

## 【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23年 1月26日
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）
【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20）（以下「ファンド」といいます。）
- ・愛称として「Aナビ20」、「ステージ4」、「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23年1月27日から平成24年1月26日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**(8) 【申込取扱場所】**

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

**(9) 【払込期日】**

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

**(10) 【払込取扱場所】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

**(11) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

**(12) 【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的に安定的な信託財産の成長をめざします。

###### ファンドの基本的性格

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 追加型投信

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

###### 内外

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

###### 資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））  
当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行いません。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。  
「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

## ファンドの特色

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



## 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、中長期的に安定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日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※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・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## 3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

- 資産の標準実質組入比率は、株式20%、債券など80%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	15%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.5%
日本債券インデックスマザーファンド	65%
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

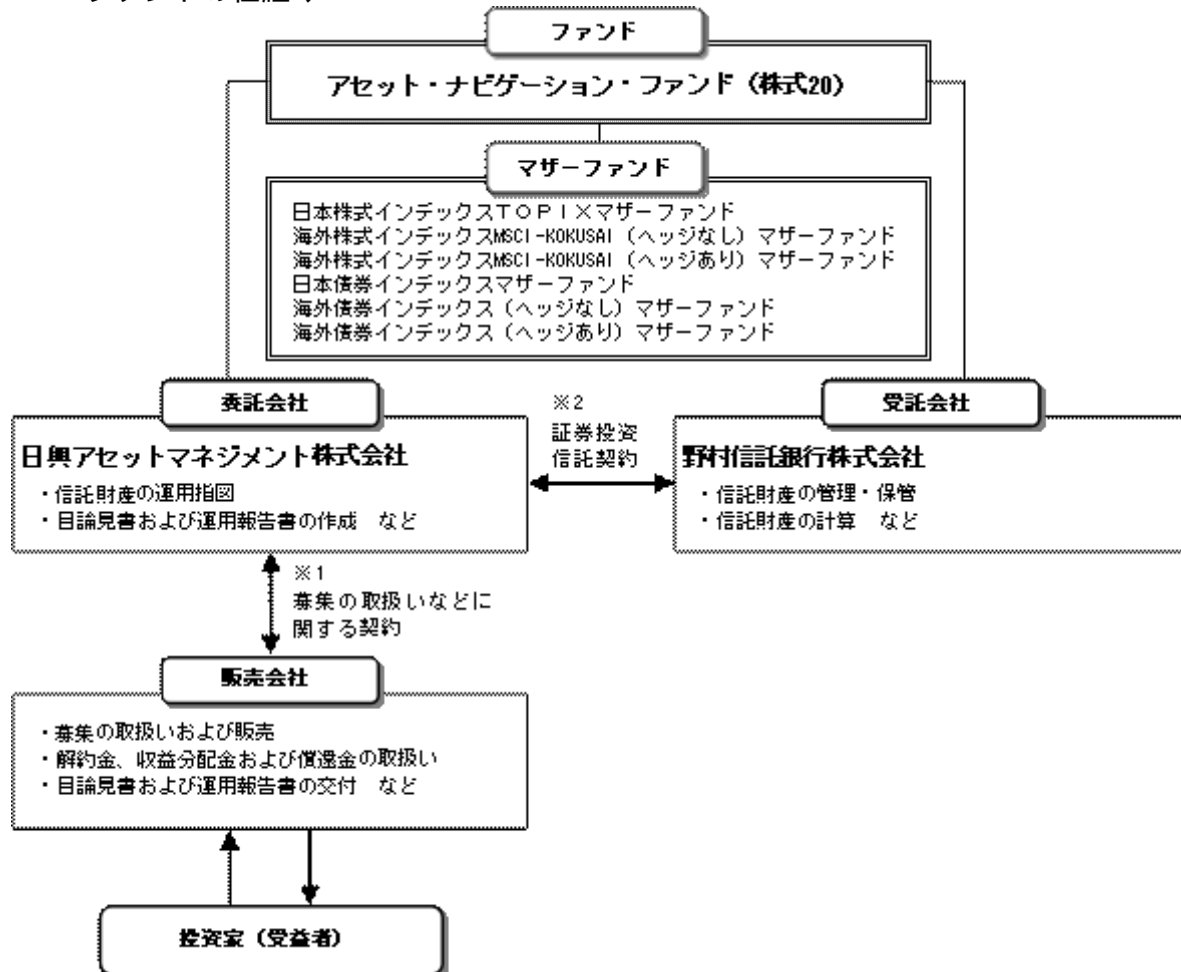
平成13年6月1日 ファンド名称変更

新名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）

旧名称：アセット・ナビゲーション・ファンド（ステージ4）

## (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（平成22年11月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
住友信託銀行株式会社	大阪府大阪市中央区北浜四丁目5番33号	194,152,500株	98.54%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

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

株式の標準実質組入比率.....20%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....80%

- 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20）&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、）

## 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せん。)
  - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
    - 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
      - 1) 預金
      - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
      - 3) コール・ローン
      - 4) 手形割引市場において売買される手形
      - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
      - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
    - 次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡し取引
      - 5) 為替先渡し取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引

< 海外株式インデックスMSCI -KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド >  
 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定める

ものをいいます。）

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
- 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本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの

- 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

#### < 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))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) 金利先渡し取引
  - 4) 為替先渡し取引
  - 5) 有価証券の貸付
  - 6) 公社債の空売
  - 7) 公社債の借入
  - 8) 外国為替予約取引

#### < 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

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

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

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

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡し取引
- 4) 為替先渡し取引
- 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B B B格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## &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;

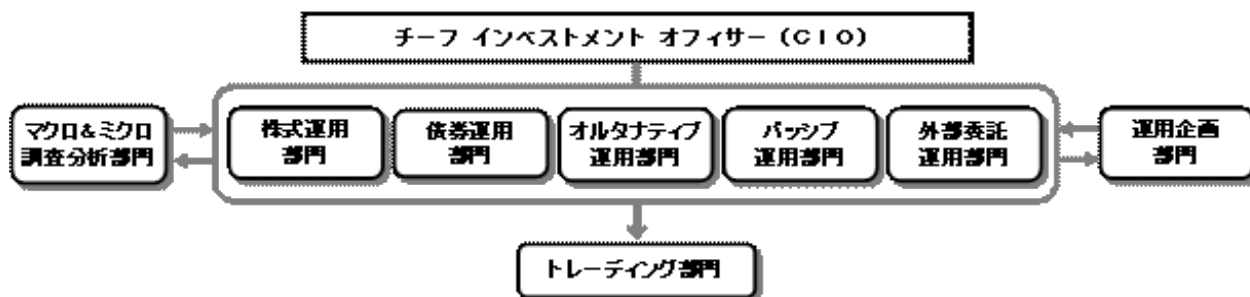
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取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

<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。（ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。

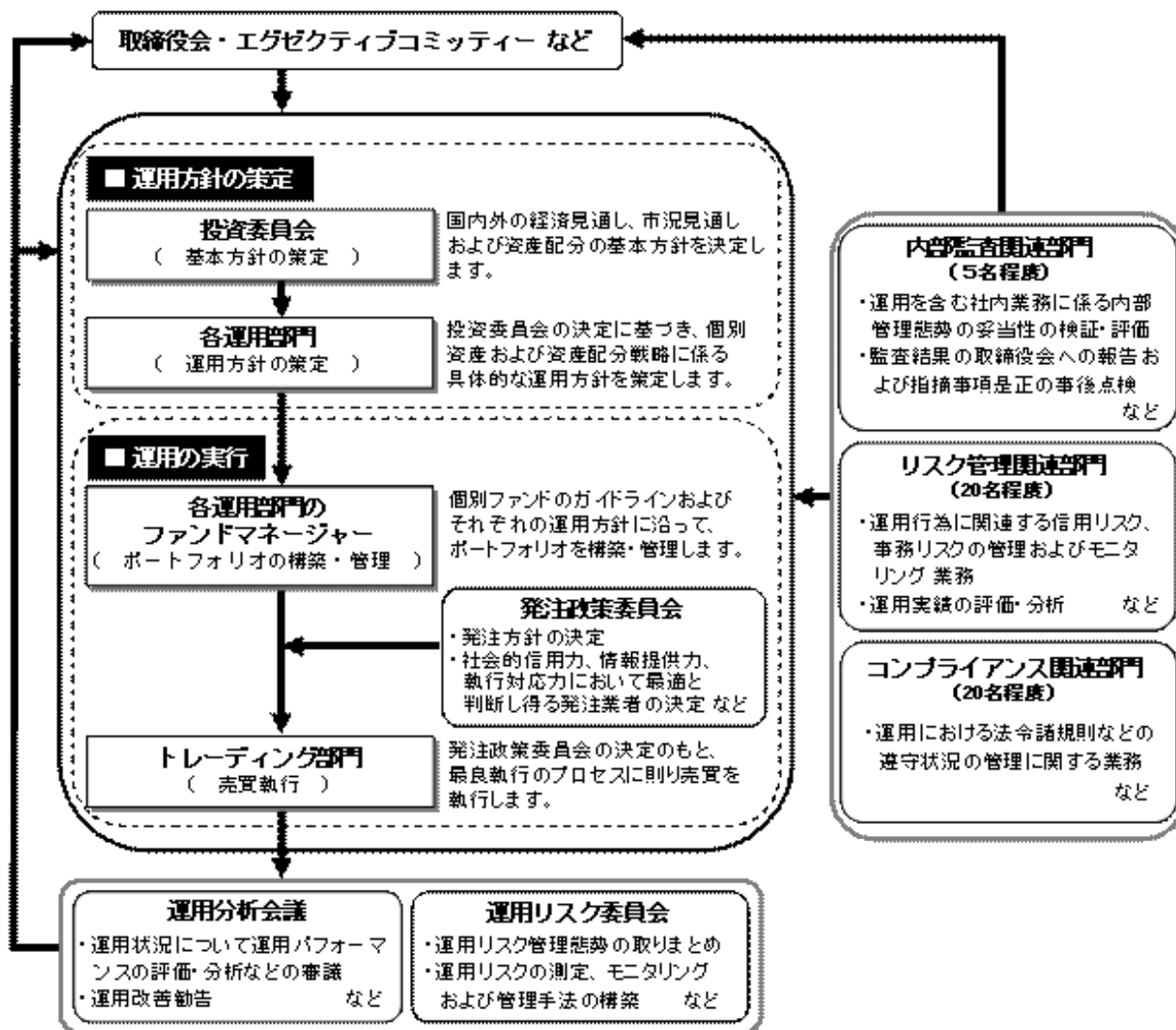
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成22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20）>

- 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30%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 14) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
  - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
  - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
  - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
  - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

<日本株式インデックストップIXマザーファンド>

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



- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

## &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;

- 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。

## &lt; 日本債券インデックスマザーファンド &gt;

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

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

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

#### < 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

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

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

< 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

- ・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。
- ・したがって、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 に帰属します。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### <その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

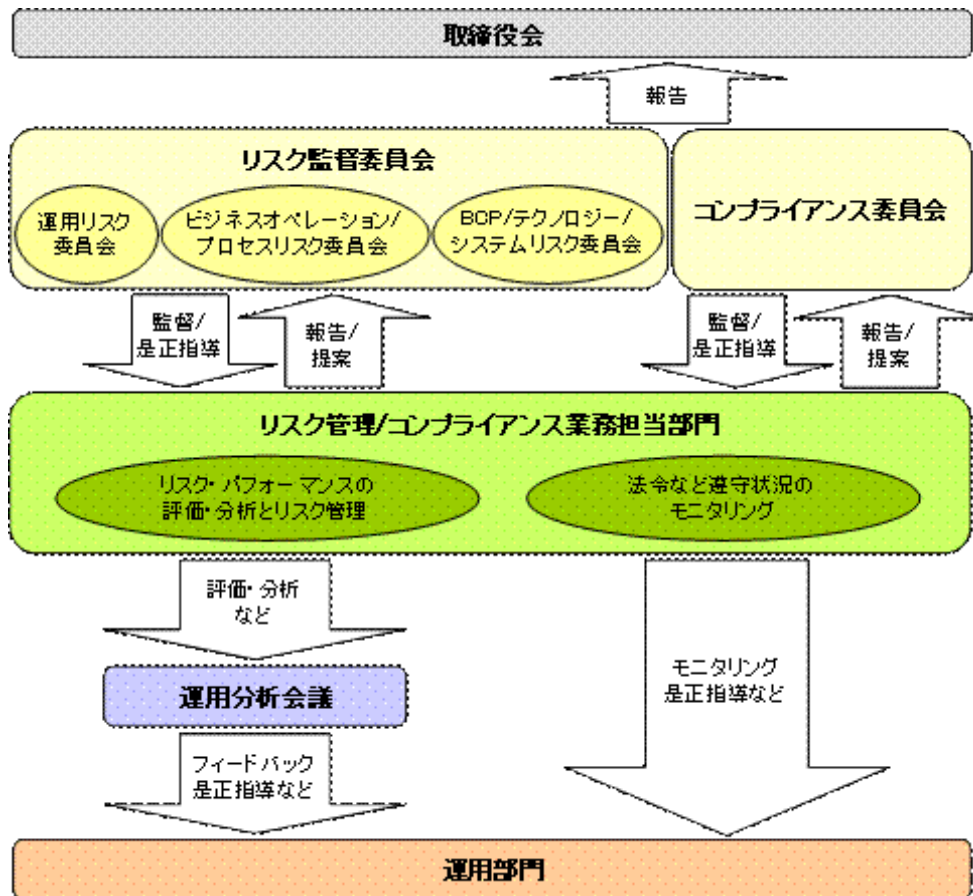
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴なう基準価額変動に関する事項

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

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

## (2) リスク管理体制



## 全社的リスク管理

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

## リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

## 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成22年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0.15%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0.56175%（税抜0.535%）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
0.56175% (0.535%)	0.21000% (0.200%)	0.31500% (0.300%)	0.03675% (0.035%)

括弧内は税抜です。

支払時期

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

## (4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

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

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

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

- ・収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもで



きます。

- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

## 2) 解約金および償還金に対する課税

- ・解約時および償還時の差益（譲渡益）<sup>\*</sup>については譲渡所得として、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

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

## 法人受益者の場合

### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

- ・収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、平成23年12月31日までは軽減税率が適用され、7%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
- ・なお、平成24年1月1日以降は、上記の7%の税率は15%（所得税のみ）となる予定です。

### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 個別元本

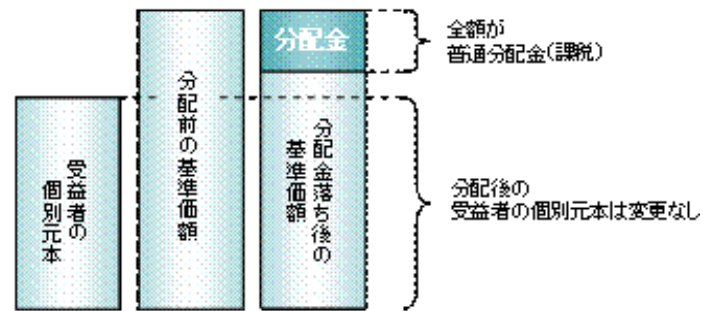
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

## 普通分配金と特別分配金

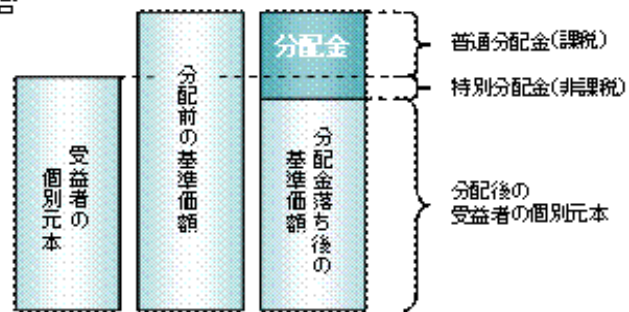
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本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

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

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

## 5【運用状況】

以下の運用状況は2010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	1,566,327,362	95.17
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		79,445,066	4.83
合計(純資産総額)		1,645,772,428	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	887,417,153	1.2180	1,080,933,866	1.2025	1,067,119,126	64.84
日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデックスT O P I Xマ ザーファンド	387,611,622	0.6205	240,513,012	0.6532	253,187,911	15.38
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	56,790,086	1.4488	82,277,585	1.4372	81,618,711	4.96
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	66,839,760	1.2477	83,400,931	1.2204	81,571,243	4.96
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	48,191,463	0.8474	40,837,446	0.8641	41,642,243	2.53
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	54,388,127	0.7654	41,628,673	0.7573	41,188,128	2.50

## 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	95.17
合計	95.17

## 【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2計算期間末	2001年10月26日	515	515	0.9922	0.9932
第3計算期間末	2002年10月28日	2,799	2,799	0.9713	0.9713
第4計算期間末	2003年10月27日	2,702	2,702	1.0005	1.0005
第5計算期間末	2004年10月26日	2,922	2,925	1.0248	1.0258
第6計算期間末	2005年10月26日	2,690	2,693	1.0817	1.0827
第7計算期間末	2006年10月26日	2,463	2,465	1.1224	1.1234
第8計算期間末	2007年10月26日	2,364	2,366	1.1378	1.1388
第9計算期間末	2008年10月27日	1,918	1,918	0.9939	0.9939
第10計算期間末	2009年10月26日	1,756	1,757	1.0701	1.0711
第11計算期間末	2010年10月26日	1,652	1,653	1.0808	1.0818
	2009年11月末日	1,733	-	1.0604	-
	12月末日	1,748	-	1.0774	-
	2010年 1月末日	1,736	-	1.0718	-
	2月末日	1,729	-	1.0712	-
	3月末日	1,736	-	1.0922	-
	4月末日	1,734	-	1.1004	-
	5月末日	1,688	-	1.0764	-
	6月末日	1,675	-	1.0729	-
	7月末日	1,677	-	1.0805	-
	8月末日	1,656	-	1.0739	-
	9月末日	1,667	-	1.0857	-
	10月末日	1,650	-	1.0772	-
	11月末日	1,645	-	1.0783	-

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第2期	2000年10月27日～2001年10月26日	0.0010
第3期	2001年10月27日～2002年10月28日	0
第4期	2002年10月29日～2003年10月27日	0
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	0.0010
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	0.0010
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	0.0010

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第2期	2000年10月27日～2001年10月26日	0.06
第3期	2001年10月27日～2002年10月28日	2.11
第4期	2002年10月29日～2003年10月27日	3.01
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	2.53
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	5.65
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	3.86
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	1.46
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	12.65
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	7.77
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	1.09

(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2期	2000年10月27日～2001年10月26日	539,592,129	30,803,391
第3期	2001年10月27日～2002年10月28日	2,568,988,011	205,891,060
第4期	2002年10月29日～2003年10月27日	480,545,520	662,276,969
第5期	2003年10月28日～2004年10月26日	843,953,479	692,709,451
第6期	2004年10月27日～2005年10月26日	654,720,494	1,019,223,298
第7期	2005年10月27日～2006年10月26日	424,810,979	717,630,199
第8期	2006年10月27日～2007年10月26日	357,052,529	473,882,665
第9期	2007年10月27日～2008年10月27日	226,415,655	373,642,661
第10期	2008年10月28日～2009年10月26日	162,320,929	451,875,313
第11期	2009年10月27日～2010年10月26日	122,706,122	234,789,317

## (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2010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	30,808,811,947	98.92
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		334,937,726	1.08
合計(純資産総額)		31,143,749,673	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	265,980,000	0.85

(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	343,800	2,866.00	985,330,800	3,220.00	1,107,036,000	3.55
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,999,000	379.95	759,520,050	396.00	791,604,000	2.54
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	225,800	2,904.52	655,840,616	3,010.00	679,658,000	2.18
日本	株式	キヤノン	電気機器	166,300	3,705.00	616,141,500	3,945.00	656,053,500	2.11
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	199,800	2,400.84	479,687,832	2,569.00	513,286,200	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	211,500	1,972.82	417,251,430	2,116.00	447,534,000	1.44
日本	株式	ソニー	電気機器	150,300	2,741.04	411,978,312	2,971.00	446,541,300	1.43
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,221,900	118.94	383,212,786	133.00	428,512,700	1.38
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	112,700	3,663.93	412,924,911	3,790.00	427,133,000	1.37
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	105,000	3,814.70	400,543,500	3,890.00	408,450,000	1.31
日本	株式	東京電力	電気・ガス業	197,100	1,895.76	373,654,296	1,950.00	384,345,000	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	15,300	21,545.01	329,638,653	22,730.00	347,769,000	1.12
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	117,000	2,632.27	307,975,590	2,900.00	339,300,000	1.09
日本	株式	ファナック	電気機器	27,900	11,132.71	310,602,609	11,990.00	334,521,000	1.07
日本	株式	パナソニック	電気機器	265,000	1,201.86	318,492,900	1,204.00	319,060,000	1.02
日本	株式	小松製作所	機械	132,800	1,917.47	254,640,016	2,318.00	307,830,400	0.99
日本	株式	三井物産	卸売業	228,000	1,298.78	296,121,840	1,307.00	297,996,000	0.96
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	2,183	133,900.00	292,303,700	135,800.00	296,451,400	0.95
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	556,400	436.58	242,913,112	482.00	268,184,800	0.86
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	338,100	726.29	245,558,649	785.00	265,408,500	0.85
日本	株式	三菱地所	不動産業	185,000	1,475.90	273,041,500	1,412.00	261,220,000	0.84
日本	株式	日立製作所	電気機器	601,000	353.00	212,153,000	396.00	237,996,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	100,200	2,275.00	227,955,000	2,367.00	237,173,400	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	46,500	5,040.00	234,360,000	5,000.00	232,500,000	0.75
日本	株式	東芝	電気機器	528,000	405.00	213,840,000	436.00	230,208,000	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	110,500	1,896.08	209,516,840	2,045.00	225,972,500	0.73
日本	株式	三菱電機	電気機器	267,000	727.25	194,175,750	829.00	221,343,000	0.71
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	109,200	1,956.96	213,700,032	2,013.00	219,819,600	0.71

日本	株式	新日本製鐵	鉄鋼	735,000	264.00	194,040,000	277.00	203,595,000	0.65
日本	株式	KDDI	情報・通信業	410	427,000.00	175,070,000	478,500.00	196,185,000	0.63

## 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	0.09
		鉱業	0.49
		建設業	1.97
		食料品	2.99
		繊維製品	0.87
		パルプ・紙	0.37
		化学	5.73
		医薬品	4.18
		石油・石炭製品	0.84
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	1.25
		鉄鋼	2.34
		非鉄金属	1.31
		金属製品	0.64
		機械	4.87
		電気機器	15.09
		輸送用機器	9.96
		精密機器	1.43
		その他製品	2.13
		電気・ガス業	4.87
		陸運業	3.54
		海運業	0.64
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	5.71
		卸売業	5.22
		小売業	3.55
銀行業	8.94		
証券、商品先物取引業	1.52		
保険業	2.48		
その他金融業	0.70		
不動産業	2.35		
サービス業	1.66		
合計			98.92

### 投資不動産物件

該当事項はありません。



その他投資資産の主要なもの  
< 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 2010年12月	買建	31	日本円	253,302,519	265,980,000	0.85

(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2010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	36,733,984,987	52.43
	カナダ	3,937,280,619	5.62
	ドイツ	2,841,829,019	4.06
	イタリア	876,357,919	1.25
	フランス	3,119,904,018	4.45
	オーストラリア	2,794,971,576	3.99
	イギリス	7,191,229,318	10.26
	スイス	2,866,637,763	4.09
	バミューダ	115,651,370	0.17
	香港	1,020,453,571	1.46
	シンガポール	570,862,489	0.81
	ニュージーランド	30,417,935	0.04
	オランダ	831,984,725	1.19
	スペイン	1,116,424,880	1.59
	ベルギー	314,537,802	0.45
	スウェーデン	1,062,745,718	1.52
	ノルウェー	236,803,037	0.34
	オーストリア	113,631,056	0.16
	ルクセンブルグ	177,889,500	0.25
	フィンランド	374,231,270	0.53
	デンマーク	343,977,928	0.49
	アイルランド	378,595,130	0.54
	ギリシャ	87,453,562	0.12
	キプロス	7,961,590	0.01
	イスラエル	262,582,416	0.37
	ポルトガル	94,557,755	0.13
	中国	2,335,788	0.00
	ケイマン島	34,858,988	0.05
	モーリシャス	8,847,665	0.01
	ジャージー	111,932,350	0.16
	ガーンジー	17,130,887	0.02
	小計	67,678,062,631	96.59
投資証券	アメリカ	598,964,541	0.85
	カナダ	98,235,694	0.14
	フランス	88,568,915	0.13
	オーストラリア	177,880,042	0.25
	イギリス	96,453,951	0.14
	香港	24,966,663	0.04
	シンガポール	16,848,085	0.02
	オランダ	11,043,043	0.02
	小計	1,112,960,934	1.59
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,276,720,286	1.82
合計(純資産総額)		70,067,743,851	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	874,880,606	1.25
	買建	ドイツ	482,975,570	0.69

(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		505,769,240	0.72

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産  
投資有価証券の主要銘柄  
イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	203,426	5,578.67	1,134,847,337	5,852.55	1,190,561,141	1.70
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	36,321	26,025.95	945,288,413	26,702.63	969,866,402	1.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービ ス	314,824	2,122.76	668,296,203	2,132.87	671,479,829	0.96
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	138,403	4,476.86	619,610,992	4,700.28	650,533,198	0.93
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	51,182	11,784.32	603,144,902	12,041.34	616,299,879	0.88
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル用品	114,949	5,354.52	615,496,236	5,235.70	601,837,916	0.86
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	698,891	876.35	612,472,568	854.57	597,252,441	0.85
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	110,089	5,391.59	593,555,257	5,217.16	574,351,453	0.82
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	426,148	1,353.38	576,738,560	1,345.79	573,506,526	0.82
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	80,176	7,151.99	573,418,343	6,884.02	551,932,890	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	235,856	2,389.90	563,671,594	2,334.28	550,553,707	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	158,805	3,123.89	496,089,176	3,194.68	507,330,474	0.72
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービ ス	9,801	51,952.45	509,186,011	49,054.41	480,782,269	0.69
オースト リア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	133,621	3,398.89	454,162,840	3,521.03	470,483,977	0.67
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	197,045	2,167.42	427,080,140	2,292.14	451,655,514	0.64
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	321,955	1,484.84	478,050,825	1,395.51	449,291,808	0.64
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	82,656	5,141.31	424,960,342	5,341.88	441,538,044	0.63
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,102,320	216.46	455,075,545	208.99	439,354,753	0.63
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	747,968	561.49	419,978,945	561.82	420,224,260	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装 置	221,447	1,674.44	370,800,799	1,797.48	398,046,354	0.57
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	83,993	4,797.24	402,934,495	4,556.96	382,752,363	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	各種金融	399,329	940.45	375,550,235	953.09	380,597,954	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	227,365	1,989.61	452,368,746	1,638.21	372,471,343	0.53
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売 り	81,202	4,546.37	369,174,052	4,537.94	368,489,763	0.53
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービ ス	159,823	2,430.35	388,425,316	2,293.83	366,606,696	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	124,108	3,153.38	391,360,107	2,923.33	362,808,180	0.52
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	141,123	2,629.05	371,019,084	2,552.30	360,188,436	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	73,698	5,011.54	369,340,246	4,872.49	359,092,871	0.51

