,568,000	
6999	K O A	3,000	649.00	1,947,000	
7244	市光工業	6,000	111.00	666,000	
7276	小糸製作所	12,000	954.00	11,448,000	
7280	ミツバ	4,000	506.00	2,024,000	
7718	スター精密	3,800	734.00	2,789,200	
7735	大日本スクリーン製造	22,000	454.00	9,988,000	
7739	キャノン電子	2,100	1,592.00	3,343,200	

7751	キャノン	146,300	2,560.00	374,528,000	代用有価証券 10,000株
7752	リコー	71,000	709.00	50,339,000	
7999	MUTOHホールディングス	2,000	174.00	348,000	
8035	東京エレクトロン	19,800	3,505.00	69,399,000	
3116	トヨタ紡織	8,200	771.00	6,322,200	
5196	鬼怒川ゴム工業	5,000	439.00	2,195,000	
5949	ユニプレス	3,800	1,813.00	6,889,400	
6201	豊田自動織機	21,400	2,238.00	47,893,200	
6455	モリタホールディングス	4,000	649.00	2,596,000	
6584	三櫻工業	3,000	461.00	1,383,000	
6902	デンソー	58,200	2,464.00	143,404,800	
6995	東海理化電機製作所	5,500	994.00	5,467,000	
7003	三井造船	91,000	94.00	8,554,000	

[次へ](#)

7007	佐世保重工業	15,000	72.00	1,080,000	
7012	川崎重工業	171,000	163.00	27,873,000	
7102	日本車輛製造	9,000	280.00	2,520,000	
7105	日本輸送機	3,000	208.00	624,000	
7122	近畿車輛	4,000	254.00	1,016,000	
7201	日産自動車	299,700	685.00	205,294,500	
7202	いすゞ自動車	149,000	405.00	60,345,000	
7203	トヨタ自動車	305,400	3,080.00	940,632,000	代用有価証券 35,000株
7205	日野自動車	34,000	597.00	20,298,000	
7211	三菱自動車工業	528,000	69.00	36,432,000	
7212	エフテック	800	1,214.00	971,200	
7220	武蔵精密工業	2,300	1,658.00	3,813,400	
7222	日産車体	7,000	885.00	6,195,000	
7224	新明和工業	10,000	397.00	3,970,000	
7226	極東開発工業	4,100	642.00	2,632,200	
7230	日信工業	4,300	1,078.00	4,635,400	
7231	トピー工業	18,000	154.00	2,772,000	
7236	ティラド	8,000	176.00	1,408,000	
7238	曙ブレーキ工業	11,900	327.00	3,891,300	
7239	タチエス	3,100	1,455.00	4,510,500	
7240	N O K	11,400	1,221.00	13,919,400	
7241	フタバ産業	6,700	306.00	2,050,200	
7242	カヤバ工業	16,000	276.00	4,416,000	
7243	シロキ工業	5,000	177.00	885,000	
7245	大同メタル工業	4,000	520.00	2,080,000	
7246	プレス工業	11,000	312.00	3,432,000	
7248	カルソニックカンセイ	14,000	308.00	4,312,000	
7250	太平洋工業	4,800	480.00	2,304,000	
7251	ケーヒン	4,900	981.00	4,806,900	
7256	河西工業	3,000	316.00	948,000	
7259	アイシン精機	19,400	2,328.00	45,163,200	
7260	富士機工	3,000	204.00	612,000	
7261	マツダ	316,000	97.00	30,652,000	
7262	ダイハツ工業	22,000	1,386.00	30,492,000	
7266	今仙電機製作所	1,700	961.00	1,633,700	
7267	本田技研工業	198,700	2,516.00	499,929,200	
7269	スズキ	49,200	1,766.00	86,887,200	
7270	富士重工業	74,000	723.00	53,502,000	
7272	ヤマハ発動機	35,800	765.00	27,387,000	
7274	ショーワ	5,000	680.00	3,400,000	
7277	T B K	2,000	390.00	780,000	
7278	エクセディ	3,200	1,582.00	5,062,400	
7282	豊田合成	6,700	1,543.00	10,338,100	
7283	愛三工業	2,400	594.00	1,425,600	
7294	ヨロズ	1,400	1,138.00	1,593,200	
7296	エフ・シー・シー	3,900	1,342.00	5,233,800	
7309	シマノ	9,500	5,180.00	49,210,000	
7312	タカタ	4,200	1,408.00	5,913,600	

7313	テイ・エス テック	5,000	1,283.00	6,415,000	
7728	日本電産トーソク	1,100	539.00	592,900	
4543	テルモ	16,700	3,445.00	57,531,500	
5187	クリエートメディック	700	804.00	562,800	
6376	日機装	8,000	945.00	7,560,000	
7701	島津製作所	28,000	538.00	15,064,000	
7702	J M S	4,000	255.00	1,020,000	
7714	モリテックス	500	286.00	143,000	
7715	長野計器	1,700	680.00	1,156,000	
7717	ブイ・テクノロジー	4	142,100.00	568,400	
7721	東京計器	8,000	122.00	976,000	
7723	愛知時計電機	3,000	286.00	858,000	
7729	東京精密	4,200	1,127.00	4,733,400	
7731	ニコン	41,100	2,014.00	82,775,400	
7732	トプコン	5,400	372.00	2,008,800	
7733	オリンパス	27,800	1,381.00	38,391,800	
7734	理研計器	1,900	502.00	953,800	
7740	タムロン	1,800	2,128.00	3,830,400	
7741	HOYA	57,300	1,625.00	93,112,500	
7744	ノーリツ鋼機	2,100	330.00	693,000	
7745	エー・アンド・デイ	2,300	258.00	593,400	
7756	日本電産コパル	1,900	603.00	1,145,700	
7762	シチズンホールディングス	28,200	390.00	10,998,000	
7769	リズム時計工業	11,000	152.00	1,672,000	
7775	大研医器	300	1,225.00	367,500	
7979	松風	1,200	838.00	1,005,600	
8050	セイコーホールディングス	14,000	206.00	2,884,000	
8086	ニプロ	12,200	543.00	6,624,600	
7817	パラマウントベッドホールディングス	2,000	2,833.00	5,666,000	
7819	S H O - B I	500	401.00	200,500	
7822	永大産業	3,000	333.00	999,000	
7825	ダンロップスポーツ	1,300	1,022.00	1,328,600	
7832	バンダイナムコホールディングス	24,300	1,269.00	30,836,700	
7838	共立印刷	2,800	277.00	775,600	
7840	フランスベッドホールディングス	15,000	173.00	2,595,000	
7846	パイロットコーポレーション	21	145,400.00	3,053,400	
7862	トッパン・フォームズ	5,100	777.00	3,962,700	
7864	フジシールインターナショナル	2,600	1,706.00	4,435,600	
7867	タカラトミー	7,800	433.00	3,377,400	
7868	廣濟堂	2,000	303.00	606,000	
7873	アーク	8,000	163.00	1,304,000	
7885	タカノ	900	397.00	357,300	
7893	プロネクサス	2,500	489.00	1,222,500	
7897	ホクシン	1,700	199.00	338,300	
7898	ウッドワン	4,000	226.00	904,000	
7905	大建工業	10,000	180.00	1,800,000	
7911	凸版印刷	72,000	451.00	32,472,000	
7912	大日本印刷	72,000	561.00	40,392,000	
7913	図書印刷	4,000	125.00	500,000	

7914	共同印刷	8,000	174.00	1,392,000	
7915	日本写真印刷	4,000	615.00	2,460,000	
7916	光村印刷	2,000	240.00	480,000	
7921	宝印刷	1,300	585.00	760,500	
7936	アシックス	21,900	1,162.00	25,447,800	
7937	ツツミ	1,200	1,845.00	2,214,000	
7944	ローランド	2,400	530.00	1,272,000	
7949	小松ウオール工業	900	1,092.00	982,800	
7951	ヤマハ	17,300	717.00	12,404,100	
7952	河合楽器製作所	9,000	163.00	1,467,000	
7955	クリナップ	2,800	487.00	1,363,600	
7956	ビジョン	2,100	3,580.00	7,518,000	
7961	兼松日産農林	4,000	127.00	508,000	
7962	キングジム	1,900	643.00	1,221,700	
7966	リンテック	4,500	1,388.00	6,246,000	
7968	T A S A K I	500	279.00	139,500	
7972	イトーキ	5,000	484.00	2,420,000	
7974	任天堂	13,500	10,270.00	138,645,000	
7976	三菱鉛筆	1,900	1,446.00	2,747,400	
7981	タカラスタANDARD	11,000	613.00	6,743,000	
7984	コクヨ	12,300	647.00	7,958,100	
7987	ナカバヤシ	5,000	172.00	860,000	
7994	岡村製作所	8,000	592.00	4,736,000	
8022	美津濃	12,000	370.00	4,440,000	
8170	アデランス	2,900	1,069.00	3,100,100	
9501	東京電力	188,100	129.00	24,264,900	
9502	中部電力	77,600	821.00	63,709,600	
9503	関西電力	96,100	600.00	57,660,000	
9504	中国電力	32,600	861.00	28,068,600	
9505	北陸電力	23,100	828.00	19,126,800	
9506	東北電力	58,800	554.00	32,575,200	
9507	四国電力	21,200	855.00	18,126,000	
9508	九州電力	52,000	605.00	31,460,000	
9509	北海道電力	22,100	664.00	14,674,400	
9511	沖縄電力	1,400	2,606.00	3,648,400	
9513	電源開発	14,600	2,028.00	29,608,800	
9531	東京瓦斯	283,000	408.00	115,464,000	
9532	大阪瓦斯	228,000	328.00	74,784,000	
9533	東邦瓦斯	60,000	490.00	29,400,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	226.00	904,000	
9536	西部瓦斯	26,000	215.00	5,590,000	
9543	静岡瓦斯	6,000	594.00	3,564,000	
9001	東武鉄道	134,000	418.00	56,012,000	
9003	相鉄ホールディングス	38,000	271.00	10,298,000	
9005	東京急行電鉄	139,000	399.00	55,461,000	
9006	京浜急行電鉄	61,000	749.00	45,689,000	
9007	小田急電鉄	75,000	833.00	62,475,000	
9008	京王電鉄	66,000	604.00	39,864,000	
9009	京成電鉄	38,000	720.00	27,360,000	



9010	富士急行	6,000	488.00	2,928,000	
9020	東日本旅客鉄道	41,000	5,500.00	225,500,000	
9021	西日本旅客鉄道	20,500	3,350.00	68,675,000	
9022	東海旅客鉄道	19,600	6,990.00	137,004,000	
9031	西日本鉄道	31,000	337.00	10,447,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,564.00	1,794,800	
9039	サカイ引越センター	400	1,720.00	688,000	
9041	近畿日本鉄道	213,000	308.00	65,604,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	158,000	433.00	68,414,000	
9044	南海電気鉄道	49,000	363.00	17,787,000	
9045	京阪電気鉄道	53,000	382.00	20,246,000	
9047	名糖運輸	1,000	595.00	595,000	
9048	名古屋鉄道	82,000	217.00	17,794,000	
9062	日本通運	93,000	299.00	27,807,000	
9064	ヤマトホールディングス	47,900	1,187.00	56,857,300	
9065	山九	28,000	282.00	7,896,000	
9067	丸運	1,300	194.00	252,200	
9068	丸全昭和運輸	8,000	233.00	1,864,000	
9069	センコー	9,000	313.00	2,817,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	173.00	865,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,000	974.00	6,818,000	
9074	日本石油輸送	3,000	182.00	546,000	
9075	福山通運	14,000	424.00	5,936,000	
9076	セイノーホールディングス	18,000	467.00	8,406,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	449.00	1,347,000	
9086	日立物流	4,900	1,233.00	6,041,700	
9101	日本郵船	186,000	146.00	27,156,000	
9104	商船三井	124,000	185.00	22,940,000	
9107	川崎汽船	89,000	97.00	8,633,000	
9110	NSユナイテッド海運	10,000	88.00	880,000	
9113	乾汽船	2,600	189.00	491,400	
9115	明治海運	2,100	288.00	604,800	
9119	飯野海運	11,400	223.00	2,542,200	
9130	共栄タンカー	2,000	158.00	316,000	
9202	全日本空輸	427,000	160.00	68,320,000	
9232	パスコ	2,000	233.00	466,000	
9066	日新	9,000	203.00	1,827,000	
9301	三菱倉庫	17,000	1,022.00	17,374,000	
9302	三井倉庫	11,000	245.00	2,695,000	
9303	住友倉庫	17,000	329.00	5,593,000	
9304	澁澤倉庫	6,000	235.00	1,410,000	
9306	東陽倉庫	4,000	184.00	736,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	280.00	1,400,000	
9312	ケイヒン	4,000	92.00	368,000	
9324	安田倉庫	1,800	535.00	963,000	
9351	東洋埠頭	7,000	127.00	889,000	
9358	宇徳	1,600	235.00	376,000	
9364	上組	26,000	639.00	16,614,000	
9366	サンリツ	600	487.00	292,200	

9368	キムラユニティー	500	747.00	373,500	
9369	キューソー流通システム	700	943.00	660,100	
9370	郵船ロジスティクス	1,800	671.00	1,207,800	
9375	近鉄エクスプレス	2,100	2,306.00	4,842,600	
9380	東海運	1,500	209.00	313,500	
9381	エーアイティー	200	1,160.00	232,000	
1973	N E C ネットズエスアイ	2,200	1,443.00	3,174,600	
2317	システナ	24	72,000.00	1,728,000	
2327	新日鉄住金ソリューションズ	1,600	1,601.00	2,561,600	
2359	コア	900	725.00	652,500	
3371	ソフトクリエイティブホールディングス	300	1,251.00	375,300	
3620	デジタルハーツ	400	740.00	296,000	
3626	I T ホールディングス	7,100	988.00	7,014,800	
3627	ネオス	5	54,800.00	274,000	
3632	グリー	12,000	1,416.00	16,992,000	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,600	623.00	2,865,800	
3636	三菱総合研究所	900	1,772.00	1,594,800	
3639	ボルテージ	400	969.00	387,600	
3656	K L a b	700	606.00	424,200	
3659	ネクソン	19,100	967.00	18,469,700	
3715	ドワンゴ	12	133,400.00	1,600,800	
3724	ベリサーブ	2	138,000.00	276,000	
3730	マクロミル	2,300	968.00	2,226,400	
3738	ティーガイア	2,200	743.00	1,634,600	
3769	G M O ペイメントゲートウェイ	800	1,337.00	1,069,600	
3770	ザッパラス	13	71,400.00	928,200	
3774	インターネットイニシアティブ	2,700	2,151.00	5,807,700	
3789	ソネットエンタテインメント	13	561,000.00	7,293,000	
3817	S R A ホールディングス	1,200	868.00	1,041,600	
3834	朝日ネット	2,000	395.00	790,000	
4283	パナソニック インフォメーションシステムズ	600	1,856.00	1,113,600	
4295	フェイス	79	8,360.00	660,440	
4307	野村総合研究所	13,200	1,641.00	21,661,200	
4312	サイバネットシステム	19	22,090.00	419,710	
4326	インテージ	700	1,638.00	1,146,600	
4340	シンプレクス・ホールディングス	39	24,820.00	967,980	
4344	ソースネクスト	600	386.00	231,600	
4674	クレスコ	500	564.00	282,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	242	118,600.00	28,701,200	
4684	オービック	730	16,190.00	11,818,700	
4687	T D C ソフトウェアエンジニアリング	500	763.00	381,500	
4689	ヤフー	1,702	27,710.00	47,162,420	
4704	トレンドマイクロ	9,200	2,247.00	20,672,400	
4716	日本オラクル	4,700	3,590.00	16,873,000	
4719	アルファシステムズ	800	966.00	772,800	
4722	フューチャーアーキテクト	28	31,000.00	868,000	
4725	シーエーシー	1,400	685.00	959,000	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	811.00	486,600	

4728	トーセ	600	505.00	303,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	600	4,475.00	2,685,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,800	3,900.00	10,920,000	
4743	アイティフォー	2,600	288.00	748,800	
4746	東計電算	400	1,126.00	450,400	
4762	エクスネット	2	114,800.00	229,600	
4768	大塚商会	2,100	6,550.00	13,755,000	
4776	サイボウズ	43	25,000.00	1,075,000	
4779	ソフトブレーン	34	8,580.00	291,720	
4799	アグレックス	600	762.00	457,200	
4812	電通国際情報サービス	1,400	720.00	1,008,000	
4825	ウェザーニューズ	600	2,757.00	1,654,200	
4826	C I J	2,300	316.00	726,800	
4839	WOWOW	7	185,600.00	1,299,200	
6791	日本コロムビア	23,000	22.00	506,000	
7518	ネットワンシステムズ	10,500	853.00	8,956,500	
7595	アルゴグラフィックス	800	998.00	798,400	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,400	1,561.00	6,868,400	
8056	日本ユニシス	5,600	574.00	3,214,400	
8096	兼松エレクトロニクス	1,400	878.00	1,229,200	
9401	東京放送ホールディングス	13,900	740.00	10,286,000	
9404	日本テレビホールディングス	20,400	1,036.00	21,134,400	
9409	テレビ朝日	5,900	1,064.00	6,277,600	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	176	37,050.00	6,520,800	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	900.00	1,350,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,000	643.00	1,286,000	
9427	イー・アクセス	177	42,100.00	7,451,700	
9430	N E Cモバイルング	800	3,295.00	2,636,000	
9432	日本電信電話	107,100	3,695.00	395,734,500	代用有価証券 12,300株
9433	K D D I	36,100	6,280.00	226,708,000	
9435	光通信	2,100	4,400.00	9,240,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	1,916	123,400.00	236,434,400	
9449	G M Oインターネット	7,800	544.00	4,243,200	
9470	学研ホールディングス	7,000	216.00	1,512,000	
9474	ゼンリン	3,400	1,006.00	3,420,400	
9475	昭文社	1,300	535.00	695,500	
9477	角川グループホールディングス	2,200	2,417.00	5,317,400	
9479	インプレスホールディングス	1,900	130.00	247,000	
9600	アイネット	1,000	590.00	590,000	
9601	松竹	15,000	777.00	11,655,000	
9602	東宝	16,600	1,388.00	23,040,800	
9605	東映	10,000	439.00	4,390,000	
9607	A O I P r o .	1,000	533.00	533,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	144	262,600.00	37,814,400	
9682	D T S	2,400	1,107.00	2,656,800	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,600	1,154.00	8,770,400	
9692	シーイーシー	1,400	464.00	649,600	

9697	カプコン	4,500	1,505.00	6,772,500	
9717	ジャステック	1,300	552.00	717,600	
9719	S C S K	4,700	1,348.00	6,335,600	
9739	日本システムウエア	800	320.00	256,000	
9742	アイネス	2,800	513.00	1,436,400	
9746	T K C	2,200	1,544.00	3,396,800	
9749	富士ソフト	3,100	1,667.00	5,167,700	
9759	N S D	4,200	774.00	3,250,800	
9766	コナミ	10,500	1,838.00	19,299,000	
9790	福井コンピュータホールディングス	300	455.00	136,500	
9889	J B C Cホールディングス	1,800	549.00	988,200	
9984	ソフトバンク	105,300	2,599.00	273,674,700	
1352	ハウスイ	2,000	101.00	202,000	
2676	高千穂交易	1,000	861.00	861,000	

[次へ](#)

2692	伊藤忠食品	600	2,905.00	1,743,000	
2715	エレマテック	1,500	1,011.00	1,516,500	
2729	J A L U X	700	837.00	585,900	
2733	あらた	5,000	326.00	1,630,000	
2737	トーメンデバイス	300	1,665.00	499,500	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	136,200.00	681,000	
2768	双日	155,600	98.00	15,248,800	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,300	3,600.00	22,680,000	
2874	横浜冷凍	5,800	545.00	3,161,000	
3004	神栄	3,000	101.00	303,000	
3022	山下医科器械	200	999.00	199,800	
3023	ラサ商事	1,000	365.00	365,000	
3036	アルコニックス	600	1,292.00	775,200	
3076	あい ホールディングス	3,700	500.00	1,850,000	
3107	ダイワボウホールディングス	23,000	143.00	3,289,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,400	795.00	3,498,000	
3153	八洲電機	1,500	350.00	525,000	
3156	U K Cホールディングス	1,400	1,574.00	2,203,600	
3167	T O K A Iホールディングス	11,400	323.00	3,682,200	
3321	ミタチ産業	600	372.00	223,200	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,000	2,669.00	8,007,000	
5009	富士興産	800	450.00	360,000	
6973	協栄産業	3,000	131.00	393,000	
7414	小野建	2,000	649.00	1,298,000	
7420	佐島電機	1,700	438.00	744,600	
7427	エコートレーディング	600	692.00	415,200	
7433	伯東	1,400	721.00	1,009,400	
7438	コンドーテック	1,600	490.00	784,000	
7442	中山福	1,300	620.00	806,000	
7447	ナガイレーベン	3,100	1,192.00	3,695,200	
7451	三菱食品	2,100	1,992.00	4,183,200	
7456	松田産業	1,700	1,065.00	1,810,500	
7459	メディパルホールディングス	25,000	998.00	24,950,000	
7463	アドヴァン	1,400	811.00	1,135,400	
7466	S P K	500	1,343.00	671,500	
7476	アズワン	1,500	1,635.00	2,452,500	
7480	スズデン	800	452.00	361,600	
7482	シモジマ	1,400	966.00	1,352,400	
7483	ドウシシャ	1,100	2,223.00	2,445,300	
7504	高速	1,400	672.00	940,800	
7517	黒田電気	2,800	920.00	2,576,000	
7537	丸文	1,800	337.00	606,600	
7552	ハピネット	1,200	684.00	820,800	
7558	トーメンエレクトロニクス	1,100	953.00	1,048,300	
7591	エクセル	1,100	672.00	739,200	
7594	マルカキカイ	800	957.00	765,600	
7599	ガリバーインターナショナル	700	2,914.00	2,039,800	
7600	日本エム・ディ・エム	2,000	242.00	484,000	
7607	進和	1,400	920.00	1,288,000	

7608	エスケイジャパン	600	244.00	146,400	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	353.00	388,300	
7613	シークス	1,500	1,197.00	1,795,500	
7619	田中商事	700	427.00	298,900	
7628	オーハシテクニカ	1,300	547.00	711,100	
7631	マクニカ	1,200	1,610.00	1,932,000	
7637	白銅	800	743.00	594,400	
8001	伊藤忠商事	185,500	786.00	145,803,000	
8002	丸紅	203,000	513.00	104,139,000	
8007	高島	4,000	276.00	1,104,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,800	944.00	1,699,200	
8012	長瀬産業	13,200	849.00	11,206,800	
8014	蝶理	1,500	869.00	1,303,500	
8015	豊田通商	25,900	1,774.00	45,946,600	
8018	三共生興	3,900	268.00	1,045,200	
8020	兼松	50,000	94.00	4,700,000	
8025	ツカモトコーポレーション	4,000	132.00	528,000	
8031	三井物産	200,700	1,130.00	226,791,000	
8032	日本紙パルプ商事	12,000	237.00	2,844,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	7,100	1,747.00	12,403,700	
8037	カメイ	3,000	673.00	2,019,000	
8038	東都水産	4,000	120.00	480,000	
8043	スターゼン	8,000	235.00	1,880,000	
8051	山善	8,900	491.00	4,369,900	
8052	椿本興業	3,000	230.00	690,000	
8053	住友商事	137,200	1,078.00	147,901,600	
8057	内田洋行	5,000	217.00	1,085,000	
8058	三菱商事	169,300	1,396.00	236,342,800	
8059	第一実業	5,000	336.00	1,680,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	7,700	1,168.00	8,993,600	
8061	西華産業	8,000	213.00	1,704,000	
8065	佐藤商事	2,100	495.00	1,039,500	
8068	菱洋エレクトロ	2,500	822.00	2,055,000	
8070	東京産業	2,500	248.00	620,000	
8074	ユアサ商事	24,000	134.00	3,216,000	
8075	神鋼商事	6,000	141.00	846,000	
8078	阪和興業	23,000	278.00	6,394,000	
8081	カナデン	2,000	500.00	1,000,000	
8084	菱電商事	3,000	459.00	1,377,000	
8087	フルサト工業	1,400	667.00	933,800	
8088	岩谷産業	26,000	297.00	7,722,000	
8089	すてきナイスグループ	10,000	164.00	1,640,000	
8090	昭光通商	8,000	123.00	984,000	
8091	二チモウ	3,000	168.00	504,000	
8093	極東貿易	3,000	124.00	372,000	
8095	イワキ	4,000	166.00	664,000	
8097	三愛石油	5,000	365.00	1,825,000	
8098	稲畑産業	6,200	502.00	3,112,400	
8101	G S I クレオス	6,000	107.00	642,000	

8103	明和産業	1,800	334.00	601,200	
8129	東邦ホールディングス	7,400	1,667.00	12,335,800	
8130	サンゲツ	4,100	2,125.00	8,712,500	
8131	ミツウロコグループホールディングス	3,700	537.00	1,986,900	
8132	シナネン	5,000	344.00	1,720,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,100	427.00	2,177,700	
8136	サンリオ	5,900	2,562.00	15,115,800	
8137	サンワテクノス	1,100	605.00	665,500	
8140	リョーサン	3,800	1,322.00	5,023,600	
8141	新光商事	2,500	683.00	1,707,500	
8142	トーホー	5,000	311.00	1,555,000	
8150	三信電気	3,300	604.00	1,993,200	
8151	東陽テクニカ	3,300	920.00	3,036,000	
8153	モスフードサービス	3,000	1,535.00	4,605,000	
8154	加賀電子	2,500	737.00	1,842,500	
8158	ソーダニッカ	2,000	344.00	688,000	
8159	立花エレテック	1,400	672.00	940,800	
8283	P a l t a c	2,400	1,146.00	2,750,400	
8835	太平洋興発	8,000	70.00	560,000	
9305	ヤマタネ	12,000	101.00	1,212,000	
9763	丸紅建材リース	2,000	115.00	230,000	
9810	日鐵商事	5,000	190.00	950,000	
9830	トラスコ中山	2,900	1,379.00	3,999,100	
9832	オートバックスセブン	2,600	3,275.00	8,515,000	
9869	加藤産業	3,400	1,448.00	4,923,200	
9880	イノテック	1,900	322.00	611,800	
9882	イエローハット	2,200	1,050.00	2,310,000	
9883	富士エレクトロニクス	1,200	1,079.00	1,294,800	
9896	J Kホールディングス	2,000	435.00	870,000	
9902	日伝	1,000	2,178.00	2,178,000	
9930	北沢産業	2,000	155.00	310,000	
9932	杉本商事	1,300	764.00	993,200	
9934	因幡電機産業	2,700	2,175.00	5,872,500	
9938	住金物産	11,000	190.00	2,090,000	
9962	ミスミグループ本社	8,600	1,950.00	16,770,000	
9963	江守商事	500	811.00	405,500	
9972	アルテック	1,200	225.00	270,000	
9982	タキヒヨー	4,000	421.00	1,684,000	
9987	スズケン	8,900	2,528.00	22,499,200	
9991	ジェコス	1,600	502.00	803,200	
2651	ローソン	7,300	5,880.00	42,924,000	
2659	サンエー	800	3,030.00	2,424,000	
2660	キリン堂	1,000	533.00	533,000	
2662	ダイユーエイト	400	540.00	216,000	
2664	カワチ薬品	1,600	1,623.00	2,596,800	
2670	エービーシー・マート	3,300	3,500.00	11,550,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,100	554.00	609,400	
2678	アスクル	1,600	1,200.00	1,920,000	
2681	ゲオホールディングス	36	91,100.00	3,279,600	

2685	ポイント	1,960	2,987.00	5,854,520	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	3,000	79.00	237,000	
2695	くらコーポレーション	1,400	1,120.00	1,568,000	
2698	キャンドウ	12	107,900.00	1,294,800	
2726	パル	650	4,045.00	2,629,250	
2730	エディオン	9,300	355.00	3,301,500	
2734	サーラコーポレーション	2,000	490.00	980,000	
2753	あみやき亭	4	196,900.00	787,600	
2764	ひらまつ	8	72,200.00	577,600	
2772	ゲンキー	200	1,896.00	379,200	
2791	大黒天物産	400	2,440.00	976,000	
2792	ハニーズ	2,040	1,266.00	2,582,640	
3028	アルペン	1,800	1,465.00	2,637,000	
3048	ビックカメラ	88	38,700.00	3,405,600	
3050	D C Mホールディングス	12,000	540.00	6,480,000	
3064	M o n o t a R O	1,600	2,152.00	3,443,200	
3086	J . フロントリテイリング	55,000	417.00	22,935,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,700	1,001.00	3,703,700	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,300	1,935.00	8,320,500	
3091	ブロンコビリー	200	2,096.00	419,200	
3092	スタートトゥデイ	4,200	836.00	3,511,200	
3097	物語コーポレーション	300	1,835.00	550,500	
3098	ココカラファイン	2,400	2,691.00	6,458,400	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	46,200	802.00	37,052,400	
3141	ウエルシアホールディングス	800	2,748.00	2,198,400	
3148	クリエイトSDホールディングス	1,000	2,146.00	2,146,000	
3159	丸善C H Iホールディングス	700	225.00	157,500	
3313	ブックオフコーポレーション	1,300	664.00	863,200	
3333	あさひ	1,400	1,212.00	1,696,800	
3341	日本調剤	290	2,158.00	625,820	
3349	コスモス薬品	1,000	7,990.00	7,990,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	97,300	2,505.00	243,736,500	
3391	ツルハホールディングス	1,900	6,030.00	11,457,000	
3395	サンマルクホールディングス	700	3,010.00	2,107,000	
3396	フェリシモ	700	1,022.00	715,400	
3397	トリドール	2,000	1,267.00	2,534,000	
3398	クスリのアオキ	400	4,110.00	1,644,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	1,400	516.00	722,400	
4775	総合メディカル	600	2,847.00	1,708,200	
7416	はるやま商事	1,000	403.00	403,000	
7421	カッパ・クリエイトホールディングス	1,700	1,733.00	2,946,100	
7445	ライトオン	1,700	675.00	1,147,500	
7448	ジーンズメイト	800	312.00	249,600	
7453	良品計画	2,500	5,480.00	13,700,000	
7455	三城ホールディングス	2,900	440.00	1,276,000	
7494	コナカ	2,700	758.00	2,046,600	
7506	ハウスオブローゼ	300	1,270.00	381,000	
7508	G - 7ホールディングス	700	406.00	284,200	
7512	イオン北海道	1,500	367.00	550,500	