アメリカ	株式	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	54,364	5,775.02	313,953,355	6,488.79	352,756,579	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	64,181	5,481.76	351,825,063	5,394.12	346,200,189	0.49

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	金鉱	0.02
		エネルギー	10.80
		素材	7.74
		資本財	7.44
		商業・専門サービス	0.80
		運輸	2.32
		自動車・自動車部品	1.31
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	1.49
		メディア	2.50
		小売	2.81
		食品・生活必需品小売り	2.38
		食品・飲料・タバコ	6.38
		家庭用品・パーソナル用品	1.67
		ヘルスケア機器・サービス	2.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.22
		銀行	8.36
		各種金融	5.13
		保険	4.12
		不動産	0.77
		ソフトウェア・サービス	4.27
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.45		
電気通信サービス	4.20		
公益事業	3.91		
半導体・半導体製造装置	1.66		
投資証券		-	1.59
合計			98.18

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500 1012	買建	35	米ドル	10,554,625	874,880,606	1.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1012	買建	175	ユーロ	4,511,710	482,975,570	0.69

(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	5,285,000	428,456,510	445,185,000	0.64
	ユーロ	買建	548,000	60,774,584	60,584,240	0.09

(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2010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	601,420,826	52.48
	カナダ	64,043,337	5.59
	ドイツ	47,789,189	4.17
	イタリア	14,640,449	1.28
	フランス	52,062,832	4.54
	オーストラリア	46,583,399	4.06
	イギリス	117,566,141	10.26
	スイス	47,951,276	4.18
	バミューダ	1,823,965	0.16
	香港	15,626,860	1.36
	シンガポール	9,183,702	0.80
	オランダ	13,566,371	1.18
	スペイン	18,505,123	1.61
	ベルギー	6,542,506	0.57
	スウェーデン	16,902,088	1.47
	ノルウェー	5,541,803	0.48
	オーストリア	2,154,552	0.19
	ルクセンブルグ	2,434,588	0.21
	フィンランド	6,774,246	0.59
	デンマーク	5,130,173	0.45
	アイルランド	6,878,714	0.60
	ギリシャ	1,208,699	0.11
	イスラエル	2,618,345	0.23
	ポルトガル	420,628	0.04
ジャージー	2,621,139	0.23	
小計		1,109,990,951	96.86
投資証券	アメリカ	10,717,647	0.94
	カナダ	2,440,494	0.21
	フランス	1,134,110	0.10
	オーストラリア	1,653,623	0.14
	イギリス	1,022,550	0.09
	香港	924,691	0.08
	小計		17,893,115
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		18,120,673	1.58
合計(純資産総額)		1,146,004,739	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	9,998,635	0.87
	買建	ドイツ	5,519,720	0.48

(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		1,143,788,020	99.81

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	3,343	5,578.67	18,649,507	5,852.55	19,565,079	1.71
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	598	26,025.95	15,563,516	26,702.63	15,968,175	1.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	5,173	2,122.76	10,981,044	2,132.87	11,033,355	0.96
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	2,274	4,476.86	10,180,381	4,700.28	10,688,442	0.93
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	841	11,784.32	9,910,610	12,041.34	10,126,767	0.88
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	1,888	5,354.52	10,109,325	5,235.69	9,884,992	0.86
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	11,481	876.87	10,067,389	854.57	9,811,336	0.86
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	1,808	5,391.59	9,748,003	5,217.16	9,432,617	0.82
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	7,003	1,353.38	9,477,693	1,345.79	9,424,580	0.82
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	1,317	7,151.99	9,419,177	6,884.02	9,066,249	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	3,874	2,389.90	9,258,461	2,334.28	9,042,996	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	2,615	3,123.89	8,168,969	3,194.68	8,354,076	0.73
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	161	51,952.45	8,364,345	49,054.40	7,897,759	0.69
オースト リア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	2,207	3,398.89	7,501,346	3,521.03	7,770,920	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	3,254	2,167.42	7,052,798	2,292.14	7,458,636	0.65
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	5,287	1,484.84	7,850,335	1,395.51	7,378,067	0.64
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	1,361	5,141.31	6,997,326	5,341.88	7,270,292	0.63
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	34,522	217.64	7,513,512	208.99	7,214,602	0.63
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	12,313	562.35	6,924,164	561.82	6,917,703	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	3,659	1,674.44	6,126,793	1,797.48	6,576,976	0.57
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	1,383	4,797.24	6,634,581	4,556.96	6,302,269	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	各種金融	6,595	940.45	6,202,288	953.09	6,285,652	0.55
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	3,755	1,989.61	7,471,003	1,638.21	6,151,474	0.54
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	1,337	4,546.37	6,078,492	4,537.94	6,067,225	0.53
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	2,630	2,430.35	6,391,812	2,293.83	6,032,771	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	2,043	3,153.38	6,442,362	2,923.33	5,972,355	0.52
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	2,323	2,629.05	6,107,277	2,552.30	5,928,995	0.52
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	1,213	5,011.54	6,078,994	4,872.49	5,910,332	0.52
アメリカ	株式	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	895	5,775.02	5,168,645	6,488.79	5,807,467	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	1,057	5,481.76	5,794,224	5,394.12	5,701,587	0.50



## 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	11.07
		素材	7.25
		資本財	8.32
		商業・専門サービス	0.70
		運輸	2.30
		自動車・自動車部品	1.32
		耐久消費財・アパレル	1.31
		消費者サービス	1.58
		メディア	2.71
		小売	2.78
		食品・生活必需品小売り	2.14
		食品・飲料・タバコ	6.21
		家庭用品・パーソナル用品	1.54
		ヘルスケア機器・サービス	2.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.35
		銀行	8.32
		各種金融	5.09
		保険	4.01
		不動産	0.93
		ソフトウェア・サービス	4.34
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.28		
電気通信サービス	4.10		
公益事業	3.76		
半導体・半導体製造装置	1.78		
投資証券		-	1.56
合計			98.42

## 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	SP EMINI1012	買建	2	米ドル	118,280	9,998,635	0.87
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1012	買建	2	ユーロ	50,960	5,519,720	0.48

(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	売建	7,492,000	605,435,282	630,779,830	55.04
	加ドル	売建	807,000	64,453,210	66,671,120	5.82
	豪ドル	売建	606,000	48,170,776	49,139,460	4.29
	英ポンド	売建	929,000	119,589,109	121,736,790	10.62
	スイスフラン	売建	550,000	45,813,340	46,361,490	4.05
	香港ドル	売建	1,541,000	16,075,548	16,719,430	1.46
	シンガポールドル	売建	147,000	9,200,413	9,404,570	0.82
	スウェーデンクローネ	売建	1,400,000	17,086,872	16,856,320	1.47
	ノルウェークローネ	売建	406,000	5,620,080	5,544,860	0.48
	デンマーククローネ	売建	346,000	5,232,348	5,133,860	0.45
	イスラエルシェケル	売建	114,000	2,594,238	2,604,160	0.23
	ユーロ	売建	1,564,000	174,396,164	172,836,130	15.08

(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。

[次へ](#)

## (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2010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	27,147,876,910	73.84
地方債証券	日本	2,606,459,000	7.09
特殊債証券	日本	3,527,934,000	9.60
社債券	日本	3,120,311,984	8.48
	オーストラリア	101,159,000	0.28
	イギリス	100,721,000	0.27
	小計	3,322,191,984	9.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		162,325,549	0.44
合計(純資産総額)		36,766,787,443	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)	1.3	2019/03/20	750,000,000	105.21	789,090,000	102.69	770,175,000	2.09
日本	国債証券	第287回利付国債(2年)	0.3	2011/12/15	580,000,000	100.21	581,241,200	100.15	580,864,200	1.58
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	1.4	2022/12/20	545,000,000	102.77	560,112,850	99.90	544,438,650	1.48
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	0.5	2014/12/20	540,000,000	101.03	545,535,000	100.48	542,581,200	1.48
日本	国債証券	第69回利付国債(5年)	0.9	2012/12/20	483,000,000	101.62	490,839,090	101.45	489,989,010	1.33
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	0.8	2014/03/20	464,000,000	102.09	473,688,320	101.65	471,642,080	1.28
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1.4	2018/03/20	446,000,000	106.45	474,771,460	104.35	465,401,000	1.27
日本	国債証券	第64回利付国債(5年)	1.5	2012/06/20	417,000,000	102.25	426,386,670	102.03	425,481,780	1.16
日本	国債証券	第240回利付国債(10年)	1.3	2012/06/20	401,000,000	101.92	408,715,240	101.73	407,917,250	1.11
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	1.7	2016/12/20	377,000,000	107.99	407,110,990	106.57	401,780,210	1.09
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	1.7	2016/09/20	369,000,000	107.79	397,759,860	106.49	392,948,100	1.07
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.3	2019/12/20	373,000,000	104.53	389,881,980	101.81	379,762,490	1.03
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	1.5	2015/03/20	361,000,000	105.38	380,425,410	104.64	377,757,620	1.03
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1.4	2019/09/20	361,000,000	105.64	381,356,790	102.98	371,772,240	1.01
日本	国債証券	第290回利付国債(2年)	0.2	2012/03/15	362,000,000	100.11	362,394,580	100.04	362,137,560	0.98
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	1.3	2018/03/20	347,000,000	105.74	366,910,860	103.66	359,696,730	0.98

日本	国債証券	第261回利付国債(10年)	1.8	2014/06/20	340,000,000	105.76	359,597,600	105.17	357,574,600	0.97
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1.4	2018/12/20	333,000,000	106.21	353,679,300	103.71	345,360,960	0.94
日本	国債証券	第295回利付国債(10年)	1.5	2018/06/20	317,000,000	107.20	339,830,340	104.91	332,552,020	0.90
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1.5	2017/12/20	309,000,000	107.15	331,105,700	105.13	324,836,250	0.88
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	2.3	2026/06/20	300,000,000	110.98	332,934,000	107.38	322,131,000	0.88
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1.3	2018/12/20	301,000,000	105.43	317,356,340	102.92	309,801,240	0.84
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	0.5	2013/06/20	285,000,000	100.92	287,622,000	100.71	287,017,800	0.78
日本	国債証券	第239回利付国債(10年)	1.4	2012/06/20	275,000,000	102.09	280,742,000	101.88	280,167,250	0.76
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	2.4	2038/09/20	246,000,000	110.22	271,141,200	106.67	262,405,740	0.71
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1.5	2014/09/20	251,000,000	104.92	263,349,200	104.33	261,865,790	0.71
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1.7	2018/03/20	241,000,000	108.71	261,979,050	106.53	256,742,120	0.70
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	1.8	2018/06/20	236,000,000	109.45	258,294,920	107.12	252,791,400	0.69
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	1.9	2021/03/22	237,000,000	109.30	259,033,890	106.51	252,435,810	0.69
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	0.5	2015/03/20	245,000,000	101.02	247,496,550	100.40	245,980,000	0.67

## □.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	73.84
地方債証券	7.09
特殊債券	9.60
社債券	9.04
合 計	99.56

## 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2010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	239,510,149,708	41.07
	カナダ	16,342,396,618	2.80
	ドイツ	54,784,997,451	9.39
	イタリア	56,043,015,312	9.61
	フランス	53,436,378,202	9.16
	オーストラリア	5,855,400,077	1.00
	イギリス	45,124,301,443	7.74
	スイス	2,993,034,945	0.51
	シンガポール	2,220,301,641	0.38
	マレーシア	3,030,167,764	0.52
	オランダ	14,278,113,386	2.45
	スペイン	23,049,528,023	3.95
	ベルギー	15,129,187,240	2.59
	スウェーデン	3,797,178,381	0.65
	ノルウェー	1,443,462,160	0.25
	オーストリア	10,092,997,033	1.73
	フィンランド	3,300,503,697	0.57
	デンマーク	5,198,496,622	0.89
	メキシコ	5,422,657,700	0.93
	アイルランド	4,518,458,412	0.77
ポーランド	4,985,271,014	0.85	
ポルトガル	5,143,186,807	0.88	
	小計	575,699,183,636	98.72
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		7,476,395,320	1.28
合計(純資産総額)		583,175,578,956	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	買建		2,307,629,890	0.40

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率	償還期限	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	40,500,000	9,276.04	3,756,798,208	9,127.49	3,696,635,221	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2019/05/15	40,000,000	8,968.17	3,587,268,560	8,816.75	3,526,699,500	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	38,700,000	9,244.61	3,577,665,467	9,087.99	3,517,053,218	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	34,400,000	9,317.10	3,205,083,045	9,238.10	3,177,905,970	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2019/02/15	35,900,000	8,760.13	3,144,886,610	8,607.39	3,090,053,174	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.750	2018/11/15	32,800,000	9,419.81	3,089,696,347	9,277.60	3,043,052,902	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	33,500,000	9,084.04	3,043,154,288	8,933.94	2,992,868,800	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	29,000,000	9,584.38	2,779,471,511	9,463.26	2,744,344,720	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	29,000,000	9,135.39	2,649,264,459	8,977.39	2,603,442,646	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2015/02/28	29,000,000	8,916.82	2,585,877,618	8,828.60	2,560,293,773	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2012/07/31	27,700,000	9,074.17	2,513,544,331	9,014.26	2,496,949,067	0.43
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.500	2013/03/07	16,500,000	14,254.39	2,351,974,617	14,146.18	2,334,119,072	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2012/12/15	27,200,000	8,554.72	2,326,884,307	8,525.75	2,319,005,062	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	26,000,000	8,920.82	2,319,413,772	8,841.77	2,298,859,265	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2012/07/15	26,800,000	8,599.49	2,304,663,361	8,573.16	2,297,605,749	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2014/11/30	26,000,000	8,836.50	2,297,489,878	8,758.81	2,277,291,412	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	23,500,000	9,761.26	2,293,895,138	9,675.25	2,273,683,603	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2015/02/15	24,000,000	9,500.13	2,280,030,184	9,393.47	2,254,433,173	0.39
イギリス	国債証券	UK TREASURY	2.250	2014/03/07	16,500,000	13,607.91	2,245,305,567	13,453.91	2,219,895,266	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2011/11/30	26,000,000	8,470.95	2,202,446,615	8,463.87	2,200,605,712	0.38
イギリス	国債証券	UK TREASURY	5.000	2012/03/07	15,850,000	13,893.63	2,202,140,536	13,831.14	2,192,235,555	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/09/30	24,600,000	8,924.06	2,195,319,086	8,842.42	2,175,236,491	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2013/04/15	25,000,000	8,697.59	2,174,396,425	8,657.43	2,164,356,445	0.37

イタリ ア	国債証 券	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.000	2031/05/01	17,900,000	13,127.60	2,349,839,648	12,051.24	2,157,171,812	0.37
アメリ カ	国債証 券	US TREASURY N/B	4.625	2040/02/15	23,500,000	9,494.86	2,231,291,842	9,131.44	2,145,889,464	0.37
アメリ カ	国債証 券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	23,400,000	9,311.12	2,178,801,587	9,159.10	2,143,228,376	0.37
アメリ カ	国債証 券	US TREASURY N/B	1.000	2012/03/31	25,000,000	8,512.59	2,128,146,679	8,496.13	2,124,031,933	0.36
アメリ カ	国債証 券	US TREASURY N/B	2.375	2014/08/31	24,000,000	8,917.48	2,140,194,654	8,841.77	2,122,023,937	0.36
アメリ カ	国債証 券	US TREASURY N/B	4.000	2018/08/15	22,400,000	9,594.93	2,149,264,214	9,442.19	2,115,050,594	0.36
フラン ス	国債証 券	FRANCE (GOVT OF)	3.000	2015/10/25	18,360,000	11,633.13	2,135,842,517	11,500.00	2,111,400,141	0.36

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.72
合 計	98.72

### 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	買建	11,800,000	992,852,000	994,268,000	0.17
	加ドル	買建	646,000	53,216,188	53,475,880	0.01
	豪ドル	買建	729,000	59,050,458	59,347,890	0.01
	英ポンド	買建	1,108,000	145,211,156	145,347,440	0.02
	スイスフラン	買建	420,000	35,243,880	35,406,000	0.01
	スウェーデンクローネ	買建	1,175,000	14,101,175	14,170,500	0.00
	ノルウェークローネ	買建	1,128,000	15,365,616	15,442,320	0.00
	デンマーククローネ	買建	1,421,000	21,184,268	21,087,640	0.00
	メキシコペソ	買建	3,527,000	23,771,980	23,701,440	0.00
	ポーランドズロチ	買建	792,000	21,827,520	21,455,280	0.00
	ユーロ	買建	8,350,000	928,044,050	923,927,500	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) 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2010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	12,476,656,484	41.49
	カナダ	850,766,784	2.83
	ドイツ	2,847,988,887	9.47
	イタリア	2,947,911,979	9.80
	フランス	2,816,819,188	9.37
	オーストラリア	287,863,456	0.96
	イギリス	2,352,418,803	7.82
	スイス	171,889,569	0.57
	シンガポール	127,199,376	0.42
	マレーシア	180,748,265	0.60
	オランダ	722,618,264	2.40
	スペイン	1,196,478,219	3.98
	ベルギー	776,380,241	2.58
	スウェーデン	209,566,460	0.70
	ノルウェー	71,632,938	0.24
	オーストリア	535,849,993	1.78
	フィンランド	158,977,292	0.53
	デンマーク	257,815,721	0.86
	メキシコ	270,983,838	0.90
	アイルランド	212,766,546	0.71
ポーランド	242,049,205	0.80	
ポルトガル	251,706,419	0.84	
	小計	29,967,087,927	99.65
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		104,268,818	0.35
合計(純資産総額)		30,071,356,745	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		30,353,170,220	100.94

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率	償還期限	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	3,400,000	9,244.68	314,319,198	9,087.99	308,991,754	1.03
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.250	2015/07/04	2,300,000	11,881.37	273,271,446	11,808.73	271,600,891	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2017/07/31	2,900,000	8,728.53	253,127,328	8,579.74	248,812,441	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2013/04/15	2,750,000	8,697.59	239,183,606	8,657.43	238,079,208	0.79
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.500	2013/03/07	1,670,000	14,254.40	238,048,476	14,146.18	236,241,137	0.79
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2014/08/01	2,000,000	11,778.45	235,568,978	11,395.43	227,908,628	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2015/03/31	2,500,000	8,968.83	224,220,743	8,875.34	221,883,567	0.74
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.500	2018/08/01	1,900,000	11,915.91	226,402,222	11,241.19	213,582,677	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2012/01/31	2,500,000	8,479.34	211,983,488	8,478.02	211,950,571	0.70
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.500	2020/02/01	1,840,000	11,800.27	217,124,884	11,100.42	204,247,640	0.68
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.000	2018/04/25	1,700,000	12,234.39	207,984,690	11,971.32	203,512,466	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2015/02/15	2,100,000	9,500.13	199,502,640	9,393.47	197,262,901	0.66
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.000	2013/04/25	1,620,000	11,823.48	191,540,336	11,785.10	190,918,578	0.63
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	2028/01/04	1,310,000	14,982.62	196,272,369	14,426.49	188,986,956	0.63
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.750	2015/08/01	1,690,000	11,601.42	196,064,008	11,137.12	188,217,347	0.63
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.750	2020/03/07	1,290,000	15,069.87	194,401,289	14,581.28	188,098,567	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2014/02/15	2,000,000	9,359.24	187,184,737	9,273.65	185,473,001	0.62
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.750	2015/01/04	1,540,000	12,074.59	185,948,642	12,017.68	185,072,242	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2012/08/31	2,200,000	8,428.98	185,437,451	8,411.20	185,046,386	0.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.750	2012/10/25	1,530,000	11,853.49	181,358,414	11,817.26	180,804,004	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2013/06/30	2,000,000	9,091.28	181,825,691	9,021.50	180,429,969	0.60
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.150	2013/01/31	1,560,000	12,011.37	187,377,378	11,561.58	180,360,589	0.60
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.250	2013/08/01	1,580,000	11,705.23	184,942,558	11,398.03	180,088,799	0.60

ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.000	2012/07/04	1,520,000	11,812.19	179,545,358	11,788.20	179,180,677	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	2,000,000	9,084.04	181,680,850	8,933.94	178,678,734	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2012/05/31	2,100,000	8,482.96	178,142,171	8,467.82	177,824,183	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2015/04/30	2,000,000	8,968.17	179,363,428	8,870.73	177,414,684	0.59
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.000	2015/10/25	1,520,000	11,632.42	176,812,845	11,500.00	174,800,011	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2015/05/31	2,000,000	8,820.70	176,413,978	8,722.60	174,452,067	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2019/08/15	1,900,000	9,277.60	176,274,405	9,127.49	173,422,393	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	99.65
合計	99.65

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
 <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	148,705,000	12,025,235,571	12,517,347,520	41.63
	加ドル	売建	10,471,000	837,065,156	865,046,700	2.88
	豪ドル	売建	3,632,000	289,656,407	293,495,030	0.98
	英ポンド	売建	18,183,000	2,352,500,256	2,382,155,550	7.92
	スイスフラン	売建	2,138,000	178,645,760	180,208,880	0.60
	シンガポールドル	売建	2,006,000	125,472,677	128,325,760	0.43
	マレーシアリングット	売建	6,856,000	179,020,187	182,918,080	0.61
	スウェーデンクローネ	売建	18,058,000	218,039,605	217,155,900	0.72
	ノルウェークローネ	売建	5,358,000	74,105,259	73,174,810	0.24
	デンマーククローネ	売建	18,124,000	270,761,342	268,745,660	0.89
	メキシコペソ	売建	41,696,000	270,190,080	279,363,200	0.93
	ポーランドズロチ	売建	9,380,000	265,358,867	253,198,260	0.84
	ユーロ	売建	115,043,000	12,888,592,557	12,712,034,870	42.27

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考情報)  
運用実績

2010年11月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,783円

純資産総額…………… 16.45億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当りの値です。

※分配金込基準価額は、2000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して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)

2006年10月	2007年10月	2008年10月	2009年10月	2010年10月	設定来累計
10円	10円	0円	10円	10円	70円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15.38%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.53%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.50%
日本債券インデックスマザーファンド	64.84%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.96%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.96%
現金その他	4.83%

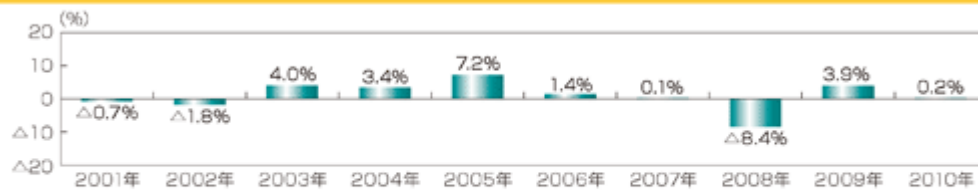
※当ファンドの対純資産総額比です。

## &lt;組入上位銘柄&gt;

組入資産	銘柄	業種	比率			
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	トヨタ自動車	輸送用機器	3.55%			
	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.54%			
	本田技研工業	輸送用機器	2.18%			
組入資産	銘柄	国名	業種	比率		
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.70%		
	APPLE COMPUTER INC	アメリカ	テクノロジーハードウェアおよび機器	1.38%		
	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.96%		
組入資産	銘柄	国名	業種	比率		
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	エネルギー	1.71%		
	APPLE COMPUTER INC	アメリカ	テクノロジーハードウェアおよび機器	1.39%		
	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	0.96%		
組入資産	銘柄	種類	クーポン	償還期限	比率	
日本債券インデックスマザーファンド	第299回利付国債(10年)	国債証券	1.300%	2019/3/20	2.09%	
	第287回利付国債(2年)	国債証券	0.300%	2011/12/15	1.58%	
	第60回利付国債(20年)	国債証券	1.400%	2022/12/20	1.48%	
組入資産	銘柄	通貨	種類	クーポン	償還期限	比率
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	US TREASURY N/B	アメリカドル	国債証券	3.625%	2019/8/15	0.63%
	US TREASURY N/B	アメリカドル	国債証券	3.125%	2019/5/15	0.60%
	US TREASURY N/B	アメリカドル	国債証券	3.625%	2020/2/15	0.60%
組入資産	銘柄	通貨	種類	クーポン	償還期限	比率
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	US TREASURY N/B	アメリカドル	国債証券	3.625%	2020/2/15	1.03%
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	ユーロ	国債証券	3.250%	2015/7/4	0.90%
	US TREASURY N/B	アメリカドル	国債証券	2.375%	2017/7/31	0.83%

※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。

※2010年は、2010年11月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

#### (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (3) 取扱時間

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

#### (4) 申込金額

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

#### (5) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (6) 申込代金の支払い

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

#### (7) 受付の中止および取消

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

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

#### (8) 償還乗換

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

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

#### (9) 乗換優遇

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

### 2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (2) 取扱時間

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

#### (3) 解約制限

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

#### (4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >



日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

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

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

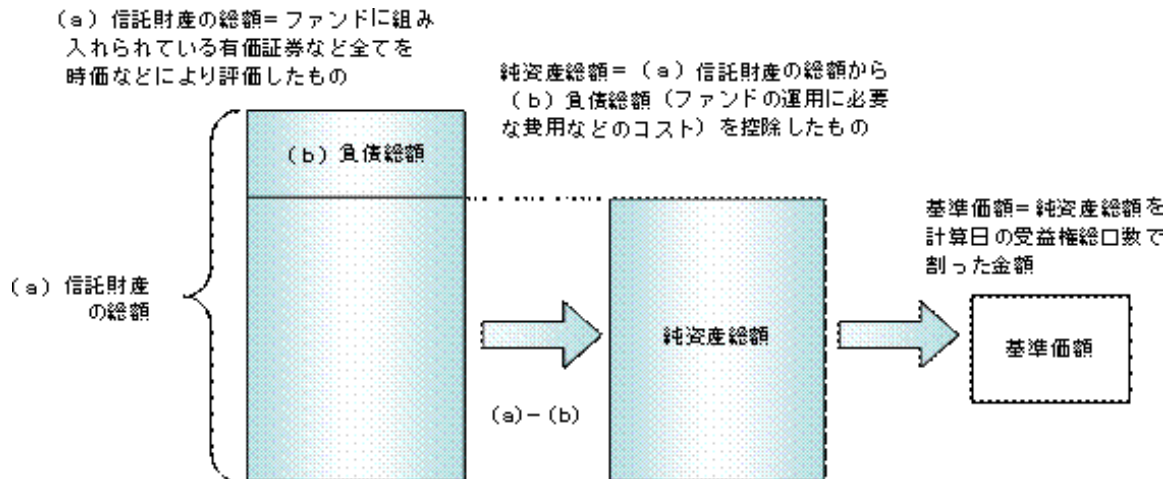
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### < 基準価額算出の流れ >



##### 有価証券などの評価基準

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

##### < 主な資産の評価方法 >

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b) 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

c) 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができません。

<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。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
  - 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
    - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
    - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
    - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
    - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
  - 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 償還金について
- ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
  - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

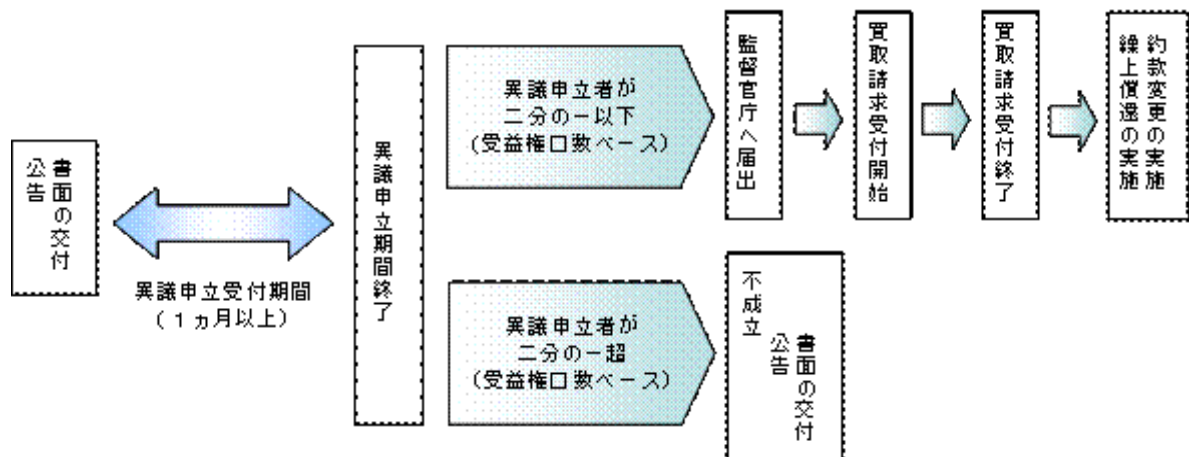
信託約款の変更

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

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行わない場合は、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。

## &lt; 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 &gt;



## 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

## 運用報告書の作成

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

## 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、その後の改正を含みます。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号、その後の改正を含みます。）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間（平成20年10月28日から平成21年10月26日まで）及び第11期計算期間（平成21年10月27日から平成22年10月26日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 平成21年10月26日現在	第11期 平成22年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	90,712,714	84,896,293
親投資信託受益証券	1,672,056,548	1,573,982,380
未収利息	-	201
流動資産合計	1,762,769,262	1,658,878,874
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,565,519	1,528,889
未払解約金	76,186	180,627
未払受託者報酬	329,660	309,255
未払委託者報酬	4,710,384	4,418,883
その他未払費用	56,462	52,966
流動負債合計	6,738,211	6,490,620
負債合計	6,738,211	6,490,620
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,640,972,320	1,528,889,125
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	115,058,731	123,499,129
（分配準備積立金）	128,313,777	109,353,291
元本等合計	1,756,031,051	1,652,388,254
純資産合計	1,756,031,051	1,652,388,254
負債純資産合計	1,762,769,262	1,658,878,874

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期	第11期
	自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	121,576	83,440
有価証券売買等損益	146,799,668	28,305,482
営業収益合計	146,921,244	28,388,922
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	681,006	628,061
委託者報酬	9,730,453	8,974,045
その他費用	116,642	107,567
営業費用合計	10,528,101	9,709,673
営業利益又は営業損失（ ）	136,393,143	18,679,249
経常利益又は経常損失（ ）	136,393,143	18,679,249
当期純利益又は当期純損失（ ）	136,393,143	18,679,249
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（ ）	16,774,632	2,184,790
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,697,506	115,058,731
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,703,245	9,680,265
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,627,242	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,076,003	9,680,265
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	16,205,437
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	16,205,437
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1,565,519	1,528,889
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	115,058,731	123,499,129

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	期別	
	第10期 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものとしたしますので、当計算期間は平成20年10月28日から平成21年10月26日までとなっております。	-

## (貸借対照表に関する注記)

第10期 平成21年10月26日現在		第11期 平成22年10月26日現在	
1. 期首元本額	1,930,526,704円	1. 期首元本額	1,640,972,320円
期中追加設定元本額	162,320,929円	期中追加設定元本額	122,706,122円
期中一部解約元本額	451,875,313円	期中一部解約元本額	234,789,317円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,640,972,320口	2. 計算期間末日における受益権の総数	1,528,889,125口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日		第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22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	101,858円	A 計算期末における費用控除後の配当等収益	52,369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	91,285,048円	C 信託約款に定める収益調整金	93,962,856円
D 信託約款に定める分配準備積立金	129,777,438円	D 信託約款に定める分配準備積立金	110,829,811円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	221,164,344円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	204,845,036円
F 分配対象収益(1口当たり)	0.1347円	F 分配対象収益(1口当たり)	0.1339円
分配対象収益(1万口当たり)	1,347円	分配対象収益(1万口当たり)	1,339円
G 分配金額	1,565,519円	G 分配金額	1,528,889円
H 分配金額(1口当たり)	0.0010円	H 分配金額(1口当たり)	0.0010円
分配金額(1万口当たり)	10円	分配金額(1万口当たり)	10円
分配金に加算した外国支払税	75,453円	分配金に加算した外国支払税	0円



## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

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

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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 該当事項はありません。</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>
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。

## (有価証券に関する注記)

第10期(自平成20年10月28日至平成21年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,672,056,548	115,691,184
合計	1,672,056,548	115,691,184

第11期(自平成21年10月27日至平成22年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	22,994,625
合計	22,994,625

## (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10期 平成21年10月26日現在		第11期 平成22年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.0701円	1口当たり純資産額	1.0808円
(1万口当たり純資産額)	(10,701円)	(1万口当たり純資産額)	(10,808円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

## (親投資信託受益証券)

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	49,240,747	41,726,609	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	55,609,612	42,563,597	
	日本債券インデックスマザーファンド	886,263,682	1,079,557,791	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	56,414,494	81,733,318	
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	66,470,527	82,948,570	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	395,508,371	245,452,495	
親投資信託受益証券 合計		1,509,507,433	1,573,982,380	
合計		1,509,507,433	1,573,982,380	

(注)親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## （参考）

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

## 1. 日本株式インデックスTOPIXマザーファンドの状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成21年10月26日現在	平成22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		77,733,687	59,190,968
株式		31,913,941,890	30,129,031,406
新株予約権証券		112,000	
派生商品評価勘定		1,762,783	
未収入金			43,341,343
未収配当金		214,808,277	261,028,706
未収利息			140
前払金		6,405,000	
差入委託証拠金			6,879,000
流動資産合計		32,214,763,637	30,499,471,563
資産合計		32,214,763,637	30,499,471,563
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,716,113	9,474,682
未払金		2,222,700	
未払解約金		692,891	16,048,391
流動負債合計		8,631,704	25,523,073
負債合計		8,631,704	25,523,073
純資産の部			
元本等			
元本		47,548,685,652	49,105,983,953
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		15,342,553,719	18,632,035,463
元本等合計		32,206,131,933	30,473,948,490
純資産合計		32,206,131,933	30,473,948,490
負債純資産合計		32,214,763,637	30,499,471,563

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1. 期首	平成20年10月28日	1. 期首	平成21年10月27日
期首元本額	46,500,062,239円	期首元本額	47,548,685,652円
期首からの追加設定元本額	12,242,918,816円	期首からの追加設定元本額	5,523,889,970円
期首からの一部解約元本額	11,194,295,403円	期首からの一部解約元本額	3,966,591,669円
平成21年10月26日現在の元本の内訳		平成22年10月26日現在の元本の内訳	
DCインデックスバランス(株式20)	147,167,770円	DCインデックスバランス(株式20)	172,322,155円
DCインデックスバランス(株式40)	534,061,559円	DCインデックスバランス(株式40)	629,565,241円
DCインデックスバランス(株式60)	1,027,464,097円	DCインデックスバランス(株式60)	1,189,744,460円
DCインデックスバランス(株式80)	1,144,679,021円	DCインデックスバランス(株式80)	1,316,027,100円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	728,834,132円	インデックスファンド日本株式(DC専用)	813,409,526円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	24,372,022,948円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,716,643,805円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	14,959,395円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	16,256,389円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	235,652,756円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	210,234,997円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	195,922,324円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	204,289,499円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	177,358,372円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	183,434,010円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	307,268,792円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	307,907,482円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	389,728,520円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	395,508,371円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	14,430,288,268円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	15,717,656,118円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	107,118,906円	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	107,980,343円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	148,047,400円	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	137,633,484円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	221,335,460円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	149,865,311円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	98,710,505円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	86,264,583円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	303,509,655円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	363,391,246円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	827,430,205円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	941,367,712円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,058,119,013円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,223,412,493円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,079,006,554円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,223,069,628円
計	47,548,685,652円	計	49,105,983,953円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	47,548,685,652口	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	49,105,983,953口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,342,553,719円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は18,632,035,463円であります。	
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。		4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。	
株式	248,216,000円	株式	215,771,500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）

## （追加情報）

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

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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>
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。



## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## I 取引の状況に関する事項

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

## 取引の時価に関する事項

## (1) 株式関連

(平成21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	313,425,000		309,570,000	3,855,000
合計		313,425,000		309,570,000	3,855,000

(平成22年10月26日現在)

(単位：円)

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

## (注) 時価の算定方法

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.6773円	1口当たり純資産額	0.6206円
(1万口当たり純資産額)	(6,773円)	(1万口当たり純資産額)	(6,206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	13,000	164.00	2,132,000	
1332	日本水産	32,600	263.00	8,573,800	
1334	マルハニチロホールディングス	64,000	133.00	8,512,000	
1377	サカタのタネ	4,400	1,042.00	4,584,800	
1379	ホクト	3,300	1,906.00	6,289,800	
1514	住石ホールディングス	8,500	70.00	595,000	
1515	日鉄鉱業	8,000	317.00	2,536,000	
1518	三井松島産業	18,000	151.00	2,718,000	
1605	国際石油開発帝石	226	438,000.00	98,988,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,590.00	1,813,000	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	422.00	1,266,000	
1662	石油資源開発	5,200	3,195.00	16,614,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,900	1,720.00	4,988,000	
1417	ミライト・ホールディングス	7,100	541.00	3,841,100	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	55,800.00	167,400	
1719	間組	12,700	59.00	749,300	
1720	東急建設	10,630	250.00	2,657,500	
1721	コムシスホールディングス	13,200	760.00	10,032,000	
1722	ミサワホーム	3,900	342.00	1,333,800	
1762	高松コンストラクショングループ	2,500	1,023.00	2,557,500	
1766	東建コーポレーション	1,100	2,449.00	2,693,900	
1780	ヤマウラ	1,500	187.00	280,500	
1801	大成建設	147,000	173.00	25,431,000	
1802	大林組	85,000	346.00	29,410,000	
1803	清水建設	86,000	325.00	27,950,000	
1808	長谷工コーポレーション	190,500	68.00	12,954,000	
1810	松井建設	4,000	318.00	1,272,000	
1812	鹿島建設	134,000	192.00	25,728,000	
1813	不動テトラ	21,400	47.00	1,005,800	
1814	大未建設	12,000	28.00	336,000	
1815	鉄建建設	19,000	68.00	1,292,000	
1816	安藤建設	10,000	102.00	1,020,000	
1819	太平工業	4,000	350.00	1,400,000	
1820	西松建設	40,000	89.00	3,560,000	
1821	三井住友建設	17,900	55.00	984,500	
1822	大豊建設	9,000	62.00	558,000	
1824	前田建設工業	22,000	228.00	5,016,000	
1827	ナカノフドー建設	2,500	187.00	467,500	
1833	奥村組	29,000	281.00	8,149,000	
1834	大和小田急建設	1,500	194.00	291,000	
1835	東鉄工業	4,000	486.00	1,944,000	
1852	浅沼組	9,000	50.00	450,000	

1860	戸田建設	35,000	271.00	9,485,000	
1861	熊谷組	25,000	51.00	1,275,000	
1865	青木あすなる建設	2,500	340.00	850,000	
1866	北野建設	7,000	180.00	1,260,000	
1867	植木組	4,000	124.00	496,000	
1868	三井ホーム	4,000	354.00	1,416,000	
1870	矢作建設工業	4,000	482.00	1,928,000	
1871	ピーエス三菱	2,100	205.00	430,500	
1878	大東建託	12,800	4,930.00	63,104,000	
1879	新日本建設	3,900	192.00	748,800	
1881	N I P P O	7,000	525.00	3,675,000	
1882	東亜道路工業	6,000	121.00	726,000	
1883	前田道路	8,000	586.00	4,688,000	
1884	日本道路	9,000	162.00	1,458,000	
1885	東亜建設工業	27,000	72.00	1,944,000	
1888	若築建設	18,000	38.00	684,000	
1890	東洋建設	41,000	39.00	1,599,000	
1893	五洋建設	33,500	119.00	3,986,500	
1896	大林道路	4,000	138.00	552,000	
1899	福田組	5,000	158.00	790,000	
1911	住友林業	22,500	580.00	13,050,000	
1914	日本基礎技術	3,900	163.00	635,700	
1916	日成ビルド工業	10,000	46.00	460,000	
1919	エス・バイ・エル	15,000	41.00	615,000	
1921	バコーボレーション	4,400	251.00	1,104,400	
1924	パナホーム	11,000	475.00	5,225,000	
1925	大和ハウス工業	76,000	892.00	67,792,000	
1926	ライト工業	6,800	178.00	1,210,400	
1928	積水ハウス	92,000	762.00	70,104,000	
1929	日特建設	6,000	48.00	288,000	
1930	北陸電気工事	2,000	211.00	422,000	
1934	ユアテック	5,000	286.00	1,430,000	
1937	西部電気工業	3,000	296.00	888,000	
1939	四電工	3,000	305.00	915,000	
1941	中電工	4,100	909.00	3,726,900	
1942	関電工	13,000	484.00	6,292,000	
1944	きんでん	19,000	722.00	13,718,000	
1945	東京エネシス	4,000	509.00	2,036,000	
1946	トーエネック	5,000	432.00	2,160,000	
1949	住友電設	2,300	292.00	671,600	
1950	日本電設工業	6,000	747.00	4,482,000	
1951	協和エクシオ	10,700	727.00	7,778,900	
1952	新日本空調	2,300	462.00	1,062,600	
1956	日本電話施設	5,000	247.00	1,235,000	
1959	九電工	6,000	431.00	2,586,000	
1961	三機工業	7,000	556.00	3,892,000	
1963	日揮	30,000	1,588.00	47,640,000	
1964	中外炉工業	10,000	264.00	2,640,000	

1967	ヤマト	3,000	300.00	900,000	
1968	太平電業	4,000	562.00	2,248,000	
1969	高砂熱学工業	8,600	606.00	5,211,600	

[次へ](#)

1972	三晃金属工業	4,000	169.00	676,000	
1973	N E C ネットズエスアイ	2,300	1,007.00	2,316,100	
1975	朝日工業社	4,000	347.00	1,388,000	
1979	大気社	4,300	1,285.00	5,525,500	
1980	ダイダン	4,000	395.00	1,580,000	
1982	日比谷総合設備	4,300	674.00	2,898,200	
1983	東芝プラントシステム	4,000	1,092.00	4,368,000	
6330	東洋エンジニアリング	19,000	267.00	5,073,000	
6366	千代田化工建設	24,000	668.00	16,032,000	
6379	新興プランテック	5,500	768.00	4,224,000	
2001	日本製粉	19,000	396.00	7,524,000	
2002	日清製粉グループ本社	29,500	1,055.00	31,122,500	
2003	日東富士製粉	3,000	301.00	903,000	
2004	昭和産業	13,000	222.00	2,886,000	
2009	鳥越製粉	2,800	706.00	1,976,800	
2052	協同飼料	11,000	93.00	1,023,000	
2053	中部飼料	3,100	482.00	1,494,200	
2056	日本配合飼料	9,000	91.00	819,000	
2107	東洋精糖	5,000	92.00	460,000	
2108	日本甜菜製糖	17,000	188.00	3,196,000	
2109	三井製糖	11,000	299.00	3,289,000	
2201	森永製菓	32,000	185.00	5,920,000	
2204	中村屋	7,000	402.00	2,814,000	
2206	江崎グリコ	12,000	977.00	11,724,000	
2207	名糖産業	1,500	1,100.00	1,650,000	
2211	不二家	19,000	157.00	2,983,000	
2212	山崎製パン	24,000	972.00	23,328,000	
2215	第一屋製パン	5,000	86.00	430,000	
2217	モロゾフ	5,000	260.00	1,300,000	
2264	森永乳業	28,000	333.00	9,324,000	
2267	ヤクルト本社	17,500	2,380.00	41,650,000	
2269	明治ホールディングス	9,700	3,775.00	36,617,500	
2270	雪印メグミルク	6,400	1,430.00	9,152,000	
2281	プリマハム	16,000	84.00	1,344,000	
2282	日本ハム	23,000	966.00	22,218,000	
2284	伊藤ハム	20,000	260.00	5,200,000	
2286	林兼産業	10,000	80.00	800,000	
2288	丸大食品	13,000	241.00	3,133,000	
2290	米久	2,500	625.00	1,562,500	
2292	S F o o d s	2,000	653.00	1,306,000	
2501	サッポロホールディングス	46,000	325.00	14,950,000	
2502	アサヒビール	61,300	1,646.00	100,899,800	
2503	キリンホールディングス	134,000	1,130.00	151,420,000	
2531	宝ホールディングス	26,000	475.00	12,350,000	
2533	オエノンホールディングス	9,000	179.00	1,611,000	
2536	メルシャン	10,000	158.00	1,580,000	
2540	養命酒製造	3,000	751.00	2,253,000	

2572	三国コカ・コーラボトリング	3,900	693.00	2,702,700	
2579	コカ・コーラウエスト	10,100	1,264.00	12,766,400	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,700	1,008.00	3,729,600	
2590	ダイドードリンク	1,300	2,722.00	3,538,600	
2593	伊藤園	8,200	1,338.00	10,971,600	
2594	キーコーヒー	2,700	1,396.00	3,769,200	
2597	ユニカフェ	800	383.00	306,400	
2599	ジャパンフーズ	400	783.00	313,200	
2602	日清オイリオグループ	12,000	358.00	4,296,000	
2607	不二製油	7,900	1,157.00	9,140,300	
2613	J - オイルミルズ	12,000	208.00	2,496,000	
2801	キッコーマン	25,000	895.00	22,375,000	
2802	味の素	82,000	795.00	65,190,000	
2809	キューピー	16,900	1,030.00	17,407,000	
2810	ハウス食品	12,100	1,206.00	14,592,600	
2811	カゴメ	11,700	1,507.00	17,631,900	
2812	焼津水産化学工業	1,500	914.00	1,371,000	
2815	アリアケジャパン	2,700	1,251.00	3,377,700	
2871	ニチレイ	34,000	348.00	11,832,000	
2875	東洋水産	14,000	1,752.00	24,528,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,600	2,922.00	30,973,200	
2899	永谷園	3,000	809.00	2,427,000	
2908	フジッコ	3,000	975.00	2,925,000	
2910	ロック・フィールド	1,600	1,199.00	1,918,400	
2914	日本たばこ産業	679	267,000.00	181,293,000	
2918	わらべや日洋	1,700	958.00	1,628,600	
2922	なとり	1,400	781.00	1,093,400	
4404	ミヨシ油脂	10,000	126.00	1,260,000	
3001	片倉工業	3,500	748.00	2,618,000	
3002	グンゼ	21,000	286.00	6,006,000	
3009	川島織物セルコン	11,000	45.00	495,000	
3101	東洋紡績	102,000	136.00	13,872,000	
3103	ユニチカ	65,000	69.00	4,485,000	
3104	富士紡ホールディングス	14,000	114.00	1,596,000	
3105	日清紡ホールディングス	19,000	845.00	16,055,000	
3106	倉敷紡績	29,000	128.00	3,712,000	
3109	シキボウ	19,000	111.00	2,109,000	
3201	日本毛織	11,000	624.00	6,864,000	
3202	大東紡織	5,000	61.00	305,000	
3204	トーア紡コーポレーション	11,000	61.00	671,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,800	662.00	2,515,600	
3302	帝国繊維	3,000	476.00	1,428,000	
3401	帝人	107,000	281.00	30,067,000	
3402	東レ	218,000	468.00	102,024,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	120.00	960,000	
3501	住江織物	8,000	134.00	1,072,000	
3512	日本フェルト	1,700	390.00	663,000	
3513	イチカワ	2,000	130.00	260,000	

3514	日本バイリーン	3,000	402.00	1,206,000	
3524	日東製網	4,000	88.00	352,000	
3526	芦森工業	7,000	111.00	777,000	
3529	アツギ	28,000	102.00	2,856,000	
3551	ダイニック	6,000	131.00	786,000	
3569	セーレン	7,000	511.00	3,577,000	
3577	東海染工	4,000	67.00	268,000	
3580	小松精練	5,000	311.00	1,555,000	
3591	ワコールホールディングス	17,000	1,172.00	19,924,000	
3593	ホギメディカル	1,300	3,700.00	4,810,000	
3605	サンエー・インターナショナル	1,300	983.00	1,277,900	
3606	レナウン	5,200	201.00	1,045,200	
3607	クラウディア	300	1,162.00	348,600	
8011	三陽商会	15,000	318.00	4,770,000	
8013	ナイガイ	9,000	44.00	396,000	
8016	オンワードホールディングス	19,000	603.00	11,457,000	
8029	ルック	5,000	128.00	640,000	
8111	ゴールドウイン	7,000	152.00	1,064,000	
8112	東京スタイル	10,000	625.00	6,250,000	
8114	デサント	8,000	390.00	3,120,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,900	345.00	655,500	
3708	特種東海製紙	19,000	181.00	3,439,000	
3861	王子製紙	125,000	375.00	46,875,000	
3864	三菱製紙	40,000	86.00	3,440,000	
3865	北越紀州製紙	19,000	385.00	7,315,000	
3877	中越パルプ工業	12,000	134.00	1,608,000	
3878	巴川製紙所	5,000	186.00	930,000	
3880	大王製紙	13,000	535.00	6,955,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,600	2,092.00	26,359,200	
3941	レンゴー	22,000	510.00	11,220,000	
3946	トーモク	10,000	190.00	1,900,000	
3950	ザ・バック	2,200	1,509.00	3,319,800	
3405	クラレ	41,600	1,100.00	45,760,000	
3407	旭化成	165,000	479.00	79,035,000	
3553	共和レザー	1,800	299.00	538,200	
4003	コープケミカル	5,000	100.00	500,000	
4004	昭和電工	203,000	149.00	30,247,000	
4005	住友化学	195,000	355.00	69,225,000	
4007	日本化成	6,000	169.00	1,014,000	
4008	住友精化	6,000	322.00	1,932,000	
4021	日産化学工業	18,900	986.00	18,635,400	
4022	ラサ工業	12,000	59.00	708,000	
4023	クレハ	18,000	451.00	8,118,000	
4027	テイカ	5,000	262.00	1,310,000	
4028	石原産業	51,000	58.00	2,958,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	264.00	528,000	
4041	日本曹達	18,000	351.00	6,318,000	
4042	東ソー	71,000	227.00	16,117,000	



4043	トクヤマ	48,000	455.00	21,840,000	
4044	セントラル硝子	29,000	353.00	10,237,000	
4045	東亜合成	31,000	342.00	10,602,000	
4046	ダイソー	12,000	222.00	2,664,000	
4047	関東電化工業	7,000	634.00	4,438,000	
4061	電気化学工業	60,000	366.00	21,960,000	
4063	信越化学工業	46,900	4,245.00	199,090,500	
4064	日本カーバイド工業	7,000	230.00	1,610,000	
4078	堺化学工業	11,000	322.00	3,542,000	
4088	エア・ウォーター	23,000	954.00	21,942,000	
4091	太陽日酸	40,000	660.00	26,400,000	
4092	日本化学工業	11,000	188.00	2,068,000	
4095	日本パーカライズニング	7,000	1,054.00	7,378,000	
4097	高圧ガス工業	5,000	457.00	2,285,000	
4099	四国化成工業	5,000	479.00	2,395,000	
4100	戸田工業	5,000	746.00	3,730,000	
4109	ステラ ケミファ	1,400	3,400.00	4,760,000	
4112	保土谷化学工業	7,000	236.00	1,652,000	
4114	日本触媒	19,000	770.00	14,630,000	
4116	大日精化工業	11,000	334.00	3,674,000	
4118	カネカ	38,000	510.00	19,380,000	
4182	三菱瓦斯化学	48,000	482.00	23,136,000	
4183	三井化学	111,000	254.00	28,194,000	
4185	J S R	27,800	1,385.00	38,503,000	
4186	東京応化工業	5,100	1,512.00	7,711,200	
4188	三菱ケミカルホールディングス	185,500	422.00	78,281,000	
4201	日本合成化学工業	7,000	478.00	3,346,000	
4202	ダイセル化学工業	36,000	578.00	20,808,000	
4203	住友ベークライト	26,000	438.00	11,388,000	
4204	積水化学工業	59,000	515.00	30,385,000	
4205	日本ゼオン	26,000	679.00	17,654,000	
4206	アイカ工業	7,600	942.00	7,159,200	
4208	宇部興産	128,000	205.00	26,240,000	
4212	積水樹脂	4,000	793.00	3,172,000	
4215	タキロン	7,000	254.00	1,778,000	
4216	旭有機材工業	10,000	191.00	1,910,000	
4217	日立化成工業	13,200	1,538.00	20,301,600	
4218	ニチバン	3,000	271.00	813,000	
4220	リケンテクノス	5,000	222.00	1,110,000	
4221	大倉工業	7,000	201.00	1,407,000	
4228	積水化成成品工業	8,000	334.00	2,672,000	
4229	群栄化学工業	8,000	219.00	1,752,000	
4231	タイガースポリマー	1,500	322.00	483,000	
4271	日本カーリット	2,400	374.00	897,600	
4272	日本化薬	22,000	787.00	17,314,000	
4362	日本精化	2,500	491.00	1,227,500	
4401	A D E K A	12,200	876.00	10,687,200	
4403	日油	25,000	364.00	9,100,000	