7513	コジマ	3,100	271.00	840,100	
7514	ヒマラヤ	700	648.00	453,600	
7516	コーナン商事	2,500	958.00	2,395,000	
7520	エコス	800	513.00	410,400	
7522	ワタミ	2,700	1,777.00	4,797,900	
7524	マルシェ	600	729.00	437,400	
7532	ドン・キホーテ	6,200	3,210.00	19,902,000	
7541	メガネトップ	3,300	905.00	2,986,500	
7545	西松屋チェーン	5,100	645.00	3,289,500	
7550	ゼンショーホールディングス	8,900	969.00	8,624,100	
7554	幸楽苑	1,400	1,179.00	1,650,600	
7561	ハークスレイ	600	621.00	372,600	
7581	サイゼリヤ	3,400	1,136.00	3,862,400	
7601	ポプラ	600	521.00	312,600	
7606	ユナイテッドアローズ	2,500	2,086.00	5,215,000	
7611	ハイデイ日高	1,200	1,289.00	1,546,800	
7615	京都きもの友禅	1,500	982.00	1,473,000	
7616	コロワイド	7,500	694.00	5,205,000	
7630	壱番屋	900	2,544.00	2,289,600	
7640	トップカルチャー	900	376.00	338,400	
7649	スギホールディングス	4,200	2,834.00	11,902,800	
8005	スクロール	3,000	282.00	846,000	
8028	ファミリーマート	7,100	3,855.00	27,370,500	
8160	木曽路	2,700	1,647.00	4,446,900	
8165	千趣会	4,200	514.00	2,158,800	
8166	タカキュー	2,000	238.00	476,000	
8168	ケーヨー	4,400	437.00	1,922,800	
8173	上新電機	5,000	888.00	4,440,000	
8174	日本瓦斯	2,200	1,384.00	3,044,800	
8175	ベスト電器	7,500	114.00	855,000	
8178	マルエツ	5,000	261.00	1,305,000	
8179	ロイヤルホールディングス	3,900	993.00	3,872,700	
8181	東天紅	2,000	190.00	380,000	
8182	いなげや	2,600	968.00	2,516,800	
8184	島忠	5,300	1,724.00	9,137,200	
8185	チヨダ	3,000	2,258.00	6,774,000	
8194	ライフコーポレーション	1,500	1,220.00	1,830,000	
8196	カスミ	4,800	527.00	2,529,600	
8200	リンガーハット	2,100	1,029.00	2,160,900	
8201	さが美	2,000	118.00	236,000	
8203	MrMax	2,300	315.00	724,500	
8207	テンアライド	1,800	272.00	489,600	
8214	AOKIホールディングス	2,000	1,726.00	3,452,000	
8217	オークワ	3,000	1,088.00	3,264,000	
8218	コメリ	3,200	1,983.00	6,345,600	
8219	青山商事	6,400	1,588.00	10,163,200	
8227	しまむら	2,700	8,280.00	22,356,000	
8229	CFSコーポレーション	1,500	374.00	561,000	
8233	高島屋	31,000	524.00	16,244,000	

8237	松屋	4,700	823.00	3,868,100	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	12,000	861.00	10,332,000	
8245	丸栄	4,000	81.00	324,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,200	320.00	1,344,000	
8251	パルコ	4,200	853.00	3,582,600	
8252	丸井グループ	30,300	568.00	17,210,400	
8255	原信ナルスホールディングス	1,300	1,490.00	1,937,000	
8263	ダイエー	14,350	151.00	2,166,850	
8266	イズミヤ	8,000	397.00	3,176,000	
8267	イオン	82,000	872.00	71,504,000	
8270	ユニー	20,100	579.00	11,637,900	
8273	イズミ	5,700	1,977.00	11,268,900	
8274	東武ストア	3,000	261.00	783,000	
8276	平和堂	4,300	1,107.00	4,760,100	
8278	フジ	2,600	1,723.00	4,479,800	
8279	ヤオコー	1,000	3,155.00	3,155,000	
8281	ゼビオ	2,800	1,564.00	4,379,200	
8282	ケーズホールディングス	5,800	1,931.00	11,199,800	
8289	O l y m p i c	1,500	645.00	967,500	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	342.00	1,368,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	5,600.00	7,280,000	
9828	元気寿司	700	1,017.00	711,900	
9831	ヤマダ電機	11,310	3,235.00	36,587,850	
9842	アークランドサカモト	1,500	1,121.00	1,681,500	
9843	ニトリホールディングス	4,600	6,560.00	30,176,000	
9854	愛眼	1,900	312.00	592,800	
9861	吉野家ホールディングス	63	101,100.00	6,369,300	
9887	松屋フーズ	1,100	1,475.00	1,622,500	
9900	サガミチェーン	3,000	622.00	1,866,000	
9945	ブレナス	2,600	1,298.00	3,374,800	
9946	ミニストップ	1,700	1,375.00	2,337,500	
9948	アークス	3,400	1,706.00	5,800,400	
9956	パロー	4,600	1,351.00	6,214,600	
9974	ベルク	1,200	1,172.00	1,406,400	
9979	大庄	1,100	1,005.00	1,105,500	
9983	ファーストリテイリング	4,700	17,770.00	83,519,000	
9989	サンドラッグ	4,400	2,905.00	12,782,000	
9990	東京デリカ	800	1,202.00	961,600	
9993	ヤマザワ	600	1,371.00	822,600	
9994	やまや	400	1,156.00	462,400	
9997	ペルーナ	2,900	596.00	1,728,400	
7150	島根銀行	500	1,031.00	515,500	
8303	新生銀行	181,000	108.00	19,548,000	
8304	あおぞら銀行	72,000	222.00	15,984,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,760,400	362.00	637,264,800	
8308	りそなホールディングス	202,300	351.00	71,007,300	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	454,000	232.00	105,328,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	176,500	2,400.00	423,600,000	
8324	第四銀行	30,000	264.00	7,920,000	

8325	北越銀行	24,000	159.00	3,816,000	
8327	西日本シティ銀行	82,000	181.00	14,842,000	
8331	千葉銀行	90,000	466.00	41,940,000	
8332	横浜銀行	148,000	365.00	54,020,000	
8333	常陽銀行	89,000	383.00	34,087,000	
8334	群馬銀行	52,000	380.00	19,760,000	
8336	武蔵野銀行	3,800	2,281.00	8,667,800	
8337	千葉興業銀行	4,500	406.00	1,827,000	
8338	筑波銀行	9,700	268.00	2,599,600	
8339	東京都民銀行	4,400	690.00	3,036,000	
8341	七十七銀行	36,000	305.00	10,980,000	
8342	青森銀行	17,000	239.00	4,063,000	

[次へ](#)

8343	秋田銀行	16,000	217.00	3,472,000	
8344	山形銀行	14,000	355.00	4,970,000	
8345	岩手銀行	1,600	3,780.00	6,048,000	
8346	東邦銀行	19,000	268.00	5,092,000	
8349	東北銀行	13,000	114.00	1,482,000	
8350	みちのく銀行	12,000	155.00	1,860,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	94,000	310.00	29,140,000	
8355	静岡銀行	68,000	822.00	55,896,000	
8356	十六銀行	29,000	257.00	7,453,000	
8358	スルガ銀行	23,000	960.00	22,080,000	
8359	八十二銀行	43,000	409.00	17,587,000	
8360	山梨中央銀行	14,000	325.00	4,550,000	
8361	大垣共立銀行	31,000	278.00	8,618,000	
8362	福井銀行	20,000	183.00	3,660,000	
8363	北國銀行	27,000	289.00	7,803,000	
8364	清水銀行	800	2,305.00	1,844,000	
8366	滋賀銀行	22,000	512.00	11,264,000	
8367	南都銀行	22,000	402.00	8,844,000	
8368	百五銀行	21,000	351.00	7,371,000	
8369	京都銀行	42,000	675.00	28,350,000	
8374	三重銀行	10,000	174.00	1,740,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	163,000	127.00	20,701,000	
8379	広島銀行	69,000	280.00	19,320,000	
8381	山陰合同銀行	14,000	552.00	7,728,000	
8382	中国銀行	18,000	1,101.00	19,818,000	
8383	鳥取銀行	7,000	162.00	1,134,000	
8385	伊予銀行	25,000	604.00	15,100,000	
8386	百十四銀行	26,000	310.00	8,060,000	
8387	四国銀行	17,000	200.00	3,400,000	
8388	阿波銀行	20,000	475.00	9,500,000	
8390	鹿児島銀行	15,000	504.00	7,560,000	
8392	大分銀行	15,000	253.00	3,795,000	
8393	宮崎銀行	15,000	200.00	3,000,000	
8394	肥後銀行	18,000	475.00	8,550,000	
8395	佐賀銀行	14,000	178.00	2,492,000	
8396	十八銀行	15,000	209.00	3,135,000	
8397	沖縄銀行	1,800	3,335.00	6,003,000	
8399	琉球銀行	4,800	1,004.00	4,819,200	
8409	八千代銀行	1,300	1,449.00	1,883,700	
8410	セブン銀行	87,100	228.00	19,858,800	
8411	みずほフィナンシャルグループ	2,990,900	125.00	373,862,500	
8415	紀陽ホールディングス	93,000	110.00	10,230,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	23,000	655.00	15,065,000	
8521	長野銀行	8,000	155.00	1,240,000	
8522	名古屋銀行	21,000	266.00	5,586,000	
8524	北洋銀行	35,000	204.00	7,140,000	
8527	愛知銀行	800	4,295.00	3,436,000	
8529	第三銀行	13,000	145.00	1,885,000	
8530	中京銀行	10,000	174.00	1,740,000	

8536	東日本銀行	11,000	170.00	1,870,000	
8537	大光銀行	8,000	204.00	1,632,000	
8541	愛媛銀行	15,000	202.00	3,030,000	
8542	トマト銀行	9,000	143.00	1,287,000	
8543	みなと銀行	21,000	149.00	3,129,000	
8544	京葉銀行	19,000	349.00	6,631,000	
8545	関西アーバン銀行	32,000	99.00	3,168,000	
8550	栃木銀行	12,000	283.00	3,396,000	
8551	北日本銀行	700	2,134.00	1,493,800	
8558	東和銀行	23,000	80.00	1,840,000	
8562	福島銀行	27,000	50.00	1,350,000	
8563	大東銀行	15,000	70.00	1,050,000	
8600	トモニホールディングス	17,800	328.00	5,838,400	
8713	フィデアホールディングス	13,400	156.00	2,090,400	
8714	池田泉州ホールディングス	19,200	491.00	9,427,200	
8473	S B Iホールディングス	24,600	564.00	13,874,400	
8595	ジャフコ	2,800	1,822.00	5,101,600	
8601	大和証券グループ本社	230,000	313.00	71,990,000	
8604	野村ホールディングス	503,200	285.00	143,412,000	
8609	岡三証券グループ	20,000	297.00	5,940,000	
8613	丸三証券	7,600	243.00	1,846,800	
8614	東洋証券	9,000	139.00	1,251,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	27,000	292.00	7,884,000	
8617	光世証券	6,000	74.00	444,000	
8622	水戸証券	7,000	144.00	1,008,000	
8624	いちよし証券	5,200	414.00	2,152,800	
8628	松井証券	13,800	530.00	7,314,000	
8692	だいこう証券ビジネス	1,300	299.00	388,700	
8698	マネックスグループ	175	13,190.00	2,308,250	
8703	カブドットコム証券	9,500	226.00	2,147,000	
8706	極東証券	3,100	587.00	1,819,700	
8707	岩井コスモホールディングス	2,200	276.00	607,200	
8630	N K S Jホールディングス	48,600	1,472.00	71,539,200	
8725	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	69,500	1,354.00	94,103,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	22,300	1,416.00	31,576,800	
8750	第一生命保険	1,243	92,200.00	114,604,600	
8766	東京海上ホールディングス	84,400	2,156.00	181,966,400	
8795	T & Dホールディングス	84,700	860.00	72,842,000	
8253	クレディセゾン	19,000	1,747.00	33,193,000	
8424	芙蓉総合リース	2,200	2,275.00	5,005,000	
8425	興銀リース	3,200	1,993.00	6,377,600	
8439	東京センチュリーリース	6,200	1,591.00	9,864,200	
8511	日本証券金融	9,600	364.00	3,494,400	
8512	大阪証券金融	2,700	180.00	486,000	
8515	アイフル	21,150	210.00	4,441,500	
8519	ポケットカード	2,300	325.00	747,500	
8566	リコーリース	1,600	1,840.00	2,944,000	

8570	イオンクレジットサービス	9,500	1,688.00	16,036,000	
8572	アコム	4,670	2,299.00	10,736,330	
8584	ジャックス	14,000	338.00	4,732,000	
8585	オリエントコーポレーション	45,000	154.00	6,930,000	
8586	日立キャピタル	4,600	1,524.00	7,010,400	
8591	オリックス	12,090	8,270.00	99,984,300	
8593	三菱UFJリース	5,900	3,475.00	20,502,500	
8772	アサックス	3	77,300.00	231,900	
8793	NECキャピタルソリューション	800	1,180.00	944,000	
2353	日本駐車場開発	252	4,440.00	1,118,880	
3003	ヒューリック	27,400	560.00	15,344,000	
3225	東京建物不動産販売	1,200	266.00	319,200	
3228	三栄建築設計	600	719.00	431,400	
3231	野村不動産ホールディングス	11,200	1,403.00	15,713,600	
3258	常和ホールディングス	400	1,464.00	585,600	
4666	パーク24	12,100	1,386.00	16,770,600	
8801	三井不動産	103,000	1,617.00	166,551,000	
8802	三菱地所	163,000	1,560.00	254,280,000	
8803	平和不動産	4,400	948.00	4,171,200	
8804	東京建物	44,000	325.00	14,300,000	
8806	ダイビル	6,800	626.00	4,256,800	
8815	東急不動産	47,000	443.00	20,821,000	
8818	京阪神ビルディング	2,800	375.00	1,050,000	
8830	住友不動産	56,000	2,171.00	121,576,000	
8833	東宝不動産	2,500	440.00	1,100,000	
8840	大京	36,000	212.00	7,632,000	
8841	テーオーシー	9,000	400.00	3,600,000	
8842	東京楽天地	4,000	300.00	1,200,000	
8848	レオパレス21	18,400	240.00	4,416,000	
8860	フジ住宅	2,900	439.00	1,273,100	
8864	空港施設	2,400	386.00	926,400	
8869	明和地所	1,200	356.00	427,200	
8870	住友不動産販売	840	3,770.00	3,166,800	
8871	ゴールドクレスト	2,100	1,190.00	2,499,000	
8875	東栄住宅	1,500	845.00	1,267,500	
8877	日本エスリード	900	685.00	616,500	
8879	東急リバブル	2,100	1,008.00	2,116,800	
8880	飯田産業	2,200	723.00	1,590,600	
8881	日神不動産	1,400	433.00	606,200	
8895	アーネストワン	3,800	1,197.00	4,548,600	
8897	タカラレーベン	2,700	900.00	2,430,000	
8904	サンヨーハウジング名古屋	12	84,000.00	1,008,000	
8905	イオンモール	10,600	2,048.00	21,708,800	
8907	フージャースコーポレーション	36	62,400.00	2,246,400	
8915	タクトホーム	12	82,400.00	988,800	
8923	トーセイ	30	30,600.00	918,000	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	145	64,900.00	9,410,500	
8934	サンフロンティア不動産	19	23,750.00	451,250	
8944	ランドビジネス	16	14,610.00	233,760	

8999	グランディハウス	500	644.00	322,000	
9706	日本空港ビルデング	7,400	884.00	6,541,600	
1954	日本工営	8,000	275.00	2,200,000	
2120	ネクスト	1,000	611.00	611,000	
2127	日本M&Aセンター	1,000	2,428.00	2,428,000	
2128	ノバレーゼ	6	53,800.00	322,800	
2131	アコーディア・ゴルフ	100	56,300.00	5,630,000	
2151	タケエイ	200	1,821.00	364,200	
2168	パソナグループ	24	49,100.00	1,178,400	
2170	リンクアンドモチベーション	10	32,100.00	321,000	
2175	エス・エム・エス	5	171,900.00	859,500	
2181	テンプホールディングス	3,400	949.00	3,226,600	
2193	クックパッド	500	2,435.00	1,217,500	
2301	学情	800	281.00	224,800	
2305	スタジオアリス	1,100	1,236.00	1,359,600	
2309	シミックホールディングス	900	1,231.00	1,107,900	
2322	NECフィールディング	2,000	941.00	1,882,000	
2331	総合警備保障	9,000	1,125.00	10,125,000	
2371	カカクコム	3,800	2,712.00	10,305,600	
2378	ルネサンス	1,100	526.00	578,600	
2398	ツクイ	900	1,801.00	1,620,900	
2413	エムスリー	57	154,800.00	8,823,600	
2418	ベストブライダル	7	86,200.00	603,400	
2432	ディー・エヌ・エー	11,000	2,576.00	28,336,000	
2433	博報堂D Yホールディングス	3,130	4,865.00	15,227,450	
2440	ぐるなび	1,700	913.00	1,552,100	
2450	一休	18	37,900.00	682,200	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	3	78,600.00	235,800	
2462	ジェイコムホールディングス	400	734.00	293,600	
2466	P G Mホールディングス	34	63,700.00	2,165,800	
2749	J Pホールディングス	700	980.00	686,000	
4282	イーピーエス	15	237,400.00	3,561,000	
4301	アミューズ	700	1,461.00	1,022,700	
4310	ドリームインキュベータ	8	72,000.00	576,000	
4319	T A C	1,400	133.00	186,200	
4321	ケネディクス	235	10,520.00	2,472,200	
4324	電通	22,400	1,886.00	42,246,400	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	105	6,590.00	691,950	
4337	ぴあ	700	1,030.00	721,000	
4343	イオンファンタジー	800	1,068.00	854,400	
4544	みらかホールディングス	6,400	3,385.00	21,664,000	
4641	アルプス技研	1,000	636.00	636,000	
4651	サニックス	3,600	254.00	914,400	
4653	ダイオーズ	500	510.00	255,000	
4658	日本空調サービス	600	728.00	436,800	
4661	オリエンタルランド	6,600	10,870.00	71,742,000	
4665	ダスキン	7,300	1,544.00	11,271,200	
4668	明光ネットワークジャパン	2,200	812.00	1,786,400	
4671	ファルコSDホールディングス	1,300	940.00	1,222,000	

4678	秀英予備校	500	297.00	148,500	
4679	田谷	400	685.00	274,000	
4680	ラウンドワン	7,700	401.00	3,087,700	
4681	リゾートトラスト	3,800	1,520.00	5,776,000	
4694	ビー・エム・エル	1,600	2,008.00	3,212,800	
4696	ワタベウェディング	700	663.00	464,100	
4708	もしもしホットライン	4,100	1,210.00	4,961,000	
4711	東急コミュニティー	600	2,864.00	1,718,400	
4714	リソー教育	248	5,850.00	1,450,800	
4724	ウェアハウス	400	220.00	88,000	
4732	ユー・エス・エス	3,210	8,380.00	26,899,800	
4745	東京個別指導学院	1,200	143.00	171,600	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	521.00	416,800	
4801	セントラルスポーツ	800	1,131.00	904,800	
5261	リゾートソリューション	2,000	160.00	320,000	
8876	リロ・ホールディング	700	2,576.00	1,803,200	
9603	エイチ・アイ・エス	2,000	2,528.00	5,056,000	
9616	共立メンテナンス	1,200	1,736.00	2,083,200	
9619	イチネンホールディングス	2,600	487.00	1,266,200	
9621	建設技術研究所	1,400	498.00	697,200	
9628	燦ホールディングス	500	1,385.00	692,500	
9632	スバル興業	2,000	250.00	500,000	
9633	東京テアトル	9,000	102.00	918,000	
9671	よみうりランド	5,000	257.00	1,285,000	
9672	東京都競馬	19,000	119.00	2,261,000	
9675	常磐興産	8,000	107.00	856,000	
9678	カナモト	3,000	973.00	2,919,000	
9681	東京ドーム	20,000	272.00	5,440,000	
9715	トランス・コスモス	3,200	914.00	2,924,800	
9716	乃村工藝社	5,000	288.00	1,440,000	
9722	藤田観光	6,000	260.00	1,560,000	
9726	近畿日本ツーリスト	8,000	97.00	776,000	
9728	日本管財	900	1,495.00	1,345,500	
9729	トーカイ	1,000	2,005.00	2,005,000	
9731	白洋舎	3,000	210.00	630,000	
9735	セコム	23,900	4,090.00	97,751,000	
9740	セントラル警備保障	1,100	794.00	873,400	
9743	丹青社	3,000	239.00	717,000	
9744	メイテック	3,800	1,781.00	6,767,800	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,100	1,852.00	7,593,200	
9755	応用地質	2,600	952.00	2,475,200	
9757	船井総合研究所	2,500	525.00	1,312,500	
9760	進学会	1,200	295.00	354,000	
9783	ベネッセホールディングス	7,500	3,735.00	28,012,500	
9787	イオンディライト	2,800	1,635.00	4,578,000	
9788	ナック	600	1,770.00	1,062,000	
9792	ニチイ学館	4,800	732.00	3,513,600	
9793	ダイセキ	4,000	1,091.00	4,364,000	
	合計	36,070,921		23,856,717,830	



(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23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		56,660,481	879,491,192
コール・ローン		168,254,680	827,338,500
株式		59,798,526,901	60,333,037,109
投資証券		1,084,330,074	1,409,155,471
派生商品評価勘定		40,122,151	11,509,244
未収入金		600,899	6,599,811
未収配当金		60,563,021	72,072,802
未収利息		313	1,580
差入委託証拠金		244,496,151	213,634,415
流動資産合計		61,453,554,671	63,752,840,124
資産合計		61,453,554,671	63,752,840,124
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		629,031	37,113,942
未払金		214,611	
未払解約金		85,692,961	157,285,011
流動負債合計		86,536,603	194,398,953
負債合計		86,536,603	194,398,953
純資産の部			
元本等			
元本		76,714,471,608	66,445,318,652
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		15,347,453,540	2,886,877,481
元本等合計		61,367,018,068	63,558,441,171
純資産合計		61,367,018,068	63,558,441,171
負債純資産合計		61,453,554,671	63,752,840,124

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
1.	期首	平成22年10月27日	平成23年10月27日
	期首元本額	83,174,708,677円	76,714,471,608円
	期首からの追加設定元本額	8,821,496,739円	4,062,313,228円
	期首からの一部解約元本額	15,281,733,808円	14,331,466,184円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	13,020,522,405円	14,253,130,726円
	DCインデックスバランス（株式20）	52,196,228円	47,303,478円
	DCインデックスバランス（株式40）	180,368,648円	167,155,442円
	DCインデックスバランス（株式60）	343,215,260円	307,882,116円
	DCインデックスバランス（株式80）	372,128,636円	337,085,275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	9,406,652,401円
	日興五大陸株式ファンド	21,218,914,066円	17,740,467,598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	73,474,807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	99,295,104円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	24,035,758円	19,537,370円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	21,998,238円	16,656,680円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	35,365,046円	26,841,375円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	45,817,851円	34,142,879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	15,479,415,845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	27,422,152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	18,895,482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	44,806,587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	120,074,635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	153,893,994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	151,053,747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	7,920,130,959円
	計	76,714,471,608円	66,445,318,652円
2.	受益権の総数	76,714,471,608口	66,445,318,652口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	15,347,453,540円	2,886,877,481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)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24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

	平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）  
（平成23年10月26日現在）  
売買目的有価証券

（単位：円）

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

（平成24年10月26日現在）  
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,257,309,721
投資証券	203,569,304
合計	6,460,879,025

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (株式関連)

(平成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

(平成24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	1,853,203,691		1,819,098,732	34,104,959
	合計	1,853,203,691		1,819,098,732	34,104,959

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (通貨関連)

(平成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

(平成24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	1,110,932,489		1,121,179,880	10,247,391
	米ドル	692,454,988		702,104,780	9,649,792
	ユーロ	418,477,501		419,075,100	597,599
	売建	276,157,870		277,905,000	1,747,130
	加ドル	72,450,450		72,621,000	170,550
	豪ドル	41,235,000		41,530,000	295,000
	英ポンド	127,983,900		129,410,000	1,426,100
	スイスフラン	34,488,520		34,344,000	144,520
	合計	1,387,090,359		1,399,084,880	8,500,261

## (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23年10月26日現在		平成24年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.7999円	1口当たり純資産額	0.9566円
(1万口当たり純資産額)	(7,999円)	(1万口当たり純資産額)	(9,566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	16,693	66.55	1,110,919.15	
APACHE CORP	13,284	82.81	1,100,048.04	
BAKER HUGHES INC	14,945	43.42	648,911.90	
CABOT OIL & GAS CORP	7,900	43.15	340,885.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	8,451	51.08	431,677.08	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	22,240	20.22	449,692.80	
CHEVRON CORP	66,301	110.96	7,356,758.96	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	58.55	196,435.25	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	5,000	20.65	103,250.00	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	87.56	319,156.20	
CONOCOPHILLIPS	40,710	57.16	2,326,983.60	
CONSOL ENERGY INC	8,638	34.42	297,319.96	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	72.50	118,175.00	
CORE LABORATORIES N.V.	1,470	103.33	151,895.10	

DENBURY RESOURCES INC	10,745	15.28	164,183.60
DEVON ENERGY CORPORATION	13,321	58.88	784,340.48
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	70.22	181,518.70
ENERGEN CORP	2,310	47.48	109,678.80
ENSCO PLC-CL A	7,000	58.77	411,390.00
EOG RESOURCES INC	9,376	112.42	1,054,049.92
EQT CORP	5,345	60.72	324,548.40
EXXON MOBIL CORP	157,081	90.43	14,204,834.83
FMC TECHNOLOGIES INC	8,285	39.90	330,571.50
HALLIBURTON CO	31,727	32.92	1,044,452.84
HELMERICH & PAYNE	4,100	49.03	201,023.00
HESS CORP	10,830	53.90	583,737.00
HOLLYFRONTIER CORP	6,410	37.73	241,849.30
KINDER MORGAN INC	22,010	35.06	771,670.60
MARATHON OIL CORP	22,967	30.20	693,603.40
MARATHON PETROLEUM CORP	11,066	53.96	597,121.36
MURPHY OIL CORP	6,255	59.85	374,361.75
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	14.15	151,985.15
NATIONAL OILWELL VARCO INC	14,241	74.88	1,066,366.08
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	27.23	134,788.50
NOBLE CORP	7,632	38.59	294,518.88
NOBLE ENERGY INC	5,651	92.87	524,808.37
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	27,181	82.52	2,242,976.12
PEABODY ENERGY CORP	9,290	28.03	260,398.70
PHILLIPS 66	20,785	45.03	935,948.55
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	104.27	375,372.00
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	4,725	35.43	167,406.75
QEP RESOURCES INC	6,820	31.65	215,853.00
RANGE RESOURCES CORP	4,920	66.45	326,934.00
ROWAN COMPANIES PLC	4,980	33.24	165,535.20
SCHLUMBERGER LTD	44,739	70.74	3,164,836.86
SOUTHWESTERN ENERGY CO	10,635	33.94	360,951.90
SPECTRA ENERGY CORP	22,844	29.12	665,217.28
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	5,500	20.24	111,320.00
ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	22.61	124,897.64
VALERO ENERGY CORP	18,992	28.49	541,082.08

[次へ](#)

WEATHERFORD INTL LTD	24,599	11.75	289,038.25
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	42.91	183,869.35
WILLIAMS COS INC	21,124	34.71	733,214.04
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,325	77.73	569,372.25
AIRGAS INC	2,650	86.35	228,827.50
ALBEMARLE CORP	2,650	55.09	145,988.50
ALCOA INC	39,339	8.73	343,429.47
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	27.32	109,553.20
BALL CORP	5,073	42.50	215,602.50
CELANESE CORP-SERIES A	6,010	37.99	228,319.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,230	203.61	454,050.30
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	38.20	204,370.00
CROWN HOLDINGS INC	4,035	37.71	152,159.85
DOW CHEMICAL	40,463	29.66	1,200,132.58
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	31,358	45.17	1,416,440.86
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,675	53.65	250,813.75
ECOLAB INC	9,230	69.20	638,716.00
FMC CORP	4,430	53.58	237,359.40
FREEPORT-MCMORAN COPPER	31,703	39.19	1,242,440.57
INTERNATIONAL PAPER CO	14,050	35.26	495,403.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,224	63.88	205,949.12
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	53.40	558,030.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,445	82.39	119,053.55
MEADWESTVACO CORP	6,889	29.59	203,845.51
MONSANTO CO	18,181	86.49	1,572,474.69
MOSAIC CO/THE	10,390	53.25	553,267.50
NEWMONT MINING CORP	15,980	53.56	855,888.80
NUCOR CORP	9,649	40.23	388,179.27
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	19.93	129,046.75
PPG INDUSTRIES INC	5,397	116.02	626,159.94
PRAXAIR INC	9,670	104.78	1,013,222.60
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	72.34	180,850.00
SEALED AIR CORP	4,356	15.92	69,347.52
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,877	140.00	402,780.00
SIGMA-ALDRICH	4,395	70.55	310,067.25
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	21.41	112,124.17
VULCAN MATERIALS CO	4,443	46.89	208,332.27
WALTER ENERGY INC	2,240	36.23	81,155.20
3M CO	22,156	87.81	1,945,518.36
AGCO CORP	3,790	47.42	179,721.80
AMETEK INC	8,163	35.50	289,786.50
BOEING CO	23,822	71.54	1,704,225.88
CATERPILLAR INC	21,706	83.53	1,813,102.18
COOPER INDUSTRIES PLC	5,008	73.81	369,640.48
CUMMINS INC	5,725	94.05	538,436.25
DANAHER CORP	19,449	52.25	1,016,210.25
DEERE & CO	12,470	84.69	1,056,084.30
DOVER CORP	6,340	58.19	368,924.60
EATON CORP	11,196	45.42	508,522.32
EMERSON ELECTRIC CO	24,520	47.96	1,175,979.20
FASTENAL CO	8,533	43.05	367,345.65
FLOWSERVE CORP	1,825	131.14	239,330.50
FLUOR CORP	5,893	55.21	325,352.53
GENERAL DYNAMICS CORP	10,352	67.61	699,898.72