4410	ハリマ化成	3,000	454.00	1,362,000	
4452	花王	78,200	2,004.00	156,712,800	
4461	第一工業製薬	5,000	210.00	1,050,000	
4471	三洋化成工業	8,000	597.00	4,776,000	
4611	大日本塗料	18,000	79.00	1,422,000	
4612	日本ペイント	26,000	591.00	15,366,000	
4613	関西ペイント	35,000	741.00	25,935,000	
4614	トウベ	3,000	66.00	198,000	
4617	中国塗料	8,000	605.00	4,840,000	
4619	日本特殊塗料	2,400	317.00	760,800	
4620	藤倉化成	3,600	495.00	1,782,000	
4626	太陽ホールディングス	2,200	2,281.00	5,018,200	
4631	D I C	107,000	147.00	15,729,000	
4633	サカタインクス	6,000	353.00	2,118,000	
4634	東洋インキ製造	28,000	337.00	9,436,000	
4901	富士フィルムホールディングス	60,600	2,757.00	167,074,200	
4911	資生堂	50,700	1,762.00	89,333,400	
4912	ライオン	35,000	435.00	15,225,000	
4914	高砂香料工業	9,000	415.00	3,735,000	
4917	マンダム	2,900	2,204.00	6,391,600	
4919	ミルボン	1,500	2,274.00	3,411,000	
4921	ファンケル	5,900	1,254.00	7,398,600	
4922	コーセー	4,400	1,936.00	8,518,400	
4924	ドクターシーラボ	20	286,500.00	5,730,000	
4951	エステー	1,900	923.00	1,753,700	
4956	コニシ	2,400	930.00	2,232,000	
4958	長谷川香料	3,900	1,307.00	5,097,300	
4967	小林製薬	4,200	3,720.00	15,624,000	
4968	荒川化学工業	2,400	876.00	2,102,400	
4971	メック	2,200	344.00	756,800	
4973	日本高純度化学	8	230,900.00	1,847,200	
4975	荏原ユーザライト	400	1,500.00	600,000	
4985	アース製薬	2,200	2,706.00	5,953,200	
4989	イハラケミカル工業	6,000	241.00	1,446,000	
4992	北興化学工業	3,000	236.00	708,000	
4994	大成ラミック	800	2,090.00	1,672,000	
4996	クミアイ化学工業	6,000	269.00	1,614,000	
4997	日本農薬	6,000	482.00	2,892,000	
5142	アキレス	23,000	110.00	2,530,000	
5208	有沢製作所	4,100	501.00	2,054,100	
6988	日東電工	23,600	3,140.00	74,104,000	
7874	レック	900	1,120.00	1,008,000	
7882	アロン化成	2,000	331.00	662,000	
7908	きもと	2,500	567.00	1,417,500	
7917	藤森工業	2,000	1,041.00	2,082,000	
7925	前澤化成工業	2,100	673.00	1,413,300	
7942	J S P	2,000	860.00	1,720,000	
7947	エフピコ	1,300	4,400.00	5,720,000	

7958	天馬	2,200	780.00	1,716,000	
7970	信越ポリマー	5,200	490.00	2,548,000	
7971	東リ	7,000	121.00	847,000	
7988	ニフコ	6,300	1,913.00	12,051,900	
7995	日本バルカー工業	12,000	235.00	2,820,000	
8113	ユニ・チャーム	16,800	3,070.00	51,576,000	
4151	協和発酵キリン	37,000	822.00	30,414,000	
4502	武田薬品工業	107,200	3,815.00	408,968,000	代用有価証券10,000株
4503	アステラス製薬	59,300	3,025.00	179,382,500	
4506	大日本住友製薬	21,600	691.00	14,925,600	
4507	塩野義製薬	41,300	1,445.00	59,678,500	
4508	田辺三菱製薬	26,000	1,313.00	34,138,000	
4512	わかもと製薬	3,000	244.00	732,000	
4514	あすか製薬	3,000	529.00	1,587,000	
4516	日本新薬	7,000	1,180.00	8,260,000	
4519	中外製薬	30,400	1,495.00	45,448,000	
4521	科研製薬	13,000	881.00	11,453,000	
4523	エーザイ	34,900	2,787.00	97,266,300	
4527	ロート製薬	13,000	1,015.00	13,195,000	
4528	小野薬品工業	14,200	3,330.00	47,286,000	
4530	久光製薬	8,600	3,320.00	28,552,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	200.00	400,000	
4534	持田製薬	11,000	900.00	9,900,000	
4535	大正製薬	24,000	1,636.00	39,264,000	
4536	参天製薬	8,700	2,805.00	24,403,500	
4538	扶桑薬品工業	10,000	217.00	2,170,000	
4539	日本ケミファ	5,000	249.00	1,245,000	
4540	ツムラ	8,300	2,488.00	20,650,400	
4547	キッセイ薬品工業	5,700	1,587.00	9,045,900	
4548	生化学工業	5,300	870.00	4,611,000	
4549	栄研化学	2,200	837.00	1,841,400	
4550	日水製薬	1,100	681.00	749,100	
4551	鳥居薬品	1,800	1,585.00	2,853,000	
4553	東和薬品	1,400	4,530.00	6,342,000	
4555	沢井製薬	1,900	7,250.00	13,775,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	986.00	3,944,000	
4568	第一三共	89,900	1,730.00	155,527,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	7,000	1,266.00	8,862,000	
4574	大幸薬品	800	989.00	791,200	
5002	昭和シェル石油	27,300	683.00	18,645,900	
5007	コスモ石油	77,000	213.00	16,401,000	
5011	ニチレキ	4,000	307.00	1,228,000	
5012	東燃ゼネラル石油	46,000	717.00	32,982,000	
5013	ユシロ化学工業	1,500	980.00	1,470,000	
5015	ピーピー・カストロール	1,300	307.00	399,100	
5017	AOCホールディングス	7,100	354.00	2,513,400	
5019	出光興産	3,200	6,880.00	22,016,000	
5020	JXホールディングス	293,700	484.00	142,150,800	

5101	横浜ゴム	31,000	405.00	12,555,000	
5105	東洋ゴム工業	28,000	165.00	4,620,000	
5108	ブリヂストン	95,700	1,423.00	136,181,100	
5110	住友ゴム工業	21,400	831.00	17,783,400	
5121	藤倉ゴム工業	1,900	308.00	585,200	
5122	オカモト	12,000	343.00	4,116,000	
5185	フコク	1,300	635.00	825,500	
5186	ニッタ	2,700	1,174.00	3,169,800	
5191	東海ゴム工業	4,700	854.00	4,013,800	
5192	三ツ星ベルト	8,000	335.00	2,680,000	
5195	バンドー化学	11,000	276.00	3,036,000	
3110	日東紡績	25,000	203.00	5,075,000	
5201	旭硝子	150,000	826.00	123,900,000	
5202	日本板硝子	113,000	175.00	19,775,000	
5204	石塚硝子	4,000	143.00	572,000	
5210	日本山村硝子	12,000	216.00	2,592,000	
5214	日本電気硝子	50,000	1,079.00	53,950,000	
5218	オハラ	1,200	1,053.00	1,263,600	
5232	住友大阪セメント	50,000	162.00	8,100,000	
5233	太平洋セメント	112,000	93.00	10,416,000	
5234	デイ・シイ	3,100	127.00	393,700	
5262	日本ヒューム	2,000	238.00	476,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	123.00	492,000	
5301	東海カーボン	28,000	487.00	13,636,000	
5302	日本カーボン	15,000	256.00	3,840,000	
5310	東洋炭素	1,500	4,460.00	6,690,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	16,000	258.00	4,128,000	
5332	TOTO	44,000	543.00	23,892,000	
5333	日本碍子	34,000	1,504.00	51,136,000	
5334	日本特殊陶業	25,000	1,092.00	27,300,000	
5337	ダントーホールディングス	5,000	73.00	365,000	
5344	MARUWA	800	1,802.00	1,441,600	
5351	品川リフラクトリーズ	8,000	184.00	1,472,000	
5352	黒崎播磨	7,000	287.00	2,009,000	
5363	東京窯業	4,000	189.00	756,000	
5367	ニッカトー	1,100	390.00	429,000	
5384	フジインコーポレーテッド	2,800	1,149.00	3,217,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	7,000	44.00	308,000	
5393	ニチアス	15,000	344.00	5,160,000	
7943	ニチハ	3,400	644.00	2,189,600	
5401	新日本製鐵	801,000	264.00	211,464,000	
5405	住友金属工業	522,000	192.00	100,224,000	
5406	神戸製鋼所	395,000	183.00	72,285,000	
5407	日新製鋼	108,000	153.00	16,524,000	
5408	中山製鋼所	14,000	102.00	1,428,000	
5410	合同製鐵	15,000	154.00	2,310,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	61,200	2,547.00	155,876,400	

5423	東京製鐵	14,000	814.00	11,396,000	
5440	共英製鋼	2,900	971.00	2,815,900	
5444	大和工業	7,200	1,912.00	13,766,400	
5445	東京鐵鋼	6,000	165.00	990,000	
5449	大阪製鐵	1,900	1,215.00	2,308,500	
5451	淀川製鋼所	22,000	307.00	6,754,000	
5453	東洋鋼鈹	6,000	407.00	2,442,000	
5457	住友鋼管	1,800	443.00	797,400	
5463	丸一鋼管	8,500	1,603.00	13,625,500	
5464	モリ工業	5,000	243.00	1,215,000	
5471	大同特殊鋼	47,000	376.00	17,672,000	
5476	日本高周波鋼業	12,000	83.00	996,000	
5479	日本金属工業	21,000	99.00	2,079,000	
5480	日本冶金工業	17,000	246.00	4,182,000	
5481	山陽特殊製鋼	15,000	385.00	5,775,000	
5482	愛知製鋼	16,000	446.00	7,136,000	
5486	日立金属	17,000	958.00	16,286,000	
5491	日本金属	8,000	140.00	1,120,000	
5541	大平洋金属	21,000	702.00	14,742,000	
5563	日本電工	12,000	614.00	7,368,000	
5602	栗本鐵工所	16,000	89.00	1,424,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	113.00	339,000	
5632	三菱製鋼	18,000	184.00	3,312,000	
5658	日亜鋼業	4,000	187.00	748,000	
5659	日本精線	2,000	416.00	832,000	
6319	シンニッタン	2,600	234.00	608,400	
7305	新家工業	7,000	120.00	840,000	
5701	日本軽金属	69,000	137.00	9,453,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	5,000	253.00	1,265,000	
5706	三井金属鋁業	83,000	250.00	20,750,000	
5707	東邦亜鉛	15,000	361.00	5,415,000	
5711	三菱マテリアル	169,000	252.00	42,588,000	
5713	住友金属鋁山	74,000	1,320.00	97,680,000	
5714	DOWAホールディングス	34,000	513.00	17,442,000	
5715	古河機械金属	51,000	88.00	4,488,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	3,000	3,925.00	11,775,000	
5727	東邦チタニウム	4,900	2,291.00	11,225,900	
5738	住友軽金属工業	43,000	91.00	3,913,000	
5741	古河スカイ	12,000	222.00	2,664,000	
5801	古河電気工業	90,000	307.00	27,630,000	
5802	住友電気工業	93,400	1,044.00	97,509,600	
5803	フジクラ	42,000	405.00	17,010,000	
5805	昭和電線ホールディングス	36,000	66.00	2,376,000	
5809	タツタ電線	6,000	189.00	1,134,000	
5812	日立電線	24,000	199.00	4,776,000	
5815	沖電線	3,000	116.00	348,000	
5819	カナレ電気	400	1,150.00	460,000	
5821	平河ヒューテック	700	603.00	422,100	

5851	リョービ	17,000	314.00	5,338,000	
5857	アサヒホールディングス	4,300	1,756.00	7,550,800	
3421	稲葉製作所	1,500	666.00	999,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,000	68.00	612,000	
3432	三協・立山ホールディングス	35,000	94.00	3,290,000	
3433	トーカロ	1,600	1,345.00	2,152,000	
3434	アルファＣo	1,000	694.00	694,000	
3436	SUMCO	16,300	1,374.00	22,396,200	

[次へ](#)

3443	川田テクノロジーズ	700	1,297.00	907,900	
5901	東洋製罐	21,600	1,441.00	31,125,600	
5902	ホッカンホールディングス	7,000	201.00	1,407,000	
5909	コロナ	1,400	719.00	1,006,600	
5911	横河ブリッジホールディングス	6,000	445.00	2,670,000	
5915	駒井ハルテック	4,000	139.00	556,000	
5929	三和ホールディングス	28,000	225.00	6,300,000	
5930	文化シャッター	8,000	178.00	1,424,000	
5936	東洋シャッター	600	280.00	168,000	
5938	住生活グループ	37,400	1,531.00	57,259,400	
5942	日本ファイルコン	2,200	410.00	902,000	
5943	ノーリツ	5,500	1,465.00	8,057,500	
5946	長府製作所	2,900	1,710.00	4,959,000	
5947	リンナイ	4,900	4,735.00	23,201,500	
5951	ダイニチ工業	1,600	503.00	804,800	
5957	日東精工	4,000	236.00	944,000	
5958	三洋工業	4,000	100.00	400,000	
5959	岡部	6,500	311.00	2,021,500	
5974	中国工業	5,000	83.00	415,000	
5975	東プレ	5,900	583.00	3,439,700	
5976	高周波熱錬	4,500	584.00	2,628,000	
5981	東京製綱	19,000	228.00	4,332,000	
5988	パイオラックス	1,300	1,675.00	2,177,500	
5991	日本発條	20,000	649.00	12,980,000	
5992	中央発條	4,000	275.00	1,100,000	
5998	アドバネクス	6,000	78.00	468,000	
8155	三益半導体工業	2,300	799.00	1,837,700	
1978	アタカ大機	2,000	224.00	448,000	
5631	日本製鋼所	44,000	801.00	35,244,000	
5963	日立ツール	1,800	937.00	1,686,600	
6005	三浦工業	4,200	1,916.00	8,047,200	
6013	タクマ	11,000	202.00	2,222,000	
6101	ツガミ	9,000	494.00	4,446,000	
6103	オークマ	20,000	498.00	9,960,000	
6104	東芝機械	15,000	328.00	4,920,000	
6113	アマダ	47,000	536.00	25,192,000	
6118	アイダエンジニアリング	7,200	274.00	1,972,800	
6135	牧野フライス製作所	14,000	582.00	8,148,000	
6136	オーエスジー	13,400	851.00	11,403,400	
6138	ダイジェット工業	4,000	104.00	416,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	7,000	1,369.00	9,583,000	
6141	森精機製作所	13,900	808.00	11,231,200	
6146	ディスコ	2,800	4,795.00	13,426,000	
6151	日東工器	1,800	1,920.00	3,456,000	
6203	豊和工業	16,000	70.00	1,120,000	
6205	大阪機工	10,000	119.00	1,190,000	
6210	東洋機械金属	2,100	219.00	459,900	

6213	オーエム製作所	3,000	257.00	771,000	
6217	津田駒工業	7,000	128.00	896,000	
6222	島精機製作所	3,700	1,542.00	5,705,400	
6247	日阪製作所	3,000	941.00	2,823,000	
6250	やまびこ	1,200	600.00	720,000	
6262	ベガサスミシン製造	2,800	179.00	501,200	
6268	ナブテスコ	11,500	1,337.00	15,375,500	
6269	三井海洋開発	2,500	1,187.00	2,967,500	
6272	レオン自動機	3,000	200.00	600,000	
6273	S M C	9,100	12,250.00	111,475,000	
6274	新川	2,400	845.00	2,028,000	
6277	ホソカワミクロン	5,000	264.00	1,320,000	
6278	ユニオンツール	1,900	2,167.00	4,117,300	
6282	オイレス工業	3,400	1,224.00	4,161,600	
6287	サトー	3,200	930.00	2,976,000	
6291	日本エアージェット	900	387.00	348,300	
6293	日精樹脂工業	2,200	236.00	519,200	
6298	ワイエイシイ	1,300	490.00	637,000	
6301	小松製作所	126,600	1,916.00	242,565,600	
6302	住友重機械工業	61,000	443.00	27,023,000	
6305	日立建機	12,500	1,804.00	22,550,000	
6306	日工	4,000	230.00	920,000	
6309	巴工業	1,200	1,172.00	1,406,400	
6310	井関農機	29,000	203.00	5,887,000	
6315	T O W A	3,200	496.00	1,587,200	
6316	丸山製作所	7,000	149.00	1,043,000	
6317	北川鉄工所	13,000	116.00	1,508,000	
6326	クボタ	116,000	717.00	83,172,000	
6328	荏原実業	700	1,150.00	805,000	
6331	三菱化工機	9,000	160.00	1,440,000	
6332	月島機械	5,000	517.00	2,585,000	
6333	帝国電機製作所	1,000	1,550.00	1,550,000	
6339	新東工業	5,600	612.00	3,427,200	
6340	澁谷工業	1,700	732.00	1,244,400	
6345	アイチ コーポレーション	5,000	300.00	1,500,000	
6349	小森コーポレーション	8,000	811.00	6,488,000	
6351	鶴見製作所	2,000	480.00	960,000	
6355	住友精密工業	4,000	277.00	1,108,000	
6358	酒井重工業	6,000	116.00	696,000	
6361	荏原製作所	57,000	358.00	20,406,000	
6362	石井鐵工所	5,000	136.00	680,000	
6363	西島製作所	2,700	1,366.00	3,688,200	
6367	ダイキン工業	31,800	2,890.00	91,902,000	
6368	オルガノ	5,000	535.00	2,675,000	
6369	トーヨーカネツ	15,000	123.00	1,845,000	
6370	栗田工業	15,600	2,187.00	34,117,200	
6371	椿本チエイン	15,000	355.00	5,325,000	
6373	大同工業	6,000	149.00	894,000	



6375	日本コンベヤ	10,000	66.00	660,000	
6378	木村化工機	2,600	507.00	1,318,200	
6381	アネスト岩田	6,000	228.00	1,368,000	
6383	ダイフク	11,500	400.00	4,600,000	
6390	加藤製作所	6,000	147.00	882,000	
6393	油研工業	5,000	164.00	820,000	
6395	タダノ	13,000	377.00	4,901,000	
6406	フジテック	8,000	367.00	2,936,000	
6407	シーケーディ	7,600	573.00	4,354,800	
6409	キトー	9	73,900.00	665,100	
6412	平和	5,400	995.00	5,373,000	
6413	理想科学工業	2,300	1,157.00	2,661,100	
6417	SANKYO	8,000	4,400.00	35,200,000	
6418	日本金銭機械	2,700	598.00	1,614,600	
6419	マースエンジニアリング	1,200	1,299.00	1,558,800	
6420	福島工業	800	723.00	578,400	
6428	オーイズミ	1,000	219.00	219,000	
6430	ダイコク電機	900	920.00	828,000	
6436	アマノ	8,100	670.00	5,427,000	
6444	サンデン	17,000	329.00	5,593,000	
6445	蛇の目マシン工業	27,000	52.00	1,404,000	
6454	マックス	5,000	875.00	4,375,000	
6457	グローリー	8,100	1,831.00	14,831,100	
6459	大和冷機工業	4,000	364.00	1,456,000	
6460	セガサミーホールディングス	30,800	1,292.00	39,793,600	
6461	日本ピストンリング	11,000	150.00	1,650,000	
6462	リケン	12,000	276.00	3,312,000	
6463	帝国ピストンリング	3,600	619.00	2,228,400	
6465	ホシザキ電機	5,900	1,558.00	9,192,200	
6470	大豊工業	2,100	582.00	1,222,200	
6471	日本精工	55,000	629.00	34,595,000	
6472	NTN	63,000	371.00	23,373,000	
6473	ジェイテクト	27,400	813.00	22,276,200	
6474	不二越	29,000	241.00	6,989,000	
6480	日本トムソン	9,000	564.00	5,076,000	
6481	THK	18,200	1,581.00	28,774,200	
6482	ユーシン精機	1,300	1,489.00	1,935,700	
6485	前澤給装工業	1,100	917.00	1,008,700	
6486	イーグル工業	3,000	629.00	1,887,000	
6489	前澤工業	2,000	143.00	286,000	
6490	日本ピラー工業	3,000	443.00	1,329,000	
6498	キッツ	13,100	354.00	4,637,400	
6581	日立工機	7,800	678.00	5,288,400	
6586	マキタ	17,700	2,675.00	47,347,500	
7004	日立造船	122,500	116.00	14,210,000	
7011	三菱重工業	458,000	292.00	133,736,000	
7013	IHI	199,000	152.00	30,248,000	
4062	イビデン	19,100	1,985.00	37,913,500	

4902	コニカミノルタホールディングス	62,500	833.00	52,062,500	
6448	ブラザー工業	37,700	1,039.00	39,170,300	
6479	ミネベア	40,000	428.00	17,120,000	
6501	日立製作所	624,000	353.00	220,272,000	
6502	東芝	614,000	405.00	248,670,000	
6503	三菱電機	253,000	727.00	183,931,000	
6504	富士電機ホールディングス	74,000	189.00	13,986,000	
6505	東洋電機製造	5,000	355.00	1,775,000	
6506	安川電機	32,000	637.00	20,384,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	16,000	163.00	2,608,000	
6508	明電舎	27,000	301.00	8,127,000	
6513	オリジン電気	4,000	281.00	1,124,000	
6517	デンヨー	2,800	518.00	1,450,400	
6588	東芝テック	18,000	306.00	5,508,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	267.00	1,068,000	
6592	マブチモーター	4,200	4,190.00	17,598,000	
6594	日本電産	13,100	7,200.00	94,320,000	
6621	高岳製作所	11,000	318.00	3,498,000	
6622	ダイヘン	15,000	359.00	5,385,000	
6632	JVC・ケンウッド・ホールディングス	10,900	298.00	3,248,200	
6641	日新電機	5,000	392.00	1,960,000	
6644	大崎電気工業	4,000	610.00	2,440,000	
6645	オムロン	32,500	1,967.00	63,927,500	
6651	日東工業	4,400	724.00	3,185,600	
6652	I D E C	3,800	667.00	2,534,600	
6665	エルピーダメモリ	28,500	884.00	25,194,000	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	52,000	580.00	30,160,000	
6675	サクサホールディングス	7,000	119.00	833,000	
6676	メルコホールディングス	1,400	2,763.00	3,868,200	
6678	テクノメディカ	2	294,600.00	589,200	
6701	日本電気	354,000	230.00	81,420,000	
6702	富士通	281,000	532.00	149,492,000	
6703	沖電気工業	99,000	71.00	7,029,000	
6704	岩崎通信機	12,000	60.00	720,000	
6706	電気興業	8,000	348.00	2,784,000	
6707	サンケン電気	16,000	281.00	4,496,000	
6715	ナカヨ通信機	3,000	148.00	444,000	
6718	アイホン	1,900	1,215.00	2,308,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	10,600	687.00	7,282,200	
6724	セイコーエプソン	21,700	1,265.00	27,450,500	
6727	ワコム	54	90,100.00	4,865,400	
6728	アルバック	5,400	1,637.00	8,839,800	
6730	アクセル	1,000	1,630.00	1,630,000	
6737	ナナオ	2,300	1,690.00	3,887,000	
6741	日本信号	6,800	583.00	3,964,400	
6742	京三製作所	6,000	342.00	2,052,000	
6744	能美防災	3,000	489.00	1,467,000	

6745	ホーチキ	3,000	379.00	1,137,000	
6749	マスプロ電工	2,000	751.00	1,502,000	
6751	日本無線	10,000	187.00	1,870,000	
6752	パナソニック	266,400	1,202.00	320,212,800	
6753	シャープ	131,000	827.00	108,337,000	
6754	アンリツ	14,000	527.00	7,378,000	
6755	富士通ゼネラル	7,000	413.00	2,891,000	
6756	日立国際電気	7,000	701.00	4,907,000	
6758	ソニー	145,500	2,742.00	398,961,000	
6762	T D K	14,100	4,595.00	64,789,500	
6763	帝国通信工業	7,000	187.00	1,309,000	
6764	三洋電機	290,000	135.00	39,150,000	
6767	ミツミ電機	8,700	1,384.00	12,040,800	
6768	タムラ製作所	8,000	215.00	1,720,000	
6770	アルプス電気	23,000	760.00	17,480,000	
6771	池上通信機	9,000	48.00	432,000	
6773	パイオニア	35,400	283.00	10,018,200	
6779	日本電波工業	1,900	1,422.00	2,701,800	
6788	日本トリム	350	1,761.00	616,350	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	1,107.00	1,217,700	
6794	フォスター電機	2,300	1,910.00	4,393,000	
6796	クラリオン	15,000	131.00	1,965,000	
6798	S M K	9,000	353.00	3,177,000	
6800	ヨコオ	2,300	428.00	984,400	
6801	東光	12,000	129.00	1,548,000	
6803	ティアック	13,000	37.00	481,000	
6804	ホシデン	7,200	823.00	5,925,600	
6806	ヒロセ電機	4,700	8,180.00	38,446,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	536.00	3,216,000	
6809	T O A	4,000	399.00	1,596,000	
6815	ユニデン	8,000	164.00	1,312,000	
6816	アルパイン	5,700	1,050.00	5,985,000	
6817	スミダコーポレーション	1,800	696.00	1,252,800	
6820	アイコム	1,500	2,227.00	3,340,500	
6839	船井電機	2,300	2,552.00	5,869,600	
6841	横河電機	29,200	554.00	16,176,800	
6844	新電元工業	9,000	319.00	2,871,000	
6845	山武	7,500	1,986.00	14,895,000	
6849	日本光電工業	5,000	1,584.00	7,920,000	
6850	チノー	5,000	192.00	960,000	
6853	共和電業	3,000	245.00	735,000	
6855	日本電子材料	1,100	466.00	512,600	
6856	堀場製作所	5,000	2,012.00	10,060,000	
6857	アドバンテスト	19,900	1,705.00	33,929,500	
6858	小野測器	3,000	207.00	621,000	
6859	エスベック	2,800	474.00	1,327,200	
6860	パナソニック電工 S U N X	2,600	499.00	1,297,400	
6861	キーエンス	5,500	20,000.00	110,000,000	

6866	日置電機	1,400	1,538.00	2,153,200	
6869	シスメックス	5,100	5,350.00	27,285,000	
6875	メガチップス	2,200	1,472.00	3,238,400	
6877	O B A R A	2,100	679.00	1,425,900	
6883	日本電産コパル電子	3,000	573.00	1,719,000	
6885	ミヤチテクノス	1,500	519.00	778,500	
6900	東京電波	900	433.00	389,700	
6901	澤藤電機	2,000	176.00	352,000	
6905	コーセル	3,900	1,045.00	4,075,500	
6910	日立メディコ	2,000	543.00	1,086,000	
6911	新日本無線	2,000	199.00	398,000	
6914	オブテックス	2,000	959.00	1,918,000	
6915	千代田インテグレ	1,100	986.00	1,084,600	
6921	東光電気	2,000	431.00	862,000	
6923	スタンレー電気	18,200	1,363.00	24,806,600	
6924	岩崎電気	10,000	126.00	1,260,000	
6925	ウシオ電機	16,400	1,356.00	22,238,400	
6926	岡谷電機産業	1,600	306.00	489,600	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,300	177.00	407,100	
6929	日本セラミック	1,900	1,322.00	2,511,800	
6934	新神戸電機	2,000	720.00	1,440,000	
6935	日本デジタル研究所	2,500	810.00	2,025,000	
6937	古河電池	2,000	513.00	1,026,000	
6938	双信電機	1,400	336.00	470,400	
6941	山一電機	2,700	215.00	580,500	
6947	図研	2,000	530.00	1,060,000	
6951	日本電子	11,000	229.00	2,519,000	
6952	カシオ計算機	30,300	575.00	17,422,500	
6954	ファナック	28,200	11,120.00	313,584,000	
6958	日本シイエムケイ	5,700	327.00	1,863,900	
6961	エンプラス	1,500	1,023.00	1,534,500	
6963	ローム	13,600	5,100.00	69,360,000	
6965	浜松ホトニクス	11,400	2,597.00	29,605,800	
6966	三井ハイテック	3,900	415.00	1,618,500	
6967	新光電気工業	7,400	854.00	6,319,600	
6971	京セラ	22,500	8,360.00	188,100,000	
6976	太陽誘電	11,000	995.00	10,945,000	
6981	村田製作所	30,600	4,490.00	137,394,000	
6985	ユーシン	3,500	608.00	2,128,000	
6986	双葉電子工業	5,000	1,385.00	6,925,000	
6989	北陸電気工業	11,000	156.00	1,716,000	
6991	パナソニック電工	48,000	1,065.00	51,120,000	
6996	ニチコン	9,200	906.00	8,335,200	
6997	日本ケミコン	16,000	320.00	5,120,000	
6999	K O A	3,700	799.00	2,956,300	
7244	市光工業	7,000	147.00	1,029,000	
7276	小糸製作所	13,000	1,022.00	13,286,000	
7280	ミツバ	5,000	507.00	2,535,000	

7704	アロカ	1,500	476.00	714,000	
7718	スター精密	5,600	756.00	4,233,600	
7735	大日本スクリーン製造	30,000	474.00	14,220,000	
7739	キャノン電子	2,700	2,059.00	5,559,300	
7751	キャノン	181,000	3,705.00	670,605,000	
7752	リコー	81,000	1,194.00	96,714,000	
7757	日本電産サンキョー	7,000	581.00	4,067,000	
7999	MUTOHホールディングス	3,000	184.00	552,000	
8035	東京エレクトロン	22,900	4,775.00	109,347,500	
3116	トヨタ紡織	8,500	1,317.00	11,194,500	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	347.00	2,082,000	
5949	ユニプレス	4,100	1,382.00	5,666,200	
6201	豊田自動織機	23,600	2,187.00	51,613,200	
6455	モリタホールディングス	4,000	463.00	1,852,000	
6584	三櫻工業	3,400	626.00	2,128,400	
6902	デンソー	64,000	2,487.00	159,168,000	
6995	東海理化電機製作所	6,800	1,241.00	8,438,800	
7003	三井造船	113,000	177.00	20,001,000	
7007	佐世保重工業	19,000	151.00	2,869,000	
7012	川崎重工業	212,000	223.00	47,276,000	
7102	日本車輛製造	11,000	364.00	4,004,000	
7105	日本輸送機	4,000	182.00	728,000	
7122	近畿車輛	4,000	345.00	1,380,000	
7201	日産自動車	327,400	726.00	237,692,400	
7202	いすゞ自動車	184,000	310.00	57,040,000	
7203	トヨタ自動車	374,400	2,866.00	1,073,030,400	代用有価証券35,000株
7205	日野自動車	37,000	392.00	14,504,000	
7211	三菱自動車工業	602,000	97.00	58,394,000	
7212	エフテック	1,000	1,309.00	1,309,000	
7220	武蔵精密工業	2,800	1,924.00	5,387,200	
7221	トヨタ車体	5,300	1,210.00	6,413,000	
7222	日産車体	11,000	629.00	6,919,000	
7223	関東自動車工業	4,400	520.00	2,288,000	
7224	新明和工業	12,000	307.00	3,684,000	
7226	極東開発工業	5,000	301.00	1,505,000	
7230	日信工業	4,800	1,379.00	6,619,200	
7231	トピー工業	24,000	204.00	4,896,000	
7236	ティラド	9,000	288.00	2,592,000	
7238	曙ブレーキ工業	11,100	488.00	5,416,800	
7239	タチエス	3,800	1,172.00	4,453,600	
7240	NOK	14,100	1,469.00	20,712,900	
7241	フタバ産業	8,900	392.00	3,488,800	
7242	カヤバ工業	18,000	445.00	8,010,000	
7243	シロキ工業	6,000	224.00	1,344,000	
7245	大同メタル工業	4,000	404.00	1,616,000	
7246	プレス工業	13,000	299.00	3,887,000	
7248	カルソニックカンセイ	20,000	278.00	5,560,000	
7250	太平洋工業	6,000	318.00	1,908,000	

7251	ケーヒン	5,400	1,732.00	9,352,800	
7256	河西工業	4,000	368.00	1,472,000	
7259	アイシン精機	24,000	2,390.00	57,360,000	
7260	富士機工	3,000	206.00	618,000	
7261	マツダ	177,000	209.00	36,993,000	
7262	ダイハツ工業	27,000	1,051.00	28,377,000	
7263	愛知機械工業	7,000	268.00	1,876,000	
7266	今仙電機製作所	2,100	1,024.00	2,150,400	
7267	本田技研工業	229,500	2,904.00	666,468,000	
7269	スズキ	55,500	1,941.00	107,725,500	
7270	富士重工業	92,000	527.00	48,484,000	
7272	ヤマハ発動機	44,300	1,199.00	53,115,700	
7274	ショーワ	6,200	503.00	3,118,600	
7277	T B K	3,000	302.00	906,000	
7278	エクセディ	3,500	2,670.00	9,345,000	
7282	豊田合成	8,200	1,809.00	14,833,800	
7283	愛三工業	3,000	621.00	1,863,000	
7294	ヨロズ	1,800	1,374.00	2,473,200	
7296	エフ・シー・シー	3,800	1,745.00	6,631,000	
7309	シマノ	12,000	4,260.00	51,120,000	
7312	タカタ	4,500	2,007.00	9,031,500	
7313	テイ・エス テック	5,500	1,302.00	7,161,000	
7728	日本電産トーソク	1,800	876.00	1,576,800	
4543	テルモ	21,000	4,280.00	89,880,000	
5187	クリエートメディック	900	808.00	727,200	
6376	日機装	9,000	600.00	5,400,000	
7701	島津製作所	32,000	626.00	20,032,000	
7702	J M S	4,000	300.00	1,200,000	
7714	モリテックス	700	239.00	167,300	
7715	長野計器	1,700	625.00	1,062,500	
7721	東京計器	10,000	109.00	1,090,000	
7723	愛知時計電機	3,000	226.00	678,000	
7729	東京精密	5,600	1,069.00	5,986,400	
7731	ニコン	50,800	1,534.00	77,927,200	
7732	トプコン	5,900	324.00	1,911,600	
7733	オリンパス	31,900	2,209.00	70,467,100	
7734	理研計器	2,400	511.00	1,226,400	
7740	タムロン	2,800	1,551.00	4,342,800	
7741	H O Y A	63,000	1,921.00	121,023,000	
7744	ノーリツ鋼機	2,300	497.00	1,143,100	
7745	エー・アンド・デイ	2,200	369.00	811,800	
7756	日本電産コバル	2,900	1,231.00	3,569,900	
7762	シチズンホールディングス	31,700	475.00	15,057,500	
7769	リズム時計工業	13,000	136.00	1,768,000	
8050	セイコーホールディングス	10,000	285.00	2,850,000	
8086	ニプロ	5,800	1,664.00	9,651,200	
7825	S R I スポーツ	18	87,500.00	1,575,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	31,700	738.00	23,394,600	

7838	共立印刷	2,600	111.00	288,600	
7840	フランスベッドホールディングス	20,000	103.00	2,060,000	
7846	パイロットコーポレーション	28	130,300.00	3,648,400	
7862	トッパン・フォームズ	5,200	756.00	3,931,200	
7864	フジシールインターナショナル	2,700	1,671.00	4,511,700	
7867	タカラトミー	8,700	623.00	5,420,100	
7868	廣濟堂	2,300	125.00	287,500	
7885	タカノ	1,200	390.00	468,000	
7893	プロネクサス	3,200	414.00	1,324,800	

[次へ](#)

7897	ホクシン	2,100	89.00	186,900	
7898	ウッドワン	5,000	231.00	1,155,000	
7905	大建工業	12,000	187.00	2,244,000	
7911	凸版印刷	82,000	648.00	53,136,000	
7912	大日本印刷	82,000	1,037.00	85,034,000	
7913	図書印刷	5,000	121.00	605,000	
7914	共同印刷	9,000	176.00	1,584,000	
7915	日本写真印刷	4,500	1,826.00	8,217,000	
7916	光村印刷	3,000	267.00	801,000	
7921	宝印刷	1,200	648.00	777,600	
7935	コンビ	1,500	636.00	954,000	
7936	アシックス	25,000	864.00	21,600,000	
7937	ツツミ	1,300	1,955.00	2,541,500	
7944	ローランド	2,800	855.00	2,394,000	
7949	小松ウオール工業	1,000	730.00	730,000	
7951	ヤマハ	19,700	1,005.00	19,798,500	
7952	河合楽器製作所	11,000	129.00	1,419,000	
7955	クリナップ	3,000	511.00	1,533,000	
7956	ビジョン	1,700	2,436.00	4,141,200	
7960	パラマウントベッド	2,900	2,144.00	6,217,600	
7961	兼松日産農林	5,000	87.00	435,000	
7962	キングジム	2,200	557.00	1,225,400	
7966	リンテック	6,200	1,797.00	11,141,400	
7968	田崎真珠	6,000	58.00	348,000	
7972	イトーキ	6,100	202.00	1,232,200	
7974	任天堂	15,400	21,550.00	331,870,000	
7976	三菱鉛筆	2,500	1,373.00	3,432,500	
7981	タカラスタンド	13,000	492.00	6,396,000	
7984	コクヨ	15,200	606.00	9,211,200	
7987	ナカバヤシ	6,000	170.00	1,020,000	
7994	岡村製作所	11,000	422.00	4,642,000	
8022	美津濃	14,000	346.00	4,844,000	
8170	ユニハア	3,300	972.00	3,207,600	
9501	東京電力	200,200	1,896.00	379,579,200	代用有価証券17,000株
9502	中部電力	89,800	1,958.00	175,828,400	
9503	関西電力	110,500	1,957.00	216,248,500	
9504	中国電力	40,300	1,607.00	64,762,100	
9505	北陸電力	27,900	1,886.00	52,619,400	
9506	東北電力	68,300	1,756.00	119,934,800	
9507	四国電力	29,600	2,303.00	68,168,800	
9508	九州電力	60,100	1,843.00	110,764,300	
9509	北海道電力	25,300	1,650.00	41,745,000	
9511	沖縄電力	1,900	3,675.00	6,982,500	
9513	電源開発	18,100	2,308.00	41,774,800	
9531	東京瓦斯	340,000	373.00	126,820,000	
9532	大阪瓦斯	293,000	299.00	87,607,000	
9533	東邦瓦斯	75,000	410.00	30,750,000	



9534	北海道瓦斯	5,000	242.00	1,210,000	
9536	西部瓦斯	33,000	231.00	7,623,000	
9543	静岡瓦斯	7,500	468.00	3,510,000	
9001	東武鉄道	117,000	464.00	54,288,000	
9003	相鉄ホールディングス	46,000	248.00	11,408,000	
9005	東京急行電鉄	149,000	359.00	53,491,000	
9006	京浜急行電鉄	75,000	755.00	56,625,000	
9007	小田急電鉄	87,000	746.00	64,902,000	
9008	京王電鉄	76,000	567.00	43,092,000	
9009	京成電鉄	40,000	542.00	21,680,000	
9010	富士急行	8,000	436.00	3,488,000	
9020	東日本旅客鉄道	50,700	5,040.00	255,528,000	
9021	西日本旅客鉄道	235	294,700.00	69,254,500	
9022	東海旅客鉄道	233	608,000.00	141,664,000	
9030	アートコーポレーション	600	1,264.00	758,400	
9031	西日本鉄道	38,000	338.00	12,844,000	
9037	ハマキョウレックス	800	1,930.00	1,544,000	
9039	サカイ引越センター	500	1,700.00	850,000	
9041	近畿日本鉄道	248,000	261.00	64,728,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	184,000	387.00	71,208,000	
9044	南海電気鉄道	57,000	350.00	19,950,000	
9045	京阪電気鉄道	61,000	357.00	21,777,000	
9047	名糖運輸	1,100	604.00	664,400	
9048	名古屋鉄道	96,000	223.00	21,408,000	
9062	日本通運	116,000	311.00	36,076,000	
9064	ヤマトホールディングス	55,100	1,011.00	55,706,100	
9065	山九	32,000	334.00	10,688,000	
9067	丸運	1,600	204.00	326,400	
9068	丸全昭和運輸	9,000	258.00	2,322,000	
9069	センコー	10,000	239.00	2,390,000	
9070	トナミホールディングス	7,000	137.00	959,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	8,000	868.00	6,944,000	
9074	日本石油輸送	3,000	180.00	540,000	
9075	福山通運	20,000	394.00	7,880,000	
9076	セイノーホールディングス	21,000	481.00	10,101,000	
9081	神奈川中央交通	4,000	402.00	1,608,000	
9086	日立物流	5,100	1,228.00	6,262,800	
9101	日本郵船	200,000	332.00	66,400,000	
9104	商船三井	131,000	520.00	68,120,000	
9107	川崎汽船	83,000	312.00	25,896,000	
9110	N S ユナイテッド海運	10,000	205.00	2,050,000	
9113	乾汽船	3,200	423.00	1,353,600	
9115	明治海運	2,600	305.00	793,000	
9119	飯野海運	13,100	375.00	4,912,500	
9130	共栄タンカー	2,000	136.00	272,000	
9132	第一中央汽船	19,000	184.00	3,496,000	
9202	全日本空輸	389,000	297.00	115,533,000	
9232	パスコ	4,000	199.00	796,000	

9234	国際航業ホールディングス	2,000	147.00	294,000	
9066	日新	11,000	177.00	1,947,000	
9301	三菱倉庫	19,000	1,011.00	19,209,000	
9302	三井倉庫	10,000	311.00	3,110,000	
9303	住友倉庫	20,000	415.00	8,300,000	
9304	澁澤倉庫	8,000	275.00	2,200,000	
9306	東陽倉庫	5,000	174.00	870,000	
9310	日本トランスシティ	6,000	248.00	1,488,000	
9312	ケイヒン	6,000	84.00	504,000	
9324	安田倉庫	2,300	485.00	1,115,500	
9351	東洋埠頭	9,000	133.00	1,197,000	
9358	宇徳	1,900	214.00	406,600	
9364	上組	32,000	621.00	19,872,000	
9366	サンリツ	800	541.00	432,800	
9368	キムラユニティー	700	647.00	452,900	
9369	キューソー流通システム	900	908.00	817,200	
9370	郵船ロジスティクス	2,300	1,077.00	2,477,100	
9375	近鉄エクスプレス	2,300	1,864.00	4,287,200	
9380	東海運	1,900	162.00	307,800	
9382	バンテック	14	115,100.00	1,611,400	
2317	システナ	29	63,600.00	1,844,400	
2327	新日鉄ソリューションズ	2,400	1,431.00	3,434,400	
2359	コア	1,100	605.00	665,500	
3626	ITホールディングス	8,700	887.00	7,716,900	
3632	グリー	4,500	1,008.00	4,536,000	
3635	コーエーテクモホールディングス	5,700	507.00	2,889,900	
3715	ダウンゴ	14	157,600.00	2,206,400	
3724	ベリサーブ	2	113,000.00	226,000	
3730	マクロミル	14	121,500.00	1,701,000	
3738	ティーガイア	23	109,500.00	2,518,500	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	6	155,300.00	931,800	
3770	ザッパラス	16	107,500.00	1,720,000	
3774	インターネットイニシアティブ	17	168,500.00	2,864,500	
3789	ソネットエンタテインメント	14	206,700.00	2,893,800	
3817	SRAホールディングス	1,400	774.00	1,083,600	
3820	JBSホールディングス	3,000	308.00	924,000	
3834	朝日ネット	2,000	284.00	568,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステム	600	2,187.00	1,312,200	
4295	フェイス	98	5,790.00	567,420	
4307	野村総合研究所	16,300	1,490.00	24,287,000	
4312	サイバネットシステム	24	21,380.00	513,120	
4326	インテージ	900	1,593.00	1,433,700	
4340	シンプレクス・ホールディングス	37	38,400.00	1,420,800	
4344	ソースネクスト	5	22,130.00	110,650	
4674	クレスコ	700	410.00	287,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	300	100,400.00	30,120,000	
4684	オービック	900	13,730.00	12,357,000	

4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	600	659.00	395,400	
4689	ヤフー	1,579	28,120.00	44,401,480	
4704	トレンドマイクロ	12,700	2,303.00	29,248,100	
4716	日本オラクル	4,600	3,590.00	16,514,000	
4719	アルファシステムズ	800	1,619.00	1,295,200	
4722	フューチャーアーキテクト	35	28,370.00	992,950	
4725	シーエーシー	1,800	589.00	1,060,200	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	700	580.00	406,000	
4728	トーセ	700	471.00	329,700	
4733	オービックビジネスコンサルタント	750	4,140.00	3,105,000	
4738	日立ビジネスソリューション	900	709.00	638,100	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	4,100	2,506.00	10,274,600	
4743	アイティフォー	3,200	235.00	752,000	
4746	東計電算	500	1,076.00	538,000	
4762	エクスネット	2	132,000.00	264,000	
4768	大塚商会	2,300	4,885.00	11,235,500	
4776	サイボウズ	38	20,810.00	790,780	
4779	ソフトブレーン	42	5,290.00	222,180	
4799	アグレックス	600	756.00	453,600	
4812	電通国際情報サービス	1,800	522.00	939,600	
4825	ウェザーニューズ	700	1,197.00	837,900	
4826	C I J	2,700	255.00	688,500	
6791	日本コロムビア	22,000	23.00	506,000	
7518	ネットワンシステムズ	55	111,000.00	6,105,000	
7595	アルゴグラフィックス	1,100	920.00	1,012,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,200	1,198.00	5,031,600	
8056	日本ユニシス	7,000	496.00	3,472,000	
8096	兼松エレクトロニクス	1,600	783.00	1,252,800	
9401	東京放送ホールディングス	15,500	975.00	15,112,500	
9404	日本テレビ放送網	2,530	10,220.00	25,856,600	
9409	テレビ朝日	73	108,200.00	7,898,600	
9412	スカパーJSATホールディングス	218	25,850.00	5,635,300	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,100	1,180.00	1,298,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,400	385.00	924,000	
9427	イー・アクセス	161	56,900.00	9,160,900	
9430	NECモバイルリング	900	2,093.00	1,883,700	
9432	日本電信電話	113,400	3,665.00	415,611,000	代用有価証券12,300株
9433	KDDI	447	427,000.00	190,869,000	
9435	光通信	3,700	1,460.00	5,402,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,378	133,900.00	318,414,200	
9448	インボイス	1,586	1,021.00	1,619,306	
9449	GMOインターネット	8,200	291.00	2,386,200	
9470	学研ホールディングス	13,000	142.00	1,846,000	
9474	ゼンリン	3,800	845.00	3,211,000	
9475	昭文社	1,600	545.00	872,000	
9477	角川グループホールディングス	2,500	1,894.00	4,735,000	
9479	インプレスホールディングス	2,400	115.00	276,000	

9600	アイネット	1,400	432.00	604,800	
9601	松竹	18,000	512.00	9,216,000	
9602	東宝	20,500	1,257.00	25,768,500	
9605	東映	11,000	336.00	3,696,000	
9607	葵プロモーション	1,500	422.00	633,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	178	249,400.00	44,393,200	
9682	D T S	2,800	856.00	2,396,800	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	1,732.00	12,643,600	
9692	シーイーシー	1,500	375.00	562,500	
9697	カプコン	6,100	1,302.00	7,942,200	
9717	ジャステック	1,700	500.00	850,000	
9719	住商情報システム	3,000	1,144.00	3,432,000	
9737	C S K	10,900	272.00	2,964,800	
9739	日本システムウエア	1,100	307.00	337,700	
9742	アイネス	3,500	467.00	1,634,500	
9746	T K C	2,200	1,590.00	3,498,000	
9749	富士ソフト	3,600	1,205.00	4,338,000	
9759	N S D	6,000	840.00	5,040,000	
9766	コナミ	11,700	1,457.00	17,046,900	
9790	福井コンピュータ	700	391.00	273,700	
9889	J B C Cホールディングス	2,200	500.00	1,100,000	
9984	ソフトバンク	117,600	2,632.00	309,523,200	
1352	ハウスイ	2,000	96.00	192,000	
2657	インターニックス	1,100	341.00	375,100	
2676	高千穂交易	1,100	843.00	927,300	
2692	伊藤忠食品	700	2,716.00	1,901,200	
2715	エレマテック	1,900	1,053.00	2,000,700	
2729	J A L U X	800	660.00	528,000	
2737	トーメンデバイス	400	1,607.00	642,800	
2768	双日	192,600	143.00	27,541,800	
2784	アルフレッサホールディングス	7,000	3,495.00	24,465,000	
2874	横浜冷凍	6,200	509.00	3,155,800	
3004	神栄	4,000	130.00	520,000	
3022	山下医科器械	200	1,026.00	205,200	
3023	ラサ商事	1,300	290.00	377,000	
3076	あいホールディングス	6,200	277.00	1,717,400	
3107	ダイワボウホールディングス	27,000	190.00	5,130,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,800	681.00	2,587,800	
3156	U K Cホールディングス	1,700	797.00	1,354,900	
3315	日本コークス工業	24,500	136.00	3,332,000	
3321	ミタチ産業	700	403.00	282,100	
3332	J F E 商事ホールディングス	19,000	323.00	6,137,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,400	789.00	2,682,600	
5009	富士興産	10,000	60.00	600,000	
6973	協栄産業	3,000	143.00	429,000	
7414	小野建	2,300	629.00	1,446,700	
7420	佐島電機	2,000	579.00	1,158,000	

7427	エコトレーディング	700	752.00	526,400	
7433	伯東	1,800	679.00	1,222,200	
7442	中山福	1,700	548.00	931,600	
7447	ナガイレーベン	1,500	1,946.00	2,919,000	
7451	菱食	2,800	1,791.00	5,014,800	
7456	松田産業	1,800	1,394.00	2,509,200	
7459	メディパルホールディングス	28,800	954.00	27,475,200	
7463	アドヴァン	1,700	576.00	979,200	
7466	S P K	600	1,088.00	652,800	
7476	アズワン	1,700	1,563.00	2,657,100	
7480	スズデン	900	477.00	429,300	
7482	シモジマ	2,000	1,115.00	2,230,000	
7483	ドウシシャ	1,400	1,965.00	2,751,000	
7504	高速	1,700	701.00	1,191,700	
7517	黒田電気	3,800	989.00	3,758,200	
7537	丸文	2,300	369.00	848,700	
7552	ハピネット	800	935.00	748,000	
7558	トーマンエレクトロニクス	900	979.00	881,100	
7591	エクセル	1,200	848.00	1,017,600	
7594	マルカキカイ	900	589.00	530,100	
7599	ガリバーインターナショナル	680	4,355.00	2,961,400	
7600	日本エム・ディ・エム	2,400	171.00	410,400	
7607	進和	1,600	816.00	1,305,600	
7608	エスケイジャパン	600	239.00	143,400	
7609	ダイトエレクトロン	1,200	507.00	608,400	
7613	シークス	1,800	747.00	1,344,600	
7619	田中商事	900	278.00	250,200	
7628	オーハシテクニカ	1,700	525.00	892,500	
7631	マクニカ	1,200	1,710.00	2,052,000	
7637	白銅	900	761.00	684,900	
8001	伊藤忠商事	186,500	724.00	135,026,000	
8002	丸紅	220,000	520.00	114,400,000	
8007	高島	5,000	121.00	605,000	
8008	F & A アクアホールディングス	2,300	699.00	1,607,700	
8012	長瀬産業	15,000	940.00	14,100,000	
8014	蝶理	20,000	89.00	1,780,000	
8015	豊田通商	25,700	1,284.00	32,998,800	
8018	三共生興	4,900	254.00	1,244,600	
8020	兼松	61,000	66.00	4,026,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	73.00	365,000	
8031	三井物産	231,800	1,299.00	301,108,200	
8032	日本紙パルプ商事	15,000	275.00	4,125,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	8,700	1,516.00	13,189,200	
8037	カメイ	3,000	331.00	993,000	
8038	東都水産	5,000	109.00	545,000	
8043	スターゼン	10,000	218.00	2,180,000	
8051	山善	11,100	338.00	3,751,800	
8052	椿本興業	3,000	200.00	600,000	

8053	住友商事	147,200	1,070.00	157,504,000	
8057	内田洋行	6,000	277.00	1,662,000	
8058	三菱商事	215,000	1,973.00	424,195,000	
8059	第一実業	6,000	235.00	1,410,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	9,600	1,004.00	9,638,400	
8061	西華産業	11,000	176.00	1,936,000	
8065	佐藤商事	2,600	425.00	1,105,000	
8068	菱洋エレクトロ	3,200	772.00	2,470,400	
8070	東京産業	2,500	241.00	602,500	
8074	ユアサ商事	29,000	70.00	2,030,000	
8075	神鋼商事	7,000	169.00	1,183,000	
8078	阪和興業	29,000	323.00	9,367,000	
8081	カナデン	3,000	443.00	1,329,000	
8084	菱電商事	4,000	440.00	1,760,000	
8087	フルサト工業	1,600	414.00	662,400	
8088	岩谷産業	30,000	237.00	7,110,000	
8089	すてきナイスグループ	13,000	174.00	2,262,000	
8090	昭光通商	10,000	112.00	1,120,000	
8091	ニチモウ	4,000	128.00	512,000	
8093	極東貿易	3,000	122.00	366,000	
8095	イワキ	3,000	181.00	543,000	
8097	三愛石油	7,000	333.00	2,331,000	
8098	稲畑産業	7,100	415.00	2,946,500	
8101	G S Iクレオス	8,000	97.00	776,000	
8103	明和産業	2,300	215.00	494,500	
8129	東邦ホールディングス	7,400	1,166.00	8,628,400	
8130	サンゲツ	4,700	1,768.00	8,309,600	
8131	ミツウロコ	4,600	457.00	2,102,200	
8132	シナネン	7,000	303.00	2,121,000	
8133	伊藤忠エネクス	6,400	374.00	2,393,600	
8134	ザ・トーカイ	7,000	338.00	2,366,000	
8136	サンリオ	8,000	1,787.00	14,296,000	
8137	サンワテクノス	1,400	522.00	730,800	
8140	リョーサン	4,400	2,004.00	8,817,600	
8141	新光商事	2,700	604.00	1,630,800	
8142	トーホー	6,000	292.00	1,752,000	
8150	三信電気	3,000	661.00	1,983,000	
8151	東陽テクニカ	3,900	774.00	3,018,600	
8153	モスフードサービス	3,800	1,438.00	5,464,400	
8154	加賀電子	2,900	899.00	2,607,100	
8158	ソーダニッカ	3,000	315.00	945,000	
8159	立花エレクトック	1,800	570.00	1,026,000	
8283	P a l t a c	2,300	1,365.00	3,139,500	
8835	太平洋興発	9,000	57.00	513,000	
9305	ヤマタネ	13,000	99.00	1,287,000	
9763	丸紅建材リース	3,000	96.00	288,000	
9810	日鐵商事	7,000	228.00	1,596,000	
9830	トラスコ中山	3,300	1,147.00	3,785,100	