GENERAL ELECTRIC CO.	356,253	21.26	7,573,938.78
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	24,766	61.43	1,521,375.38
ILLINOIS TOOL WORKS	13,800	60.47	834,486.00
INGERSOLL-RAND PLC	10,266	46.39	476,239.74
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,810	38.88	187,012.80
JOY GLOBAL INC	3,935	59.74	235,076.90
KBR INC	5,860	28.56	167,361.60
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	3,081	73.79	227,346.99
LOCKHEED MARTIN CORP	9,461	93.55	885,076.55
MASCO CORP	12,359	14.91	184,272.69
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,414	69.04	580,902.56
PACCAR INC	10,674	42.78	456,633.72
PALL CORP	3,666	62.28	228,318.48
PARKER HANNIFIN CORP	5,290	77.58	410,398.20
PENTAIR LTD-REGISTERED	7,788	41.25	321,255.00
PRECISION CASTPARTS CORP	5,050	167.18	844,259.00
QUANTA SERVICES INC	8,315	23.55	195,818.25
RAYTHEON COMPANY	10,732	55.74	598,201.68
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,933	68.90	339,883.70
ROCKWELL COLLINS INC.	4,795	53.31	255,621.45
ROPER INDUSTRIES INC	3,180	108.84	346,111.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	28.05	86,955.00
SPX CORP	2,087	66.67	139,140.29
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,436	68.35	371,550.60
TEXTRON INC	10,336	25.51	263,671.36
TRANSDIGM GROUP INC	1,460	135.11	197,260.60
UNITED TECHNOLOGIES CORP	29,005	77.29	2,241,796.45
URS CORP	1,950	33.73	65,773.50
WW GRAINGER INC	2,157	199.63	430,601.91
XYLEM INC	6,518	23.71	154,541.78
ADT CORP/THE	8,177	41.16	336,565.32
AVERY DENNISON CORP	3,790	32.46	123,023.40
CINTAS CORP	4,727	41.37	195,555.99
DUN & BRADSTREET CORP	1,662	78.87	131,081.94
EQUIFAX INC	4,084	49.42	201,831.28
IHS INC-CLASS A	1,710	85.52	146,239.20
IRON MOUNTAIN INC	4,302	33.68	144,891.36
MANPOWERGROUP	2,657	38.00	100,966.00
NIELSEN HOLDINGS NV	3,245	28.47	92,385.15
PITNEY BOWES INC	5,613	14.35	80,546.55
REPUBLIC SERVICES INC	9,240	28.49	263,247.60
ROBERT HALF INTL INC	3,425	27.07	92,714.75
STERICYCLE INC	3,025	95.21	288,010.25
TYCO INTERNATIONAL LTD	14,885	26.78	398,620.30
VERISK ANALYTICS INC	4,000	46.29	185,160.00
WASTE MANAGEMENT INC	14,694	32.69	480,346.86
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,250	59.10	310,275.00
CSX CORP	35,673	20.58	734,150.34
DELTA AIR LINES INC	6,905	9.64	66,564.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,227	35.78	222,802.06
FEDEX CORP	10,298	91.12	938,353.76
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	13.67	133,692.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,080	57.28	176,422.40
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.78	157,000.00

KANSAS CITY SOUTHERN	4,130	80.03	330,523.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,380	62.57	712,046.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	8.83	62,074.90
UNION PACIFIC CORP	16,038	121.64	1,950,862.32
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	19.26	48,053.70
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	24,237	73.20	1,774,148.40
AUTOLIV INC	2,610	56.61	147,752.10
BORGWARNER INC	4,135	64.66	267,369.10
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	9,500	31.43	298,585.00
FORD MOTOR COMPANY	118,905	10.39	1,235,422.95
GENERAL MOTORS CORP	25,855	23.63	610,953.65
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,385	12.30	115,435.50
HARLEY-DAVIDSON INC	7,689	46.52	357,692.28
JOHNSON CONTROLS INC	23,158	26.16	605,813.28
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	45.34	172,518.70
COACH INC	9,706	56.81	551,397.86
DR HORTON INC	10,076	21.11	212,704.36
FOSSIL INC	2,035	87.99	179,059.65
GARMIN LTD	3,575	39.26	140,354.50
HASBRO INC	3,368	36.57	123,167.76
LEGGETT & PLATT INC	4,468	25.29	112,995.72
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	67.69	243,684.00
MATTEL INC	11,459	37.06	424,670.54
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,318	80.99	187,734.82
NEWELL RUBBERMAID INC	9,310	20.09	187,037.90
NIKE INC -CL B	12,307	91.31	1,123,752.17
PVH CORP	2,030	93.01	188,810.30
RALPH LAUREN CORP	2,095	153.75	322,106.25
TOLL BROTHERS INC	4,501	34.21	153,979.21
VF CORP	2,975	155.19	461,690.25
WHIRLPOOL CORP	2,934	94.88	278,377.92
APOLLO GROUP INC-CL A	2,732	19.62	53,601.84
CARNIVAL CORP	14,907	38.66	576,304.62
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,155	248.01	286,451.55
DARDEN RESTAURANTS INC	4,383	52.66	230,808.78
H&R BLOCK INC	12,000	17.81	213,720.00
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	12.79	149,463.94
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	46.25	631,775.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,466	36.47	345,225.02
MCDONALD'S CORP	34,101	87.33	2,978,040.33
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	10.88	152,320.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	33.74	165,595.92
STARBUCKS CORP	25,822	46.25	1,194,267.50
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,567	51.66	339,251.22
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,550	51.55	234,552.50
WYNN RESORTS LTD	2,370	120.43	285,419.10
YUM! BRANDS INC	15,514	70.19	1,088,927.66
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	17.89	102,420.25
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	20,888	33.28	695,152.64
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	76.19	106,666.00
COMCAST CORP-CLASS A	71,176	36.36	2,587,959.36
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	20,541	35.51	729,410.91
DIRECTV	21,884	51.32	1,123,086.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,960	58.76	291,449.60

DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3,095	54.60	168,987.00
DISH NETWORK CORP-A	7,659	35.77	273,962.43
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,846	10.55	167,175.30
LIBERTY GLOBAL INC-A	4,473	60.69	271,466.37
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	3,223	56.79	183,034.17
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-A	3,685	111.31	410,177.35
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	8,872	54.91	487,161.52
NEWS CORP-CL A	54,912	24.09	1,322,830.08
NEWS CORP-CLASS B	15,779	24.58	387,847.82
OMNICOM GROUP	9,457	48.22	456,016.54
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	62.20	206,504.00
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	2.85	386,260.50
THE WALT DISNEY CO.	57,363	50.26	2,883,064.38
TIME WARNER CABLE	10,767	97.95	1,054,627.65
TIME WARNER INC	32,278	43.59	1,406,998.02
VIACOM INC-CLASS B	15,548	53.46	831,196.08
VIRGIN MEDIA INC	9,025	32.70	295,117.50
WASHINGTON POST-CLASS B	142	331.98	47,141.16
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,321	30.86	102,486.06
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,708	67.90	183,873.20
AMAZON.COM INC	12,095	227.55	2,752,217.25
AUTOZONE INC	1,232	367.78	453,104.96
BED BATH & BEYOND INC	8,292	58.37	484,004.04
BEST BUY CO INC	9,654	15.17	146,451.18
CARMAX INC	7,589	32.78	248,767.42
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	50.34	139,441.80
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	7,440	47.30	351,912.00
DOLLAR TREE INC	7,944	40.05	318,157.20
EXPEDIA INC	3,642	51.33	186,943.86
FAMILY DOLLAR STORES	3,343	65.98	220,571.14
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	23.72	122,158.00
GAP INC/THE	10,356	35.17	364,220.52
GENUINE PARTS CO	4,731	60.88	288,023.28
HOME DEPOT INC	51,730	60.48	3,128,630.40
J.C. PENNEY CO INC	6,061	25.13	152,312.93
KOHL'S CORP	8,052	51.59	415,402.68
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	18,970	19.95	378,451.50
LIMITED INC/THE	8,778	48.27	423,714.06
LOWE'S COS INC	39,302	31.79	1,249,410.58
MACY'S INC	12,869	38.68	497,772.92
NETFLIX INC	1,830	61.51	112,563.30
NORDSTROM INC	5,840	55.10	321,784.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,665	84.46	394,005.90
PETSMART INC	3,430	66.17	226,963.10
PRICELINE.COM INC	1,630	557.87	909,328.10
ROSS STORES INC	7,506	60.65	455,238.90
STAPLES INC	22,854	11.41	260,764.14
TARGET CORP	21,010	63.12	1,326,151.20
TIFFANY & CO	4,560	63.04	287,462.40
TJX COMPANIES INC	25,793	41.35	1,066,540.55
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,220	92.88	206,193.60
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	92.27	163,317.90
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	35.80	170,766.00
COSTCO WHOLESALE CORP	14,779	96.60	1,427,651.40

CVS CAREMARK CORP	43,157	46.11	1,989,969.27
KROGER CO	16,285	25.36	412,987.60
SAFeway INC	8,473	16.57	140,397.61
SYSCO CORP	19,986	30.84	616,368.24
WALGREEN CO	28,972	35.33	1,023,580.76
WAL-MART STORES INC	62,962	75.32	4,742,297.84
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	93.50	518,457.50
ALTRIA GROUP INC	69,398	32.10	2,227,675.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,913	26.99	618,421.87
BEAM INC	5,276	56.48	297,988.48
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,517	63.95	224,912.15
BUNGE LTD	4,657	70.18	326,828.26
CAMPBELL SOUP CO	7,215	34.75	250,721.25
COCA COLA HELLENIC BTLNG-ADR	3,000	21.77	65,310.00
COCA-COLA CO/THE	136,382	37.09	5,058,408.38
COCA-COLA ENTERPRISES	10,930	31.00	338,830.00
CONAGRA FOODS INC	14,060	28.32	398,179.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,580	35.81	199,819.80
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	6,909	42.92	296,534.28
GENERAL MILLS INC	22,629	39.91	903,123.39
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	24.41	118,998.75
HERSHEY CO/THE	5,095	69.85	355,885.75
HJ HEINZ CO	10,670	57.36	612,031.20
HORMEL FOODS CORP	5,800	29.29	169,882.00
JM SMUCKER CO/THE	3,380	85.76	289,868.80
KELLOGG CO	7,808	52.56	410,388.48
KRAFT FOODS GROUP INC	19,241	45.91	883,354.31
LORILLARD INC	4,660	115.04	536,086.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,005	61.94	248,069.70
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,191	63.53	456,844.23
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,080	43.80	222,504.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	56,845	26.47	1,504,687.15
MONSTER BEVERAGE CORP	5,650	47.09	266,058.50
PEPSICO INC	52,651	68.89	3,627,127.39
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	57,458	87.73	5,040,790.34
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	72.39	131,749.80
REYNOLDS AMERICAN INC	11,440	41.35	473,044.00
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	16.37	183,442.22
AVON PRODUCTS	15,953	15.76	251,419.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,225	50.98	215,390.50
CLOROX COMPANY	4,156	72.81	302,598.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	16,130	104.60	1,687,198.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,061	72.19	148,783.59
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,340	61.30	511,242.00
HERBALIFE LTD	4,450	49.95	222,277.50
KIMBERLY-CLARK CORP	12,973	82.84	1,074,683.32
PROCTER & GAMBLE CO	92,029	70.07	6,448,472.03
AETNA INC	12,283	44.43	545,733.69
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,014	39.76	358,396.64
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,339	61.42	1,126,381.38
BECTON DICKINSON AND CO	6,326	75.29	476,284.54
BOSTON SCIENTIFIC CORP	52,468	5.12	268,636.16
CARDINAL HEALTH INC	11,805	40.89	482,706.45
CAREFUSION CORP	8,275	26.79	221,687.25

CERNER CORP	5,335	68.47	365,287.45	
CIGNA CORP	10,330	50.37	520,322.10	
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	43.93	222,944.75	
COVIDIEN PLC	16,755	54.85	919,011.75	
CR BARD INC	2,344	96.93	227,203.92	
DAVITA INC	3,499	111.41	389,823.59	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,562	37.33	170,299.46	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,660	86.99	318,383.40	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	27,064	63.23	1,711,256.72	
HCA HOLDINGS INC	6,715	31.26	209,910.90	

[次へ](#)

HENRY SCHEIN INC	3,010	74.81	225,178.10
HOLOGIC INC	8,758	20.33	178,050.14
HUMANA INC	5,785	75.55	437,056.75
INTUITIVE SURGICAL INC	1,340	545.63	731,144.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,875	85.62	246,157.50
MCKESSON CORP	7,624	93.16	710,251.84
MEDTRONIC INC	34,692	41.88	1,452,900.96
OMNICARE INC	3,640	34.41	125,252.40
PATTERSON COS INC	3,142	33.68	105,822.56
QUEST DIAGNOSTICS	5,866	58.60	343,747.60
ST JUDE MEDICAL INC	10,490	38.27	401,452.30
STRYKER CORP	9,683	52.40	507,389.20
UNITEDHEALTH GROUP INC	34,750	56.21	1,953,297.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,164	58.10	183,828.40
WELLPOINT INC	11,306	62.23	703,572.38
ZIMMER HOLDINGS INC	5,762	63.98	368,652.76
ABBOTT LABORATORIES	52,777	65.78	3,471,671.06
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,200	36.11	440,542.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,450	96.45	622,102.50
ALLERGAN INC	10,085	91.26	920,357.10
AMGEN INC	26,271	88.05	2,313,161.55
BIOGEN IDEC INC	7,737	144.43	1,117,454.91
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	57,051	33.73	1,924,330.23
CELGENE CORP	14,582	74.32	1,083,734.24
ELI LILLY & CO	35,293	51.08	1,802,766.44
FOREST LABORATORIES INC	9,545	34.62	330,447.90
GILEAD SCIENCES INC	25,797	67.38	1,738,201.86
HOSPIRA INC	6,181	31.16	192,599.96
ILLUMINA INC	4,745	47.60	225,862.00
JOHNSON & JOHNSON	92,201	71.14	6,559,179.14
LIFE TECHNOLOGIES CORP	5,316	48.62	258,463.92
MERCK & CO. INC.	102,103	46.30	4,727,368.90
MYLAN INC	14,505	25.00	362,625.00
PERRIGO CO	3,180	117.37	373,236.60
PFIZER INC	251,720	25.61	6,446,549.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,350	155.23	364,790.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,694	61.70	721,519.80
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,300	50.11	365,803.00
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	12.00	54,000.00
WATERS CORP	3,106	80.67	250,561.02
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	86.89	408,817.45
BB&T CORP	22,738	28.95	658,265.10
CIT GROUP INC	7,175	37.55	269,421.25
COMERICA INC	7,190	29.57	212,608.30
FIFTH THIRD BANCORP	31,889	14.64	466,854.96
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	34.62	80,664.60
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	8.69	172,670.30
KEYCORP	34,838	8.53	297,168.14
M & T BANK CORP	3,463	104.21	360,879.23
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	13.90	223,289.60
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,750	12.24	131,580.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,510	58.44	1,023,284.40
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	6.61	303,227.14
SUNTRUST BANKS INC	18,667	27.24	508,489.08

US BANCORP	64,541	33.48	2,160,832.68
WELLS FARGO & CO	170,030	34.06	5,791,221.80
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,540	124.19	191,252.60
AMERICAN EXPRESS CO	35,464	55.44	1,966,124.16
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,670	59.00	393,530.00
BANK OF AMERICA CORPORATION	361,429	9.24	3,339,603.96
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	38,412	24.76	951,081.12
BLACKROCK INC	4,415	187.12	826,134.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	19,185	59.97	1,150,524.45
CITIGROUP INC	98,317	37.41	3,678,038.97
CME GROUP INC	10,380	55.00	570,900.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	19,360	39.85	771,496.00
EATON VANCE CORP	3,790	28.03	106,233.70
FRANKLIN RESOURCES INC	5,035	126.33	636,071.55
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,648	119.72	1,873,378.56
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,160	130.50	281,880.00
INVESCO LTD	13,827	24.19	334,475.13
JPMORGAN CHASE & CO	127,850	41.67	5,327,509.50
LEGG MASON INC	4,925	24.70	121,647.50
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	22.81	166,627.05
MOODY'S CORP	5,927	45.72	270,982.44
MORGAN STANLEY	52,185	17.10	892,363.50
NASDAQ OMX GROUP/THE	5,095	23.86	121,592.17
NORTHERN TRUST CORP	7,340	47.33	347,402.20
NYSE EURONEXT	9,700	24.76	240,172.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	36,334	13.51	490,872.34
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	22.07	95,452.75
SLM CORP	16,092	17.54	282,253.68
STATE STREET CORP	16,137	44.69	721,162.53
T ROWE PRICE GROUP INC	8,825	64.74	571,330.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	15.71	134,006.30
ACE LTD	11,073	80.01	885,950.73
AFLAC INC	14,922	50.03	746,547.66
ALLEGHANY CORP	400	348.94	139,576.00
ALLSTATE CORP	15,763	40.51	638,559.13
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	35,435	34.98	1,239,516.30
AON PLC	10,247	52.35	536,430.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,295	44.70	236,686.50
ASSURANT INC	2,500	38.02	95,050.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	37.30	111,713.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	30,980	87.15	2,699,907.00
CHUBB CORP	9,573	79.39	760,000.47
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,030	39.94	200,898.20
EVEREST RE GROUP LTD	1,434	114.60	164,336.40
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	21.81	128,264.61
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	5.64	105,157.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,002	22.48	314,764.96
LINCOLN NATIONAL CORP	9,373	25.09	235,168.57
LOEWS CORP	10,945	42.40	464,068.00
MARSH & MCLENNAN COS	19,203	33.39	641,188.17
METLIFE INC	28,445	35.65	1,014,064.25
PARTNERRE LTD	2,372	82.22	195,025.84
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,290	28.29	291,104.10
PROGRESSIVE CORP	17,870	22.59	403,683.30

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,282	57.31	875,811.42
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	82.08	122,873.76
TORCHMARK CORP	3,101	50.17	155,577.17
TRAVELERS COS INC/THE	13,424	72.12	968,138.88
UNUM GROUP	7,828	20.52	160,630.56
WILLIS GROUP HOLDING	6,260	33.58	210,210.80
WR BERKLEY CORP	4,253	39.51	168,036.03
XL GROUP PLC	9,680	25.08	242,774.40
CBRE GROUP INC	11,490	18.24	209,577.60
ACCENTURE PLC-CL A	21,548	66.66	1,436,389.68
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,350	11.06	147,651.00
ADOBE SYSTEMS INC	16,749	33.40	559,416.60
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	6,270	38.54	241,645.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,595	142.33	227,016.35
ANSYS INC	2,800	69.04	193,312.00
AUTODESK INC	7,690	32.10	246,849.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,046	58.23	992,588.58
BMC SOFTWARE INC	5,554	41.47	230,324.38
CA INC	11,450	24.90	285,105.00
CITRIX SYSTEMS INC	6,488	63.09	409,327.92
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	10,309	68.17	702,764.53
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	30.74	171,621.42
EBAY INC	39,247	48.34	1,897,199.98
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	12.21	154,016.94
EQUINIX INC	1,450	183.80	266,510.00
FACEBOOK INC-A	14,000	22.56	315,840.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,595	32.54	247,141.30
FISERV INC	4,069	75.13	305,703.97
GOOGLE INC-CL A	8,756	677.76	5,934,466.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,812	191.60	7,053,179.20
INTUIT INC	9,976	59.44	592,973.44
LINKEDIN CORP - A	2,110	105.72	223,069.20
MASTERCARD INC-CLASS A	3,690	449.36	1,658,138.40
MICROSOFT CORP	253,954	27.88	7,080,237.52
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,350	22.19	207,476.50
ORACLE CORP	133,593	30.86	4,122,679.98
PAYCHEX INC	11,862	32.81	389,192.22
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	62.80	201,588.00
RED HAT INC	5,810	50.03	290,674.30
SAIC INC	10,745	10.87	116,798.15
SALESFORCE.COM INC	4,160	145.31	604,489.60
SYMANTEC CORP	24,085	18.54	446,535.90
SYNOPSIS INC	4,627	32.28	149,359.56
TERADATA CORP	5,595	67.83	379,508.85
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	22.41	100,979.46
VERIFONE SYSTEMS INC	3,110	29.80	92,678.00
VERISIGN INC	5,190	46.60	241,854.00
VISA INC-CLASS A SHARES	17,815	137.55	2,450,453.25
VMWARE INC	3,115	86.36	269,011.40
WESTERN UNION CO	20,081	17.81	357,642.61
YAHOO! INC	40,365	16.61	670,462.65
AMPHENOL CORP-CL A	5,650	60.10	339,565.00
APPLE COMPUTER INC	31,466	609.80	19,187,966.80
ARROW ELECTRONICS INC	4,490	34.60	155,354.00



AVNET INC	4,620	28.53	131,808.60
CISCO SYSTEMS INC	179,740	17.20	3,091,528.00
CORNING INC	51,348	12.09	620,797.32
DELL INC	51,456	9.24	475,453.44
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	1,250	31.23	39,037.50
EMC CORP/MASS	70,199	24.14	1,694,603.86
F5 NETWORKS INC	3,005	83.00	249,415.00
FLEXTRONICS INTL LTD	22,836	5.80	132,448.80
FLIR SYSTEMS INC	5,565	19.65	109,352.25
HARRIS CORP	3,080	47.06	144,944.80
HEWLETT-PACKARD CO	67,255	14.19	954,348.45
JUNIPER NETWORKS INC	19,573	16.07	314,538.11
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,375	50.00	468,750.00
NETAPP INC	12,226	28.13	343,917.38
QUALCOMM INC	57,262	57.43	3,288,556.66
SANDISK CORP	7,303	42.39	309,574.17
SEAGATE TECHNOLOGY	12,394	28.13	348,643.22
TE CONNECTIVITY LTD	14,455	32.07	463,571.85
TRIMBLE NAVIGATION LTD	3,770	47.25	178,132.50
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	34.40	294,292.00
XEROX CORP	45,964	6.50	298,766.00
AT&T INC	197,416	34.50	6,810,852.00
CENTURYLINK INC	21,506	38.68	831,852.08
CROWN CASTLE INTL CORP	10,290	66.05	679,654.50
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	4.78	189,928.52
METROPCS COMMUNICATIONS INC	8,725	10.72	93,532.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	4,610	65.78	303,245.80
SPRINT NEXTEL CORP	103,232	5.52	569,840.64
VERIZON COMMUNICATIONS INC	95,733	44.25	4,236,185.25
WINDSTREAM CORP	20,465	9.63	197,077.95
AES CORP	24,528	10.45	256,317.60
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	44.49	160,608.90
AMEREN CORPORATION	8,922	32.59	290,767.98
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,008	43.91	746,821.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,875	36.76	215,965.00
CALPINE CORP	12,490	17.79	222,197.10
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	21.38	315,611.56
CMS ENERGY CORP	7,820	24.21	189,322.20
CONSOLIDATED EDISON INC	10,486	60.01	629,264.86
DOMINION RESOURCES INC/VA	19,857	51.95	1,031,571.15
DTE ENERGY COMPANY	5,638	61.60	347,300.80
DUKE ENERGY CORP	23,916	64.75	1,548,561.00
EDISON INTERNATIONAL	10,619	46.74	496,332.06
ENTERGY CORP	5,977	70.42	420,900.34
EXELON CORP	29,546	35.64	1,053,019.44
FIRSTENERGY CORP	13,185	45.89	605,059.65
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	53.85	130,317.00
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	21.58	113,942.40
NEXTERA ENERGY INC	12,805	69.74	893,020.70
NISOURCE INC	10,915	25.54	278,769.10
NORTHEAST UTILITIES	11,400	39.01	444,714.00
NRG ENERGY INC	9,360	22.25	208,260.00
ONEOK INC	6,490	47.25	306,652.50
P G & E CORP	14,601	42.04	613,826.04

PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.86	142,833.12	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,569	53.08	189,442.52	
PPL CORPORATION	19,788	29.55	584,735.40	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,738	32.01	535,783.38	
SCANA CORP	3,443	48.60	167,329.80	
SEMPRA ENERGY	7,777	68.65	533,891.05	
SOUTHERN CO	29,725	46.23	1,374,186.75	
WISCONSIN ENERGY CORP	7,644	37.80	288,943.20	
XCEL ENERGY INC	15,294	28.03	428,690.82	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,671	2.12	50,182.52	
ALTERA CORPORATION	11,116	30.20	335,703.20	
ANALOG DEVICES INC	10,261	38.69	396,998.09	
APPLIED MATERIALS INC	43,833	10.68	468,136.44	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	33.70	274,318.00	
BROADCOM CORP-CL A	17,556	31.62	555,120.72	
CREE INC	3,840	29.28	112,435.20	
INTEL CORP	167,832	21.69	3,640,276.08	
KLA-TENCOR CORPORATION	4,819	47.14	227,167.66	
LAM RESEARCH CORP	7,027	35.68	250,723.36	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	7,544	31.41	236,957.04	
LSI CORP	20,595	6.75	139,016.25	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	12,624	7.74	97,709.76	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,910	26.49	262,515.90	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,334	31.41	198,950.94	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	5.69	186,956.33	
NVIDIA CORP	22,805	12.18	277,764.90	
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,762	28.13	1,090,375.06	
XILINX INC	7,715	32.55	251,123.25	
米ドル小計	10,449,030		435,756,001.48 (34,973,776,678)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	24.25	257,413.75	
ATHABASCA OIL CORP	11,180	12.04	134,607.20	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	46.35	205,098.75	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	17.99	89,680.15	
CAMECO CORP	13,702	18.84	258,145.68	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	36,674	29.93	1,097,652.82	
CANADIAN OIL SANDS LTD	14,490	20.67	299,508.30	
CENOVUS ENERGY INC	24,673	34.40	848,751.20	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	41.80	389,785.00	
ENBRIDGE INC	26,035	39.03	1,016,146.05	
ENCANA CORP	24,748	22.31	552,127.88	
ENERPLUS CORP	6,630	15.93	105,615.90	
HUSKY ENERGY INC	10,659	26.68	284,382.12	
IMPERIAL OIL LTD	10,162	43.95	446,619.90	
MEG ENERGY CORP	4,510	37.41	168,719.10	
NEXEN INC	18,090	23.70	428,733.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	24.32	228,364.80	
PEMBINA PIPELINE CORP	10,105	27.43	277,180.15	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	6.08	77,702.40	
PENN WEST PETROLEUM LTD	15,493	13.13	203,423.09	
PRECISION DRILLING CORP	8,865	7.48	66,310.20	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	6,275	18.73	117,530.75	
SUNCOR ENERGY INC	52,225	33.14	1,730,736.50	
TALISMAN ENERGY INC	35,392	12.20	431,782.40	

TOURMALINE OIL CORP	4,005	33.20	132,966.00	
TRANSCANADA CORP	24,303	44.10	1,071,762.30	
VERMILION ENERGY INC	3,000	47.52	142,560.00	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	55.97	356,808.75	
AGRIUM INC	5,415	105.24	569,874.60	
BARRICK GOLD CORP	33,444	39.25	1,312,677.00	
CENTERRA GOLD INC	6,530	10.53	68,760.90	
ELDORADO GOLD CORP	20,510	14.04	287,960.40	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	22.55	399,586.00	

[次へ](#)

FRANCO-NEVADA CORP	4,495	56.44	253,697.80
GOLDCORP INC	27,357	43.60	1,192,765.20
IAMGOLD CORP	14,165	15.22	215,591.30
INMET MINING CORPORATION	2,100	51.79	108,759.00
KINROSS GOLD CORP	34,515	9.69	334,450.35
NEW GOLD INC	16,160	11.73	189,556.80
OSISKO MINING CORP	13,590	9.33	126,794.70
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	21.04	86,579.60
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	28,707	40.17	1,153,160.19
SILVER WHEATON CORP	12,035	38.76	466,476.60
TECK RESOURCES LTD-CLS B	18,085	31.73	573,837.05
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	7.89	105,875.91
YAMANA GOLD INC	24,996	18.71	467,675.16
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	3.73	197,003.68
CAE INC	10,675	10.58	112,941.50
FINNING INTERNATIONAL INC	6,675	23.10	154,192.50
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	38.78	221,627.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,295	21.01	69,227.95
CANADIAN NATL RAILWAY CO	14,934	86.45	1,291,044.30
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,285	91.97	486,061.45
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,039	43.33	304,999.87
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	33.63	131,829.60
TIM HORTONS INC	4,585	49.49	226,911.65
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	20.85	277,409.25
THOMSON REUTERS CORP	13,504	28.20	380,812.80
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,970	71.56	212,533.20
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	48.91	229,877.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	56.96	56,960.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	34.06	131,096.94
METRO INC	3,090	57.55	177,829.50
SHOPPERS DRUG MART INC	7,155	40.80	291,924.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	63.01	117,954.72
SAPUTO INC	3,520	43.36	152,627.20
CATAMARAN CORP	6,760	48.61	328,603.60
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,134	54.91	556,457.94
BANK OF MONTREAL	21,511	59.55	1,280,980.05
BANK OF NOVA SCOTIA	36,869	53.69	1,979,496.61
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	13,425	78.02	1,047,418.50
NATIONAL BANK OF CANADA	5,470	76.45	418,181.50
ROYAL BANK OF CANADA	48,289	56.91	2,748,126.99
TORONTO-DOMINION BANK	30,450	81.25	2,474,062.50
CI FINANCIAL CORP	5,690	23.25	132,292.50
IGM FINANCIAL INC	4,295	38.59	165,744.05
ONEX CORPORATION	3,845	40.06	154,030.70
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	662	369.77	244,787.74
GREAT-WEST LIFECO INC	9,334	22.76	212,441.84
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	26.85	77,999.25
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	60.47	243,391.75
MANULIFE FINANCIAL CORP	62,111	12.39	769,555.29
POWER CORP OF CANADA	10,160	24.08	244,652.80
POWER FINANCIAL CORP	7,645	25.40	194,183.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	18,214	24.95	454,439.30
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	19,852	33.85	671,990.20
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	15.35	132,992.40