9832	オートボックスセブン	3,400	3,070.00	10,438,000	
9869	加藤産業	4,200	1,168.00	4,905,600	
9882	イエローハット	2,700	526.00	1,420,200	
9883	富士エレクトロニクス	1,600	986.00	1,577,600	
9896	J Kホールディングス	2,400	334.00	801,600	
9902	日伝	1,200	2,389.00	2,866,800	
9930	北沢産業	2,500	146.00	365,000	

[次へ](#)

9932	杉本商事	1,500	648.00	972,000	
9934	因幡電機産業	3,000	1,959.00	5,877,000	
9938	住金物産	14,000	168.00	2,352,000	
9962	ミスミグループ本社	9,700	1,686.00	16,354,200	
9963	江守商事	600	720.00	432,000	
9972	アルテック	1,200	231.00	277,200	
9982	タキヒヨー	5,000	391.00	1,955,000	
9987	スズケン	10,200	2,602.00	26,540,400	
9991	ジェコス	2,000	288.00	576,000	
2651	ローソン	8,200	3,710.00	30,422,000	
2659	サンエー	1,000	3,225.00	3,225,000	
2660	キリン堂	1,100	373.00	410,300	
2662	ダイユーエイト	400	438.00	175,200	
2664	カワチ薬品	1,800	1,412.00	2,541,600	
2670	エービーシー・マート	2,700	2,844.00	7,678,800	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	380.00	456,000	
2678	アスクル	2,100	1,640.00	3,444,000	
2681	ゲオ	48	79,000.00	3,792,000	
2685	ポイント	2,430	3,330.00	8,091,900	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	101.00	202,000	
2695	くらコーポレーション	1,500	1,325.00	1,987,500	
2698	キャンドゥ	12	93,100.00	1,117,200	
2726	バル	750	2,572.00	1,929,000	
2730	エディオン	11,500	586.00	6,739,000	
2734	サーラコーポレーション	3,000	438.00	1,314,000	
2738	バルス	12	88,600.00	1,063,200	
2753	あみやき亭	5	233,600.00	1,168,000	
2792	ハニーズ	2,530	1,130.00	2,858,900	
3028	アルペン	2,200	1,237.00	2,721,400	
3048	ビックカメラ	70	31,900.00	2,233,000	
3050	D C Mホールディングス	14,400	406.00	5,846,400	
3064	M o n o t a R O	600	754.00	452,400	
3078	ユニバース	500	1,199.00	599,500	
3086	J . フロント リテイリング	68,000	420.00	28,560,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	4,600	1,113.00	5,119,800	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,800	1,522.00	7,305,600	
3098	ココカラファイン	2,800	1,661.00	4,650,800	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	50,000	898.00	44,900,000	
3148	クリエイイトSDホールディングス	1,000	1,789.00	1,789,000	
3159	C H Iグループ	1,400	282.00	394,800	
3313	ブックオフコーポレーション	1,200	644.00	772,800	
3333	あさひ	1,200	1,121.00	1,345,200	
3337	サークルKサンクス	5,500	1,138.00	6,259,000	
3341	日本調剤	360	2,720.00	979,200	
3349	コスモス薬品	1,300	2,597.00	3,376,100	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	112,300	1,896.00	212,920,800	
3391	ツルハホールディングス	2,100	3,515.00	7,381,500	



3395	サンマルクホールディングス	800	2,866.00	2,292,800	
3396	フェリシモ	700	1,045.00	731,500	
3397	トリドール	7	117,300.00	821,100	
4350	メディカルシステムネットワーク	400	618.00	247,200	
4775	総合メディカル	600	2,090.00	1,254,000	
7416	はるやま商事	1,400	319.00	446,600	
7421	カップ・クリエイト	1,900	1,784.00	3,389,600	
7445	ライトオン	2,200	325.00	715,000	
7448	ジーンズメイト	900	162.00	145,800	
7453	良品計画	3,100	2,850.00	8,835,000	
7455	三城ホールディングス	3,600	639.00	2,300,400	
7494	コナカ	3,400	160.00	544,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,209.00	362,700	
7508	G - 7ホールディングス	900	475.00	427,500	
7512	イオン北海道	1,800	271.00	487,800	
7513	コジマ	3,900	370.00	1,443,000	
7516	コーナン商事	2,500	933.00	2,332,500	
7520	エコス	1,000	316.00	316,000	
7522	ワタミ	3,000	1,525.00	4,575,000	
7524	マルシェ	700	652.00	456,400	
7532	ドン・キホーテ	4,600	2,195.00	10,097,000	
7541	メガネトップ	2,500	815.00	2,037,500	
7545	西松屋チェーン	6,300	764.00	4,813,200	
7550	ゼンショー	11,000	741.00	8,151,000	
7554	幸楽苑	1,600	1,158.00	1,852,800	
7561	ハークスレイ	700	528.00	369,600	
7581	サイゼリヤ	3,800	1,485.00	5,643,000	
7601	ポプラ	800	489.00	391,200	
7606	ユナイテッドアローズ	3,100	1,029.00	3,189,900	
7611	ハイデイ日高	1,200	1,184.00	1,420,800	
7615	京都きもの友禅	1,700	857.00	1,456,900	
7616	コロワイド	8,000	438.00	3,504,000	
7630	壱番屋	1,000	2,256.00	2,256,000	
7640	トップカルチャー	1,100	379.00	416,900	
7649	スギホールディングス	4,000	1,888.00	7,552,000	
8005	スクロール	3,400	314.00	1,067,600	
8028	ファミリーマート	8,900	2,864.00	25,489,600	
8160	木曽路	3,100	1,665.00	5,161,500	
8165	千趣会	5,200	445.00	2,314,000	
8166	タカキュー	2,500	139.00	347,500	
8168	ケーヨー	5,400	392.00	2,116,800	
8173	上新電機	6,000	749.00	4,494,000	
8174	日本瓦斯	3,000	1,120.00	3,360,000	
8175	ベスト電器	9,000	238.00	2,142,000	
8178	マルエツ	6,000	296.00	1,776,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,400	818.00	3,599,200	
8181	東天紅	2,000	125.00	250,000	
8182	いなげや	3,000	870.00	2,610,000	

8184	島忠	5,600	1,643.00	9,200,800	
8185	チヨダ	3,800	976.00	3,708,800	
8193	鈴丹	700	152.00	106,400	
8194	ライフコーポレーション	1,800	1,249.00	2,248,200	
8196	カスミ	5,900	418.00	2,466,200	
8200	リンガーハット	2,000	960.00	1,920,000	
8201	さが美	2,000	104.00	208,000	
8203	M r M a x	2,900	274.00	794,600	
8207	テンアライド	1,900	263.00	499,700	
8214	A O K Iホールディングス	2,700	1,174.00	3,169,800	
8217	オークワ	4,000	795.00	3,180,000	
8218	コメリ	3,500	1,707.00	5,974,500	
8219	青山商事	6,700	1,295.00	8,676,500	
8227	しまむら	3,000	7,670.00	23,010,000	
8229	C F Sコーポレーション	2,500	467.00	1,167,500	
8233	高島屋	36,000	627.00	22,572,000	
8237	松屋	5,300	433.00	2,294,900	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	15,000	539.00	8,085,000	
8245	丸栄	4,000	81.00	324,000	
8248	ニッセンホールディングス	5,800	348.00	2,018,400	
8251	パルコ	7,500	632.00	4,740,000	
8252	丸井グループ	31,700	643.00	20,383,100	
8255	原信ナルスホールディングス	1,600	1,012.00	1,619,200	
8263	ダイエー	12,200	299.00	3,647,800	
8266	イズミヤ	9,000	282.00	2,538,000	
8267	イオン	94,200	982.00	92,504,400	
8270	ユニー	21,600	690.00	14,904,000	
8273	イズミ	6,900	1,073.00	7,403,700	
8274	東武ストア	4,000	230.00	920,000	
8276	平和堂	5,300	996.00	5,278,800	
8278	フジ	3,200	1,592.00	5,094,400	
8279	ヤオコー	1,300	2,260.00	2,938,000	
8281	ゼビオ	3,000	1,605.00	4,815,000	
8282	ケーズホールディングス	5,500	2,006.00	11,033,000	
8289	O l y m p i c	1,900	580.00	1,102,000	
8291	東日カーライフグループ	4,000	63.00	252,000	
9627	アインファーマシーズ	900	2,623.00	2,360,700	
9828	元気寿司	800	702.00	561,600	
9831	ヤマダ電機	13,130	4,980.00	65,387,400	
9842	アークランドサカモト	1,700	870.00	1,479,000	
9843	ニトリホールディングス	5,200	6,860.00	35,672,000	
9854	愛眼	2,100	417.00	875,700	
9861	吉野家ホールディングス	78	102,300.00	7,979,400	
9887	松屋フーズ	1,400	1,227.00	1,717,800	
9900	サガミチェーン	3,000	469.00	1,407,000	
9945	ブレナス	3,200	1,156.00	3,699,200	
9946	ミニストップ	2,100	1,218.00	2,557,800	
9947	イマージュホールディングス	900	235.00	211,500	

9948	アークス	3,400	1,067.00	3,627,800	
9956	パロー	5,200	608.00	3,161,600	
9974	ベルク	1,100	873.00	960,300	
9979	大庄	1,500	964.00	1,446,000	
9983	ファーストリテイリング	6,700	10,900.00	73,030,000	
9989	サンドラッグ	5,500	2,257.00	12,413,500	
9993	ヤマザワ	800	1,069.00	855,200	
9994	やまや	600	703.00	421,800	
9997	ベルーナ	3,600	399.00	1,436,400	
8303	新生銀行	130,000	65.00	8,450,000	
8304	あおぞら銀行	90,000	136.00	12,240,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,049,000	380.00	778,620,000	
8308	りそなホールディングス	77,000	622.00	47,894,000	
8309	中央三井トラスト・ホールディングス	150,000	290.00	43,500,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	204,800	2,401.00	491,724,800	
8324	第四銀行	38,000	238.00	9,044,000	
8325	北越銀行	30,000	143.00	4,290,000	
8327	西日本シティ銀行	94,000	220.00	20,680,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	39,800	331.00	13,173,800	
8331	千葉銀行	105,000	503.00	52,815,000	
8332	横浜銀行	185,000	396.00	73,260,000	
8333	常陽銀行	104,000	345.00	35,880,000	
8334	群馬銀行	67,000	398.00	26,666,000	
8336	武蔵野銀行	4,400	2,282.00	10,040,800	
8337	千葉興業銀行	5,500	448.00	2,464,000	
8338	筑波銀行	8,800	233.00	2,050,400	
8339	東京都民銀行	5,100	809.00	4,125,900	
8341	七十七銀行	45,000	377.00	16,965,000	
8342	青森銀行	20,000	201.00	4,020,000	
8343	秋田銀行	20,000	235.00	4,700,000	
8344	山形銀行	16,000	365.00	5,840,000	
8345	岩手銀行	1,900	3,355.00	6,374,500	
8346	東邦銀行	24,000	212.00	5,088,000	
8349	東北銀行	15,000	131.00	1,965,000	
8350	みちのく銀行	14,000	166.00	2,324,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	109,000	316.00	34,444,000	
8355	静岡銀行	83,000	691.00	57,353,000	
8356	十六銀行	35,000	231.00	8,085,000	
8358	スルガ銀行	28,000	700.00	19,600,000	
8359	八十二銀行	55,000	401.00	22,055,000	
8360	山梨中央銀行	18,000	293.00	5,274,000	
8361	大垣共立銀行	38,000	221.00	8,398,000	
8362	福井銀行	25,000	248.00	6,200,000	
8363	北國銀行	31,000	319.00	9,889,000	
8364	清水銀行	1,000	3,360.00	3,360,000	
8366	滋賀銀行	27,000	425.00	11,475,000	
8367	南都銀行	27,000	400.00	10,800,000	
8368	百五銀行	27,000	328.00	8,856,000	

8369	京都銀行	48,000	706.00	33,888,000	
8374	三重銀行	12,000	217.00	2,604,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	189,000	149.00	28,161,000	
8379	広島銀行	79,000	335.00	26,465,000	
8381	山陰合同銀行	17,000	536.00	9,112,000	
8382	中国銀行	24,000	954.00	22,896,000	
8383	鳥取銀行	9,000	171.00	1,539,000	
8385	伊予銀行	33,000	588.00	19,404,000	
8386	百十四銀行	32,000	295.00	9,440,000	
8387	四国銀行	21,000	222.00	4,662,000	
8388	阿波銀行	24,000	533.00	12,792,000	
8390	鹿児島銀行	18,000	473.00	8,514,000	
8392	大分銀行	19,000	259.00	4,921,000	
8393	宮崎銀行	18,000	203.00	3,654,000	
8394	肥後銀行	23,000	355.00	8,165,000	
8395	佐賀銀行	16,000	211.00	3,376,000	
8396	十八銀行	18,000	206.00	3,708,000	
8397	沖縄銀行	2,200	3,005.00	6,611,000	
8399	琉球銀行	5,700	945.00	5,386,500	
8403	住友信託銀行	243,000	439.00	106,677,000	
8404	みずほ信託銀行	228,000	74.00	16,872,000	
8409	八千代銀行	1,500	1,762.00	2,643,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,251,400	119.00	386,916,600	
8415	紀陽ホールディングス	107,000	108.00	11,556,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	27,000	732.00	19,764,000	
8521	長野銀行	10,000	149.00	1,490,000	
8522	名古屋銀行	26,000	239.00	6,214,000	
8527	愛知銀行	1,000	4,475.00	4,475,000	
8529	第三銀行	17,000	208.00	3,536,000	
8530	中京銀行	12,000	239.00	2,868,000	
8536	東日本銀行	15,000	146.00	2,190,000	
8541	愛媛銀行	18,000	212.00	3,816,000	
8542	トマト銀行	11,000	149.00	1,639,000	
8543	みなと銀行	30,000	117.00	3,510,000	
8544	京葉銀行	24,000	373.00	8,952,000	
8545	関西アーバン銀行	33,000	126.00	4,158,000	
8550	栃木銀行	14,000	327.00	4,578,000	
8551	北日本銀行	900	1,925.00	1,732,500	
8558	東和銀行	29,000	72.00	2,088,000	
8562	福島銀行	36,000	44.00	1,584,000	
8563	大東銀行	18,000	53.00	954,000	
8600	トモニホールディングス	17,400	302.00	5,254,800	
8713	フィデアホールディングス	13,600	176.00	2,393,600	
8714	池田泉州ホールディングス	113,300	111.00	12,576,300	
8473	SBIホールディングス	3,069	10,000.00	30,690,000	
8595	ジャフコ	3,900	1,709.00	6,665,100	
8601	大和証券グループ本社	254,000	341.00	86,614,000	
8604	野村ホールディングス	538,500	437.00	235,324,500	

8606	みずほ証券	74,000	183.00	13,542,000	
8607	みずほインベスターズ証券	67,000	73.00	4,891,000	
8609	岡三証券グループ	25,000	243.00	6,075,000	
8613	丸三証券	8,900	438.00	3,898,200	
8614	東洋証券	11,000	119.00	1,309,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	30,000	287.00	8,610,000	
8617	光世証券	7,000	72.00	504,000	
8622	水戸証券	8,000	123.00	984,000	
8624	いちよし証券	6,000	497.00	2,982,000	
8628	松井証券	17,100	483.00	8,259,300	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	253.00	354,200	
8698	マネックスグループ	217	21,640.00	4,695,880	
8703	カブドットコム証券	8,800	312.00	2,745,600	
8706	極東証券	3,600	608.00	2,188,800	
8707	岩井コスモホールディングス	2,500	585.00	1,462,500	
8742	小林洋行	800	221.00	176,800	
8630	N K S Jホールディングス	204,000	556.00	113,424,000	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	79,100	2,023.00	160,019,300	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	118	284,800.00	33,606,400	
8750	第一生命保険	1,154	100,000.00	115,400,000	
8763	富士火災海上保険	44,000	100.00	4,400,000	
8766	東京海上ホールディングス	109,300	2,275.00	248,657,500	
8795	T & Dホールディングス	49,350	1,650.00	81,427,500	
8253	クレディセゾン	20,200	1,193.00	24,098,600	
8258	セディナ	22,100	124.00	2,740,400	
8424	芙蓉総合リース	2,500	2,358.00	5,895,000	
8425	興銀リース	4,000	1,727.00	6,908,000	
8439	東京センチュリーリース	6,700	1,186.00	7,946,200	
8511	日本証券金融	11,900	487.00	5,795,300	
8512	大阪証券金融	3,400	145.00	493,000	
8519	ポケットカード	2,700	198.00	534,600	
8566	リコーリース	2,000	2,016.00	4,032,000	
8570	イオンクレジットサービス	12,800	946.00	12,108,800	
8572	アコム	7,230	993.00	7,179,390	
8574	プロミス	12,200	405.00	4,941,000	
8584	ジャックス	17,000	160.00	2,720,000	
8586	日立キャピタル	6,800	1,058.00	7,194,400	
8591	オリックス	13,970	7,360.00	102,819,200	
8593	三菱UFJリース	7,300	2,699.00	19,702,700	
8772	アサックス	4	87,900.00	351,600	
8793	N E Cキャピタルソリューション	1,000	1,025.00	1,025,000	
2353	日本駐車場開発	312	3,365.00	1,049,880	
3003	昭栄	5,200	617.00	3,208,400	
3225	東京建物不動産販売	800	212.00	169,600	
3231	野村不動産ホールディングス	13,800	1,253.00	17,291,400	
3265	ヒューリック	8,200	566.00	4,641,200	

4666	パーク24	13,500	828.00	11,178,000	
8801	三井不動産	120,000	1,574.00	188,880,000	
8802	三菱地所	189,000	1,476.00	278,964,000	
8803	平和不動産	20,500	224.00	4,592,000	
8804	東京建物	59,000	333.00	19,647,000	
8806	ダイビル	7,400	648.00	4,795,200	
8809	サンケイビル	5,000	444.00	2,220,000	
8815	東急不動産	53,000	379.00	20,087,000	
8818	京阪神不動産	3,400	354.00	1,203,600	
8830	住友不動産	65,000	1,827.00	118,755,000	
8833	東宝不動産	3,000	468.00	1,404,000	
8840	大京	40,000	126.00	5,040,000	
8841	テーオーシー	11,200	327.00	3,662,400	
8842	東京楽天地	5,000	298.00	1,490,000	
8848	レオパレス21	18,800	104.00	1,955,200	
8860	フジ住宅	3,300	297.00	980,100	
8864	空港施設	3,000	311.00	933,000	
8869	明和地所	1,600	452.00	723,200	
8870	住友不動産販売	1,040	3,630.00	3,775,200	
8871	ゴールドクレスト	1,940	1,804.00	3,499,760	
8875	東栄住宅	1,700	878.00	1,492,600	
8877	日本エスリード	1,100	750.00	825,000	
8879	東急リバブル	2,600	922.00	2,397,200	
8880	飯田産業	2,200	653.00	1,436,600	
8881	日神不動産	1,500	547.00	820,500	
8895	アーネストワン	4,800	898.00	4,310,400	
8897	タカラレーベン	2,500	529.00	1,322,500	
8904	サンヨーハウジング名古屋	12	72,400.00	868,800	
8905	イオンモール	13,100	1,900.00	24,890,000	
8907	フージャースコーポレーション	36	16,900.00	608,400	
8915	タクトホーム	13	66,200.00	860,600	
8918	ランド	2,200	17.00	37,400	
8924	リサ・パートナーズ	40	28,460.00	1,138,400	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	179	74,500.00	13,335,500	
8934	サンフロンティア不動産	30	9,120.00	273,600	
8944	ランドビジネス	20	12,070.00	241,400	
9706	日本空港ビルデング	9,200	1,353.00	12,447,600	
1954	日本工営	10,000	221.00	2,210,000	
2120	ネクスト	5	76,600.00	383,000	
2127	日本M&Aセンター	6	266,700.00	1,600,200	
2131	アコーディア・ゴルフ	76	76,100.00	5,783,600	
2168	パソナグループ	27	59,700.00	1,611,900	
2170	リンクアンドモチベーション	6	41,250.00	247,500	
2181	テンプホールディングス	4,200	706.00	2,965,200	
2301	学情	1,000	275.00	275,000	
2305	スタジオアリス	1,300	686.00	891,800	
2309	シミック	60	24,100.00	1,446,000	
2322	NECフィールディング	2,500	863.00	2,157,500	

2331	総合警備保障	10,200	830.00	8,466,000	
2371	カカクコム	18	443,000.00	7,974,000	
2378	ルネサンス	1,400	291.00	407,400	
2392	セキュアード・キャピタル・ジャパン	11	67,100.00	738,100	
2395	新日本科学	1,600	367.00	587,200	
2413	エムスリー	12	360,000.00	4,320,000	
2432	ディー・エヌ・エー	10,500	2,030.00	21,315,000	
2433	博報堂D Yホールディングス	3,870	3,730.00	14,435,100	
2440	ぐるなび	16	103,800.00	1,660,800	
2450	一休	19	34,850.00	662,150	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	5	63,200.00	316,000	
2462	ジェイコムホールディングス	3	87,800.00	263,400	
2466	P G Mホールディングス	64	52,800.00	3,379,200	
4282	イーピーエス	16	202,500.00	3,240,000	
4301	アミューズ	800	905.00	724,000	
4310	ドリームインキュベータ	9	47,150.00	424,350	
4319	T A C	1,500	353.00	529,500	
4321	ケネディクス	343	16,130.00	5,532,590	
4324	電通	27,700	1,920.00	53,184,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	106	5,350.00	567,100	
4337	ぴあ	1,000	668.00	668,000	
4343	イオンファンタジー	1,000	820.00	820,000	
4544	みらかホールディングス	5,800	2,984.00	17,307,200	
4641	アルプス技研	1,300	623.00	809,900	
4651	サニックス	4,000	159.00	636,000	
4653	ダイオーズ	600	447.00	268,200	
4658	日本空調サービス	700	707.00	494,900	
4661	オリエンタルランド	7,400	7,920.00	58,608,000	
4665	ダスキン	8,500	1,398.00	11,883,000	
4668	明光ネットワークジャパン	2,500	691.00	1,727,500	
4671	ファルコSDホールディングス	1,700	603.00	1,025,100	
4678	秀英予備校	600	359.00	215,400	
4679	田谷	400	666.00	266,400	
4680	ラウンドワン	5,200	321.00	1,669,200	
4681	リゾートトラスト	4,200	1,301.00	5,464,200	
4694	ビー・エム・エル	1,600	2,069.00	3,310,400	
4696	ワタベウェディング	800	806.00	644,800	
4708	もしもしホットライン	1,900	1,871.00	3,554,900	
4711	東急コミュニティー	700	2,308.00	1,615,600	
4714	リソー教育	309	3,730.00	1,152,570	
4724	ウェアハウス	700	249.00	174,300	
4732	ユー・エス・エス	3,690	6,300.00	23,247,000	
4745	東京個別指導学院	1,600	241.00	385,600	
4756	カルチャア・コンビニエンス・クラブ	10,600	361.00	3,826,600	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	452.00	361,600	
4801	セントラルスポーツ	800	856.00	684,800	
5261	リゾートソリューション	3,000	151.00	453,000	
9603	エイチ・アイ・エス	3,100	1,673.00	5,186,300	

9616	共立メンテナンス	1,200	1,084.00	1,300,800	
9619	イチネンホールディングス	3,000	355.00	1,065,000	
9621	建設技術研究所	1,800	429.00	772,200	
9628	燦ホールディングス	600	1,265.00	759,000	
9632	スバル興業	2,000	228.00	456,000	
9633	東京テアトル	10,000	104.00	1,040,000	
9667	ホリプロ	900	643.00	578,700	
9671	よみうりランド	6,000	280.00	1,680,000	
9672	東京都競馬	21,000	118.00	2,478,000	
9675	常磐興産	9,000	115.00	1,035,000	
9678	カナモト	4,000	423.00	1,692,000	
9681	東京ドーム	21,000	208.00	4,368,000	
9715	トランス・コスモス	3,500	627.00	2,194,500	
9716	乃村工藝社	6,000	217.00	1,302,000	
9722	藤田観光	8,000	348.00	2,784,000	
9726	近畿日本ツーリスト	10,000	73.00	730,000	
9728	日本管財	1,100	1,278.00	1,405,800	
9731	白洋舎	3,000	243.00	729,000	
9735	セコム	27,400	3,725.00	102,065,000	
9740	セントラル警備保障	1,200	790.00	948,000	
9743	丹青社	3,000	172.00	516,000	
9744	メイテック	4,100	1,557.00	6,383,700	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,900	1,842.00	9,025,800	
9755	応用地質	2,900	672.00	1,948,800	
9757	船井総合研究所	3,300	499.00	1,646,700	
9760	進学会	1,700	252.00	428,400	
9783	ベネッセホールディングス	9,600	3,705.00	35,568,000	
9787	イオンディライト	2,900	1,505.00	4,364,500	
9788	ナック	700	922.00	645,400	
9792	ニチイ学館	6,000	689.00	4,134,000	
9793	ダイセキ	4,900	1,487.00	7,286,300	
	合計	41,691,097		30,129,031,406	

(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。

[次へ](#)



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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成21年10月26日現在	平成22年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		325,562,561	1,151,205,573
コール・ローン		282,273,310	302,487,637
株式		69,620,560,066	67,507,160,823
新株予約権証券		2,817	
投資証券		972,114,978	1,132,774,504
派生商品評価勘定		30,952,229	32,312,950
未収入金		16,258,785	6,420,863
未収配当金		61,611,611	56,114,448
未収利息			717
差入委託証拠金		364,619,828	459,629,159
流動資産合計		71,673,956,185	70,648,106,674
資産合計		71,673,956,185	70,648,106,674
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,229,877	5,639,953
未払金			2,355,711
未払解約金		8,202,007	161,136,873
流動負債合計		10,431,884	169,132,537
負債合計		10,431,884	169,132,537
純資産の部			
元本等			
元本		81,113,705,231	83,174,708,677
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		9,450,180,930	12,695,734,540
元本等合計		71,663,524,301	70,478,974,137
純資産合計		71,663,524,301	70,478,974,137
負債純資産合計		71,673,956,185	70,648,106,674