CGI GROUP INC - CL A	8,920	26.02	232,098.40
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	52.12	117,530.60
RESEARCH IN MOTION	16,878	7.66	129,285.48
BCE INC	8,930	42.78	382,025.40
BELL ALIANT INC	2,800	26.97	75,516.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,665	43.46	593,880.90
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	61.83	347,979.24
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,205	65.82	145,133.10
FORTIS INC	7,035	33.40	234,969.00
TRANSALTA CORP	7,950	15.22	120,999.00
加ドル小計	1,292,949		41,470,303.14 (3,346,653,463)
豪ドル			
CALTEX AUSTRALIA LTD	4,575	16.63	76,082.25
ORIGIN ENERGY LTD	36,640	11.39	417,329.60
SANTOS LTD	33,605	11.66	391,834.30
WHITEHAVEN COAL LTD	15,000	3.20	48,000.00
WOODSIDE PETROLEUM LTD	22,318	34.84	777,559.12
WORLEYPARSONS LTD	7,260	24.39	177,071.40
ALUMINA LTD	94,332	0.93	88,200.42
AMCOR LIMITED	44,030	7.78	342,553.40
BHP BILLITON LTD	108,206	34.37	3,719,040.22
BORAL LTD	28,545	3.65	104,189.25
FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	4.15	192,041.25
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	9.99	151,698.15
INCITEC PIVOT LTD	53,090	3.24	172,011.60
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	13,935	9.25	128,898.75
LYNAS CORP LTD	61,300	0.69	42,297.00
NEWCREST MINING LTD	25,149	26.01	654,125.49
ORICA LIMITED	10,785	25.35	273,399.75
OZ MINERALS LTD	10,381	8.30	86,162.30
RIO TINTO LTD	15,088	57.50	867,560.00
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	9.29	60,338.55
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	18.43	108,128.81
ALS LTD	12,700	9.80	124,460.00
BRAMBLES LTD	53,968	7.14	385,331.52
ASCIANO LTD	36,333	4.53	164,588.49
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.34	46,059.52
QR NATIONAL LTD	59,950	3.72	223,014.00
SYDNEY AIRPORT	9,550	3.27	31,228.50
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	4.27	105,661.15
TRANSURBAN GROUP	47,535	6.05	287,586.75
CROWN LTD	10,705	9.46	101,269.30
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	28,772	3.65	105,017.80
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.86	68,574.22
TATTS GROUP LTD	42,460	2.79	118,463.40
FAIRFAX MEDIA LTD	69,685	0.40	27,874.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	1.99	31,521.60
METCASH LTD	31,790	3.69	117,305.10
WESFARMERS LTD	33,640	34.57	1,162,934.80
WOOLWORTHS LTD	41,032	29.15	1,196,082.80
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	13.62	280,980.60
COCHLEAR LTD	2,157	71.57	154,376.49
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	23.43	114,689.85
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	13.07	192,913.20

CSL LTD	16,662	46.87	780,947.94	
AUST AND NZ BANKING GROUP	89,839	25.38	2,280,113.82	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	8.06	126,606.48	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	53,427	57.30	3,061,367.10	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	75,013	26.00	1,950,338.00	
WESTPAC BANKING CORP	102,461	25.26	2,588,164.86	
ASX LTD	6,590	29.80	196,382.00	
MACQUARIE GROUP LTD	11,946	29.81	356,110.26	
AMP LTD	96,747	4.69	453,743.43	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	73,478	4.59	337,264.02	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,780	13.50	550,530.00	
SUNCORP GROUP LTD	46,700	9.66	451,122.00	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	8.70	156,252.00	
TELSTRA CORPORATION LTD	153,644	4.07	625,331.08	
AGL ENERGY LTD	16,671	14.49	241,562.79	
豪ドル小計	2,095,056		28,074,290.48 (2,332,692,795)	
英ポンド				
AMEC PLC	8,850	10.34	91,509.00	
BG GROUP PLC	113,854	13.07	1,488,071.78	
BP PLC	637,768	4.31	2,749,417.84	
PETROFAC LTD	9,765	15.63	152,626.95	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	122,938	20.88	2,567,560.13	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	88,724	21.65	1,920,874.60	
TULLOW OIL PLC	31,580	13.92	439,593.60	
ANGLO AMERICAN PLC	46,094	18.57	856,196.05	
ANTOFAGASTA PLC	11,360	12.68	144,044.80	
BHP BILLITON PLC	70,761	19.95	1,411,681.95	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	22.90	89,310.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	3.33	34,240.18	
FRESNILLO PLC	6,750	19.30	130,275.00	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	118,495	3.43	406,556.34	
JOHNSON MATTHEY PLC	6,847	22.53	154,262.91	
KAZAKHMYS PLC-	7,325	7.36	53,912.00	
LONMIN PLC	5,310	4.98	26,449.11	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,050	74.25	226,462.50	
REXAM PLC	32,225	4.49	144,786.92	
RIO TINTO PLC	44,905	31.00	1,392,055.00	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	11.36	43,281.60	
XSTRATA PLC	68,200	9.68	660,585.20	
BAE SYSTEMS PLC ORD	108,535	3.10	336,567.03	
BALFOUR BEATTY PLC	18,710	3.13	58,562.30	
BUNZL PLC	10,376	10.21	105,938.96	
COBHAM PLC	34,695	2.16	75,253.45	
IMI PLC	9,210	9.18	84,593.85	
INVENSYS PLC	27,080	2.23	60,632.12	
MEGGITT PLC	29,235	3.86	113,110.21	
MELROSE PLC	40,000	2.37	95,080.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	65,155	8.56	558,052.57	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C(N)	4,951,780	0.00	4,951.78	
SMITHS GROUP PLC	14,563	10.35	150,727.05	
WEIR GROUP PLC/THE	6,800	16.88	114,784.00	
WOLSELEY PLC	9,330	27.00	251,910.00	
AGGREKO PLC	10,021	20.89	209,338.69	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	9.53	93,204.62	

CAPITA PLC	23,289	7.28	169,660.36
EXPERIAN PLC	34,088	10.76	366,786.88
G4S PLC	55,329	2.61	144,795.99
INTERTEK GROUP PLC	5,975	28.30	169,092.50
SERCO GROUP PLC	19,895	5.70	113,500.97
GKN PLC	58,715	2.04	119,954.74
BURBERRY GROUP PLC	13,234	11.34	150,073.56
CARNIVAL PLC	6,710	25.05	168,085.50
COMPASS GROUP PLC	63,908	6.84	437,450.26
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,369	15.47	129,468.43
TUI TRAVEL PLC	14,295	2.52	36,109.17
WHITBREAD PLC	6,950	23.09	160,475.50
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	36,214	7.20	260,740.80
ITV PLC	147,795	0.86	128,212.16
PEARSON PLC	27,619	12.12	334,742.28
REED ELSEVIER PLC	39,836	6.00	239,016.00
WPP PLC	39,544	7.89	312,199.88
KINGFISHER PLC	77,657	2.83	220,235.25
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.92	228,202.20
NEXT PLC	5,867	36.18	212,268.06
SAINSBURY (J) PLC	44,131	3.53	156,003.08
TESCO PLC	267,344	3.14	841,866.25
WM MORRISON SUPERMARKETS	79,475	2.70	214,741.45
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	13.75	183,768.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	66,437	31.56	2,096,751.72
DIAGEO PLC	84,542	17.74	1,499,775.08
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	33,272	23.30	775,237.60
SABMILLER PLC	32,321	26.40	853,436.00
TATE & LYLE PLC	17,580	7.24	127,279.20
UNILEVER PLC	43,547	23.10	1,005,935.70
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	21,745	37.45	814,350.25
SMITH & NEPHEW PLC	26,646	6.51	173,465.46
ASTRAZENECA PLC	42,323	28.96	1,225,885.69
GLAXOSMITHKLINE PLC	168,611	14.06	2,371,513.71
SHIRE PLC	19,855	17.69	351,234.95
BARCLAYS PLC	388,181	2.32	903,879.45
HSBC HOLDINGS PLC	608,831	6.14	3,738,222.34
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,422,976	0.40	579,008.93
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	68,120	2.78	189,577.96
STANDARD CHARTERED PLC	80,109	15.05	1,206,040.99
3I GROUP PLC	39,379	2.20	86,988.21
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	3.22	73,213.33
ICAP PLC	18,640	3.20	59,759.84
INVESTEC PLC	13,185	3.69	48,665.83
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	9.78	39,785.04
MAN GROUP PLC	68,256	0.80	54,638.92
SCHRODERS PLC	4,181	15.43	64,512.83
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	11.04	76,893.60
AVIVA PLC	98,450	3.33	328,035.40
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	198,871	1.34	267,481.49
OLD MUTUAL PLC	166,919	1.72	288,102.19
PRUDENTIAL PLC	84,792	8.53	723,275.76
RESOLUTION LTD	51,593	2.10	108,654.85
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.12	138,934.26

STANDARD LIFE PLC	87,275	2.88	251,526.55	
SAGE GROUP PLC/THE	43,845	3.04	133,508.02	
BT GROUP PLC	260,702	2.17	566,244.74	
INMARSAT PLC	16,910	5.62	95,034.20	
VODAFONE GROUP PLC	1,662,495	1.70	2,837,047.71	
CENTRICA PLC	176,265	3.23	569,864.74	
NATIONAL GRID PLC	120,865	7.00	846,659.32	
SEVERN TRENT PLC	8,803	16.55	145,689.65	
SSE PLC	30,057	14.33	430,716.81	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	21,925	7.19	157,750.37	
ARM HOLDINGS PLC	42,150	6.65	280,297.50	
英ボンド小計	14,443,874		49,578,786.30 (6,416,486,522)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	43.33	519,743.35	
GIVAUDAN-REG	258	924.00	238,392.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	7,573	63.65	482,021.45	
SIKA AG-BR	85	1,878.00	159,630.00	
SYNGENTA AG-REG	3,161	353.90	1,118,677.90	
ABB LTD-REG	73,515	17.36	1,276,220.40	
GEBERIT AG-REG	1,255	203.40	255,267.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	119.00	92,820.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	120.60	229,140.00	
SULZER AG-REG	870	132.30	115,101.00	
ADECCO SA-REG	4,757	47.82	227,479.74	
SGS SA-REG	201	2,009.00	403,809.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	108.90	219,978.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	17,849	59.05	1,053,983.45	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,065	379.30	403,954.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	65.70	99,864.00	
ARYZTA AG	2,630	46.00	120,980.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	2,912.00	72,800.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	33,955.00	135,820.00	
NESTLE SA-REG	111,283	59.95	6,671,415.85	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	95.20	184,688.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	109.50	23,104.50	
ACTELION LTD-REG	3,860	45.02	173,777.20	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	46.13	76,114.50	
NOVARTIS AG-REG	77,463	56.80	4,399,898.40	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	23,678	180.80	4,280,982.40	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	39,495	21.35	843,218.25	
GAM HOLDING LTD	5,635	12.70	71,564.50	
JULIUS BAER GROUP LTD	6,780	31.77	215,400.60	
PARGESA HOLDING SA-BR	975	63.60	62,010.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	195.00	97,500.00	
UBS AG-REG	121,782	12.35	1,504,007.70	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	77.45	107,655.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	119.10	101,235.00	
SWISS RE LTD	11,589	65.60	760,238.40	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,921	232.30	1,143,148.30	
SWISS PRIME SITE-REG	1,370	76.65	105,010.50	
SWISSCOM AG-REG	744	382.70	284,728.80	
スイスフラン小計	547,579		28,331,380.19 (2,432,532,303)	
香港ドル				



HOPEWELL HOLDINGS	22,500	29.50	663,750.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	74,823	77.90	5,828,711.70	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	11.96	580,060.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	13.92	515,040.00	
MTR CORP	54,500	30.10	1,640,450.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	47.25	283,500.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	27.25	667,625.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	25.95	1,167,750.00	
SANDS CHINA LTD	78,600	29.65	2,330,490.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	15.74	755,520.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	17.56	1,000,920.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	22.20	1,292,040.00	
LI & FUNG LTD	210,000	12.88	2,704,800.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	15,500	16.86	261,330.00	
BANK OF EAST ASIA	50,640	29.10	1,473,624.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	128,500	24.45	3,141,825.00	
HANG SENG BANK LTD	23,500	119.90	2,817,650.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	80.45	603,375.00	
FIRST PACIFIC CO	80,000	8.74	699,200.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34,900	128.40	4,481,160.00	
AIA GROUP LTD	342,800	31.10	10,661,080.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	47,682	119.40	5,693,230.80	
HANG LUNG GROUP LTD	33,000	45.80	1,511,400.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	77,000	27.10	2,086,700.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	27,426	57.15	1,567,395.90	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	34.50	759,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	39.95	1,116,602.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	131,000	13.10	1,716,100.00	
SINO LAND CO	105,050	14.86	1,561,043.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,480	113.00	5,817,240.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,017	94.55	2,270,807.35	
WHARF HOLDINGS LTD	47,800	53.70	2,566,860.00	
WHEELOK & CO LTD	34,000	35.40	1,203,600.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	2.70	205,200.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	46.40	696,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	63,500	66.20	4,203,700.00	
HONG KONG & CHINA GAS	181,671	20.50	3,724,255.50	
POWER ASSETS HOLDINGS	45,500	65.75	2,991,625.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	86.65	563,225.00	
香港ドル小計	2,464,539		83,823,885.75 (868,415,456)	
シンガポールドル				
FRASER AND NEAVE LTD	31,800	9.23	293,514.00	
KEPPEL CORP LTD	49,660	11.10	551,226.00	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.33	188,665.82	
SEMCORP INDUSTRIES LTD	32,000	5.51	176,320.00	
SEMCORP MARINE LTD	27,000	4.85	130,950.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	3.52	225,280.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	71,000	0.93	66,030.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.66	127,820.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.17	35,100.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	10.68	222,144.00	
GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.32	293,040.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	4.08	224,604.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	50.15	200,600.00	

OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	1.96	92,355.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.64	140,800.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	3.15	233,100.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	60,625	14.02	849,962.50	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	86,240	9.18	791,683.20	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	42,700	18.58	793,366.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,000	6.79	190,120.00	
CAPITALAND LTD	71,000	3.33	236,430.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.80	90,250.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	11.41	228,200.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	2.55	153,000.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	3.43	102,900.00	
UOL GROUP LTD	12,250	5.75	70,437.50	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	276,810	3.20	885,792.00	
シンガポールドル小計	1,904,789		7,593,690.02 (499,285,118)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	7.21	168,641.90	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	30,950	2.69	83,255.50	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.92	78,360.80	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.47	180,055.59	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.49	51,770.70	
ニュージーランドドル小計	156,657		562,084.49 (36,968,296)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	8,370	154.90	1,296,513.00	
BOLIDEN AB	7,620	116.00	883,920.00	
HOLMEN AB-B SHS	1,885	191.10	360,223.50	
SSAB AB-A SHARES	6,295	46.68	293,850.60	
ALFA LAVAL AB	12,110	113.70	1,376,907.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	219.50	2,561,565.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	22,945	160.00	3,671,200.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	11,280	142.80	1,610,784.00	
SANDVIK AB	34,950	90.75	3,171,712.50	
SCANIA AB-B SHS	12,030	125.40	1,508,562.00	
SKANSKA AB-B SHS	10,520	101.40	1,066,728.00	
SKF AB-B SHS	12,949	148.40	1,921,631.60	
VOLVO AB-B SHARES	44,630	87.05	3,885,041.50	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	48.33	589,577.67	
ELECTROLUX AB - B	8,875	171.10	1,518,512.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	34.34	488,314.80	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,325	199.90	264,867.50	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	32,298	226.90	7,328,416.20	
SWEDISH MATCH AB	6,530	261.70	1,708,901.00	
SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	17,395	130.60	2,271,787.00	
ELEKTA AB-B SHS	10,440	91.75	957,870.00	
GETINGE AB-B SHS	7,610	203.00	1,544,830.00	
NORDEA BANK AB	85,988	60.40	5,193,675.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,630	54.60	2,436,798.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,760	231.00	3,871,560.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	28,180	123.30	3,474,594.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	93.45	410,245.50	
INVESTOR AB-B SHS	14,365	146.40	2,103,036.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	126.30	848,104.50	
RATOS AB-B SHS	7,000	55.80	390,600.00	

ERICSSON LM-B SHS	104,455	60.50	6,319,527.50	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	145.60	1,306,032.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,160	578.50	1,249,560.00	
TELE2 AB-B SHS	8,705	111.50	970,607.50	
TELIASONERA AB	73,750	44.17	3,257,537.50	
スウェーデンクローナ小計	714,214		72,113,593.07 (862,478,573)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	113.20	769,760.00	
SEADRILL LTD	11,325	232.50	2,633,062.50	
STATOIL ASA	38,634	142.60	5,509,208.40	
SUBSEA 7 SA	10,615	126.00	1,337,490.00	
NORSK HYDRO A S	34,250	25.62	877,485.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,300	272.10	1,714,230.00	
ORKLA ASA	28,690	45.41	1,302,812.90	
DNB ASA	31,955	72.40	2,313,542.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	84.00	609,000.00	
TELENOR ASA	23,945	111.40	2,667,473.00	
ノルウェークローネ小計	199,764		19,734,063.80 (274,303,486)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,275	159.90	1,323,172.50	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	38,000.00	874,000.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	43	40,160.00	1,726,880.00	
DSV A/S	7,370	128.00	943,360.00	
CARLSBERG AS-B	3,930	510.00	2,004,300.00	
COLOPLAST-B	881	1,256.00	1,106,536.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	517.00	517,000.00	
NOVO NORDISK A/S-B	13,705	961.50	13,177,357.50	
DANSKE BANK A/S	23,595	103.70	2,446,801.50	
TRYG A/S	615	378.40	232,716.00	
TDC A/S	14,545	40.03	582,236.35	
デンマーククローネ小計	73,982		24,934,359.85 (347,086,289)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	15,760	46.62	734,731.20	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	2,470.00	192,660.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	31,520	158.10	4,983,312.00	
BANK HAPAOALIM BM	27,725	15.75	436,668.75	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	50,135	12.42	622,676.70	
NICE SYSTEMS LTD	2,325	121.20	281,790.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,880	4.64	319,603.20	
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	1,400	286.00	400,400.00	
イスラエルシュケル小計	197,823		7,971,841.85 (165,335,999)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	4,720	24.65	116,371.60	
ENI SPA	84,316	17.37	1,464,568.92	
FUGRO NV-CVA	2,640	51.08	134,851.20	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	12.56	116,996.40	
NESTE OIL OYJ	3,590	9.91	35,576.90	
OMV AG	4,890	27.30	133,497.00	
REPSOL SA	28,101	15.01	421,796.01	
SAIPEM SPA	8,980	34.29	307,924.20	
SBM OFFSHORE NV	6,700	10.15	68,005.00	

TECHNIP SA	3,008	88.70	266,809.60
TENARIS SA	15,515	14.70	228,070.50
TOTAL SA	71,407	38.43	2,744,171.01
ACERINOX SA	3,087	8.07	24,924.43
AIR LIQUIDE	10,516	91.12	958,217.92
AKZO NOBEL NV	7,208	41.40	298,447.24
ARCELORMITTAL	30,061	11.90	357,725.90
ARKEMA	2,005	71.12	142,595.60
BASF SE	30,995	63.18	1,958,264.10
CRH PLC	24,440	13.82	337,760.80
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	40.87	206,623.12
IMERYS SA	910	46.07	41,928.25
K+S AG	5,420	35.56	192,762.30
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	39.00	221,598.00
LAFARGE SA	6,368	45.17	287,674.40
LANXESS AG	2,765	62.33	172,342.45
LINDE AG	6,035	128.75	777,006.25
SALZGITTER AG	1,005	33.80	33,974.02
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	91.62	199,823.22
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.81	98,085.25
THYSSENKRUPP AG	13,275	17.67	234,569.25
UMICORE	3,460	39.40	136,341.30
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	8.11	151,235.28
VOESTALPINE AG	4,239	23.85	101,100.15
WACKER CHEMIE AG	580	42.59	24,702.20
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	16.50	84,909.00
ALSTOM	7,390	26.41	195,169.90
ANDRITZ AG	1,980	45.26	89,624.70
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	29.08	83,023.40
BOUYGUES SA	6,820	18.89	128,829.80
BRENNTAG AG	1,125	95.74	107,707.50
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	13,616	26.80	364,908.80
EADS NV	14,968	26.74	400,319.16
FERROVIAL SA	13,715	10.84	148,670.60
FIAT INDUSTRIAL	28,270	7.96	225,029.20
FINMECCANICA SPA	14,290	3.93	56,188.28
GEA GROUP AG	6,740	24.19	163,040.60
HOCHTIEF AG	1,045	38.55	40,289.97
KONE OYJ-B	5,277	54.95	289,971.15
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	35,731	19.42	694,074.67
LEGRAND SA	7,428	29.88	221,985.78
MAN SE	1,554	77.28	120,093.12
METSO OYJ	4,900	26.56	130,144.00
PRYSMIAN SPA	5,635	14.60	82,271.00
SAFRAN SA	6,190	30.40	188,206.95
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,018	47.94	863,782.92
SIEMENS AG-REG	27,756	76.56	2,124,999.36
THALES SA	3,505	27.68	97,018.40
VALLOUREC	3,345	32.59	109,013.55
VINCI SA	15,550	33.84	526,289.75
WARTSILA OYJ	6,100	30.12	183,732.00
ZARDOYA OTIS SA	5,219	9.37	48,902.03
ZODIAC AEROSPACE	910	77.41	70,443.10
BUREAU VERITAS SA	1,770	83.98	148,644.60

EDENRED	6,096	22.74	138,653.52	
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	26.55	116,952.75	
SOCIETE BIC SA	735	91.96	67,590.60	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,551	11.73	170,683.23	
ADP	1,210	59.60	72,116.00	
ATLANTIA SPA	12,070	12.50	150,875.00	
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	10.74	84,563.15	
DEUTSCHE POST AG	28,343	15.90	450,795.41	
FRAPORT AG	980	44.78	43,884.40	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	5.96	104,531.39	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	1.99	63,126.78	
RYANAIR HOLDINGS PLC	2,835	4.53	12,853.89	

[次へ](#)

TNT EXPRESS NV	13,270	8.37	111,149.52
VOPAK	2,440	53.95	131,638.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	10,605	60.34	639,905.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,090	42.39	88,605.55
CONTINENTAL AG	2,915	76.86	224,046.90
DAIMLER AG	30,332	36.79	1,115,914.28
FIAT SPA	26,775	4.15	111,223.35
MICHELIN (CGDE)-B	6,179	64.36	397,680.44
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	29.60	125,652.00
PEUGEOT SA	8,372	5.36	44,940.89
PIRELLI & C.	9,236	8.47	78,228.92
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	4,500	49.00	220,522.50
RENAULT SA	6,797	35.37	240,443.87
VOLKSWAGEN AG	771	143.85	110,908.35
VOLKSWAGEN AG-PFD	4,983	153.70	765,887.10
ADIDAS AG	7,141	65.09	464,807.69
CHRISTIAN DIOR	2,000	105.45	210,900.00
HUGO BOSS AG -ORD	900	71.06	63,954.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	28.52	113,395.52
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	8,499	122.40	1,040,277.60
ACCOR SA	5,606	23.65	132,581.90
AUTOGRILL SPA	3,115	7.98	24,857.70
SODEXO	3,470	60.00	208,200.00
AXEL SPRINGER AG	995	32.34	32,178.30
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	24.33	92,351.32
JC DECAUX SA .	2,520	16.24	40,937.40
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	55.87	172,079.60
LAGARDERE S.C.A.	2,980	20.79	61,969.10
MEDIASET SPA	25,926	1.38	35,803.80
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	20.59	58,784.45
PUBLICIS GROUPE	4,725	40.89	193,228.87
REED ELSEVIER NV	20,248	10.30	208,554.40
SES	11,190	20.97	234,654.30
WOLTERS KLUWER	11,107	14.68	163,106.29
INDITEX	7,655	96.93	741,999.15
PPR	2,667	130.90	349,110.30
CARREFOUR SA	18,903	17.84	337,324.03
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	67.63	135,530.52
COLRUYT SA	2,725	34.43	93,821.75
DELHAIZE GROUP	3,666	28.76	105,452.49
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	4.68	106,179.84
JERONIMO MARTINS	7,685	13.69	105,207.65
KESKO OYJ-B SHS	2,230	23.60	52,628.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	34,854	9.56	333,343.65
METRO AG	4,940	21.38	105,617.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	27,131	65.82	1,785,762.42
DANONE	19,344	46.62	901,914.00
DE MASTER BLENDERS1753 NVW/I	20,968	9.31	195,212.08
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	39.01	101,230.95
HEINEKEN NV	8,333	47.68	397,359.10
KERRY GROUP PLC-A	5,390	40.60	218,834.00
PERNOD-RICARD SA	7,036	83.77	589,405.72
REMY COINTREAU	780	79.30	61,854.00
SUEDZUCKER AG	2,400	29.63	71,112.00

UNILEVER NV-CVA	55,055	28.44	1,566,039.47
BEIERSDORF AG	3,745	56.50	211,592.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,790	50.80	243,332.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,873	62.52	367,179.96
L'OREAL	8,366	96.80	809,828.80
CELESIO AG	2,150	15.02	32,303.75
ESSILOR INTERNATIONAL	6,685	69.30	463,270.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,383	57.66	425,703.78
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,985	92.22	367,496.70
BAYER AG	27,910	66.69	1,861,317.90
ELAN CORP PLC	18,000	8.44	152,028.00
GRIFOLS SA	5,290	26.13	138,254.15
MERCK KGAA	2,405	98.47	236,820.35
ORION OYJ-CLASS B	2,590	18.54	48,018.60
QIAGEN N.V.	7,635	13.60	103,836.00
SANOFI	40,216	67.04	2,696,080.64
UCB SA	3,708	44.31	164,320.02
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.22	35,175.54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	177,163	6.25	1,107,445.91
BANCO DE SABADELL SA	69,154	1.90	131,392.60
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	0.76	16,239.36
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	1.27	80,149.62
BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	1.25	46,018.03
BANCO SANTANDER SA	328,137	5.74	1,885,147.06
BNP PARIBAS	32,322	39.62	1,280,759.25
CAIXABANK	26,440	2.91	77,072.60
COMMERZBANK AG	134,443	1.49	200,588.95
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	6.00	223,549.25
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	18.23	129,796.73
INTESA SANPAOLO	339,823	1.26	430,555.74
INTESA SANPAOLO-RSP	31,990	1.06	34,005.37
KBC GROEP NV	6,119	18.18	111,243.42
NATIXIS	32,490	2.58	84,051.63
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	29.71	43,673.70
SOCIETE GENERALE	23,749	24.88	590,993.86
UBI BANCA SCPA	28,684	3.10	89,149.87
UNICREDIT SPA	139,803	3.50	489,869.71
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	31,385	33.40	1,048,259.00
DEUTSCHE BOERSE AG	5,790	41.69	241,385.10
EURAZEO	1,104	36.63	40,439.52
EXOR SPA	1,714	20.64	35,376.96
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	57.06	166,158.72
ING GROEP NV-CVA	128,115	6.76	866,057.40
MEDIOBANCA SPA	19,150	4.52	86,634.60
POHJOLA BANK PLC	3,875	10.60	41,075.00
WENDEL	1,190	67.77	80,646.30
AEGON NV	56,759	4.21	239,466.22
AGEAS	8,414	19.51	164,157.14
ALLIANZ SE-REG	15,378	93.57	1,438,919.46
ASSICURAZIONI GENERALI	40,128	12.05	483,542.40
AXA	60,722	12.18	739,897.57
CNP ASSURANCES	6,070	10.97	66,587.90
DELTA LLOYD NV	3,600	12.78	46,026.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	55.14	135,368.70

MAPFRE SA	26,034	2.16	56,363.61
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,786	124.95	722,960.70
SAMPO OYJ-A SHS	13,759	24.30	334,343.70
SCOR SE	6,822	20.57	140,328.54
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	33.00	46,530.00
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	25,580	2.95	75,640.06
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	18.45	185,607.00
ATOS	1,650	50.75	83,737.50
CAP GEMINI SA	5,469	31.49	172,218.81
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	83.37	193,001.55
SAP AG-COMMON	31,092	55.00	1,710,060.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,570	15.42	55,067.25
ALCATEL-LUCENT	91,534	0.80	74,051.00
GEMALTO	2,370	69.00	163,530.00
NOKIA OYJ	137,696	2.02	279,247.48
BELGACOM SA	5,820	21.47	124,955.40
DEUTSCHE TELEKOM AG	96,086	8.71	837,389.49
ELISA OYJ	4,205	16.50	69,382.50
FRANCE TELECOM SA	62,204	8.83	549,447.93
ILIAD SA	815	117.75	95,966.25
KONINKLIJKE KPN NV	35,906	5.11	183,551.47
MOBISTAR SA	689	20.25	13,955.69
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	15,833	3.88	61,511.20
TELECOM ITALIA SPA	277,303	0.70	196,607.82
TELECOM ITALIA-RSP	189,867	0.62	119,236.47
TELEFONICA SA	135,038	10.19	1,376,037.22
TELEKOM AUSTRIA AG	6,570	5.24	34,485.93
TELENET GROUP HOLDING NV	2,000	35.85	71,700.00
VIVENDI	41,370	15.78	652,818.60
ACCIONA SA	566	46.83	26,508.61
E.ON AG	60,359	17.55	1,059,300.45
ELECTRICITE DE FRANCE	8,795	16.63	146,260.85
ENAGAS	7,050	15.33	108,076.50
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.33	86,151.26
ENEL SPA	230,174	2.88	662,901.12
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	71,841	2.07	149,070.07
FORTUM OYJ	14,195	14.10	200,149.50
GAS NATURAL SDG SA	11,902	11.87	141,336.25
GDF SUEZ	43,064	17.47	752,328.08
IBERDROLA SA	129,702	3.97	515,565.45
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	37.10	150,255.00
RWE AG	16,705	34.67	579,162.35
RWE AG-NON VTG PFD	1,060	31.33	33,209.80
SNAM SPA	58,840	3.36	197,702.40
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	8.45	87,216.18
TERNA SPA	43,127	2.87	123,774.49
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	7.94	105,951.96
VERBUND AG	2,370	18.00	42,660.00
ASML HOLDING NV	14,652	42.00	615,384.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,545	5.22	196,059.99
STMICROELECTRONICS NV	23,623	4.70	111,075.34
ユ-一口小計	5,724,850		74,872,649.77 (7,777,022,131)



合計	40,265,106	60,333,037,109 (60,333,037,109)
----	------------	------------------------------------

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	11,760	379,848.00	
		AMERICAN TOWER CORP	13,629	999,278.28	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	32,570	517,537.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	465,372.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,687	503,149.45	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	142,296.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	239,488.20	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	98,862.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	10,300	581,126.00	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,475	263,117.25	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	13,915	266,611.40	
		HCP INC	13,295	588,835.55	
		HEALTH CARE REIT INC	8,730	512,887.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,749	325,147.55	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	301,743.90	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	110,449.24	
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	200,157.48	
		PROLOGIS INC	15,622	535,522.16	
		PUBLIC STORAGE	5,149	706,288.33	
		RAYONIER INC	3,507	169,142.61	
		REALTY INCOME CORP	3,700	148,666.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	134,079.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	10,284	1,557,614.64	
		SL GREEN REALTY CORP	2,650	201,426.50	
		THE MACERICH COMPANY	4,370	248,653.00	
		UDR INC	7,800	190,086.00	
VENTAS INC	10,295	648,790.90			
VORNADO REALTY TRUST	5,821	465,680.00			
WEYERHAEUSER CO	18,296	499,480.80			
	投資証券小計		262,610	12,001,337.54 (963,227,350)	
米ドル合計				12,001,337.54 (963,227,350)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	142,800.00	
	投資証券小計		5,250	142,800.00 (11,523,960)	
加ドル合計				142,800.00 (11,523,960)	

豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	98,430.85		
		CENTRO RETAIL AUSTRALIA	45,000	95,400.00		
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	67,010	133,684.95		
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	165,342.05		
		GOODMAN GROUP	54,772	234,424.16		
		GPT GROUP	47,615	169,985.55		
		LEND LEASE GROUP	17,037	147,370.05		
		MIRVAC GROUP	108,455	167,562.97		
		STOCKLAND	75,690	267,942.60		
		WESTFIELD GROUP	75,865	802,651.70		
		WESTFIELD RETAIL TRUST	86,505	270,760.65		
	投資証券小計	761,459	2,553,555.53	(212,174,928)		
豪ドル合計				2,553,555.53	(212,174,928)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	32,561	172,247.69		
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	19,860	66,292.68		
		HAMMERSON PLC	24,955	117,862.46		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	232,989.78		
		SEGRO PLC	20,223	47,706.05		
	投資証券小計	126,488	637,098.66	(82,453,308)		
英ポンド合計				637,098.66	(82,453,308)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	74,500	2,786,300.00		
	投資証券小計		74,500	2,786,300.00	(28,866,068)	
香港ドル合計				2,786,300.00	(28,866,068)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,000	153,140.00		
		CAPITAMALL TRUST	71,800	156,524.00		
	投資証券小計		133,800	309,664.00	(20,360,408)	
シンガポールドル合計				309,664.00	(20,360,408)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	68,771.16		
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	61,556.25		
		GECINA SA	740	62,441.20		
		ICADE	685	46,696.45		
		KLEPIERRE	3,895	112,234.42		
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,070	520,058.00		
	投資証券小計	11,393	871,757.48	(90,549,449)		
ユーロ合計				871,757.48	(90,549,449)	
合計				1,409,155,471	(1,409,155,471)	

(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 574銘柄	97.3%		56.8%
	投資証券 29銘柄		2.7%	1.6%

加ドル	株式	97銘柄	99.7%		5.4%
	投資証券	1銘柄		0.3%	0.0%
豪ドル	株式	57銘柄	91.7%		3.8%
	投資証券	11銘柄		8.3%	0.3%
英ポンド	株式	102銘柄	98.7%		10.4%
	投資証券	5銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.0%		3.9%
香港ドル	株式	39銘柄	96.8%		1.4%
	投資証券	1銘柄		3.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	27銘柄	96.1%		0.8%
	投資証券	2銘柄		3.9%	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	35銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%		0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%		0.6%
イスラエルシケル	株式	8銘柄	100.0%		0.3%
ユーロ	株式	236銘柄	98.8%		12.6%
	投資証券	6銘柄		1.2%	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23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		2,987,025	56,358,489
コール・ローン		41,328,897	22,210,993
株式		1,046,286,605	1,136,537,137
投資証券		18,959,889	25,347,234
派生商品評価勘定		16,288,542	28,808
未収入金		17,075,502	102,399
未収配当金		1,041,572	1,427,275
未収利息		77	42
差入委託証拠金		21,007,443	20,487,294
流動資産合計		1,164,975,552	1,262,499,671
資産合計		1,164,975,552	1,262,499,671
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,007,395	34,629,133
未払金		7	59,069
未払解約金		1,343,059	426,766
流動負債合計		4,350,461	35,114,968

負債合計	4,350,461	35,114,968
純資産の部		
元本等		
元本	1,537,000,695	1,423,095,784
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	376,375,604	195,711,081
元本等合計	1,160,625,091	1,227,384,703
純資産合計	1,160,625,091	1,227,384,703
負債純資産合計	1,164,975,552	1,262,499,671

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
1.	期首	平成22年10月27日	平成23年10月27日
	期首元本額	1,538,197,145円	1,537,000,695円
	期首からの追加設定元本額	272,831,118円	156,925,408円
	期首からの一部解約元本額	274,027,568円	270,830,319円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（DC専用）	64,752,515円	99,354,693円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	25,492,804円	21,263,305円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	23,400,681円	18,234,104円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	37,805,820円	29,459,396円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	48,704,085円	37,353,755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	196,735,372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	120,363,635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	48,411,996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	130,071,267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	165,886,923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	163,956,468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	392,004,870円
計	1,537,000,695円	1,423,095,784円	
2.	受益権の総数	1,537,000,695口	1,423,095,784口

3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	376,375,604円	195,711,081円
----	----------------------------------	--------------	--------------

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

[次へ](#)

## （金融商品に関する注記）

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24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

	平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

（平成23年10月26日現在）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

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

（平成24年10月26日現在）  
 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	115,743,397
投資証券	3,691,182
合計	119,434,579

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成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

（平成24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	75,761,733		74,417,674	1,344,059
	合計	75,761,733		74,417,674	1,344,059

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（平成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
	イスラエルシュケル	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

(平成24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	1,211,175,694		1,244,431,960	33,256,266
	米ドル	709,302,893		724,716,940	15,414,047
	加ドル	64,773,059		66,011,380	1,238,321
	豪ドル	49,792,447		51,198,920	1,406,473
	英ポンド	125,240,821		130,367,310	5,126,489
	スイスフラン	48,151,822		49,805,410	1,653,588
	香港ドル	16,888,492		17,294,570	406,078
	シンガポールドル	10,694,284		11,038,060	343,776
	スウェーデンクローナ	16,230,620		16,493,570	262,950
	ノルウェークローネ	5,651,325		5,748,430	97,105
	デンマーククローネ	6,987,239		7,269,880	282,641
	イスラエルシュケル	1,843,596		1,946,590	102,994
	ユーロ	155,619,096		162,540,900	6,921,804
	合計	1,211,175,694		1,244,431,960	33,256,266

(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23年10月26日現在		平成24年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.7551円	1口当たり純資産額	0.8625円
(1万口当たり純資産額)	(7,551円)	(1万口当たり純資産額)	(8,625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	323	66.55	21,495.65	

APACHE CORP	249	82.81	20,619.69
BAKER HUGHES INC	290	43.42	12,591.80
CAMERON INTERNATIONAL CORP	313	51.08	15,988.04
CHESAPEAKE ENERGY CORP	438	20.22	8,856.36
CHEVRON CORP	1,252	110.96	138,921.92
CONOCOPHILLIPS	764	57.16	43,670.24
CONSOL ENERGY INC	243	34.42	8,364.06
DEVON ENERGY CORPORATION	254	58.88	14,955.52
EOG RESOURCES INC	178	112.42	20,010.76
EQT CORP	195	60.72	11,840.40
EXXON MOBIL CORP	2,961	90.43	267,763.23
FMC TECHNOLOGIES INC	312	39.90	12,448.80
HALLIBURTON CO	589	32.92	19,389.88
HESS CORP	203	53.90	10,941.70
KINDER MORGAN INC	416	35.06	14,584.96
MARATHON OIL CORP	467	30.20	14,103.40
MARATHON PETROLEUM CORP	226	53.96	12,194.96
MURPHY OIL CORP	174	59.85	10,413.90
NABORS INDUSTRIES LTD	405	14.15	5,730.75
NATIONAL OILWELL VARCO INC	272	74.88	20,367.36
NOBLE CORP	245	38.59	9,454.55
NOBLE ENERGY INC	118	92.87	10,958.66
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	525	82.52	43,323.00
PEABODY ENERGY CORP	253	28.03	7,091.59
PHILLIPS 66	377	45.03	16,976.31
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	160	104.27	16,683.20
QEP RESOURCES INC	262	31.65	8,292.30
RANGE RESOURCES CORP	181	66.45	12,027.45
SCHLUMBERGER LTD	868	70.74	61,402.32
SOUTHWESTERN ENERGY CO	328	33.94	11,132.32
SPECTRA ENERGY CORP	432	29.12	12,579.84
ULTRA PETROLEUM CORP	208	22.61	4,702.88
VALERO ENERGY CORP	366	28.49	10,427.34
WEATHERFORD INTL LTD	710	11.75	8,342.50
WILLIAMS COS INC	618	34.71	21,450.78
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	216	77.73	16,789.68
ALCOA INC	1,100	8.73	9,603.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	156	38.20	5,959.20
DOW CHEMICAL	767	29.66	22,749.22
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	599	45.17	27,056.83
ECOLAB INC	192	69.20	13,286.40
FMC CORP	145	53.58	7,769.10
FREEPORT-MCMORAN COPPER	615	39.19	24,101.85
INTERNATIONAL PAPER CO	275	35.26	9,696.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	84	82.39	6,920.76
MONSANTO CO	347	86.49	30,012.03
MOSAIC CO/THE	216	53.25	11,502.00
NEWMONT MINING CORP	336	53.56	17,996.16
NUCOR CORP	393	40.23	15,810.39
PPG INDUSTRIES INC	171	116.02	19,839.42
PRAXAIR INC	196	104.78	20,536.88
SIGMA-ALDRICH	164	70.55	11,570.20
UNITED STATES STEEL CORP	205	21.41	4,389.05
VULCAN MATERIALS CO	174	46.89	8,158.86

3M CO	428	87.81	37,582.68
BOEING CO	458	71.54	32,765.32
CATERPILLAR INC	419	83.53	34,999.07
COOPER INDUSTRIES PLC	225	73.81	16,607.25
CUMMINS INC	121	94.05	11,380.05
DANAHER CORP	406	52.25	21,213.50
DEERE & CO	241	84.69	20,410.29
DOVER CORP	206	58.19	11,987.14
EATON CORP	212	45.42	9,629.04
EMERSON ELECTRIC CO	478	47.96	22,924.88
FASTENAL CO	357	43.05	15,368.85
FLUOR CORP	183	55.21	10,103.43
GENERAL DYNAMICS CORP	197	67.61	13,319.17
GENERAL ELECTRIC CO.	6,727	21.26	143,016.02
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	477	61.43	29,302.11
ILLINOIS TOOL WORKS	284	60.47	17,173.48
INGERSOLL-RAND PLC	272	46.39	12,618.08
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	237	38.88	9,214.56
JOY GLOBAL INC	127	59.74	7,586.98
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	94	73.79	6,936.26
LOCKHEED MARTIN CORP	183	93.55	17,119.65
NORTHROP GRUMMAN CORP	144	69.04	9,941.76
PACCAR INC	224	42.78	9,582.72
PARKER HANNIFIN CORP	153	77.58	11,869.74
PENTAIR LTD-REGISTERED	87	41.25	3,588.75
PRECISION CASTPARTS CORP	96	167.18	16,049.28
RAYTHEON COMPANY	230	55.74	12,820.20
ROCKWELL COLLINS INC.	158	53.31	8,422.98
ROPER INDUSTRIES INC	150	108.84	16,326.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	208	68.35	14,216.80
TEXTRON INC	317	25.51	8,086.67
UNITED TECHNOLOGIES CORP	557	77.29	43,050.53
XYLEM INC	293	23.71	6,947.03
ADT CORP/THE	183	41.16	7,532.28
EQUIFAX INC	284	49.42	14,035.28
IRON MOUNTAIN INC	258	33.68	8,689.44
ROBERT HALF INTL INC	303	27.07	8,202.21
TYCO INTERNATIONAL LTD	366	26.78	9,801.48
WASTE MANAGEMENT INC	291	32.69	9,512.79
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	59.10	9,160.50
CSX CORP	688	20.58	14,159.04
EXPEDITORS INTL WASH INC	230	35.78	8,229.40
FEDEX CORP	212	91.12	19,317.44
NORFOLK SOUTHERN CORP	216	62.57	13,515.12
UNION PACIFIC CORP	313	121.64	38,073.32
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	469	73.20	34,330.80
AUTOLIV INC	134	56.61	7,585.74
BORGWARNER INC	139	64.66	8,987.74
FORD MOTOR COMPANY	2,298	10.39	23,876.22
GENERAL MOTORS CORP	381	23.63	9,003.03
HARLEY-DAVIDSON INC	281	46.52	13,072.12
JOHNSON CONTROLS INC	450	26.16	11,772.00
COACH INC	190	56.81	10,793.90
MATTEL INC	416	37.06	15,416.96

NEWELL RUBBERMAID INC	396	20.09	7,955.64
NIKE INC -CL B	245	91.31	22,370.95
VF CORP	105	155.19	16,294.95
WHIRLPOOL CORP	73	94.88	6,926.24
CARNIVAL CORP	296	38.66	11,443.36
LAS VEGAS SANDS CORP	266	46.25	12,302.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	321	36.47	11,706.87
MCDONALD'S CORP	646	87.33	56,415.18
STARBUCKS CORP	484	46.25	22,385.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	229	51.66	11,830.14
YUM! BRANDS INC	294	70.19	20,635.86
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	402	33.28	13,378.56
COMCAST CORP-CLASS A	1,392	36.36	50,613.12
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	564	35.51	20,027.64
DIRECTV	418	51.32	21,451.76
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	66	54.60	3,603.60
DISH NETWORK CORP-A	298	35.77	10,659.46
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	298	54.91	16,363.18
NEWS CORP-CL A	1,119	24.09	26,956.71
OMNICOM GROUP	326	48.22	15,719.72
THE WALT DISNEY CO.	1,105	50.26	55,537.30
TIME WARNER CABLE	198	97.95	19,394.10
TIME WARNER INC	650	43.59	28,333.50
VIACOM INC-CLASS B	438	53.46	23,415.48
AMAZON.COM INC	236	227.55	53,701.80
AUTOZONE INC	41	367.78	15,078.98
BED BATH & BEYOND INC	154	58.37	8,988.98
BEST BUY CO INC	220	15.17	3,337.40
GAP INC/THE	403	35.17	14,173.51
GENUINE PARTS CO	189	60.88	11,506.32
HOME DEPOT INC	998	60.48	60,359.04
J.C. PENNEY CO INC	174	25.13	4,372.62
KOHL'S CORP	178	51.59	9,183.02
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	566	19.95	11,291.70
LIMITED INC/THE	296	48.27	14,287.92
LOWE'S COS INC	819	31.79	26,036.01
MACY'S INC	463	38.68	17,908.84
NORDSTROM INC	194	55.10	10,689.40
PRICELINE.COM INC	33	557.87	18,409.71
ROSS STORES INC	268	60.65	16,254.20
STAPLES INC	489	11.41	5,579.49
TARGET CORP	411	63.12	25,942.32
TIFFANY & CO	125	63.04	7,880.00
TJX COMPANIES INC	473	41.35	19,558.55
COSTCO WHOLESALE CORP	281	96.60	27,144.60
CVS CAREMARK CORP	843	46.11	38,870.73
KROGER CO	460	25.36	11,665.60
SAFEWAY INC	328	16.57	5,434.96
SYSCO CORP	388	30.84	11,965.92
WALGREEN CO	554	35.33	19,572.82
WAL-MART STORES INC	1,182	75.32	89,028.24
WHOLE FOODS MARKET INC	115	93.50	10,752.50
ALTRIA GROUP INC	1,332	32.10	42,757.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	484	26.99	13,063.16

BEAM INC	213	56.48	12,030.24
BUNGE LTD	139	70.18	9,755.02
COCA-COLA CO/THE	2,579	37.09	95,655.11
COCA-COLA ENTERPRISES	444	31.00	13,764.00
CONAGRA FOODS INC	463	28.32	13,112.16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	342	35.81	12,247.02
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	242	42.92	10,386.64
GENERAL MILLS INC	428	39.91	17,081.48
HJ HEINZ CO	212	57.36	12,160.32
KELLOGG CO	224	52.56	11,773.44
KRAFT FOODS GROUP INC	362	45.91	16,619.42
LORILLARD INC	86	115.04	9,893.44
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	135	63.53	8,576.55
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,087	26.47	28,772.89
MONSTER BEVERAGE CORP	223	47.09	10,501.07
PEPSICO INC	994	68.89	68,476.66
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,083	87.73	95,011.59
TYSON FOODS INC-CL A	392	16.37	6,417.04
AVON PRODUCTS	330	15.76	5,200.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	314	104.60	32,844.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	157	61.30	9,624.10
KIMBERLY-CLARK CORP	259	82.84	21,455.56
PROCTER & GAMBLE CO	1,740	70.07	121,921.80
AETNA INC	230	44.43	10,218.90
AMERISOURCEBERGEN CORP	267	39.76	10,615.92
BAXTER INTERNATIONAL INC	375	61.42	23,032.50
BECTON DICKINSON AND CO	134	75.29	10,088.86
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,188	5.12	6,082.56
CARDINAL HEALTH INC	229	40.89	9,363.81
CAREFUSION CORP	265	26.79	7,099.35
CIGNA CORP	191	50.37	9,620.67
COVIDIEN PLC	319	54.85	17,497.15
DAVITA INC	145	111.41	16,154.45
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	530	63.23	33,511.90
HUMANA INC	185	75.55	13,976.75
INTUITIVE SURGICAL INC	39	545.63	21,279.57
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	108	85.62	9,246.96
MCKESSON CORP	156	93.16	14,532.96
MEDTRONIC INC	685	41.88	28,687.80
QUEST DIAGNOSTICS	187	58.60	10,958.20
ST JUDE MEDICAL INC	263	38.27	10,065.01
STRYKER CORP	229	52.40	11,999.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	691	56.21	38,841.11
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	141	58.10	8,192.10
WELLPOINT INC	219	62.23	13,628.37

[次](#)

ZIMMER HOLDINGS INC	157	63.98	10,044.86
ABBOTT LABORATORIES	1,000	65.78	65,780.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	390	36.11	14,082.90
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	123	96.45	11,863.35
ALLERGAN INC	204	91.26	18,617.04
AMGEN INC	514	88.05	45,257.70
BIOGEN IDEC INC	145	144.43	20,942.35
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,098	33.73	37,035.54
CELGENE CORP	292	74.32	21,701.44
ELI LILLY & CO	676	51.08	34,530.08
FOREST LABORATORIES INC	375	34.62	12,982.50
GILEAD SCIENCES INC	488	67.38	32,881.44
HOSPIRA INC	149	31.16	4,642.84
JOHNSON & JOHNSON	1,743	71.14	123,997.02
MERCK & CO. INC.	1,932	46.30	89,451.60
PFIZER INC	4,755	25.61	121,775.55
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	243	61.70	14,993.10
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	145	50.11	7,265.95
WATERS CORP	120	80.67	9,680.40
BB&T CORP	462	28.95	13,374.90
COMERICA INC	211	29.57	6,239.27
FIFTH THIRD BANCORP	609	14.64	8,915.76
KEYCORP	1,033	8.53	8,811.49
M & T BANK CORP	105	104.21	10,942.05
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	537	13.90	7,464.30
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	332	58.44	19,402.08
SUNTRUST BANKS INC	356	27.24	9,697.44
US BANCORP	1,237	33.48	41,414.76
WELLS FARGO & CO	3,206	34.06	109,196.36
AMERICAN EXPRESS CO	677	55.44	37,532.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	240	59.00	14,160.00
BANK OF AMERICA CORPORATION	6,851	9.24	63,303.24
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	777	24.76	19,238.52
BLACKROCK INC	88	187.12	16,466.56
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	393	59.97	23,568.21
CITIGROUP INC	1,863	37.41	69,694.83
CME GROUP INC	220	55.00	12,100.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	535	39.85	21,319.75
FRANKLIN RESOURCES INC	153	126.33	19,328.49
GOLDMAN SACHS GROUP INC	301	119.72	36,035.72
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	85	130.50	11,092.50
INVESCO LTD	557	24.19	13,473.83
JPMORGAN CHASE & CO	2,418	41.67	100,758.06
MOODY'S CORP	322	45.72	14,721.84
MORGAN STANLEY	982	17.10	16,792.20
NORTHERN TRUST CORP	299	47.33	14,151.67
SCHWAB (CHARLES) CORP	716	13.51	9,673.16
STATE STREET CORP	323	44.69	14,434.87
T ROWE PRICE GROUP INC	265	64.74	17,156.10
ACE LTD	236	80.01	18,882.36
AFLAC INC	327	50.03	16,359.81
ALLSTATE CORP	325	40.51	13,165.75
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	733	34.98	25,640.34
AON PLC	204	52.35	10,679.40

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	189	37.30	7,049.70
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	605	87.15	52,725.75
CHUBB CORP	179	79.39	14,210.81
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	341	22.48	7,665.68
MARSH & MCLENNAN COS	361	33.39	12,053.79
METLIFE INC	519	35.65	18,502.35
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	325	28.29	9,194.25
PROGRESSIVE CORP	699	22.59	15,790.41
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	309	57.31	17,708.79
TRAVELERS COS INC/THE	245	72.12	17,669.40
UNUM GROUP	310	20.52	6,361.20
WR BERKLEY CORP	271	39.51	10,707.21
ACCENTURE PLC-CL A	416	66.66	27,730.56
ADOBE SYSTEMS INC	524	33.40	17,501.60
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	312	38.54	12,024.48
AUTODESK INC	352	32.10	11,299.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	324	58.23	18,866.52
BMC SOFTWARE INC	172	41.47	7,132.84
CA INC	494	24.90	12,300.60
CITRIX SYSTEMS INC	212	63.09	13,375.08
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	180	68.17	12,270.60
COMPUTER SCIENCES CORP	169	30.74	5,195.06
EBAY INC	754	48.34	36,448.36
FACEBOOK INC-A	293	22.56	6,610.08
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	306	32.54	9,957.24
FISERV INC	192	75.13	14,424.96
GOOGLE INC-CL A	165	677.76	111,830.40
INTL BUSINESS MACHINES CORP	695	191.60	133,162.00
INTUIT INC	296	59.44	17,594.24
MASTERCARD INC-CLASS A	71	449.36	31,904.56
MICROSOFT CORP	4,800	27.88	133,824.00
ORACLE CORP	2,529	30.86	78,044.94
PAYCHEX INC	388	32.81	12,730.28
SALESFORCE.COM INC	86	145.31	12,496.66
SYMANTEC CORP	676	18.54	12,533.04
VISA INC-CLASS A SHARES	338	137.55	46,491.90
WESTERN UNION CO	725	17.81	12,912.25
YAHOO! INC	766	16.61	12,723.26
AMPHENOL CORP-CL A	191	60.10	11,479.10
APPLE COMPUTER INC	592	609.80	361,001.60
CISCO SYSTEMS INC	3,405	17.20	58,566.00
CORNING INC	1,086	12.09	13,129.74
DELL INC	984	9.24	9,092.16
EMC CORP/MASS	1,322	24.14	31,913.08
F5 NETWORKS INC	107	83.00	8,881.00
HARRIS CORP	239	47.06	11,247.34
HEWLETT-PACKARD CO	1,278	14.19	18,134.82
JUNIPER NETWORKS INC	445	16.07	7,151.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC	281	50.00	14,050.00
NETAPP INC	302	28.13	8,495.26
QUALCOMM INC	1,123	57.43	64,493.89
SEAGATE TECHNOLOGY	338	28.13	9,507.94
TE CONNECTIVITY LTD	283	32.07	9,075.81
XEROX CORP	1,249	6.50	8,118.50

AT&T INC	3,723	34.50	128,443.50
CENTURYLINK INC	408	38.68	15,781.44
CROWN CASTLE INTL CORP	194	66.05	12,813.70
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,805	44.25	79,871.25
AES CORP	993	10.45	10,376.85
AMERICAN ELECTRIC POWER	321	43.91	14,095.11
CENTERPOINT ENERGY INC	687	21.38	14,688.06
CONSOLIDATED EDISON INC	194	60.01	11,641.94
DOMINION RESOURCES INC/VA	392	51.95	20,364.40
DUKE ENERGY CORP	455	64.75	29,461.25
EDISON INTERNATIONAL	205	46.74	9,581.70
ENTERGY CORP	134	70.42	9,436.28
EXELON CORP	565	35.64	20,136.60
FIRSTENERGY CORP	277	45.89	12,711.53
NEXTERA ENERGY INC	262	69.74	18,271.88
P G & E CORP	280	42.04	11,771.20
PINNACLE WEST CAPITAL	235	53.08	12,473.80
PPL CORPORATION	384	29.55	11,347.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	336	32.01	10,755.36
SEMPRA ENERGY	256	68.65	17,574.40
SOUTHERN CO	560	46.23	25,888.80
WISCONSIN ENERGY CORP	367	37.80	13,872.60
XCEL ENERGY INC	322	28.03	9,025.66
ALTERA CORPORATION	339	30.20	10,237.80
ANALOG DEVICES INC	368	38.69	14,237.92
APPLIED MATERIALS INC	848	10.68	9,056.64
BROADCOM CORP-CL A	364	31.62	11,509.68
INTEL CORP	3,198	21.69	69,364.62
LINEAR TECHNOLOGY CORP	304	31.41	9,548.64
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	452	7.74	3,498.48
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	279	31.41	8,763.39
TEXAS INSTRUMENTS INC	742	28.13	20,872.46
XILINX INC	373	32.55	12,141.15
米ドル小計	185,244		8,217,255.53 (659,516,928)
加ドル			
CAMECO CORP	350	18.84	6,594.00
CANADIAN NATURAL RESOURCES	710	29.93	21,250.30
CANADIAN OIL SANDS LTD	466	20.67	9,632.22
CENOVUS ENERGY INC	500	34.40	17,200.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	210	41.80	8,778.00
ENBRIDGE INC	494	39.03	19,280.82
ENCANA CORP	487	22.31	10,864.97
ENERPLUS CORP	346	15.93	5,511.78
HUSKY ENERGY INC	279	26.68	7,443.72
IMPERIAL OIL LTD	196	43.95	8,614.20
NEXEN INC	539	23.70	12,774.30
PENN WEST PETROLEUM LTD	679	13.13	8,915.27
SUNCOR ENERGY INC	1,020	33.14	33,802.80
TALISMAN ENERGY INC	920	12.20	11,224.00
TRANSCANADA CORP	478	44.10	21,079.80
AGNICO-EAGLE MINES LTD	152	55.97	8,507.44
AGRIUM INC	184	105.24	19,364.16
BARRICK GOLD CORP	648	39.25	25,434.00
ELDORADO GOLD CORP	598	14.04	8,395.92



FIRST QUANTUM MINERALS LTD	496	22.55	11,184.80	
GOLDCORP INC	526	43.60	22,933.60	
KINROSS GOLD CORP	888	9.69	8,604.72	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	556	40.17	22,334.52	
SILVER WHEATON CORP	234	38.76	9,069.84	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	382	31.73	12,120.86	
YAMANA GOLD INC	857	18.71	16,034.47	
BOMBARDIER INC 'B'	1,631	3.73	6,083.63	
SNC-LAVALIN GROUP INC	229	38.78	8,880.62	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	289	86.45	24,984.05	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	193	91.97	17,750.21	
MAGNA INTERNATIONAL INC	219	43.33	9,489.27	
TIM HORTONS INC	257	49.49	12,718.93	
THOMSON REUTERS CORP	422	28.20	11,900.40	
SHOPPERS DRUG MART INC	141	40.80	5,752.80	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	193	54.91	10,597.63	
BANK OF MONTREAL	415	59.55	24,713.25	
BANK OF NOVA SCOTIA	706	53.69	37,905.14	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	264	78.02	20,597.28	
NATIONAL BANK OF CANADA	186	76.45	14,219.70	
ROYAL BANK OF CANADA	956	56.91	54,405.96	
TORONTO-DOMINION BANK	601	81.25	48,831.25	
IGM FINANCIAL INC	271	38.59	10,457.89	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,278	12.39	15,834.42	
POWER CORP OF CANADA	445	24.08	10,715.60	
SUN LIFE FINANCIAL INC	391	24.95	9,755.45	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	370	33.85	12,524.50	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	757	15.35	11,619.95	
RESEARCH IN MOTION	345	7.66	2,642.70	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	429	43.46	18,644.34	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	100	61.83	6,183.00	
TRANSALTA CORP	508	15.22	7,731.76	
加ドル小計	24,791		781,890.24 (63,098,542)	
豪ドル				
ORIGIN ENERGY LTD	944	11.39	10,752.16	
SANTOS LTD	807	11.66	9,409.62	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	477	34.84	16,618.68	
WORLEYPARSONS LTD	285	24.39	6,951.15	
BHP BILLITON LTD	2,049	34.37	70,424.13	
NEWCREST MINING LTD	538	26.01	13,993.38	
ORICA LIMITED	480	25.35	12,168.00	
RIO TINTO LTD	287	57.50	16,502.50	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	219	18.43	4,036.17	
BRAMBLES LTD	1,733	7.14	12,373.62	
CROWN LTD	846	9.46	8,003.16	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,652	3.65	6,029.80	
TABCORP HOLDINGS LTD	1,303	2.86	3,726.58	
WESFARMERS LTD	661	34.57	22,850.77	
WOOLWORTHS LTD	798	29.15	23,261.70	
COCA-COLA AMATIL LTD	768	13.62	10,460.16	
CSL LTD	324	46.87	15,185.88	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,780	25.38	45,176.40	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,050	57.30	60,165.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,487	26.00	38,662.00	

WESTPAC BANKING CORP	2,029	25.26	51,252.54	
MACQUARIE GROUP LTD	306	29.81	9,121.86	
AMP LTD	1,916	4.69	8,986.04	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,897	4.59	13,297.23	
QBE INSURANCE GROUP LTD	853	13.50	11,515.50	
SUNCORP GROUP LTD	1,427	9.66	13,784.82	
COMPUTERSHARE LTD	820	8.70	7,134.00	
TELSTRA CORPORATION LTD	2,882	4.07	11,729.74	
AGL ENERGY LTD	726	14.49	10,519.74	
豪ドル小計	32,344		544,092.33 (45,208,631)	
英bond				
BG GROUP PLC	2,197	13.07	28,714.79	
BP PLC	12,089	4.31	52,115.67	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,348	20.88	49,037.98	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,681	21.65	36,393.65	
TULLOW OIL PLC	596	13.92	8,296.32	
ANGLO AMERICAN PLC	858	18.57	15,937.35	
ANTOFAGASTA PLC	612	12.68	7,760.16	
BHP BILLITON PLC	1,368	19.95	27,291.60	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	2,600	3.43	8,920.60	
RANDGOLD RESOURCES LTD	93	74.25	6,905.25	
RIO TINTO PLC	888	31.00	27,528.00	
XSTRATA PLC	1,347	9.68	13,047.04	
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,945	3.10	6,031.44	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,239	8.56	10,612.03	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C(N)	94,164	0.00	94.16	
SMITHS GROUP PLC	404	10.35	4,181.40	
WOLSELEY PLC	377	27.00	10,179.00	
CAPITA PLC	748	7.28	5,449.18	
EXPERIAN PLC	644	10.76	6,929.44	
G4S PLC	1,942	2.61	5,082.21	
CARNIVAL PLC	202	25.05	5,060.10	
COMPASS GROUP PLC	1,940	6.84	13,279.30	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	412	15.47	6,373.64	
WHITBREAD PLC	114	23.09	2,632.26	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	1,034	7.20	7,444.80	
REED ELSEVIER PLC	1,234	6.00	7,404.00	
WPP PLC	834	7.89	6,584.43	
KINGFISHER PLC	2,100	2.83	5,955.60	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,326	3.92	5,199.24	
NEXT PLC	193	36.18	6,982.74	
TESCO PLC	5,147	3.14	16,207.90	
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,579	2.70	4,266.45	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,243	31.56	39,229.08	
DIAGEO PLC	1,619	17.74	28,721.06	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	654	23.30	15,238.20	
SABMILLER PLC	619	26.40	16,344.69	
UNILEVER PLC	833	23.10	19,242.30	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	438	37.45	16,403.10	
SMITH & NEPHEW PLC	824	6.51	5,364.24	
ASTRAZENECA PLC	838	28.96	24,272.67	
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,188	14.06	44,839.22	
SHIRE PLC	593	17.69	10,490.17	
BARCLAYS PLC	7,515	2.32	17,498.67	

HSBC HOLDINGS PLC	11,535	6.14	70,824.90	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	28,127	0.40	11,444.87	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,630	2.78	4,536.29	
STANDARD CHARTERED PLC	1,543	15.05	23,229.86	
AVIVA PLC	2,180	3.33	7,263.76	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,338	1.34	8,524.61	
OLD MUTUAL PLC	3,107	1.72	5,362.68	
PRUDENTIAL PLC	1,626	8.53	13,869.78	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	2,890	1.12	3,248.36	
STANDARD LIFE PLC	2,723	2.88	7,847.68	
SAGE GROUP PLC/THE	2,571	3.04	7,828.69	
BT GROUP PLC	5,166	2.17	11,220.55	
VODAFONE GROUP PLC	31,355	1.70	53,507.30	
CENTRICA PLC	3,661	3.23	11,836.01	
NATIONAL GRID PLC	2,312	7.00	16,195.56	
SEVERN TRENT PLC	442	16.55	7,315.10	
SSE PLC	625	14.33	8,956.25	
ARM HOLDINGS PLC	1,370	6.65	9,110.50	
英ボンド小計	271,820		937,663.88 (121,352,459)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	232	43.33	10,052.56	
GIVAUDAN-REG	13	924.00	12,012.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	152	63.65	9,674.80	
SYNGENTA AG-REG	60	353.90	21,234.00	
ABB LTD-REG	1,422	17.36	24,685.92	
GEBERIT AG-REG	62	203.40	12,610.80	
ADECCO SA-REG	199	47.82	9,516.18	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	99	108.90	10,781.10	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	359	59.05	21,198.95	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	39	379.30	14,792.70	
NESTLE SA-REG	2,095	59.95	125,595.25	
ACTELION LTD-REG	171	45.02	7,698.42	
NOVARTIS AG-REG	1,461	56.80	82,984.80	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	446	180.80	80,636.80	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	761	21.35	16,247.35	
GAM HOLDING LTD	550	12.70	6,985.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	290	31.77	9,213.30	
UBS AG-REG	2,359	12.35	29,133.65	
SWISS RE LTD	225	65.60	14,760.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	95	232.30	22,068.50	
スイスフラン小計	11,090		541,882.08 (46,525,995)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	1,411	77.90	109,916.90	
LI & FUNG LTD	4,000	12.88	51,520.00	
BANK OF EAST ASIA	1,880	29.10	54,708.00	
HANG SENG BANK LTD	550	119.90	65,945.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	680	128.40	87,312.00	
AIA GROUP LTD	6,800	31.10	211,480.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	920	119.40	109,848.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	27.10	81,300.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	2,000	57.15	114,300.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	933	113.00	105,429.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,254	94.55	118,565.70	

WHARF HOLDINGS LTD	2,100	53.70	112,770.00	
CLP HOLDINGS LTD	1,194	66.20	79,042.80	
HONG KONG & CHINA GAS	6,290	20.50	128,945.00	
香港ドル小計	33,012		1,431,082.40 (14,826,013)	
シンガポールドル				
KEPPEL CORP LTD	2,100	11.10	23,310.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,000	10.68	10,680.00	

[次へ](#)

GENTING SINGAPORE PLC	9,000	1.32	11,880.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	4,000	4.08	16,320.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,202	14.02	16,852.04	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,708	9.18	15,679.44	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	842	18.58	15,644.36	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,000	6.79	13,580.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	500	11.41	5,705.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,000	3.20	25,600.00	
シンガポールドル小計	30,352		155,250.84 (10,207,742)	
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	662	116.00	76,792.00	
ASSA ABLOY AB-B	435	219.50	95,482.50	
ATLAS COPCO AB-A SHS	831	160.00	132,960.00	
SANDVIK AB	664	90.75	60,258.00	
SKANSKA AB-B SHS	622	101.40	63,070.80	
SKF AB-B SHS	482	148.40	71,528.80	
VOLVO AB-B SHARES	865	87.05	75,298.25	
SECURITAS AB-B SHS	836	48.33	40,403.88	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	664	226.90	150,661.60	
NORDEA BANK AB	1,654	60.40	99,901.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,545	54.60	84,357.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	325	231.00	75,075.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	544	123.30	67,075.20	
ERICSSON LM-B SHS	2,048	60.50	123,904.00	
TELIASONERA AB	1,433	44.17	63,295.61	
スウェーデンクローナ小計	13,610		1,280,064.24 (15,309,568)	
ノルウェークローネ				
STATOIL ASA	751	142.60	107,092.60	
NORSK HYDRO A S	1,642	25.62	42,068.04	
YARA INTERNATIONAL ASA	199	272.10	54,147.90	
ORKLA ASA	1,079	45.41	48,997.39	
DNB ASA	960	72.40	69,504.00	
TELENOR ASA	857	111.40	95,469.80	
ノルウェークローネ小計	5,488		417,279.73 (5,800,188)	
デンマーククローネ				
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	2	40,160.00	80,320.00	
DSV A/S	438	128.00	56,064.00	
CARLSBERG AS-B	110	510.00	56,100.00	
NOVO NORDISK A/S-B	259	961.50	249,028.50	
DANSKE BANK A/S	622	103.70	64,501.40	
デンマーククローネ小計	1,431		506,013.90 (7,043,713)	
イスラエルシュケル				
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	601	158.10	95,018.10	
イスラエルシュケル小計	601		95,018.10 (1,970,675)	
ユーロ				
ENI SPA	1,557	17.37	27,045.09	
OMV AG	232	27.30	6,333.60	
REPSOL SA	540	15.01	8,105.40	
SAIPEM SPA	337	34.29	11,555.73	
TECHNIP SA	138	88.70	12,240.60	

TOTAL SA	1,352	38.43	51,957.36
AIR LIQUIDE	202	91.12	18,406.24
AKZO NOBEL NV	155	41.40	6,417.77
ARCELORMITTAL	647	11.90	7,699.30
BASF SE	595	63.18	37,592.10
CRH PLC	831	13.82	11,484.42
K+S AG	190	35.56	6,757.35
KONINKLIJKE DSM NV	215	39.00	8,385.00
LAFARGE SA	188	45.17	8,492.90
LANXESS AG	140	62.33	8,726.20
LINDE AG	130	128.75	16,737.50
SOLVAY ET CIE SA -A	88	91.62	8,062.56
THYSSENKRUPP AG	421	17.67	7,439.07
UMICORE	187	39.40	7,368.73
UPM-KYMMENE OYJ	507	8.11	4,111.77
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	161	16.50	2,656.50
ALSTOM	186	26.41	4,912.26
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	261	26.80	6,994.80
EADS NV	461	26.74	12,329.44
FIAT INDUSTRIAL	875	7.96	6,965.00
KONE OYJ-B	185	54.95	10,165.75
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	673	19.42	13,073.02
MAN SE	87	77.28	6,723.36
SCHNEIDER ELECTRIC SA	340	47.94	16,299.60
SIEMENS AG-REG	533	76.56	40,806.48
VALLOUREC	105	32.59	3,421.95
VINCI SA	305	33.84	10,322.72
WARTSILA OYJ	272	30.12	8,192.64
EDENRED	307	22.74	6,982.71
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	617	11.73	7,237.41
ATLANTIA SPA	492	12.50	6,150.00
DEUTSCHE POST AG	966	15.90	15,364.23
TNT EXPRESS NV	390	8.37	3,266.64
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	219	60.34	13,214.46
CONTINENTAL AG	101	76.86	7,762.86
DAIMLER AG	587	36.79	21,595.73
MICHELIN (CGDE)-B	119	64.36	7,658.84
RENAULT SA	223	35.37	7,888.62
VOLKSWAGEN AG-PFD	96	153.70	14,755.20
ADIDAS AG	229	65.09	14,905.61
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	165	122.40	20,196.00
ACCOR SA	197	23.65	4,659.05
SODEXO	131	60.00	7,860.00
LAGARDERE S.C.A.	186	20.79	3,867.87
MEDIASET SPA	1,605	1.38	2,216.50
SES	443	20.97	9,289.71
WOLTERS KLUWER	443	14.68	6,505.45
INDITEX	144	96.93	13,957.92
PPR	70	130.90	9,163.00
CARREFOUR SA	401	17.84	7,155.84
DELHAIZE GROUP	91	28.76	2,617.61
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	1,567	4.68	7,333.56
KONINKLIJKE AHOLD NV	825	9.56	7,890.30
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	520	65.82	34,226.40

DANONE	379	46.62	17,670.87
DE MASTER BLENDERS1753 NVW/I	670	9.31	6,237.70
HEINEKEN NV	152	47.68	7,248.12
PERNOD-RICARD SA	209	83.77	17,507.93
UNILEVER NV-CVA	1,056	28.44	30,037.92
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	260	62.52	16,255.20
L'OREAL	165	96.80	15,972.00
ESSILOR INTERNATIONAL	212	69.30	14,691.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	229	57.66	13,204.14
FRESENIUS SE & CO KGAA	134	92.22	12,357.48
BAYER AG	536	66.69	35,745.84
SANOFI	755	67.04	50,615.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,557	6.25	22,234.80
BANCO SANTANDER SA	6,219	5.74	35,728.15
BNP PARIBAS	627	39.62	24,844.87
CREDIT AGRICOLE SA	708	6.00	4,248.70
ERSTE GROUP BANK AG	241	18.23	4,394.63
INTESA SANPAOLO	6,669	1.26	8,449.62
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	2,782		
SOCIETE GENERALE	433	24.88	10,775.20
UNICREDIT SPA	2,763	3.50	9,681.55
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	603	33.40	20,140.20
ING GROEP NV-CVA	2,488	6.76	16,818.88
MEDIOBANCA SPA	857	4.52	3,877.06
AGEAS	266	19.51	5,189.66
ALLIANZ SE-REG	295	93.57	27,603.15
ASSICURAZIONI GENERALI	773	12.05	9,314.65
AXA	1,224	12.18	14,914.44
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	119	124.95	14,869.05
SAMPO OYJ-A SHS	317	24.30	7,703.10
CAP GEMINI SA	173	31.49	5,447.77
SAP AG-COMMON	596	55.00	32,780.00
NOKIA OYJ	2,577	2.02	5,226.15
BELGACOM SA	334	21.47	7,170.98
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,825	8.71	15,904.87
FRANCE TELECOM SA	1,247	8.83	11,014.75
KONINKLIJKE KPN NV	660	5.11	3,373.92
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	1,177	3.88	4,572.64
TELECOM ITALIA SPA	11,938	0.70	8,464.04
TELEFONICA SA	2,659	10.19	27,095.21
VIVENDI	870	15.78	13,728.60
ACCIONA SA	76	46.83	3,559.46
E.ON AG	1,169	17.55	20,515.95
ELECTRICITE DE FRANCE	161	16.63	2,677.43
ENEL SPA	4,357	2.88	12,548.16
FORTUM OYJ	342	14.10	4,822.20
GDF SUEZ	805	17.47	14,063.35
IBERDROLA SA	2,570	3.97	10,215.75
RWE AG	324	34.67	11,233.08
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	362	8.45	3,059.62
VEOLIA ENVIRONNEMENT	338	7.94	2,685.74
ASML HOLDING NV	278	42.00	11,676.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,474	5.22	7,697.22
STMICROELECTRONICS NV	664	4.70	3,122.12

ユーロ小計	96,904		1,402,490.45 (145,676,683)	
合計	706,687		1,136,537,137 (1,136,537,137)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	261	19,136.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	134	17,945.28	
		BOSTON PROPERTIES INC	201	21,577.35	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	200	11,284.00	
		HCP INC	292	12,932.68	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	889	13,290.55	
		KIMCO REALTY CORPORATION	712	14,083.36	
		PUBLIC STORAGE	100	13,717.00	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	253	12,093.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	191	28,928.86	
		THE MACERICH COMPANY	85	4,836.50	
		VENTAS INC	190	11,973.80	
		VORNADO REALTY TRUST	208	16,640.00	
	WEYERHAEUSER CO	619	16,898.70		
	投資証券小計		4,335	215,338.00 (17,283,027)	
米ドル合計				215,338.00 (17,283,027)	
豪ドル	投資証券	LEND LEASE GROUP	1,164	10,068.60	
		WESTFIELD GROUP	1,428	15,108.24	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	4,464	13,972.32	
		投資証券小計		7,056	39,149.16 (3,252,903)
豪ドル合計				39,149.16 (3,252,903)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,166	6,168.14	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	944	7,613.36	
		投資証券小計		2,110	13,781.50 (1,783,601)
英ポンド合計				13,781.50 (1,783,601)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	3,500	130,900.00	
		投資証券小計		3,500	130,900.00 (1,356,124)
香港ドル合計				130,900.00 (1,356,124)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	95	16,093.00	
		投資証券小計		95	16,093.00 (1,671,579)
ユーロ合計				16,093.00 (1,671,579)	
合計				25,347,234 (25,347,234)	

(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	349銘柄	97.4%	56.8%
	投資証券	14銘柄		1.5%
加ドル	株式	51銘柄	100.0%	5.4%
豪ドル	株式	29銘柄	93.3%	3.9%
	投資証券	3銘柄		0.3%
英ポンド	株式	61銘柄	98.6%	10.4%
	投資証券	2銘柄		0.2%
スイスフラン	株式	20銘柄	100.0%	4.0%
香港ドル	株式	14銘柄	91.6%	1.3%
	投資証券	1銘柄		0.1%
シンガポールドル	株式	10銘柄	100.0%	0.9%
スウェーデンクローナ	株式	15銘柄	100.0%	1.3%
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%	0.6%
イスラエルシケル	株式	1銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	113銘柄	98.9%	12.5%
	投資証券	1銘柄		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23年10月26日現在	平成24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		12,239,439	23,445,690
国債証券		23,977,123,895	24,348,578,740
地方債証券		2,205,615,000	1,998,839,000
特殊債証券		3,112,968,968	2,903,682,603
社債証券		2,535,618,000	2,182,644,000
未収入金		30,972,000	
未収利息		96,696,343	89,004,354
前払費用		700,244	1,021,799
流動資産合計		31,971,933,889	31,547,216,186
資産合計		31,971,933,889	31,547,216,186
負債の部			
流動負債			
未払解約金		35,375,353	6,252,210
流動負債合計		35,375,353	6,252,210

負債合計	35,375,353	6,252,210
純資産の部		
元本等		
元本	25,987,788,436	25,106,160,065
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	5,948,770,100	6,434,803,911
元本等合計	31,936,558,536	31,540,963,976
純資産合計	31,936,558,536	31,540,963,976
負債純資産合計	31,971,933,889	31,547,216,186

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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>
-----------------	---

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
1.	期首	平成22年10月27日	平成23年10月27日
	期首元本額	30,762,768,556円	25,987,788,436円
	期首からの追加設定元本額	1,834,319,535円	1,802,086,670円
	期首からの一部解約元本額	6,609,299,655円	2,683,715,041円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	423,709,192円	464,923,776円
	DCインデックスバランス（株式40）	516,868,348円	569,838,246円
	DCインデックスバランス（株式60）	356,183,324円	386,310,060円
	DCインデックスバランス（株式80）	57,515,142円	63,246,822円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	942,608,257円	1,105,071,789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	7,126,691,792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	8,126,582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	99,397,477円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,509,748円	7,420,263円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	47,227,701円	42,502,040円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	206,207,797円	185,939,603円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	763,311,408円	677,839,851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	6,942,590,807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	113,893,062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	195,112,931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	21,261,988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	28,156,286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	874,366,945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	808,826,593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	382,806,853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	56,241,735円
	年金積立 インデックスファンド日本債券	4,227,032,466円	4,800,769,855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	144,824,709円
	計	25,987,788,436円	25,106,160,065円
2.	受益権の総数	25,987,788,436口	25,106,160,065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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24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

	平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成23年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	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

(平成24年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	214,690,300
地方債証券	3,633,000
特殊債券	10,119,000
社債券	24,949,000
合計	225,887,300

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成23年10月26日現在		平成24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)	1.2289円 (12,289円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2563円 (12,563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310回利付国債(2年)	40,000,000	40,043,600	
	第311回利付国債(2年)	250,000,000	250,295,000	
	第312回利付国債(2年)	40,000,000	40,002,400	
	第313回利付国債(2年)	40,000,000	40,002,400	
	第314回利付国債(2年)	550,000,000	550,033,000	
	第315回利付国債(2年)	50,000,000	50,003,500	
	第320回利付国債(2年)	180,000,000	180,016,200	
	第78回利付国債(5年)	113,000,000	114,035,080	
	第79回利付国債(5年)	143,000,000	143,983,840	
	第81回利付国債(5年)	574,000,000	579,602,240	
	第83回利付国債(5年)	62,000,000	62,815,920	
	第84回利付国債(5年)	112,000,000	113,107,680	
	第85回利付国債(5年)	92,000,000	93,049,720	
	第87回利付国債(5年)	20,000,000	20,172,800	
	第89回利付国債(5年)	90,000,000	90,721,800	
	第90回利付国債(5年)	50,000,000	50,269,500	
	第91回利付国債(5年)	80,000,000	80,703,200	
	第92回利付国債(5年)	15,000,000	15,088,500	
	第93回利付国債(5年)	225,000,000	227,814,750	
	第94回利付国債(5年)	70,000,000	71,094,800	
	第95回利付国債(5年)	220,000,000	223,597,000	
	第97回利付国債(5年)	140,000,000	141,394,400	
	第98回利付国債(5年)	55,000,000	55,348,150	
	第99回利付国債(5年)	150,000,000	151,537,500	
	第100回利付国債(5年)	50,000,000	50,319,000	
	第101回利付国債(5年)	350,000,000	353,671,500	
	第102回利付国債(5年)	80,000,000	80,509,600	
	第104回利付国債(5年)	50,000,000	50,087,000	
	第105回利付国債(5年)	100,000,000	100,115,000	
	第106回利付国債(5年)	140,000,000	140,100,800	
	第2回利付国債(40年)	185,000,000	192,183,550	
	第4回利付国債(40年)	75,000,000	77,250,750	
	第256回利付国債(10年)	148,000,000	150,197,800	
	第258回利付国債(10年)	40,000,000	40,667,200	
	第259回利付国債(10年)	7,000,000	7,136,150	
	第261回利付国債(10年)	270,000,000	277,530,300	
	第262回利付国債(10年)	85,000,000	87,509,200	
	第264回利付国債(10年)	141,000,000	144,737,910	

第265回利付国債(10年)	50,000,000	51,500,000	
第266回利付国債(10年)	118,000,000	121,287,480	
第268回利付国債(10年)	361,000,000	373,075,450	
第269回利付国債(10年)	90,000,000	92,581,200	
第270回利付国債(10年)	88,000,000	90,790,480	
第271回利付国債(10年)	146,000,000	150,245,680	
第272回利付国債(10年)	178,000,000	184,667,880	
第273回利付国債(10年)	111,000,000	115,477,740	
第274回利付国債(10年)	73,000,000	76,198,130	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	36,642,900	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	84,560,800	
第279回利付国債(10年)	70,000,000	74,463,200	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	166,027,680	
第281回利付国債(10年)	182,000,000	194,359,620	
第282回利付国債(10年)	274,000,000	290,593,440	
第283回利付国債(10年)	50,000,000	53,221,500	
第284回利付国債(10年)	57,000,000	60,659,400	
第285回利付国債(10年)	361,000,000	385,298,910	
第286回利付国債(10年)	216,000,000	232,202,160	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	37,786,350	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,326,240	
第289回利付国債(10年)	269,000,000	286,788,970	
第290回利付国債(10年)	446,000,000	474,138,140	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	303,499,630	
第292回利付国債(10年)	241,000,000	260,055,870	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	104,330,880	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,599,040	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,911,170	
第296回利付国債(10年)	176,000,000	188,605,120	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	157,861,240	
第298回利付国債(10年)	221,000,000	234,392,600	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	795,750,000	
第300回利付国債(10年)	86,000,000	92,321,860	
第301回利付国債(10年)	138,000,000	148,246,500	
第302回利付国債(10年)	14,000,000	14,948,780	
第303回利付国債(10年)	511,000,000	545,814,430	
第305回利付国債(10年)	343,000,000	364,046,480	
第306回利付国債(10年)	115,000,000	122,853,350	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,457,400	
第309回利付国債(10年)	84,000,000	87,837,120	
第310回利付国債(10年)	268,000,000	277,854,360	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	94,973,460	
第312回利付国債(10年)	125,000,000	131,381,250	
第313回利付国債(10年)	340,000,000	359,862,800	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	89,187,950	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,422,050	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	171,456,450	
第318回利付国債(10年)	175,000,000	180,299,000	
第319回利付国債(10年)	180,000,000	186,744,600	

第320回利付国債(10年)	100,000,000	102,886,000	
第321回利付国債(10年)	160,000,000	164,227,200	
第322回利付国債(10年)	200,000,000	203,522,000	

[次へ](#)



第323回利付国債(10年)	100,000,000	101,530,000	
第324回利付国債(10年)	45,000,000	45,263,250	
第325回利付国債(10年)	120,000,000	120,440,400	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	232,843,520	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	184,103,280	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	62,313,900	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	179,018,740	
第26回利付国債(30年)	100,000,000	111,300,000	
第27回利付国債(30年)	109,000,000	123,494,820	
第28回利付国債(30年)	14,000,000	15,859,480	
第29回利付国債(30年)	246,000,000	273,758,640	
第30回利付国債(30年)	127,000,000	138,607,800	
第31回利付国債(30年)	20,000,000	21,391,400	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	43,588,400	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	51,191,000	
第34回利付国債(30年)	110,000,000	117,274,300	
第35回利付国債(30年)	120,000,000	122,352,000	
第36回利付国債(30年)	235,000,000	239,204,150	
第37回利付国債(30年)	30,000,000	29,829,300	
第26回利付国債(20年)	37,000,000	40,080,620	
第27回利付国債(20年)	16,000,000	17,483,520	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	123,027,300	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	44,570,800	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	228,410,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	97,408,300	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	71,935,290	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	96,972,740	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,984,770	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	203,525,200	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	85,409,270	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,557,180	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,728,740	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	114,312,330	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	64,086,810	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	262,558,080	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,538,820	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	17,027,850	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	73,721,340	
第57回利付国債(20年)	137,000,000	151,843,950	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	149,638,050	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,937,000	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	577,563,750	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	27,504,630	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,038,930	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	59,830,380	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	155,037,400	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,286,780	
第67回利付国債(20年)	54,000,000	59,761,800	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	43,302,900	

第70回利付国債(20年)	49,000,000	56,892,920
第72回利付国債(20年)	42,000,000	47,362,560
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,501,500
第74回利付国債(20年)	78,000,000	87,906,780
第76回利付国債(20年)	151,000,000	166,435,220
第88回利付国債(20年)	300,000,000	342,894,000
第90回利付国債(20年)	156,000,000	176,039,760
第91回利付国債(20年)	200,000,000	228,230,000
第92回利付国債(20年)	110,000,000	122,485,000
第94回利付国債(20年)	50,000,000	55,554,500
第95回利付国債(20年)	32,000,000	36,360,000
第96回利付国債(20年)	98,000,000	108,710,420
第97回利付国債(20年)	45,000,000	50,461,650
第98回利付国債(20年)	44,000,000	48,725,600
第99回利付国債(20年)	97,000,000	107,290,730
第100回利付国債(20年)	110,000,000	123,008,600
第101回利付国債(20年)	96,000,000	110,033,280
第102回利付国債(20年)	106,000,000	121,310,640
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,429,560
第104回利付国債(20年)	33,000,000	36,360,060
第105回利付国債(20年)	82,000,000	90,163,920
第106回利付国債(20年)	142,000,000	158,205,040
第107回利付国債(20年)	30,000,000	32,937,900
第108回利付国債(20年)	134,000,000	143,291,560
第109回利付国債(20年)	119,000,000	126,845,670
第110回利付国債(20年)	148,000,000	162,132,520
第111回利付国債(20年)	90,000,000	99,715,500
第113回利付国債(20年)	20,000,000	21,837,800
第114回利付国債(20年)	52,000,000	56,639,960
第116回利付国債(20年)	185,000,000	203,982,850
第117回利付国債(20年)	30,000,000	32,616,900
第118回利付国債(20年)	70,000,000	74,933,600
第119回利付国債(20年)	50,000,000	51,983,000
第120回利付国債(20年)	70,000,000	70,582,400
第121回利付国債(20年)	22,000,000	23,159,400
第122回利付国債(20年)	80,000,000	82,975,200
第123回利付国債(20年)	55,000,000	59,493,500
第124回利付国債(20年)	50,000,000	53,298,500
第125回利付国債(20年)	95,000,000	104,058,250
第126回利付国債(20年)	25,000,000	26,590,500
第128回利付国債(20年)	35,000,000	36,586,200
第129回利付国債(20年)	115,000,000	118,386,750
第130回利付国債(20年)	80,000,000	82,141,600
第131回利付国債(20年)	25,000,000	25,252,750
第132回利付国債(20年)	90,000,000	90,786,600
第133回利付国債(20年)	30,000,000	30,744,000
第134回利付国債(20年)	60,000,000	61,366,800
第135回利付国債(20年)	30,000,000	30,198,000
第136回利付国債(20年)	210,000,000	207,845,400

	第137回利付国債(20年)	140,000,000	140,723,800	
	第140回利付国債(20年)	150,000,000	150,670,500	
国債証券 合計		22,979,000,000	24,348,578,740	
地方債証券	第636回東京都公募公債	100,000,000	106,781,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	105,883,000	
	第708回東京都公募公債	100,000,000	101,117,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,691,000	
	第123回神奈川県公募公債	100,000,000	101,468,000	
	第261回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,514,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	107,652,000	
	平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,254,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,046,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,089,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	107,277,000	
	平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,025,000	
	平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	103,193,000	
	平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,099,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,954,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,404,000	
	平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,785,000	
	第12回め号名古屋市公募公債	100,000,000	102,858,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	106,749,000	
	地方債証券 合計		1,900,000,000	1,998,839,000
特殊債券	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,411,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,478,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,085,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,529,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,558,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	102,611,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	102,727,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	102,847,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	103,287,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,107,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,837,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	102,562,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	106,663,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,299,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,562,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,092,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	102,576,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	205,938,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,929,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	205,460,000	
	い第709号農林債	100,000,000	101,546,000	
	い第714号農林債	100,000,000	101,402,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,874,000	
	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	101,238,603	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	101,549,000	
	第234回信金中金債(5年)	100,000,000	101,515,000	

特殊債券 合計		2,800,000,000	2,903,682,603	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	113,234,000	
	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	101,607,000	
	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	101,489,000	
	第8回帝人株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,896,000	
	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	103,899,000	
	第12回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,547,000	
	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	100,765,000	
	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	104,053,000	
	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	103,606,000	
	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	100,339,000	
	第18回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,826,000	
	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	106,393,000	
	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	101,012,000	
	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	101,876,000	
	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	109,100,000	
	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	109,386,000	
	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	103,831,000	
	第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	95,038,000	
	第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	112,128,000	
	第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,159,000	
第19回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,460,000		
社債券 合計		2,100,000,000	2,182,644,000	
合計		29,779,000,000	31,433,744,343	

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23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		877,024,236	526,591,699
コール・ローン		57,631,052	50,403,359
国債証券		451,984,941,922	223,980,927,942
派生商品評価勘定		954,178	
未収入金		919,079,566	545,928,863
未収利息		5,712,615,059	2,884,023,543
前払費用		195,740,478	72,225,632
流動資産合計		459,747,986,491	228,060,101,038
資産合計			
		459,747,986,491	228,060,101,038
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,216,348	1,768,417
未払解約金		983,367,478	456,857,911
流動負債合計		984,583,826	458,626,328
負債合計			
		984,583,826	458,626,328
純資産の部			
元本等			
元本		328,307,863,758	149,884,558,127
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		130,455,538,907	77,716,916,583
元本等合計		458,763,402,665	227,601,474,710
純資産合計			
		458,763,402,665	227,601,474,710
負債純資産合計			
		459,747,986,491	228,060,101,038

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
1.	期首	平成22年10月27日	平成23年10月27日
	期首元本額	410,189,621,640円	328,307,863,758円
	期首からの追加設定元本額	13,628,129,297円	1,581,095,536円
	期首からの一部解約元本額	95,509,887,179円	180,004,401,167円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	9,633,553,500円	10,178,641,504円
	DCインデックスバランス（株式20）	57,256,999円	60,404,469円
	DCインデックスバランス（株式40）	100,709,226円	106,385,397円
	DCインデックスバランス（株式60）	124,636,684円	130,847,111円
	DCインデックスバランス（株式80）	100,852,481円	107,250,758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	41,302,697,103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	5,998,185,805円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	104,969,488,141円	74,934,401,067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	46,557,824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	1,358,030,930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	9,899,741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	70,323,881円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	6,525,478円	6,232,597円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	8,247,647円	7,103,388円

アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	20,058,227円	17,186,845円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,489,457円	43,517,521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	1,091,712,429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	1,963,563,094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	136,015,513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	190,213,809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	17,680,881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	53,500,276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	56,775,136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	75,813,671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	64,963,568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	47,690,463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	11,584,994,196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	223,969,150円
計	328,307,863,758円	149,884,558,127円
2. 受益権の総数	328,307,863,758口	149,884,558,127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)

### 1 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24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

	平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1) 有価証券            同左</p> <p>(2) デリバティブ取引            同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成23年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(平成24年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,098,832,565
合計	5,098,832,565

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



## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## （通貨関連）

（平成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	

（平成24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	629,842,363		631,610,780	1,768,417
	米ドル	267,530,520		268,837,500	1,306,980
	英ポンド	67,258,152		67,293,200	35,048
	デンマーククローネ	35,755,691		35,830,080	74,389
	ユーロ	259,298,000		259,650,000	352,000
合計	629,842,363		631,610,780	1,768,417	

## （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23年10月26日現在		平成24年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3974円	1口当たり純資産額	1.5185円
（1万口当たり純資産額）	（13,974円）	（1万口当たり純資産額）	（15,185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-3.125%-13/09/30	20,200,000	20,744,453.12	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	2,500,000	2,563,867.18	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	27,500,000	28,662,304.68	
		US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	20,900,000	21,303,304.68	
		US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	16,600,000	16,846,406.25	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,058,750.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	36,280,000	38,045,815.62	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	11,300,000	11,542,773.43	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	9,700,000	9,903,851.56	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	4,000,000	4,095,937.50	
		US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	40,550,000	43,350,484.37	
		US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	3,600,000	3,712,218.75	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	4,000,000	4,163,125.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	28,700,000	30,731,421.87	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	4,700,000	4,878,085.93	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	4,400,000	4,574,281.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	11,400,000	11,868,468.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	33,800,000	36,506,640.62	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000	11,099,578.12	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	16,000,000	16,795,000.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	16,800,000	17,516,625.00	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	3,748,125.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	26,700,000	28,921,523.43	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	2,300,000	2,407,363.28	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	10,000,000	10,514,843.75	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	8,000,000	8,422,500.00	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000	25,283,671.87	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	9,500,000	9,921,562.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	13,700,000	15,155,625.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	10,900,000	12,225,882.81	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	7,500,000	8,479,101.56	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	28,500,000	33,086,718.75	
		US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,120,625.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	18,600,000	20,378,625.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	9,500,000	10,427,734.37	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000	4,616,718.75	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,700,000	10,098,796.87	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	4,800,000	5,238,000.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,700,000	6,226,804.68	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000	7,582,453.12	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000	6,958,125.00	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	12,997,031.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,600,000	1,735,750.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	11,900,000	13,169,023.43	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,400,000	10,363,500.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	13,250,000	15,460,058.59	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000	5,932,828.12	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	9,200,000	10,219,906.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000	7,744,843.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	14,100,000	16,478,273.43	
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	10,878,750.00			

US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000	9,605,750.00	
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000	4,321,250.00	
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	20,500,000	24,335,742.18	
US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,530,937.50	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	18,900,000	22,096,757.81	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	16,200,000	18,380,671.87	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	5,550,000	6,433,664.06	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,900,000	20,958,382.81	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	16,500,000	19,116,796.87	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,383,593.75	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000	6,159,562.50	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	2,400,000	2,698,312.50	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	3,000,000	3,474,375.00	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,106,953.12	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	5,000,000	5,714,062.50	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	16,300,000	18,914,367.18	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	8,000,000	9,225,625.00	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,302,625.00	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000	2,177,031.25	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	22,500,000	26,223,046.87	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000	18,494,062.50	
US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	5,999,375.00	
US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	12,003,750.00	
US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,000,000	9,506,250.00	
US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,653,906.25	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	4,071,304.68	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	4,700,000	6,936,539.06	
US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	5,100,000	7,667,132.81	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	5,900,000	9,050,968.75	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000	4,952,773.43	
US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	6,700,000	9,051,804.68	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	4,100,000	5,732,632.81	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	8,400,000	10,778,250.00	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	6,200,000	8,107,468.75	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	6,300,000	7,950,304.68	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	8,900,000	11,671,515.62	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	7,000,000	9,010,312.50	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	15,300,000	20,460,164.06	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	13,700,000	17,649,453.12	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000	5,826,406.25	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	8,200,000	10,366,593.75	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000	2,183,750.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	8,500,000	10,963,007.81	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	6,000,000	6,977,812.50	
国債証券小計	1,005,880,000	1,159,983,206.02 (93,100,252,115)	
米ドル合計		1,159,983,206.02 (93,100,252,115)	

加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	6,800,000	6,998,288.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	9,130,000	9,683,095.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	3,200,000	3,254,720.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,375,785.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	5,950,000	6,448,610.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,550,000	2,682,268.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	6,000,000	6,559,080.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	6,000,000	6,685,140.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	3,100,000	3,556,506.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	3,300,000	3,739,494.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	2,550,000	2,873,187.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,600,000	1,784,544.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	930,000	1,637,906.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	900,000	1,545,075.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	2,300,000	3,381,230.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	2,750,000	4,228,180.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	3,200,000	4,672,864.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	3,800,000	4,993,960.00	
CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,300,000	1,607,034.00			
	国債証券小計	67,660,000	78,706,967.60 (6,351,652,285)		
加ドル合計			78,706,967.60 (6,351,652,285)		
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	1,570,000	1,618,929.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	2,800,000	2,961,005.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	2,300,000	2,383,713.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	3,080,000	3,347,498.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-15/10/21	300,000	318,433.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	4,000,000	4,295,252.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	3,900,000	4,431,757.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,200,000	1,282,195.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,100,000	2,378,821.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	3,500,000	3,985,282.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	3,700,000	4,079,509.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	3,600,000	4,327,218.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,350,000	2,860,420.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,100,000	2,525,449.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,300,000	1,481,876.50	
	国債証券小計	37,800,000	42,277,359.55 (3,512,825,805)		
豪ドル合計			42,277,359.55 (3,512,825,805)		
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.25%-14/03/07	4,200,000	4,313,734.06	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	9,450,000	10,281,715.66	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	1,400,000	1,475,166.00	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	3,930,000	4,423,148.34	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	5,800,000	7,172,134.71	
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000	419,826.80	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	8,600,000	9,733,346.44	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	4,100,000	5,645,638.13	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	1,200,000	1,454,873.20	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	3,650,000	4,402,082.50	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000	2,502,428.00	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	6,400,000	7,916,975.04	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,900,000	2,219,880.80	

		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	4,800,000	7,288,263.36	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	3,200,000	3,744,489.21	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	5,100,000	6,088,893.26	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	3,040,000	3,989,030.05	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	2,750,000	3,378,688.61	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	2,000,000	2,944,345.48	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,700,000	3,513,658.28	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	4,550,000	5,553,865.95	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	5,350,000	6,703,347.55	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,050,000	1,267,781.85	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,550,000	2,016,681.28	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	2,800,000	3,371,418.82	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	5,350,000	6,433,310.05	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,350,000	4,202,614.02	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	3,750,000	4,520,801.73	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	3,100,000	3,744,744.91	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	5,900,000	7,211,480.37	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	1,999,286.76	
	国債証券小計		115,220,000	139,933,651.22 (18,110,213,140)	
英ポンド合計				139,933,651.22 (18,110,213,140)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	1,100,000	1,158,166.90	
		SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	1,850,000	2,013,208.85	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	2,560,000	2,954,641.92	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,560,000	3,437,918.72	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	790,000	1,145,929.76	
	国債証券小計		8,860,000	10,709,866.15 (919,549,107)	
スイスフラン合計				10,709,866.15 (919,549,107)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	1,420,000	1,500,230.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000	612,840.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,350,000	1,443,869.99	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	1,180,000	1,334,816.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	1,000,000	1,087,050.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	970,000	1,159,829.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	800,000	884,760.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	1,650,000	1,911,525.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	730,000	849,756.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,145,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	700,000	835,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	600,000	667,740.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	380,000	407,955.33		
国債証券小計		12,380,000	13,840,891.82 (910,038,637)		
シンガポールドル合計				13,840,891.82 (910,038,637)	

マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	7,700,000	7,941,895.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	2,600,000	2,637,310.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,039,466.66	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	2,300,000	2,401,265.71	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	3,800,000	3,956,750.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	2,300,000	2,350,845.43	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,400,000	3,512,426.67	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	4,100,000	4,280,367.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,200,000	3,640,537.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,800,000	4,029,900.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	2,900,000	3,056,793.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	3,350,000	3,600,133.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,750,000	1,704,441.69	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000	885,013.83	
	国債証券小計		43,950,000	46,037,146.52 (1,213,539,182)	
マレーシアリングット合計				46,037,146.52 (1,213,539,182)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	16,000,000	17,453,408.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	11,980,000	13,203,852.84	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	10,000,000	10,764,400.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	10,700,000	12,054,662.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	14,500,000	17,181,340.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	10,300,000	13,066,528.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	16,000,000	18,727,696.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	8,500,000	10,724,713.50	
	国債証券小計		97,980,000	113,176,601.64 (1,353,592,155)	
スウェーデンクローナ合計				113,176,601.64 (1,353,592,155)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	11,800,000	12,845,291.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	10,550,000	11,797,094.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	6,950,000	8,117,655.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	7,350,000	8,394,170.40	
	国債証券小計		36,650,000	41,154,211.60 (572,043,541)	
ノルウェークローネ合計				41,154,211.60 (572,043,541)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	13,800,000	14,534,215.20	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	19,900,000	22,213,613.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	15,500,000	18,124,770.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	32,800,000	39,568,673.60	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	7,950,000	12,689,837.70	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	21,850,000	31,841,633.55	
	国債証券小計		111,800,000	138,972,743.85 (1,934,500,594)	
デンマーククローネ合計				138,972,743.85 (1,934,500,594)	

メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	36,400,000	37,761,274.09	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	42,700,000	46,810,259.30	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	30,100,000	32,805,394.02	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	11,900,000	12,920,516.86	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	15,500,000	17,401,841.47	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	36,800,000	43,199,808.14	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	44,300,000	61,557,795.06	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	37,100,000	46,042,947.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	11,900,000	16,886,684.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	25,300,000	31,333,677.83	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	5,200,000	5,973,277.64	
	国債証券小計		297,200,000	352,693,476.25 (2,176,118,748)	
メキシコペソ合計				352,693,476.25 (2,176,118,748)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	5,000,000	5,054,085.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	11,700,000	12,011,220.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	6,900,000	7,157,715.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	4,500,000	4,794,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	6,100,000	6,303,435.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	10,200,000	10,707,450.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	5,400,000	5,810,940.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	5,900,000	6,238,660.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	3,200,000	3,490,560.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	5,300,000	5,808,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,500,000	1,678,258.50	
	国債証券小計		65,700,000	69,055,423.50 (1,729,147,804)	
ポーランドズロチ合計				69,055,423.50 (1,729,147,804)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-14/12/21	18,600,000	19,996,709.34	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-13.5%-15/09/15	10,000,000	12,115,819.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-17/09/15	15,000,000	16,527,759.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-18/12/21	10,000,000	10,948,567.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%-20/01/15	15,000,000	15,678,526.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%-21/03/31	10,000,000	10,063,070.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	40,000,000	49,457,216.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-41/02/28	20,000,000	15,616,092.00	
	国債証券小計		138,600,000	150,403,758.84 (1,383,714,581)	
南アフリカランド合計				150,403,758.84 (1,383,714,581)	

ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	2,700,000	2,843,473.95	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	1,900,000	2,043,479.45	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	1,150,000	1,235,270.89	
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	3,000,000	3,545,433.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	3,200,000	3,498,871.68	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,603,522.50	
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	2,840,000	3,098,840.44	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	3,800,000	4,280,865.68	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	2,400,000	2,886,881.04	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	1,800,000	2,047,584.42	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	2,050,000	2,336,434.81	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	3,700,000	4,146,463.09	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	3,150,000	3,650,608.39	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	3,000,000	3,415,821.30	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000	1,730,814.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,600,000	1,877,584.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	4,350,000	5,665,611.82	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	4,050,000	5,117,011.78	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	2,230,000	2,579,166.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-13/10/31	200,000	199,474.58	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.25%-14/01/31	8,800,000	8,941,868.32	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.75%-14/07/30	5,300,000	5,444,743.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	5,000,000	5,014,126.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	4,600,000	4,714,375.78	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,286,235.21	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-15/07/30	5,200,000	5,260,022.04	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-3.15%-16/01/31	7,100,000	6,945,988.22	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.25%-16/10/31	4,900,000	4,900,479.71	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,550,000	2,496,688.17	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	3,750,000	3,906,608.62	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,700,000	3,585,098.72	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	3,600,000	3,519,133.56	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	3,000,000	2,861,014.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	5,200,000	4,814,716.92	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.85%-20/10/31	3,700,000	3,566,979.82	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	4,200,000	4,192,776.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	3,700,000	3,356,837.21	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.65%-25/07/30	1,100,000	955,771.85	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	2,200,000	2,139,583.82	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	3,850,000	3,763,050.44	
		B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.75%-32/07/30	3,500,000	3,291,410.15	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	3,200,000	2,349,539.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	2,800,000	2,243,167.36	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	3,100,000	2,425,329.64	
BUNDESobligation-4.0%-13/10/11	6,700,000	6,951,783.32			
BUNDESobligation-2.25%-14/04/11	1,100,000	1,135,189.00			
BUNDESobligation-2.5%-14/10/10	1,500,000	1,570,489.80			
BUNDESobligation-2.5%-15/02/27	4,500,000	4,751,380.80			



BUNDESOBLIGATION-2.25%-15/04/10	4,500,000	4,735,224.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	14,500,000	15,223,435.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	4,700,000	5,029,599.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	5,200,000	5,614,237.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	5,000,000	5,414,660.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	5,600,000	6,182,029.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	8,900,000	10,701,062.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	7,160,000	8,126,374.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	7,600,000	8,650,852.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	5,750,000	6,739,783.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	3,400,000	3,980,989.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	6,300,000	7,522,315.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	1,900,000	2,228,433.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	5,300,000	6,165,253.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	4,300,000	4,943,103.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	9,400,000	10,653,756.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	12,200,000	14,079,483.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	4,600,000	6,728,728.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	2,100,000	3,283,028.07	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	2,200,000	3,198,994.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	1,780,000	2,394,524.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	4,150,000	6,524,592.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	3,050,000	4,511,021.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	5,900,000	8,294,540.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	3,900,000	5,056,203.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	3,800,000	5,186,915.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	4,900,000	7,229,140.03	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	1,500,000	1,768,003.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	7,500,000	7,643,742.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	5,500,000	5,605,526.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	10,000,000	10,325,205.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	11,200,000	11,629,545.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	1,700,000	1,711,571.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,610,432.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	12,000,000	12,272,955.60	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	12,500,000	12,718,457.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	8,600,000	8,779,998.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	7,500,000	7,997,175.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	4,200,000	4,335,156.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	5,200,000	5,347,696.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	6,300,000	6,376,308.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	5,000,000	5,113,643.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	6,790,000	6,842,942.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	5,700,000	5,784,570.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	3,300,000	3,300,942.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	6,950,000	6,837,792.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	5,100,000	4,828,823.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	6,900,000	7,032,935.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-22/03/01	2,400,000	2,467,084.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-22/09/01	500,000	529,205.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	1,000,000	999,758.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	10,905,428.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	4,300,000	4,300,411.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	4,100,000	4,921,286.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	5,600,000	6,259,568.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	6,500,000	6,476,154.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	5,700,000	6,026,503.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	6,200,000	6,374,175.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	2,300,000	2,172,764.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	3,700,000	3,045,627.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	5,500,000	5,137,869.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	3,200,000	2,984,827.52	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	1,350,000	1,426,093.69	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	1,540,000	1,705,788.23	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,180,000	1,235,842.67	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,520,000	1,747,207.32	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	2,200,000	2,645,615.72	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	2,070,000	2,361,302.82	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,200,000	1,380,374.04	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	2,520,000	3,031,751.52	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	9,400,000	9,764,189.84	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	8,100,000	8,565,451.11	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	8,400,000	9,029,547.24	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	8,750,000	9,441,631.50	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	8,160,000	8,788,256.35	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	14,300,000	15,638,960.48	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	11,500,000	13,441,186.20	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	6,000,000	6,765,928.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	6,000,000	6,943,535.40	

FRANCE (GOVT OF) -4.0%-18/04/25	4,900,000	5,641,899.20	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-18/10/25	1,800,000	2,106,298.26	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-19/04/25	9,400,000	11,029,367.80	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-19/10/25	1,050,000	1,531,473.93	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-19/10/25	5,600,000	6,398,879.76	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-20/04/25	6,400,000	7,204,722.56	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-20/10/25	2,300,000	2,414,553.11	
FRANCE (GOVT OF) -3.75%-21/04/25	10,600,000	12,102,307.26	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-21/10/25	5,500,000	6,042,458.95	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-22/04/25	2,300,000	2,465,940.86	
FRANCE (GOVT OF) -8.5%-23/04/25	4,000,000	6,309,596.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	4,700,000	5,548,305.82	
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	4,600,000	6,331,532.00	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	1,370,000	1,843,890.26	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	5,100,000	7,217,690.85	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	4,500,000	5,723,327.25	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	3,250,000	3,752,450.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	7,500,000	9,391,047.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	2,500,000	2,917,665.50	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	3,600,000	4,206,906.72	
FRANCE(GOVT OF) -3.5%-26/04/25	5,000,000	5,473,324.00	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	3,610,000	3,714,082.43	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	3,700,000	3,877,954.83	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	1,200,000	1,259,357.04	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,671,691.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	5,300,000	5,629,408.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	4,750,000	5,017,669.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	3,820,000	4,126,582.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	5,100,000	5,753,039.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	5,800,000	6,798,586.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	3,200,000	3,720,664.32	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	3,750,000	4,405,837.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	3,500,000	4,016,506.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000	2,370,617.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,600,000	3,043,033.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	1,800,000	2,738,527.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	2,700,000	3,783,444.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	3,750,000	4,715,925.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,550,000	3,152,338.81	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	2,600,000	2,693,132.26	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	2,150,000	2,301,585.53	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	2,400,000	2,550,833.04	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	2,750,000	2,985,611.47	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	2,900,000	3,277,251.43	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,800,000	1,987,565.22	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	1,550,000	1,802,224.52	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	2,600,000	3,080,118.86	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	2,700,000	3,200,742.27	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	3,080,000	3,582,215.25	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	3,300,000	3,746,698.89	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,250,000	1,431,791.62	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	2,050,000	2,599,656.25	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	1,650,000	2,393,735.19	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	2,700,000	3,294,470.61	

	国債証券小計	788,080,000	873,339,176.36 (90,713,740,248)	
ユーロ合計			873,339,176.36 (90,713,740,248)	
合計			223,980,927,942 (223,980,927,942)	

(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 95銘柄	100.0%	41.5%
加ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	2.8%
豪ドル	国債証券 15銘柄	100.0%	1.6%
英ポンド	国債証券 31銘柄	100.0%	8.1%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 181銘柄	100.0%	40.5%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

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23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		64,127,913	129,235,946
コール・ローン		725,396,721	53,843,740
国債証券		26,450,255,507	27,812,499,897
派生商品評価勘定		192,302,571	2,294,420
未収入金		185,434,457	
未収利息		290,392,138	286,621,739
前払費用		29,301,442	14,648,832
流動資産合計		27,937,210,749	28,299,144,574
資産合計		27,937,210,749	28,299,144,574
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		341,783,049	997,052,890
未払解約金		1,023,347	2,320,490
流動負債合計		342,806,396	999,373,380
負債合計		342,806,396	999,373,380
純資産の部			
元本等			
元本		21,844,897,199	20,550,735,931
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,749,507,154	6,749,035,263
元本等合計		27,594,404,353	27,299,771,194
純資産合計		27,594,404,353	27,299,771,194
負債純資産合計		27,937,210,749	28,299,144,574

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (追加情報)

当期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

## (貸借対照表に関する注記)

		平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
1.	期首	平成22年10月27日	平成23年10月27日
	期首元本額	24,647,191,029円	21,844,897,199円
	期首からの追加設定元本額	2,252,487,323円	1,154,740,736円
	期首からの一部解約元本額	5,054,781,153円	2,448,902,004円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	489,921,232円	630,254,056円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,258,683円	7,004,522円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	9,172,905円	8,008,779円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	22,267,796円	19,454,343円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	57,014,826円	49,145,308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	17,515,781,536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	63,372,276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	84,712,607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	72,124,344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	53,077,042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	2,047,801,118円
	計	21,844,897,199円	20,550,735,931円
2.	受益権の総数	21,844,897,199口	20,550,735,931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)

## I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日	自 平成23年10月27日 至 平成24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

	平成23年10月26日現在	平成24年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）  
（平成23年10月26日現在）  
売買目的有価証券

（単位：円）

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

（平成24年10月26日現在）  
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	608,918,075
合計	608,918,075

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成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git	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	

(平成24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	27,361,253,810		28,356,012,280	994,758,470
	米ドル	11,553,656,584		11,786,676,550	233,019,966
	加ドル	813,436,499		833,230,620	19,794,121
	豪ドル	449,206,344		463,136,800	13,930,456
	英ポンド	2,145,914,072		2,251,273,940	105,359,868
	スイスフラン	105,868,463		112,223,800	6,355,337
	シンガポールドル	99,622,687		103,426,730	3,804,043
	マレーシアリングgit	184,848,275		194,325,920	9,477,645
	スウェーデンクローナ	158,577,407		163,114,080	4,536,673
	ノルウェークローネ	75,152,023		77,985,210	2,833,187
	デンマーククローネ	244,274,824		259,020,750	14,745,926
	メキシコペソ	221,328,120		225,238,780	3,910,660
	ポーランドズロチ	208,726,380		215,207,340	6,480,960
南アフリカランド	164,096,420		161,802,000	2,294,420	
ユーロ	10,936,545,712		11,509,349,760	572,804,048	
合計	27,361,253,810		28,356,012,280	994,758,470	

(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23年10月26日現在		平成24年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.2632円	1口当たり純資産額	1.3284円
( 1万口当たり純資産額 )	( 12,632円 )	( 1万口当たり純資産額 )	( 13,284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-3.125%-13/09/30	1,100,000	1,129,648.43	
		US TREASURY N/B-0.5%-13/10/15	1,000,000	1,002,734.37	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	760,000	792,121.87	
		US TREASURY N/B-0.25%-13/11/30	2,300,000	2,300,269.53	
		US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	1,220,000	1,238,109.37	
		US TREASURY N/B-0.125%-13/12/31	1,000,000	998,671.87	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/01/31	1,000,000	1,000,000.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	2,500,000	2,621,679.68	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/02/28	1,450,000	1,449,773.43	
		US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	1,600,000	1,633,625.00	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/03/31	2,100,000	2,099,261.71	
		US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	2,300,000	2,355,164.06	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/04/30	2,500,000	2,498,437.50	
		US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	1,730,000	1,849,478.12	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/05/31	2,500,000	2,498,242.18	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	1,100,000	1,142,882.81	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/06/30	3,000,000	2,997,656.25	
		US TREASURY N/B-0.625%-14/07/15	1,100,000	1,106,101.56	
		US TREASURY N/B-0.125%-14/07/31	2,000,000	1,993,437.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	210,000	224,864.06	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	1,000,000	1,037,890.62	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/08/31	650,000	649,187.50	
		US TREASURY N/B-0.25%-14/09/15	1,150,000	1,148,832.03	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	600,000	623,765.62	
		US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	900,000	936,984.37	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	700,000	756,054.68	
US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	1,450,000	1,504,148.43			
US TREASURY N/B-0.25%-14/12/15	300,000	299,437.50			

US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	1,000,000	1,049,687.50	
US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	550,000	687,156.25	
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	1,300,000	1,408,164.06	
US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	670,000	701,275.39	
US TREASURY N/B-0.375%-15/03/15	600,000	599,953.12	
US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	500,000	525,742.18	
US TREASURY N/B-0.375%-15/04/15	500,000	499,882.81	
US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	1,580,000	1,729,359.37	
US TREASURY N/B-0.25%-15/05/15	2,000,000	1,992,343.75	
US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	1,400,000	1,462,125.00	
US TREASURY N/B-0.25%-15/07/15	1,500,000	1,493,085.93	
US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	1,700,000	1,761,757.81	
US TREASURY N/B-0.25%-15/08/15	1,000,000	995,234.37	
US TREASURY N/B-1.25%-15/08/31	600,000	613,968.75	
US TREASURY N/B-1.25%-15/10/31	1,650,000	1,689,960.93	
US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	1,250,000	1,402,050.78	
US TREASURY N/B-1.375%-15/11/30	1,000,000	1,027,968.75	
US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	1,100,000	1,156,804.68	
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	430,000	486,135.15	
US TREASURY N/B-2.0%-16/04/30	1,300,000	1,366,015.62	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	220,000	255,406.25	
US TREASURY N/B-1.5%-16/06/30	2,000,000	2,067,187.50	
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	1,460,000	1,694,740.62	
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	1,800,000	1,964,250.00	
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	1,000,000	1,098,906.25	
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	1,160,000	1,345,237.50	
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000	1,084,843.75	
US TREASURY N/B-0.875%-16/11/30	3,000,000	3,027,890.62	
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	1,250,000	1,383,300.78	
US TREASURY N/B-0.875%-16/12/31	1,000,000	1,008,593.75	
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	1,430,000	1,576,575.00	
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	1,170,000	1,299,705.46	
US TREASURY N/B-1.0%-17/03/31	2,000,000	2,024,843.75	
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	1,050,000	1,161,726.56	
US TREASURY N/B-0.875%-17/04/30	1,500,000	1,509,375.00	
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	820,000	958,310.93	
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	1,000,000	1,091,562.50	
US TREASURY N/B-0.625%-17/05/31	1,500,000	1,492,031.25	
US TREASURY N/B-0.75%-17/06/30	1,200,000	1,199,156.25	
US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	2,300,000	2,471,960.93	
US TREASURY N/B-1.875%-17/09/30	1,750,000	1,840,371.09	
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	480,000	561,187.50	
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	250,000	283,652.34	
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	200,000	231,843.75	
US TREASURY N/B-2.375%-18/06/30	700,000	753,812.50	
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	770,000	901,561.71	
US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	850,000	872,910.15	
US TREASURY N/B-1.75%-18/10/31	700,000	728,273.43	
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	200,000	231,718.75	
US TREASURY N/B-1.375%-18/11/30	600,000	610,640.62	
US TREASURY N/B-1.375%-18/12/31	700,000	711,648.43	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	1,660,000	1,825,870.31	
US TREASURY N/B-1.5%-19/03/31	1,000,000	1,021,718.75	
US TREASURY N/B-1.25%-19/04/30	2,600,000	2,613,406.25	

		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	1,050,000	1,180,511.71	
		US TREASURY N/B-0.875%-19/07/31	1,050,000	1,026,046.87	
		US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,900,000	2,200,437.50	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	1,300,000	1,485,656.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	550,000	638,214.84	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	1,300,000	1,499,164.06	
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000	603,525.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	1,100,000	1,197,367.18	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	310,000	337,076.56	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	400,000	466,187.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	1,500,000	1,687,148.43	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000	1,494,936.71	
		US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	1,350,000	1,386,492.18	
		US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	2,950,000	3,019,140.62	
		US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	950,000	1,425,445.31	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,680,000	2,395,575.00	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	970,000	1,393,617.18	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	880,000	1,298,756.25	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	660,000	904,870.31	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	130,000	199,428.12	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	190,000	247,534.37	
		US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	300,000	405,304.68	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	350,000	449,093.75	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	1,540,000	1,720,107.81	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000	1,862,196.87	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000	128,718.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	300,000	401,179.68	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,630,000	2,099,898.43	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	770,000	915,578.12	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	550,000	695,320.31	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	650,000	838,347.65	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000	232,593.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	700,000	724,554.68	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	2,850,000	2,946,632.81	
	国債証券小計		134,110,000	144,948,011.72 (11,633,527,420)	
米ドル合計				144,948,011.72 (11,633,527,420)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-13/11/01	750,000	752,970.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	1,370,000	1,409,949.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	480,000	488,208.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	650,000	671,417.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	1,050,000	1,147,839.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-16/09/01	400,000	420,564.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	300,000	334,257.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	500,000	573,630.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	350,000	396,613.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	750,000	845,055.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	300,000	334,602.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	500,000	537,150.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	150,000	257,512.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000	411,628.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	910,000	1,328,845.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000	262,840.00	

	国債証券小計		8,940,000	10,173,080.90 (820,967,628)	
加ドル合計				10,173,080.90 (820,967,628)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	1,050,000	1,110,377.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	520,000	565,162.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	780,000	886,351.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	1,000,000	1,138,652.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	970,000	1,165,944.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	300,000	365,160.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	200,000	227,981.00	
	国債証券小計		4,820,000	5,459,628.39 (453,640,522)	
豪ドル合計				5,459,628.39 (453,640,522)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.25%-14/03/07	250,000	256,769.88	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	480,000	522,245.87	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	220,000	231,811.80	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	950,000	1,069,208.88	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	1,710,000	1,935,351.44	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	860,000	1,042,659.13	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	830,000	1,001,021.50	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	690,000	853,548.87	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	570,000	865,481.27	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	450,000	526,568.79	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,980,000	2,598,118.26	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	870,000	1,280,790.28	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	730,000	891,059.81	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	360,000	434,668.06	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	620,000	806,672.51	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	590,000	740,161.87	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,000,000	1,205,547.13	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000	684,479.49	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	250,000	294,012.76	
	国債証券小計		13,970,000	17,240,177.60 (2,231,223,784)	
英ポンド合計				17,240,177.60 (2,231,223,784)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	450,000	538,546.05	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	350,000	403,954.95	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000	188,011.18	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000	145,054.40	
	国債証券小計		1,040,000	1,275,566.58 (109,520,146)	
スイスフラン合計				1,275,566.58 (109,520,146)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	600,000	678,720.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000	478,280.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-21/06/01	100,000	108,313.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	250,000	298,400.00	
	国債証券小計		1,350,000	1,563,713.33 (102,814,151)	
シンガポールドル合計				1,563,713.33 (102,814,151)	

マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	300,000	304,305.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	1,700,000	1,770,125.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000	2,244,582.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	600,000	636,300.00	
	国債証券小計		4,750,000	4,955,312.80 (130,622,045)	
マレーシアリングット合計				4,955,312.80 (130,622,045)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	2,250,000	2,454,385.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	3,460,000	3,724,482.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	1,500,000	1,777,380.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	3,100,000	3,932,644.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	1,100,000	1,387,904.10	
	国債証券小計		11,410,000	13,276,796.50 (158,790,486)	
スウェーデンクローナ合計				13,276,796.50 (158,790,486)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	1,900,000	2,068,309.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	1,600,000	1,789,132.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	1,000,000	1,168,008.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	400,000	456,825.60	
	国債証券小計		4,900,000	5,482,276.00 (76,203,636)	
ノルウェークローネ合計				5,482,276.00 (76,203,636)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	2,750,000	2,896,311.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	750,000	837,196.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	4,000,000	4,677,360.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000	2,171,451.60	
		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	1,950,000	2,220,457.20	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	650,000	1,037,533.90	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,750,000	4,007,528.25	
	国債証券小計		14,650,000	17,847,838.45 (248,441,911)	
デンマーククローネ合計				17,847,838.45 (248,441,911)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	9,000,000	9,866,331.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000	7,043,446.98	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	4,000,000	5,558,265.92	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000	7,446,298.74	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000	5,573,183.80	
	国債証券小計		29,500,000	35,487,526.44 (218,958,038)	
メキシコペソ合計				35,487,526.44 (218,958,038)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	2,650,000	2,678,665.05	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	800,000	852,320.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,800,000	2,939,300.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	1,700,000	1,863,200.00	
	国債証券小計		7,950,000	8,333,485.05 (208,670,465)	
ポーランドズロチ合計				8,333,485.05 (208,670,465)	

南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-13.5%-15/09/15	3,300,000	3,998,220.27	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%-20/01/15	4,500,000	4,703,557.95	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	7,000,000	8,655,012.80	
	国債証券小計		14,800,000	17,356,791.02 (159,682,477)	
南アフリカランド合計				17,356,791.02 (159,682,477)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	900,000	967,963.95	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	1,000,000	1,093,397.40	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	720,000	866,064.31	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	100,000	113,972.43	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	950,000	1,064,632.41	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	900,000	1,024,746.39	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000	494,927.01	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	910,000	1,149,748.32	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-14/01/31	200,000	203,224.28	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.75%-14/07/30	1,490,000	1,530,691.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-15/07/30	600,000	606,925.62	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	2,900,000	2,837,093.78	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	830,000	864,662.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	450,000	436,025.52	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	560,000	547,420.77	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	1,620,000	1,561,758.73	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	500,000	499,140.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	400,000	362,901.32	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	930,000	908,996.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,280,000	939,815.68	
		BUNDES OBLIGATION-4.0%-13/10/11	900,000	933,821.64	
		BUNDES OBLIGATION-1.75%-15/10/09	350,000	366,149.24	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	800,000	839,913.68	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	1,340,000	1,433,970.98	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	1,340,000	1,446,745.87	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	1,100,000	1,191,225.31	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	530,000	585,084.96	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	1,790,000	2,031,593.61	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	430,000	489,456.14	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	520,000	609,510.82	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	250,000	292,719.85	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	2,350,000	2,805,943.24	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	1,610,000	1,888,304.27	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	450,000	517,301.55	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	400,000	453,351.32	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-21/01/04	350,000	383,201.45	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	1,150,000	1,327,164.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	200,000	197,873.98	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	720,000	1,053,192.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	610,000	886,994.04	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	870,000	1,286,750.35	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	910,000	1,179,780.78	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	600,000	818,986.62	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	250,000	368,833.67	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%-20/09/04	350,000	376,878.21	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	500,000	589,334.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-13/11/01	700,000	703,088.40			

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	400,000	407,666.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-14/04/01	400,000	404,811.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	2,000,000	2,065,041.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	1,530,000	1,588,679.01	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	1,640,000	1,677,303.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	1,490,000	1,516,040.13	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	900,000	918,837.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	1,300,000	1,386,177.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	280,000	289,010.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	1,500,000	1,542,604.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	510,000	516,177.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	600,000	604,678.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	1,400,000	1,377,397.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	2,280,000	2,158,768.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	1,300,000	1,299,685.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	430,000	571,173.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,100,000	1,229,558.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	1,050,000	1,046,147.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	550,000	581,504.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	400,000	411,237.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,000,000	944,680.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	610,000	502,117.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,000,000	932,758.60	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	150,000	158,454.85	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	200,000	221,530.94	
FINNISH GOVERNMENT-1.875%-17/04/15	300,000	316,375.80	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	200,000	229,895.70	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	160,000	192,408.41	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	350,000	399,254.10	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	300,000	360,922.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	640,000	664,795.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	1,280,000	1,353,552.76	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	900,000	967,451.49	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	810,000	874,025.31	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	1,170,000	1,260,080.87	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	1,260,000	1,377,978.33	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	1,340,000	1,566,190.39	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	1,300,000	1,465,951.11	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	900,000	1,036,267.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	1,150,000	1,349,337.55	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000	860,542.49	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	370,000	422,783.12	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	250,000	281,434.47	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	1,300,000	1,364,747.41	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	1,380,000	1,575,583.39	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	1,350,000	1,483,149.01	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	1,150,000	1,357,564.19	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	700,000	963,494.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	660,000	888,297.49	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	540,000	764,226.09	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	830,000	1,055,635.91	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,160,000	1,339,336.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000	373,461.18	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	200,000	233,717.04	

	FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	800,000	823,065.36	
	FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	850,000	888,086.29	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-1.0%-14/01/15	500,000	505,622.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	730,000	775,371.32	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	1,020,000	1,101,862.44	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	860,000	970,120.42	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	620,000	720,878.71	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	750,000	860,679.97	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	620,000	725,646.45	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	420,000	588,535.79	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	650,000	817,427.06	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	150,000	185,431.69	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	740,000	792,173.62	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	450,000	488,554.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	320,000	361,627.74	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	670,000	793,722.93	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	1,000,000	1,185,460.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	300,000	348,917.07	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	250,000	283,840.82	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	200,000	229,086.66	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	500,000	725,374.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	300,000	366,052.29	
	国債証券小計	98,570,000	108,399,318.27 (11,259,437,188)	
ユーロ合計			108,399,318.27 (11,259,437,188)	
合計			27,812,499,897 (27,812,499,897)	

(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 116銘柄	100.0%	41.6%
加ドル	国債証券 16銘柄	100.0%	3.0%
豪ドル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.6%
英ポンド	国債証券 19銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 3銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 123銘柄	100.0%	40.5%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。



## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2012年11月30日現在です。

## 【純資産額計算書】

資産総額	523,230,805 円
負債総額	2,300,091 円
純資産総額( - )	520,930,714 円
発行済口数	514,537,661 口
1口当たり純資産額( / )	1.0124 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	25,147,994,076 円
負債総額	113,454,158 円
純資産総額( - )	25,034,539,918 円
発行済口数	40,208,978,035 口
1口当たり純資産額( / )	0.6226 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	65,412,614,213 円
負債総額	142,885,275 円
純資産総額( - )	65,269,728,938 円
発行済口数	65,902,340,092 口
1口当たり純資産額( / )	0.9904 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	1,277,760,405 円
負債総額	20,932,649 円
純資産総額( - )	1,256,827,756 円
発行済口数	1,442,163,564 口
1口当たり純資産額( / )	0.8715 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	31,691,364,410 円
負債総額	133,892,888 円
純資産総額( - )	31,557,471,522 円
発行済口数	25,075,034,386 口

1口当たり純資産額( / )

1.2585 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	230,034,091,248 円
負債総額	493,270,107 円
純資産総額( - )	229,540,821,141 円
発行済口数	145,703,427,066 口
1口当たり純資産額( / )	1.5754 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	28,939,928,731 円
負債総額	1,440,029,240 円
純資産総額( - )	27,499,899,491 円
発行済口数	20,439,564,882 口
1口当たり純資産額( / )	1.3454 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24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ないます。

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24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24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24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	435	69,713
株式投資信託	370	55,949
単位型	44	1,228
追加型	326	54,721
公社債投資信託	65	13,763
単位型	48	563
追加型	17	13,200
投資法人合計	1	32

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「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53期事業年度（平成23年4月1日から平成24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52期 (平成23年 3月31日)		第53期 (平成24年 3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	21,290	3	17,352
前払費用		330		332
未収入金		4		1
未収委託者報酬		6,173		5,872
未収収益	3	422	3	543
関係会社短期貸付金		-		33
立替金		504		1,094
繰延税金資産		1,142		1,084
その他	2	30	2	30
流動資産合計		29,897		26,345
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67	1	66
器具備品	1	147	1	137
有形固定資産合計		215		203
無形固定資産				
ソフトウェア		101		72
無形固定資産合計		101		72
投資その他の資産				
投資有価証券		7,030		3,002
関係会社株式		16,225		24,320
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		962		774
繰延税金資産		868		723
投資その他の資産合計		25,147		28,880
固定資産合計		25,463		29,156
資産合計		55,361		55,502

	第52期 (平成23年3月31日)		第53期 (平成24年3月31日)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金		150		194
未払金		3,354		3,086
未払収益分配金		8		7
未払償還金		181		129
未払手数料	3	2,870	3	2,486
その他未払金		294		462
未払費用	3	3,253	3	2,807
未払法人税等		945		1,295
未払消費税等		108		281
賞与引当金		2,149		2,039
役員賞与引当金		237		105
流動負債合計		10,199		9,809
<b>固定負債</b>				
退職給付引当金		818		907
その他		55		55
固定負債合計		874		963
負債合計		11,073		10,773
<b>純資産の部</b>				
<b>株主資本</b>				
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		-
資本剰余金合計		5,225		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		21,703		22,172
利益剰余金合計		21,703		22,172
自己株式		68		68
株主資本合計		44,224		44,687
<b>評価・換算差額等</b>				
その他有価証券評価差額金		63		42
評価・換算差額等合計		63		42
純資産合計		44,287		44,729
負債純資産合計		55,361		55,502



## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（単位：百万円）

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,650	56,698
その他営業収益	2,581	2,025
営業収益合計	55,231	58,724
営業費用		
支払手数料	26,518	29,251
広告宣伝費	803	673
公告費	13	3
調査費	11,373	11,397
調査費	698	719
委託調査費	10,654	10,660
図書費	20	18
委託計算費	335	348
営業雑経費	557	577
通信費	176	206
印刷費	287	247
協会費	41	43
諸会費	8	9
その他	43	70
営業費用計	39,601	42,252
一般管理費		
給料	7,045	6,991
役員報酬	239	237
役員賞与引当金繰入額	237	105
給料・手当	4,391	4,508
賞与	27	101
賞与引当金繰入額	2,149	2,039
交際費	73	74
寄付金	140	111
旅費交通費	389	328
租税公課	133	145
不動産賃借料	921	749
退職給付費用	305	307
退職金	12	8
固定資産減価償却費	175	143
諸経費	2,953	3,110
一般管理費計	12,149	11,971
営業利益	3,480	4,500

	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2		15
受取配当金	1	1,071	1	757
有価証券償還益		29		19
時効成立分配金・償還金		8		35
その他		10		18
営業外収益合計		1,121		846
営業外費用				
支払利息		10		10
時効成立後支払分配金・償還金		34		77
支払源泉所得税		106		74
為替差損		1		35
弁護士報酬等		-		180
その他		0		4
営業外費用合計		153		381
経常利益		4,448		4,965
特別利益				
投資有価証券売却益		49		1
子会社投資損失引当金戻入額		576		-
その他		23		-
特別利益合計		649		1
特別損失				
投資有価証券売却損		0		0
固定資産処分損		4		6
役員退職一時金		-		369
過年度敷金償却費用		58		-
特別損失合計		62		376
税引前当期純利益		5,034		4,590
法人税、住民税及び事業税		1,134		1,795
法人税等調整額		705		224
法人税等合計		1,839		2,020
当期純利益		3,195		2,570

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	4
当期変動額		
自己株式の処分	-	4
当期変動額合計	-	4
当期末残高	4	-
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,225
当期変動額		
自己株式の処分	-	4
当期変動額合計	-	4
当期末残高	5,225	5,220
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	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	-	599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172
利益剰余金合計		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	-	599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172

	第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
自己株式		
当期首残高	53	68
当期変動額		
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,700
当期変動額合計	14	-
当期末残高	68	68
株主資本合計		
当期首残高	41,349	44,224
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,095
当期変動額合計	2,874	463
当期末残高	44,224	44,687
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	57	21
当期末残高	63	42
評価・換算差額等合計		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	57	21
当期末残高	63	42
純資産合計		
当期首残高	41,470	44,287
当期変動額		
剰余金の配当	305	1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	14	8,700
自己株式の処分	-	8,095
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	57	21
当期変動額合計	2,817	441
当期末残高	44,287	44,729

## 重要な会計方針

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 4年～5年 器具備品 4年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 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。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

## 追加情報

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
<p>「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」等の適用 当事業年度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>	

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 971百万円</p> <p>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>現金・預金 10,013百万円</p> <p>未収収益 31百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 24百万円</p> <p>未払費用 226百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,012百万円</p> <p>器具備品 590百万円</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。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 5,802百万円</p> <p>未収収益 217百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 42百万円</p> <p>未払費用 259百万円</p> <p>4 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務110百万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138百万円に対して保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 1,066百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 743百万円</p>

## （株主資本等変動計算書関係）

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	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 新株予約権等に関する事項

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)
			当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
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

## 第53期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	14,283,400	14,283,400	109,600

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であり、自己株式の減少は、自己株式の処分であります。

## 3 新株予約権等に関する事項

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)
			当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
提出会社	平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	19,328,100	-	112,200	19,215,900	-
	平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,702,800	-	26,400	1,676,400	-
	平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
	第1回新株予約権	普通株式	-	2,955,200	-	2,955,200	-
	平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	-	6,101,700	9,900	6,091,800	-
合計			23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	-

(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)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

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

4 平成23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、減少は新株予約権の失効によるものであります。

5 平成21年度ストックオプション(1)9,837,300株、平成21年度ストックオプション(2)871,200株、平成22年度ストックオプション(1)1,155,000株、第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。



## 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24年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19日

## (リース取引関係)

第52期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		第53期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	731百万円	1年内	740百万円
1年超	2,234百万円	1年超	1,548百万円
合計	2,966百万円	合計	2,288百万円

## (金融商品関係)

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、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

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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24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	17,352	17,352	-
(2) 未収委託者報酬	5,872	5,872	-
(3) 未収収益	543	543	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	2,854	2,854	-
(5) 関係会社株式 関連会社株式	1,404	1,615	210
(6) 未払金	(3,086)	(3,086)	-
(7) 未払費用	(2,807)	(2,807)	-

( )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20,023百万円）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	17,352	-	-	-
未収委託者報酬	5,872	-	-	-
未収収益	543	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	362	479	439
合計	23,768	362	479	439

## （有価証券関係）

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

第53期(自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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
関連会社株式	1,404	1,615	210
合 計	1,404	1,615	210

(注) 子会社株式（貸借対照表計上額20,023百万円）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	35	7	28
	そ の 他	1,177	999	177
	小 計	1,212	1,006	206
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,642	1,784	141
	小 計	1,642	1,784	141
合 計		2,854	2,790	64

(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	112	1	0
合 計	112	1	0

(持分法損益等)

第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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 4,703 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,054	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 4,407 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927

## (退職給付関係)

第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)																																																
<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ 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 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>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">165</td> </tr> <tr> <td>ホ 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 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 数理計算上の差異の費用処理額	30	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165	ホ 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 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 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;">985</td> </tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">985</td> </tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">77</td> </tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">907</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;">97</td> </tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td> <td style="text-align: right;">14</td> </tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">27</td> </tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">168</td> </tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">307</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;">1.4%</td> </tr> <tr> <td>ハ 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	985	ロ 未積立退職給付債務	985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	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	1.4%	ハ 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 数理計算上の差異の費用処理額	30																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165																																																
ホ 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 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	985																																																
ロ 未積立退職給付債務	985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
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	1.4%																																																
ハ 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52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)
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)	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。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
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) 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) 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

## 第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24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)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社の従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

## (2) ストックオプション(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	19,328,100	1,702,800
付与	0	0
失効	112,200	26,400
権利確定	0	0
権利未確定残	19,215,900	1,676,400
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	-
付与	0	6,101,700
失効	0	9,900
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	6,091,800
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額

当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

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

## (税効果会計関係)

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <p>賞与引当金繰入超過額 886</p> <p>その他 255</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">1,142</p> <p>繰延税金資産(固定)</p> <p>投資有価証券等評価損 60</p> <p>関係会社株式評価損 185</p> <p>退職給付引当金超過額 333</p> <p>固定資産減価償却超過額 234</p> <p>その他 99</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">912</p> <p>繰延税金資産合計 2,054</p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <p>その他有価証券評価差額金 43</p> <p>繰延税金負債合計 43</p> <p>繰延税金資産の純額 2,010</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/>	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <p>賞与引当金繰入超過額 775</p> <p>その他 309</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">1,084</p> <p>繰延税金資産(固定)</p> <p>投資有価証券等評価損 52</p> <p>関係会社株式評価損 205</p> <p>退職給付引当金超過額 329</p> <p>固定資産減価償却超過額 190</p> <p>その他 28</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p style="text-align: right;">806</p> <p>繰延税金資産小計 1,890</p> <p>評価性引当金 61</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p>繰延税金資産合計 1,829</p> <p>繰延税金負債(固定)</p> <p>その他有価証券評価差額金 22</p> <p>繰延税金負債合計 22</p> <p>繰延税金資産の純額 1,807</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/>
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.6%</p> <p>(調整)</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 2.7%</p> <p>受取配当金等永久に益金に算入されない項目 7.3%</p> <p>海外子会社の留保利益の影響額等 0.5%</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.5%</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.6%</p> <p>(調整)</p> <p>交際費等永久に損金に算入されない項目 2.5%</p> <p>受取配当金等永久に益金に算入されない項目 5.6%</p> <p>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 3.8%</p> <p>海外子会社の留保利益の影響額等 2.7%</p> <hr style="width: 100px; margin-left: auto; margin-right: 0;"/> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 44.0%</p>

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
	<p>3 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成24年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.0%、平成27年4月1日以降のものについては35.6%にそれぞれ変更されております。</p> <p>その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債を控除した金額）が170百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が174百万円、その他有価証券評価差額金額が4百万円、それぞれ増加しております。</p>



## （関連当事者情報）

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24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(注)3	大阪市中央区	342,037	信託銀行業	(被所有)直接 91.34(注)2	投資信託受益証券の募集販売	自己株式の取得(注)1	8,700	-	-

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 当社株式14,283,400株を1株につき609.10円で取得したものであります。
- 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。
- 3 住友信託銀行株式会社は、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社及び中央三井アセット信託銀行株式会社を吸収合併し、三井住友信託銀行株式会社に社名を変更しております。

## (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 (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)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール 国	252,000	アセットマ ネジメント 業	直接 100.00	-	増資の引受 (注1)	8,095	-	-
							株式売買代金 相当額の引受 (注2)	8,095	-	-

## (注) 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137,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。なお、Nikko Asset Management Singapore Limitedは、当事業年度中にNikko Asset Management International Limited に社名を変更しております。
- DBS Asset Management Ltd(現社名Nikko Asset Management Asia Limited)株式の売買代金相当額をNikko Asset Management Singapore Limited(現社名Nikko Asset Management International Limited)から当社が受領したものであります。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

住友信託銀行株式会社(非上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成23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	9,309百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	8,206百万円
営業収益	7,961百万円
税引前当期純利益	2,868百万円
当期純利益	2,181百万円

## （セグメント情報等）

### セグメント情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

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

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

### 関連情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

#### 1 製品及びサービスごとの情報

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

#### 2 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

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

##### （2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

#### 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

## （ 1株当たり情報 ）

	第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり純資産額	224円92銭	227円16銭
1株当たり当期純利益金額	16円22銭	13円09銭

(注) 1 潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載していません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-	-
普通株式に係る当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,926	196,278
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後 1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 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	平成21年度ストックオプション(1) 19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2) 1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 6,091,800株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (平成23年 3月31日)	第53期 (平成24年 3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	44,287	44,729
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	44,287	44,729
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	196,903	196,903

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

- 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54期中間会計期間(平成24年4月1日から平成24年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。  
なお、当社の監査法人は次のとおり、交代しております。  
第53期事業年度 あらた監査法人  
第54期中間会計期間 有限責任 あずさ監査法人

## 中間財務諸表等

## ( 1 ) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第54期中間会計期間  
(平成24年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		14,955
未収委託者報酬		4,974
未収収益		529
関係会社短期貸付金		63
繰延税金資産		473
その他	2	1,096
流動資産合計		22,092
固定資産		
有形固定資産	1	208
無形固定資産		73
投資その他の資産		
投資有価証券		3,794
関係会社株式		24,340
関係会社長期貸付金		313
長期差入保証金		770
繰延税金資産		779
投資その他の資産合計		29,996
固定資産合計		30,279
資産合計		52,371



(単位：百万円)

第54期中間会計期間  
(平成24年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	2,741
未払費用	2,622
未払法人税等	124
未払消費税等	3 112
賞与引当金	810
役員賞与引当金	105
その他	291
流動負債合計	6,807
固定負債	
退職給付引当金	952
その他	55
固定負債合計	1,007
負債合計	7,814
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	22,055
利益剰余金合計	22,055
自己株式	68
株主資本合計	44,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	14
評価・換算差額等合計	14
純資産合計	44,585
負債純資産合計	52,371

## ( 2 ) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第54期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
営業収益		
委託者報酬		24,943
その他営業収益		928
営業収益合計		25,872
営業費用及び一般管理費	1	24,332
営業利益		1,540
営業外収益	2	577
営業外費用	3	70
経常利益		2,047
特別損失	4	1
税引前中間純利益		2,046
法人税、住民税及び事業税		106
法人税等調整額		586
中間純利益		1,352

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

		第54期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24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		17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高		5,220
当中間期末残高		5,220
資本剰余金合計		
当期首残高		5,220
当中間期末残高		5,220
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		22,172
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,468
中間純利益		1,352
当中間期変動額合計		116
当中間期末残高		22,055
利益剰余金合計		
当期首残高		22,172
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,468
中間純利益		1,352
当中間期変動額合計		116
当中間期末残高		22,055

(単位：百万円)

第54期中間会計期間  
 (自 平成24年 4月 1日  
 至 平成24年 9月30日)

自己株式	
当期首残高	68
当中間期末残高	68
株主資本合計	
当期首残高	44,687
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,468
中間純利益	1,352
当中間期変動額合計	116
当中間期末残高	44,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	42
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)	56
当中間期変動額合計	56
当中間期末残高	14
評価・換算差額等合計	
当期首残高	42
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)	56
当中間期変動額合計	56
当中間期末残高	14
純資産合計	
当期首残高	44,729
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,468
中間純利益	1,352
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	56
当中間期変動額合計	172
当中間期末残高	44,556

## 会計方針の変更等

<p>第54期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p>
<p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年 4月 1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。</p>

## 重要な会計方針

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24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 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 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。</p>
4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第54期中間会計期間 (平成24年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,625百万円
2 信託資産	
その他流動資産のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	
3 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。	
4 保証債務	
当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務91百万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37百万円に対して保証を行っております。	

## （中間損益計算書関係）

第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	44百万円
無形固定資産	12百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	4百万円
受取配当金	570百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	9百万円
時効成立後支払分配金・償還金	1百万円
支払源泉所得税	55百万円
4 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54期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	6,091,800	-	158,400	5,933,400	-
合計		32,249,300	-	2,445,300	29,804,000	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション(1)9,837,300株、平成21年度ストックオプション(2)871,200株、平成22年度ストックオプション(1)1,155,000株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年5月28日取締役会	普通株式	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19日

(2) 基準日が当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54期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	740百万円
1年超	1,178百万円
合計	1,918百万円

## (金融商品関係)

## 第54期中間会計期間(平成24年9月30日)

## 1 金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注)2をご参照ください。)

(単位:百万円)

	中間貸借対照表 計上額( )	時価( )	差額
(1) 現金及び預金	14,955	14,955	-
(2) 未収委託者報酬	4,974	4,974	-
(3) 未収収益	529	529	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	3,646	3,646	-
(5) 関係会社株式 関連会社株式	1,404	1,523	119
(6) 未払金	(2,741)	(2,741)	-
(7) 未払費用	(2,622)	(2,622)	-

( )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20,042百万円)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54期中間会計期間(平成24年9月30日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
関連会社株式	1,404	1,523	119
合計	1,404	1,523	119

（注）子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）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

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株式	29	7	22
	その他	1,670	1,505	165
	小計	1,700	1,512	187
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	1,946	2,157	211
	小計	1,946	2,157	211
	合計	3,646	3,670	23

（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54期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	4,297百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	6,089百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	323百万円

(ストックオプション等関係)

第54期中間会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第54期中間会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

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

関連情報

第54期中間会計期間(自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## （ 1株当たり情報 ）

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり純資産額	226円28銭
1株当たり中間純利益金額	6円86銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載していません。

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	
中間純利益（百万円）	1,352
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-
普通株式に係る中間純利益（百万円）	1,352
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション（1）16,978,500株、平成21年度ストックオプション（2）1,626,900株、平成22年度ストックオプション（1）2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション（1）5,933,400株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期中間会計期間 (平成24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）	44,556
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	44,556
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,903

## （ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常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24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24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	
ソニー生命保険株式会社 1	70,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
三井生命保険株式会社	167,280百万円	
信金中央金庫	490,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。  
委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日  
ファンドの基本的性格など  
委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など  
委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など  
目論見書の使用開始日
- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。  
投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。  
投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。  
投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。  
「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。  
「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。  
請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。  
請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。  
「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。  
商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。  
投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。  
有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。  
委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」、「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。  
ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。  
投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。  
分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する旨の記載。



## 独立監査人の監査報告書

平成24年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### 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23年10月27日から平成24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。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の平成24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。

#### 利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成24年6月15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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

(注) 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24年12月7日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### 有限責任あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 羽太典明指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 秋宗勝彦

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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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。