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(1) デリバティブ取引 同左</p> <p>(2) 為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1. 期首	平成20年10月28日	1. 期首	平成21年10月27日

期首元本額	77,820,389,733円	期首元本額	81,113,705,231円
期首からの追加設定元本額	21,427,250,271円	期首からの追加設定元本額	10,617,791,534円
期首からの一部解約元本額	18,133,934,773円	期首からの一部解約元本額	8,556,788,088円
平成21年10月26日現在の元本の 内訳		平成22年10月26日現在の元本の 内訳	
インデックスファンド海外株式 ヘッジなし(DC専用)	9,117,356,044円	インデックスファンド海外株式 ヘッジなし(DC専用)	11,060,121,732円
DCインデックスバランス(株 式20)	37,867,008円	DCインデックスバランス(株 式20)	42,762,889円
DCインデックスバランス(株 式40)	143,955,460円	DCインデックスバランス(株 式40)	157,619,037円
DCインデックスバランス(株 式60)	278,670,542円	DCインデックスバランス(株 式60)	306,043,383円
DCインデックスバランス(株 式80)	301,414,972円	DCインデックスバランス(株 式80)	326,203,319円
世界の財産3分法ファンド(不 動産・債券・株式)毎月分配型	19,625,582,867円	世界の財産3分法ファンド(不 動産・債券・株式)毎月分配型	17,717,955,512円
日興五大陸株式ファンド	24,189,978,867円	日興五大陸株式ファンド	24,118,120,284円
全世界株式債券ファンド(日本 ・先進国・新興国)毎月分配型	82,880,289円	全世界株式債券ファンド(日本 ・先進国・新興国)毎月分配型	88,481,960円
日興ストラテジック・アローケー ション・ファンド(株式資産)	233,605,655円	日興ストラテジック・アローケー ション・ファンド(株式資産)	202,197,283円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式80)	26,445,181円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式80)	25,396,885円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式60)	23,345,864円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式60)	22,762,971円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式40)	40,517,089円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式40)	38,818,023円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式20)	51,831,232円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式20)	49,240,747円
国際分散型ファンド40(適格機 関投資家向け)	19,054,989,782円	国際分散型ファンド40(適格機 関投資家向け)	20,467,941,165円
3資産バランスファンド(適格 機関投資家向け)	176,360,524円	3資産バランスファンド(適格 機関投資家向け)	112,146,456円
グローバルバランスファンド35 (適格機関投資家向け)	31,437,801円	グローバルバランスファンド35 (適格機関投資家向け)	26,468,943円
年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式20)	41,301,828円	年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式20)	45,396,324円
年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式40)	109,702,383円	年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式40)	118,980,185円
年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式60)	141,376,749円	年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式60)	159,499,292円
年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式80)	147,533,927円	年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式80)	154,166,467円
年金積立 インデックスファン ド海外株式(ヘッジなし)	7,257,551,167円	年金積立 インデックスファン ド海外株式(ヘッジなし)	7,934,385,820円
計	81,113,705,231円	計	83,174,708,677円

<p>2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 81,113,705,231口</p> <p>3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,450,180,930円であります。</p>	<p>2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 83,174,708,677口</p> <p>3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は12,695,734,540円であります。</p>
---	--

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

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

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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>
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。

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## I 取引の状況に関する事項

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

## 取引の時価に関する事項

## (1) 株式関連

(平成21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	1,028,473,203		1,045,327,394	16,859,186
	合計	1,028,473,203		1,045,327,394	16,859,186

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

(注) 時価の算定方法

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

## (2) 通貨関連

(平成21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	397,813,394		409,681,560	11,868,166
	米ドル	167,228,813		171,562,560	4,333,747
	ユーロ	230,584,581		238,119,000	7,534,419
合計		397,813,394		409,681,560	11,868,166

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.8835円	1口当たり純資産額	0.8474円
(1万口当たり純資産額)	(8,835円)	(1万口当たり純資産額)	(8,474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	株	米ドル	米ドル	
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	5,900	45.79	270,161.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	20,103	62.78	1,262,066.34	
APACHE CORP	14,659	101.07	1,481,585.13	
ARCH COAL INC	8,575	25.07	214,975.25	
BAKER HUGHES INC	16,470	46.58	767,172.60	
CABOT OIL & GAS CORP	5,310	30.92	164,185.20	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,101	43.32	394,255.32	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	24,630	21.16	521,170.80	
CHEVRON CORP	81,616	84.87	6,926,749.92	
CIMAREX ENERGY CO	4,510	72.18	325,531.80	
CONOCOPHILLIPS	57,450	61.34	3,523,983.00	
CONSOL ENERGY INC	7,633	38.53	294,099.49	
DENBURY RESOURCES INC	10,025	17.12	171,628.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	17,251	65.02	1,121,660.02	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,405	69.50	167,147.50	
EOG RESOURCES INC	10,686	97.46	1,041,457.56	
EXXON MOBIL CORP	207,091	66.20	13,709,424.20	
FMC TECHNOLOGIES INC	5,160	72.21	372,603.60	
HALLIBURTON CO	37,072	34.28	1,270,828.16	
HELMERICH & PAYNE	5,140	41.31	212,333.40	
HESS CORP	12,240	62.55	765,612.00	
MARATHON OIL CORP	28,702	35.89	1,030,114.78	
MURPHY OIL CORP	6,605	65.68	433,816.40	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	19.33	207,623.53	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	17,111	47.97	820,814.67	
NEWFIELD EXPLORATION CO	5,285	59.99	317,047.15	
NOBLE CORP	9,412	34.25	322,361.00	
NOBLE ENERGY INC	6,541	78.33	512,356.53	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,001	80.06	2,642,060.06	
PEABODY ENERGY CORP	10,085	52.43	528,756.55	
PETROHAWK ENERGY CORP	10,750	17.29	185,867.50	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,260	73.19	384,979.40	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	7,050	27.55	194,227.50	
PRIDE INTERNATIONAL INC	8,910	30.66	273,180.60	
QEP RESOURCES INC	7,365	31.45	231,629.25	
RANGE RESOURCES CORP	6,505	36.42	236,912.10	
ROWAN COMPANIES INC	6,265	32.61	204,301.65	
SCHLUMBERGER LTD	55,519	68.53	3,804,717.07	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,815	33.96	435,197.40	
SPECTRA ENERGY CORP	25,369	23.74	602,260.06	
SUNOCO INC	5,953	39.52	235,262.56	
TRANSOCEAN LTD	12,780	64.74	827,377.20	
ULTRA PETROLEUM CORP	6,379	41.49	264,664.71	
VALERO ENERGY CORP	20,592	17.77	365,919.84	
WEATHERFORD INTL LTD	27,744	17.09	474,144.96	
WILLIAMS COS INC	21,699	20.83	451,990.17	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,730	85.74	748,510.20	
AIRGAS INC	3,745	69.99	262,112.55	
ALCOA INC	38,334	12.88	493,741.92	

ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,490	47.82	214,711.80
BALL CORP	4,129	61.50	253,933.50
CELANESE CORP-SERIES A	7,245	34.97	253,357.65
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,290	118.15	270,563.50
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	6,165	65.36	402,944.40
CROWN HOLDINGS INC	8,030	31.27	251,098.10
DOW CHEMICAL	46,928	31.56	1,481,047.68
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	36,813	47.70	1,755,980.10
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	3,810	82.59	314,667.90
ECOLAB INC	9,535	52.12	496,964.20
FMC CORP	3,340	71.18	237,741.20
FREEMPORT-MCMORAN COPPER	17,579	96.07	1,688,814.53
INTERNATIONAL PAPER CO	15,415	23.96	369,343.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,194	50.04	209,867.76
LUBRIZOL CORP	2,695	114.81	309,412.95
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,235	79.91	178,598.85
MEADWESTVACO CORP	8,929	25.55	228,135.95
MONSANTO CO	21,981	58.71	1,290,504.51
MOSAIC CO/THE	7,075	68.00	481,100.00
NEWMONT MINING CORP	20,715	59.37	1,229,849.55
NUCOR CORP	11,699	38.26	447,603.74
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	29.62	191,789.50
PACTIV CORPORATION	6,429	33.15	213,121.35
PPG INDUSTRIES INC	6,702	77.33	518,265.66
PRAXAIR INC	12,430	93.77	1,165,561.10
SEALED AIR CORP	8,226	23.87	196,354.62
SIGMA-ALDRICH	5,485	63.13	346,268.05
UNITED STATES STEEL CORP	4,537	42.27	191,778.99
VULCAN MATERIALS CO	4,443	36.94	164,124.42
WEYERHAEUSER CO	20,756	15.99	331,888.44
3M CO	27,526	90.90	2,502,113.40
AGCO CORP	4,815	43.83	211,041.45
AMETEK INC	4,695	50.29	236,111.55
BOEING CO	27,757	71.66	1,989,066.62
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	3,955	68.51	270,957.05
CATERPILLAR INC	25,526	79.05	2,017,830.30
COOPER INDUSTRIES PLC	7,098	52.96	375,910.08
CUMMINS INC	7,550	94.49	713,399.50
DANAHER CORP	23,659	42.86	1,014,024.74
DEERE & CO	17,260	77.24	1,333,162.40
DOVER CORP	6,790	53.40	362,586.00
EATON CORP	6,323	88.25	558,004.75
EMERSON ELECTRIC CO	30,605	54.95	1,681,744.75
FASTENAL CO	5,509	52.62	289,883.58
FIRST SOLAR INC	1,955	147.15	287,678.25
FLOWERVE CORP	2,620	116.33	304,784.60
FLUOR CORP	6,633	49.57	328,797.81
FOSTER WHEELER AG	7,015	22.65	158,889.75
GENERAL DYNAMICS CORP	13,227	64.06	847,321.62
GENERAL ELECTRIC CO.	433,818	16.06	6,967,117.08
GOODRICH CORP	4,860	81.13	394,291.80
HARSCO CORP	4,885	24.59	120,122.15
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	29,576	47.53	1,405,747.28
ILLINOIS TOOL WORKS	16,840	46.94	790,469.60

INGERSOLL-RAND PLC	12,221	39.87	487,251.27
ITT CORP	6,173	48.15	297,229.95
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	39.06	203,893.20
JOY GLOBAL INC	4,425	70.38	311,431.50
KBR INC	8,300	24.89	206,587.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,031	70.46	284,024.26
LOCKHEED MARTIN CORP	13,731	71.41	980,530.71
MASCO CORP	18,309	10.89	199,385.01
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,734	60.91	714,717.94
PACCAR INC	13,089	51.05	668,193.45
PALL CORP	5,116	43.35	221,778.60
PARKER HANNIFIN CORP	5,765	77.19	445,000.35
PENTAIR INC	5,054	35.45	179,164.30
PRECISION CASTPARTS CORP	5,510	138.12	761,041.20
QUANTA SERVICES INC	8,315	19.88	165,302.20
RAYTHEON COMPANY	15,262	47.14	719,450.68
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,098	63.84	325,456.32
ROCKWELL COLLINS INC.	6,270	61.14	383,347.80
ROPER INDUSTRIES INC	3,990	70.38	280,816.20
SPX CORP	2,892	69.21	200,155.32
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,496	60.80	334,156.80
TEXTRON INC	9,791	20.83	203,946.53
TYCO INTERNATIONAL LTD	20,605	38.84	800,298.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	36,020	75.01	2,701,860.20
URS CORP	4,170	39.29	163,839.30
WW GRAINGER INC	2,792	122.72	342,634.24
AVERY DENNISON CORP	5,315	39.51	209,995.65
CINTAS CORP	7,227	28.01	202,428.27
DUN & BRADSTREET CORP	2,657	75.12	199,593.84
EQUIFAX INC	6,539	33.02	215,917.78
IHS INC-CLASS A	2,425	72.22	175,133.50
IRON MOUNTAIN INC	7,807	22.90	178,780.30
MANPOWER INC	4,357	56.46	245,996.22
PITNEY BOWES INC	8,543	22.18	189,483.74
REPUBLIC SERVICES INC	14,110	30.82	434,870.20
ROBERT HALF INTL INC	7,240	27.44	198,665.60
RR DONNELLEY & SONS CO	11,125	18.54	206,257.50
STERICYCLE INC	3,555	72.60	258,093.00
VERISK ANALYTICS INC	4,000	29.77	119,080.00
WASTE MANAGEMENT INC	18,674	36.88	688,697.12
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,145	72.78	447,233.10
CSX CORP	15,441	61.24	945,606.84
DELTA AIR LINES INC	5,005	13.47	67,417.35
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,947	49.99	397,270.53
FEDEX CORP	12,463	89.56	1,116,186.28
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,415	36.52	161,235.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	14,655	61.97	908,170.35
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,285	13.54	58,018.90
UNION PACIFIC CORP	20,558	87.19	1,792,452.02
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,000	27.71	83,130.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,267	69.32	2,028,788.44
BORGWARNER INC	4,810	54.27	261,038.70
FORD MOTOR COMPANY	120,585	14.15	1,706,277.75
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,245	11.73	143,633.85

HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	31.47	279,894.18
JOHNSON CONTROLS INC	26,383	34.74	916,545.42
COACH INC	11,426	44.48	508,228.48
DR HORTON INC	14,806	10.68	158,128.08
FORTUNE BRANDS INC	5,661	55.99	316,959.39
GARMIN LTD	4,625	32.05	148,231.25
HASBRO INC	4,903	45.96	225,341.88
LEGETT & PLATT INC	8,218	20.29	166,743.22
MATTEL INC	14,664	23.62	346,363.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,088	58.19	179,690.72
NEWELL RUBBERMAID INC	14,005	18.13	253,910.65
NIKE INC -CL B	15,272	82.05	1,253,067.60
POLO RALPH LAUREN CORP	2,135	94.83	202,462.05
PULTE GROUP INC	18,664	8.11	151,365.04
TOLL BROTHERS INC	8,051	18.16	146,206.16
VF CORP	3,275	85.25	279,193.75
WHIRLPOOL CORP	2,934	84.81	248,832.54
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	36.44	168,061.28
CARNIVAL CORP	19,797	40.50	801,778.50
DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	46.65	243,652.95
DEVRY INC	3,350	44.75	149,912.50
H&R BLOCK INC	14,360	10.78	154,800.80
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	15.13	176,809.18
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	1,815	62.24	112,965.60
LAS VEGAS SANDS CORP	14,810	39.45	584,254.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,846	37.57	407,484.22
MCDONALD'S CORP	43,711	78.70	3,440,055.70
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	10.99	153,860.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,103	35.15	214,520.45
STARBUCKS CORP	31,747	28.39	901,297.33
STARWOOD HOTELS & RESORTS	6,957	57.62	400,862.34
WYNN RESORTS LTD	2,420	103.35	250,107.00
YUM! BRANDS INC	20,064	49.88	1,000,792.32
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,160	26.43	242,098.80
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	20,103	17.26	346,977.78
COMCAST CORP-CLASS A	83,961	19.77	1,659,908.97
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	33,591	18.63	625,800.33
DIRECTV-CLASS A	36,039	43.22	1,557,605.58
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	4,535	44.28	200,809.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	38.89	180,255.15
DISH NETWORK CORP-A	6,309	19.49	122,962.41
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	25,686	10.62	272,785.32
LIBERTY GLOBAL INC-A	6,058	35.37	214,271.46
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,128	34.92	144,149.76
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,407	36.56	417,039.92
NEWS CORP-CL A	74,042	14.25	1,055,098.50
NEWS CORP-CLASS B	20,039	16.08	322,227.12
OMNICOM GROUP	11,432	43.60	498,435.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,345	48.63	162,667.35
THE WALT DISNEY CO.	75,603	35.46	2,680,882.38
TIME WARNER CABLE	15,347	57.88	888,284.36
TIME WARNER INC	46,308	31.64	1,465,185.12
VIACOM INC-CLASS B	23,653	37.78	893,610.34
VIRGIN MEDIA INC	14,950	24.59	367,620.50

WASHINGTON POST-CLASS B	247	370.57	91,530.79	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	4,836	42.78	206,884.08	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,993	62.08	247,885.44	
AMAZON.COM INC	14,485	169.00	2,447,965.00	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	10,867	16.72	181,696.24	
AUTONATION INC	4,530	24.20	109,626.00	
AUTOZONE INC	1,247	235.12	293,194.64	
BED BATH & BEYOND INC	9,737	44.04	428,817.48	
BEST BUY CO INC	13,919	43.08	599,630.52	
CARMAX INC	11,189	29.79	333,320.31	
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	1,995	28.59	57,037.05	

[次へ](#)

DOLLAR TREE INC	5,617	51.64	290,061.88
EXPEDIA INC	6,900	28.59	197,271.00
FAMILY DOLLAR STORES	5,308	45.90	243,637.20
GAMESTOP CORP-CLASS A	8,430	19.23	162,108.90
GAP INC/THE	16,776	19.36	324,783.36
GENUINE PARTS CO	6,956	47.67	331,592.52
HOME DEPOT INC	68,805	31.40	2,160,477.00
J.C. PENNEY CO INC	8,461	32.70	276,674.70
KOHL'S CORP	11,222	52.85	593,082.70
LIBERTY MEDIA CORP-INTER A	20,745	14.47	300,180.15
LIMITED INC/THE	11,298	29.16	329,449.68
LOWE'S COS INC	58,634	21.86	1,281,739.24
MACY'S INC	15,369	22.47	345,341.43
NETFLIX INC	2,175	166.84	362,877.00
NORDSTROM INC	6,435	37.53	241,505.55
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,205	54.60	284,193.00
PETSMART INC	6,180	37.19	229,834.20
PRICELINE.COM INC	1,635	371.93	608,105.55
ROSS STORES INC	5,483	58.42	320,316.86
SEARS HOLDINGS CORP	1,301	75.72	98,511.72
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,042	74.57	301,411.94
STAPLES INC	27,729	21.00	582,309.00
TARGET CORP	28,430	53.76	1,528,396.80
TIFFANY & CO	5,030	51.50	259,045.00
TJX COMPANIES INC	17,019	45.69	777,598.11
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	31.16	148,633.20
COSTCO WHOLESALE CORP	17,899	64.11	1,147,504.89
CVS CAREMARK CORP	55,297	31.23	1,726,925.31
KROGER CO	22,920	21.76	498,739.20
SAFEWAY INC	15,208	22.50	342,180.00
SUPERVALU INC	11,165	10.49	117,120.85
SYSCO CORP	23,321	29.55	689,135.55
WALGREEN CO	39,757	34.44	1,369,231.08
WAL-MART STORES INC	82,902	53.95	4,472,562.90
WHOLE FOODS MARKET INC	7,010	39.86	279,418.60
ALTRIA GROUP INC	84,623	25.06	2,120,652.38
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,598	33.71	896,618.58
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,820	61.40	173,148.00
BUNGE LTD	4,857	62.56	303,853.92
CAMPBELL SOUP CO	7,460	36.27	270,574.20
COCA-COLA CO/THE	84,366	61.01	5,147,169.66
COCA-COLA ENTERPRISES	10,610	24.11	255,807.10
CONAGRA FOODS INC	16,205	22.92	371,418.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,550	19.50	205,725.00
DEAN FOODS CO	11,132	9.97	110,986.04
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,854	35.97	354,448.38
GENERAL MILLS INC	28,369	37.50	1,063,837.50
HANSEN NATURAL CORPORATION	3,965	51.59	204,554.35
HERSHEY CO/THE	5,595	49.60	277,512.00
HJ HEINZ CO	12,395	49.72	616,279.40
HORMEL FOODS CORP	3,430	45.08	154,624.40
JM SMUCKER CO/THE	5,110	63.17	322,798.70
KELLOGG CO	11,778	49.57	583,835.46
KRAFT FOODS INC-CLASS A	70,845	32.47	2,300,337.15

LORILLARD INC	6,010	85.14	511,691.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,285	43.19	228,259.15
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,561	58.38	441,411.18
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,790	48.51	280,872.90
PEPSICO INC	65,531	65.05	4,262,791.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	75,248	59.47	4,474,998.56
RALCORP HOLDINGS INC	2,870	62.89	180,494.30
REYNOLDS AMERICAN INC	6,020	63.37	381,487.40
SARA LEE CORP	30,403	14.50	440,843.50
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	15.74	176,382.44
AVON PRODUCTS	16,548	33.02	546,414.96
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,245	67.89	220,303.05
CLOROX COMPANY	5,961	67.52	402,486.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	19,930	76.87	1,532,019.10
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,476	74.18	257,849.68
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,275	65.49	279,969.75
KIMBERLY-CLARK CORP	16,818	66.47	1,117,892.46
PROCTER & GAMBLE CO	117,019	63.54	7,435,387.26
AETNA INC	15,898	31.27	497,130.46
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,544	32.03	433,814.32
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,274	50.43	1,224,137.82
BECKMAN COULTER INC	2,773	51.27	142,171.71
BECTON DICKINSON AND CO	9,266	76.91	712,648.06
BOSTON SCIENTIFIC CORP	54,613	6.31	344,608.03
CARDINAL HEALTH INC	13,410	32.41	434,618.10
CAREFUSION CORP	7,100	24.68	175,228.00
CERNER CORP	2,820	87.83	247,680.60
CIGNA CORP	9,785	36.38	355,978.30
COVENTRY HEALTH CARE INC	7,750	23.74	183,985.00
COVIDIEN PLC	19,850	40.19	797,771.50
CR BARD INC	3,534	83.47	294,982.98
DAVITA INC	4,319	71.77	309,974.63
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,312	32.96	208,043.52
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,560	64.78	295,396.80
EXPRESS SCRIPTS INC	22,052	49.10	1,082,753.20
HENRY SCHEIN INC	4,060	58.96	239,377.60
HOLOGIC INC	13,333	16.22	216,261.26
HOSPIRA INC	6,641	58.53	388,697.73
HUMANA INC	7,140	57.46	410,264.40
INTUITIVE SURGICAL INC	1,490	265.80	396,042.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,830	78.81	380,652.30
MCKESSON CORP	11,594	61.68	715,117.92
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	19,487	52.45	1,022,093.15
MEDTRONIC INC	44,757	36.22	1,621,098.54
OMNICARE INC	6,230	22.89	142,604.70
PATTERSON COS INC	5,182	27.88	144,474.16
QUEST DIAGNOSTICS	5,461	49.41	269,828.01
ST JUDE MEDICAL INC	12,495	38.29	478,433.55
STRYKER CORP	11,638	51.27	596,680.26
UNITEDHEALTH GROUP INC	46,185	37.56	1,734,708.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,339	61.15	326,479.85
WELLPOINT INC	18,036	57.26	1,032,741.36
ZIMMER HOLDINGS INC	7,397	51.56	381,389.32
ABBOTT LABORATORIES	62,717	52.51	3,293,269.67

ALLERGAN INC	11,805	71.80	847,599.00
AMGEN INC	38,926	57.95	2,255,761.70
BIOGEN IDEC INC	11,097	59.90	664,710.30
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	69,876	27.16	1,897,832.16
CELGENE CORP	19,387	59.56	1,154,689.72
CEPHALON INC	3,200	64.79	207,328.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,685	32.79	120,831.15
COVANCE INC	3,290	47.13	155,057.70
ELI LILLY & CO	42,168	35.13	1,481,361.84
FOREST LABORATORIES INC	11,125	33.89	377,026.25
GENZYME CORP	10,624	72.32	768,327.68
GILEAD SCIENCES INC	36,162	39.54	1,429,845.48
HUMAN GENOME SCIENCES INC	8,535	26.21	223,702.35
ILLUMINA INC	5,280	51.22	270,441.60
JOHNSON & JOHNSON	112,069	63.98	7,170,174.62
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,016	47.93	288,346.88
MERCK & CO. INC.	126,703	37.42	4,741,226.26
MYLAN INC	12,415	19.65	243,954.75
PERRIGO CO	4,345	66.20	287,639.00
PFIZER INC	327,750	17.62	5,774,955.00
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	5,690	25.34	144,184.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,899	50.23	848,836.77
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,860	37.32	256,015.20
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	24.05	108,225.00
WATERS CORP	4,046	73.26	296,409.96
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,075	46.99	191,484.25
BB&T CORP	30,038	22.32	670,448.16
COMERICA INC	6,145	35.23	216,488.35
FIFTH THIRD BANCORP	28,749	12.62	362,812.38
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	11.48	228,107.60
KEYCORP	34,838	8.08	281,491.04
M & T BANK CORP	2,798	74.58	208,674.84
MARSHALL & ILSLEY CORP	25,772	6.10	157,209.20
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	12,954	16.78	217,368.12
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,980	12.66	189,646.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,735	54.00	1,173,690.00
REGIONS FINANCIAL CORP	44,609	7.03	313,601.27
SUNTRUST BANKS INC	18,537	25.51	472,878.87
TFS FINANCIAL CORP	5,980	8.78	52,504.40
US BANCORP	77,891	23.47	1,828,101.77
WELLS FARGO & CO	201,120	25.72	5,172,806.40
AMERICAN EXPRESS CO	43,929	39.30	1,726,409.70
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,595	51.19	491,168.05
BANK OF AMERICA CORPORATION	407,669	11.16	4,549,586.04
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	50,627	24.93	1,262,131.11
BLACKROCK INC	890	168.39	149,867.10
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	19,795	38.24	756,960.80
CIT GROUP INC	7,555	40.58	306,581.90
CITIGROUP INC	1,000,913	4.21	4,213,843.73
CME GROUP INC	2,606	282.98	737,445.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,695	17.52	380,096.40
EATON VANCE CORP	6,175	29.65	183,088.75
FRANKLIN RESOURCES INC	6,830	115.78	790,777.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,873	157.39	3,127,811.47



INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,325	115.61	268,793.25
INVESCO LTD	14,627	22.11	323,402.97
JEFFERIES GROUP INC	6,350	24.03	152,590.50
JPMORGAN CHASE & CO	161,665	37.07	5,992,921.55
LEGG MASON INC	7,995	30.96	247,525.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	25.25	184,451.25
MOODY'S CORP	8,597	26.48	227,648.56
MORGAN STANLEY	52,600	24.38	1,282,388.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	7,745	20.90	161,870.50
NORTHERN TRUST CORP	7,960	48.02	382,239.20
NYSE EURONEXT	10,860	30.40	330,144.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	38,224	15.00	573,360.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,985	21.94	153,250.90
SLM CORP	19,052	11.75	223,861.00
STATE STREET CORP	20,067	40.26	807,897.42
T ROWE PRICE GROUP INC	9,720	54.69	531,586.80
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,005	16.75	117,333.75
ACE LTD	13,508	60.72	820,205.76
AFLAC INC	19,712	55.25	1,089,088.00
ALLSTATE CORP	20,358	33.11	674,053.38
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	4,750	41.10	195,225.00
AON CORP	11,802	40.30	475,620.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,660	86.59	230,329.40
ASSURANT INC	5,880	41.24	242,491.20
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,885	34.66	203,974.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	33,460	83.33	2,788,221.80
CHUBB CORP	13,408	58.23	780,747.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	30.66	194,384.40
EVEREST RE GROUP LTD	2,684	84.53	226,878.52
FIDELITY NATIONAL FINL-A	11,456	13.12	150,302.72
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	13.51	251,893.95
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,322	24.57	376,461.54
LINCOLN NATIONAL CORP	11,878	25.82	306,689.96
LOEWS CORP	12,955	39.65	513,665.75
MARSH & MCLENNAN COS	20,613	25.12	517,798.56
METLIFE INC	36,380	40.16	1,461,020.80
OLD REPUBLIC INTL CORP	12,853	13.91	178,785.23
PARTNERRE LTD	2,372	80.91	191,918.52
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,520	27.23	286,459.60
PROGRESSIVE CORP	25,715	21.01	540,272.15
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	19,597	52.98	1,038,249.06
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,227	60.76	196,072.52
TORCHMARK CORP	4,181	55.51	232,087.31
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	3,405	51.87	176,617.35
TRAVELERS COS INC/THE	20,489	55.59	1,138,983.51
UNUM GROUP	13,988	22.35	312,631.80
VALIDUS HOLDINGS LTD	5,315	28.93	153,762.95
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	470	321.50	151,105.00
WILLIS GROUP HOLDING	6,770	31.80	215,286.00
WR BERKLEY CORP	6,018	28.09	169,045.62
XL GROUP PLC	13,665	22.07	301,586.55
ACCENTURE PLC-CL A	25,883	45.53	1,178,452.99
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	11.33	217,196.10
ADOBE SYSTEMS INC	20,304	28.20	572,572.80

AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,700	48.68	374,836.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,425	64.20	219,885.00
AUTODESK INC	9,580	35.43	339,419.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,191	43.99	888,202.09
BMC SOFTWARE INC	7,584	44.20	335,212.80
CA INC	14,950	22.75	340,112.50
CITRIX SYSTEMS INC	6,818	61.38	418,488.84
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,554	67.26	777,122.04
COMPUTER SCIENCES CORP	5,173	49.51	256,115.23
EBAY INC	47,797	27.93	1,334,970.21
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	15.62	197,030.68
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	10,520	28.82	303,186.40
FISERV INC	6,424	55.15	354,283.60
GOOGLE INC-CL A	9,981	616.50	6,153,286.50
INTUIT INC	11,366	47.19	536,361.54
LENDER PROCESSING SERVICES	4,960	26.81	132,977.60
MASTERCARD INC-CLASS A	4,230	245.15	1,036,984.50
MCAFEE INC	6,335	47.31	299,708.85
MICROSOFT CORP	320,494	25.19	8,073,243.86
NUANCE COMMUNICATIONS INC	10,635	15.72	167,182.20
ORACLE CORP	163,153	28.84	4,705,332.52
PAYCHEX INC	11,682	28.04	327,563.28
RED HAT INC	7,790	41.08	320,013.20
SAIC INC	14,890	15.69	233,624.10
SALESFORCE.COM INC	4,305	112.55	484,527.75
SYMANTEC CORP	29,710	15.78	468,823.80
SYNOPSYS INC	7,652	25.51	195,202.52
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,286	15.81	146,811.66
VERISIGN INC	7,695	33.35	256,628.25
VISA INC-CLASS A SHARES	20,115	80.63	1,621,872.45
VMWARE INC	3,230	77.24	249,485.20
WESTERN UNION CO	24,891	18.11	450,776.01
YAHOO! INC	52,720	16.40	864,608.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,890	34.90	449,861.00
AMPHENOL CORP-CL A	6,530	50.04	326,761.20
APPLE COMPUTER INC	36,971	308.84	11,418,123.64
ARROW ELECTRONICS INC	6,365	28.63	182,229.95
AVNET INC	7,805	29.10	227,125.50
CISCO SYSTEMS INC	232,060	23.61	5,478,936.60
CORNING INC	63,728	18.71	1,192,350.88
DELL INC	73,346	14.71	1,078,919.66
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	62.58	131,418.00
EMC CORP/MASS	83,524	21.28	1,777,390.72
F5 NETWORKS INC	3,160	100.83	318,622.80
FLEXTRONICS INTL LTD	30,311	6.36	192,777.96
FLIR SYSTEMS INC	5,565	26.85	149,420.25
HARRIS CORP	5,795	44.83	259,789.85
HEWLETT-PACKARD CO	95,290	42.88	4,086,035.20
INTL BUSINESS MACHINES CORP	52,107	139.84	7,286,642.88
JUNIPER NETWORKS INC	20,008	32.02	640,656.16
MOTOROLA INC	88,865	7.93	704,699.45
NETAPP INC	13,506	51.90	700,961.40
QUALCOMM INC	66,652	44.33	2,954,683.16
SANDISK CORP	9,508	37.41	355,694.28

SEAGATE TECHNOLOGY	20,539	14.81	304,182.59
TERADATA CORP	7,150	38.66	276,419.00
TYCO ELECTRONICS LTD	17,020	31.71	539,704.20
WESTERN DIGITAL CORP	7,660	30.44	233,170.40
XEROX CORP	52,349	11.60	607,248.40
AMERICAN TOWER CORP-CL A	15,824	50.81	804,017.44
AT&T INC	240,101	28.36	6,809,264.36
CENTURYLINK INC	10,795	40.92	441,731.40
CROWN CASTLE INTL CORP	11,110	42.58	473,063.80
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	27,414	8.70	238,501.80
METROPCS COMMUNICATIONS INC	15,005	10.53	158,002.65
NII HOLDINGS INC	6,562	39.27	257,689.74
QWEST COMMUNICATIONS INTL	65,293	6.53	426,363.29
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	5,410	39.25	212,342.50
SPRINT NEXTEL CORP	115,162	4.75	547,019.50
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	3,170	34.50	109,365.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	114,858	32.35	3,715,656.30
WINDSTREAM CORP	20,465	12.52	256,221.80
AES CORP	23,028	12.32	283,704.96
ALLEGHENY ENERGY INC	8,795	23.41	205,890.95
ALLIANT ENERGY CORP	5,635	36.79	207,311.65
AMEREN CORPORATION	8,557	28.76	246,099.32
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,798	36.46	685,375.08
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,825	23.55	207,828.75
CALPINE CORP	14,055	12.25	172,173.75
CENTERPOINT ENERGY INC	13,697	16.40	224,630.80
CONSOLIDATED EDISON INC	11,061	49.20	544,201.20
CONSTELLATION ENERGY GROUP	7,810	31.24	243,984.40
DOMINION RESOURCES INC/VA	24,217	44.46	1,076,687.82
DTE ENERGY COMPANY	6,843	46.82	320,389.26
DUKE ENERGY CORP	52,788	17.77	938,042.76
EDISON INTERNATIONAL	11,234	36.06	405,098.04
EL PASO CORP	30,330	13.06	396,109.80
ENERGEN CORP	3,570	45.52	162,506.40
ENERGY CORP	7,602	73.73	560,495.46
EQT CORP	5,345	37.47	200,277.15
EXELON CORP	26,839	41.33	1,109,255.87
FIRSTENERGY CORP	11,273	37.13	418,566.49
NEXTERA ENERGY INC	15,385	54.85	843,867.25
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,205	53.18	223,621.90
MDU RESOURCES GROUP INC	9,180	20.98	192,596.40
NISOURCE INC	13,990	17.71	247,762.90
NORTHEAST UTILITIES	6,920	31.18	215,765.60
NRG ENERGY INC	9,360	20.18	188,884.80
NSTAR	5,385	41.40	222,939.00
ONEOK INC	5,070	50.17	254,361.90
P G & E CORP	14,891	47.67	709,853.97
PEPCO HOLDINGS INC	11,297	19.28	217,806.16
PINNACLE WEST CAPITAL	5,389	42.02	226,445.78
PPL CORPORATION	17,463	26.89	469,580.07
PROGRESS ENERGY INC	11,228	44.93	504,474.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,613	33.33	653,701.29
SCANA CORP	4,853	41.16	199,749.48
SEMPRA ENERGY	8,742	53.79	470,232.18

SOUTHERN CO	34,260	38.18	1,308,046.80	
WISCONSIN ENERGY CORP	5,127	59.56	305,364.12	
XCEL ENERGY INC	16,129	23.90	385,483.10	
ADVANCED MICRO DEVICES	26,706	7.26	193,885.56	
ALTERA CORPORATION	12,031	30.24	363,817.44	
ANALOG DEVICES INC	9,966	32.27	321,602.82	
APPLIED MATERIALS INC	51,263	12.15	622,845.45	
BROADCOM CORP-CL A	17,121	37.51	642,208.71	
CREE INC	4,000	51.40	205,600.00	
INTEL CORP	226,082	19.87	4,492,249.34	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,579	36.81	242,172.99	
LAM RESEARCH CORP	5,822	45.01	262,048.22	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	31.16	277,448.64	
LSI CORP	35,140	4.72	165,860.80	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	19,744	17.57	346,902.08	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,465	19.44	242,319.60	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	12,180	12.69	154,564.20	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	31.52	234,162.08	

[次へ](#)

MICRON TECHNOLOGY INC	33,477	7.81	261,455.37	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	12,325	13.15	162,073.75	
NVIDIA CORP	22,340	11.91	266,069.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	49,662	28.98	1,439,204.76	
XILINX INC	11,600	25.45	295,220.00	
米ドル小計	13,164,729		447,422,233.48 (36,115,922,686.00)	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	9,200	10.87	100,004.00	
CAMECO CORP	14,232	31.58	449,446.56	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,239	36.71	1,624,013.69	
CENOVUS ENERGY INC	32,073	29.22	937,173.06	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,215	41.10	378,736.50	
ENBRIDGE INC	15,730	55.67	875,689.10	
ENCANA CORP	32,338	28.25	913,548.50	
ENSIGN ENERGY SERVICES INC	8,205	12.93	106,090.65	
HUSKY ENERGY INC	11,764	25.24	296,923.36	
IMPERIAL OIL LTD	12,972	39.35	510,448.20	
NEXEN INC	21,815	22.31	486,692.65	
NIKO RESOURCES LTD	1,905	96.40	183,642.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	8,705	32.26	280,823.30	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	2,800	23.16	64,848.00	
PETROBANK ENERGY & RESOURCES	3,395	40.69	138,142.55	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	10,635	10.70	113,794.50	
SUNCOR ENERGY INC	63,430	33.47	2,123,002.10	
TALISMAN ENERGY INC	43,677	18.47	806,714.19	
TRANSCANADA CORP	27,918	38.48	1,074,284.64	
VERMILION ENERGY INC	3,000	39.87	119,610.00	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	5,575	72.94	406,640.50	
AGRIUM INC	5,535	89.10	493,168.50	
BARRICK GOLD CORP	40,024	47.47	1,899,939.28	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,875	86.31	248,141.25	
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	33.88	152,290.60	
GOLDCORP INC	29,822	43.55	1,298,748.10	
IAMGOLD CORP	12,045	18.12	218,255.40	
INMET MINING CORPORATION	2,935	62.54	183,554.90	
IVANHOE MINES LTD	11,025	24.71	272,427.75	
KINROSS GOLD CORP	43,535	18.07	786,677.45	
PAN AMERICAN SILVER CORP	5,650	31.88	180,122.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	12,039	146.90	1,768,529.10	
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	18,000	7.84	141,120.00	
SILVER WHEATON CORP	11,515	27.90	321,268.50	
SINO-FOREST CORPORATION	11,590	21.32	247,098.80	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,155	46.26	978,630.30	
YAMANA GOLD INC	25,391	11.03	280,062.73	
BOMBARDIER INC 'B'	48,226	5.16	248,846.16	
CAE INC	15,585	11.08	172,681.80	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,020	23.70	213,774.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,060	52.61	266,206.60	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,620	21.38	120,155.60	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	19,874	68.30	1,357,394.20	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,890	66.78	393,334.20	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,522	91.60	322,615.20	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	28.81	112,935.20	

TIM HORTONS INC	7,010	38.84	272,268.40	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	11,785	22.00	259,270.00	
THOMSON REUTERS CORP	16,619	39.30	653,126.70	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,340	58.16	194,254.40	
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	6,060	23.51	142,470.60	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,939	42.60	125,201.40	
METRO INC -A	5,410	45.79	247,723.90	
SHOPPERS DRUG MART INC	7,365	38.67	284,804.55	
WESTON (GEORGE) LTD	1,312	79.88	104,802.56	
ELDORADO GOLD CORP	24,205	17.56	425,039.80	
SAPUTO INC	6,195	36.97	229,029.15	
VITERRA INC	19,640	9.75	191,490.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	8,124	27.18	220,810.32	
BANK OF MONTREAL	22,761	61.57	1,401,394.77	
BANK OF NOVA SCOTIA	41,669	54.52	2,271,793.88	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,785	77.95	1,230,440.75	
NATIONAL BANK OF CANADA	5,720	66.84	382,324.80	
ROYAL BANK OF CANADA	57,759	55.33	3,195,805.47	
TORONTO-DOMINION BANK	35,320	74.77	2,640,876.40	
CI FINANCIAL CORP	7,240	21.40	154,936.00	
IGM FINANCIAL INC	3,605	42.52	153,284.60	
ONEX CORPORATION	5,320	30.07	159,972.40	
TMX GROUP INC	4,400	33.30	146,520.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	647	414.53	268,200.91	
GREAT-WEST LIFECO INC	12,979	25.80	334,858.20	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4,390	31.03	136,221.70	
INTACT FINANCIAL CORP	3,300	46.00	151,800.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	75,436	12.82	967,089.52	
POWER CORP OF CANADA	11,895	27.48	326,874.60	
POWER FINANCIAL CORP	11,320	29.80	337,336.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,099	28.02	675,253.98	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	22,367	31.14	696,508.38	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	8,959	18.21	163,143.39	
CGI GROUP INC - CL A	11,525	15.95	183,823.75	
OPEN TEXT CORPORATION	3,310	48.78	161,461.80	
RESEARCH IN MOTION	20,928	52.89	1,106,881.92	
BCE INC	11,750	34.90	410,075.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	20,140	41.31	831,983.40	
TELUS CORP	1,440	47.12	67,852.80	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	4,348	45.22	196,616.56	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,725	49.50	184,387.50	
FORTIS INC	7,570	32.50	246,025.00	
TRANSALTA CORP	9,680	21.69	209,959.20	
加ドル小計	1,346,562		47,412,240.13 (3,754,101,173.00)	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
CALTEX AUSTRALIA LTD	8,725	12.31	107,404.75	
ORIGIN ENERGY LTD	36,590	16.26	594,953.40	
PALADIN ENERGY LTD	37,630	4.24	159,551.20	
SANTOS LTD	30,045	12.82	385,176.90	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,128	43.94	1,016,244.32	
WORLEYPARSONS LTD	6,770	23.19	156,996.30	
ALUMINA LTD	126,052	2.05	258,406.60	
AMCOR LIMITED	47,995	6.64	318,686.80	
BHP BILLITON LTD	136,366	41.74	5,691,916.84	

BLUESCOPE STEEL LTD	72,831	2.14	155,858.34	
BORAL LTD	32,450	4.50	146,025.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	49,920	6.55	326,976.00	
INCITEC PIVOT LTD	64,675	3.76	243,178.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	26,890	5.53	148,701.70	
NEWCREST MINING LTD	31,624	40.62	1,284,566.88	
ONESTEEL LTD	33,285	2.69	89,536.65	
ORICA LIMITED	14,920	25.54	381,056.80	
OZ MINERALS LTD	174,320	1.58	276,297.20	
RIO TINTO LTD	17,708	84.10	1,489,242.80	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	16.09	104,504.55	
CSR LTD	83,135	1.83	152,552.72	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	4,345	38.11	165,587.95	
BRAMBLES LTD	50,713	6.55	332,170.15	
ASCIANO GROUP	109,000	1.64	179,305.00	
INTOLL GROUP	129,922	1.50	194,883.00	
MAP GROUP	24,545	3.10	76,089.50	
QANTAS AIRWAYS LTD	46,470	2.91	135,227.70	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	6.71	166,038.95	
TRANSURBAN GROUP	49,780	5.44	270,803.20	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	12,830	7.81	100,202.30	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,860	3.55	91,803.00	
CROWN LTD	17,690	8.57	151,603.30	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,580	7.47	161,202.60	
TATTS GROUP LTD	66,575	2.51	167,103.25	
FAIRFAX MEDIA LTD	120,540	1.47	177,193.80	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	3.39	86,495.85	
METCASH LTD	41,580	4.39	182,536.20	
WESFARMERS LTD	40,840	33.84	1,382,025.60	
WESFARMERS LTD-PPS	8,002	34.11	272,948.22	
WOOLWORTHS LTD	50,412	29.00	1,461,948.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	19,450	12.62	245,459.00	
FOSTER'S GROUP LTD	72,680	6.13	445,528.40	
GOODMAN FIELDER LTD	81,745	1.47	120,573.87	
COCHLEAR LTD	2,157	72.17	155,670.69	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	11.11	163,983.60	
CSL LTD	22,667	32.85	744,610.95	
AUST AND NZ BANKING GROUP	102,944	23.90	2,460,361.60	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,793	9.12	180,512.16	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	62,927	50.95	3,206,130.65	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	86,188	25.01	2,155,561.88	
WESTPAC BANKING CORP	120,976	22.95	2,776,399.20	
ASX LTD	7,235	41.75	302,061.25	
MACQUARIE GROUP LTD	13,166	34.97	460,415.02	
AMP LTD	81,862	5.50	450,241.00	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	34,590	5.36	185,402.40	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	72,963	3.89	283,826.07	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,350	17.01	686,353.50	
SUNCORP-METWAY LIMITED	46,635	9.06	422,513.10	
LEND LEASE CORP LIMITED	21,287	7.59	161,568.33	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	10.27	184,449.20	
TELSTRA CORPORATION LTD	187,989	2.64	496,290.96	
AGL ENERGY LTD	20,580	16.83	346,361.40	
豪ドル小計	3,083,402		35,877,275.55	(2,871,258,362.00)

英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
FRESNILLO PLC	6,140	12.71	78,039.40	
AMEC PLC	16,590	10.56	175,190.40	
BG GROUP PLC	137,394	11.96	1,643,232.24	
BP PLC	763,443	4.28	3,272,498.41	
CAIRN ENERGY PLC	56,900	4.12	234,428.00	
COMPASS GROUP PLC	72,773	5.23	380,602.79	
PETROFAC LTD	8,280	14.66	121,384.80	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	144,073	20.04	2,887,222.92	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	109,539	19.57	2,144,225.92	
TULLOW OIL PLC	33,860	12.28	415,800.80	
ANGLO AMERICAN PLC	53,584	29.82	1,597,874.88	
ANTOFAGASTA PLC	13,970	13.21	184,543.70	
BHP BILLITON PLC	89,676	22.52	2,019,951.90	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	7,470	9.25	69,134.85	
JOHNSON MATTHEY PLC	9,179	19.45	178,531.55	
KAZAKHMYS PLC-	7,345	13.80	101,361.00	
LONMIN PLC	8,130	18.21	148,047.30	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,145	60.60	190,587.00	
RIO TINTO PLC	58,900	42.08	2,478,512.00	
VEDANTA RESOURCES PLC	6,350	21.92	139,192.00	
XSTRATA PLC	83,595	13.24	1,106,797.80	
BAE SYSTEMS PLC ORD	132,530	3.54	469,421.26	
BALFOUR BEATTY PLC	37,375	2.72	101,996.37	
BUNZL PLC	17,096	7.53	128,818.36	
COBHAM PLC	59,030	2.45	144,918.65	
INVENSYS PLC	40,670	3.11	126,727.72	
REXAM PLC	43,675	3.24	141,812.72	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	71,025	6.38	453,494.62	
SMITHS GROUP PLC	15,713	12.02	188,870.26	
WOLSELEY PLC	6,410	17.03	109,162.30	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	14,500	6.00	87,000.00	
CAPITA GROUP PLC	25,499	7.81	199,147.19	
EXPERIAN PLC	41,513	7.26	301,384.38	
G4S PLC	59,864	2.70	161,991.98	
INTERTEK GROUP PLC	6,595	18.98	125,173.10	
SERCO GROUP PLC	24,505	6.33	155,116.65	
BRITISH AIRWAYS PLC	35,650	2.83	101,174.70	
FIRSTGROUP PLC	26,395	3.98	105,052.10	
BURBERRY GROUP PLC	22,444	10.26	230,275.44	
CARNIVAL PLC	6,710	26.54	178,083.40	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13,032	12.25	159,642.00	
THOMAS COOK GROUP PLC	45,560	1.80	82,099.12	
TUI TRAVEL PLC	33,940	2.11	71,613.40	
WHITBREAD PLC	9,490	17.29	164,082.10	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	39,929	7.05	281,499.45	
ITV PLC	194,510	0.68	133,433.86	
PEARSON PLC	30,249	9.47	286,609.27	
REED ELSEVIER PLC	43,666	5.50	240,163.00	
WPP PLC	48,154	7.44	358,506.53	
HOME RETAIL GROUP	45,048	2.19	98,880.36	
KINGFISHER PLC	98,082	2.47	242,556.78	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	64,120	4.26	273,343.56	
NEXT PLC	7,872	23.12	182,000.64	
SAINSBURY (J) PLC	42,246	3.87	163,872.23	



TESCO PLC	325,939	4.31	1,405,285.99	
WM MORRISON SUPERMARKETS	76,000	2.99	227,468.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,730	10.60	124,338.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	81,132	24.32	1,973,535.90	
DIAGEO PLC	101,797	11.86	1,207,312.42	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	41,622	19.94	829,942.68	
UNILEVER PLC	52,152	18.56	967,941.12	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	25,250	34.18	863,045.00	
SMITH & NEPHEW PLC	37,036	5.78	214,068.08	
ASTRAZENECA PLC	58,588	33.00	1,933,404.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	210,991	12.87	2,715,454.17	
SHIRE PLC	21,035	14.78	310,897.30	
BARCLAYS PLC	464,916	2.81	1,308,041.16	
HSBC HOLDINGS PLC	711,471	6.68	4,755,472.16	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,655,741	0.68	1,125,903.88	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	683,034	0.45	310,097.43	
SABMILLER PLC	39,861	20.43	814,360.23	
STANDARD CHARTERED PLC	83,835	18.06	1,514,060.10	
STANDARD CHARTERED PLC-NPRTS	10,479	5.24	54,962.35	
3I GROUP PLC	48,869	2.96	144,652.24	
ICAP PLC	28,310	4.69	132,943.76	
INVESTEC PLC	24,460	5.03	123,156.10	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	8,878	7.40	65,697.20	
MAN GROUP PLC	69,121	2.60	180,198.44	
SCHRODERS PLC	4,981	15.18	75,611.58	
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	16.14	112,415.10	
AVIVA PLC	106,180	4.00	425,569.44	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	232,476	1.02	238,985.32	
OLD MUTUAL PLC	213,005	1.34	286,278.72	
PRUDENTIAL PLC	98,402	6.32	621,900.64	
RESOLUTION LTD	59,463	2.61	155,376.81	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	116,917	1.33	155,733.44	
STANDARD LIFE PLC	87,275	2.27	198,114.25	
AUTONOMY CORPORATION PLC	8,700	14.65	127,455.00	
SAGE GROUP PLC/THE	63,105	2.74	173,412.54	
BT GROUP PLC	300,237	1.56	468,669.95	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	135,861	0.69	94,966.83	
INMARSAT PLC	16,910	6.29	106,448.45	
VODAFONE GROUP PLC	2,140,165	1.65	3,550,533.73	
AGGREKO PLC	10,345	16.85	174,313.25	
CENTRICA PLC	204,640	3.24	663,442.88	
INTERNATIONAL POWER PLC	61,825	4.06	251,009.50	
NATIONAL GRID PLC	139,115	5.84	812,431.60	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	35,777	11.17	399,629.09	
SEVERN TRENT PLC	11,803	13.63	160,874.89	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	6.02	160,944.70	
ARM HOLDINGS PLC	57,215	3.89	222,680.78	
英ボンド小計	12,103,777		58,754,119.36 (7,462,360,699.00)	
スイスフラン GIVAUDAN-REG	株 353	スイスフラン 1,023.00	スイスフラン 361,119.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	9,508	60.70	577,135.60	
SIKA AG-BR	105	1,980.00	207,900.00	
SYNGENTA AG-REG	3,761	281.20	1,057,593.20	
ABB LTD-REG	89,915	21.98	1,976,331.70	

GEBERIT AG-REG	1,885	188.30	354,945.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	890	110.00	97,900.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,520	108.80	274,176.00	
ADECCO SA-REG	4,757	56.50	268,770.50	
SGS SA-REG	181	1,592.00	288,152.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,115	119.00	251,685.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	20,929	49.61	1,038,287.69	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,140	383.30	436,962.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,165	69.20	80,618.00	
ARYZTA AG	4,245	43.35	184,020.75	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	2,615.00	143,825.00	

[次へ](#)

LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	27,555.00	165,330.00	
NESTLE SA-REG	140,893	53.10	7,481,418.30	
NOBEL BIOCARE HOLDING AG-REG	7,230	16.65	120,379.50	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	118.20	229,308.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	491	198.50	97,463.50	
SYNTHES INC	2,409	119.50	287,875.50	
ACTELION LTD-REG	5,200	51.15	265,980.00	
LONZA GROUP AG-REG	2,370	88.30	209,271.00	
NOVARTIS AG-REG	85,738	56.90	4,878,492.20	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,548	143.50	4,096,638.00	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	45,770	40.69	1,862,381.30	
GAM HOLDING LTD	11,775	15.75	185,456.25	
JULIUS BAER GROUP LTD	9,840	40.07	394,288.80	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,675	78.50	131,487.50	
UBS AG-REG	147,872	17.64	2,608,462.08	
BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	92.20	228,195.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,535	120.90	185,581.50	
SWISS REINSURANCE CO LTD-REG	13,669	47.59	650,507.71	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	6,086	238.50	1,451,511.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,690	19.35	187,501.50	
SWISSCOM AG-REG	1,004	397.80	399,391.20	
スイスフラン小計	669,740		33,716,341.78 (2,801,828,001.00)	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
MONGOLIA ENERGY CO LTD	116,000	3.25	377,000.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	81,823	79.50	6,504,928.50	
NWS HOLDINGS LTD	27,000	18.70	504,900.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	24,000	21.05	505,200.00	
MTR CORP	69,000	30.40	2,097,600.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	13,500	67.15	906,525.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	28.45	697,025.00	
SANDS CHINA LTD	108,000	15.86	1,712,880.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	32,000	17.82	570,240.00	
WYNN MACAU LTD	53,400	16.96	905,664.00	
TELEVISION BROADCASTS LTD	12,000	42.95	515,400.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	40,475	44.15	1,786,971.25	
LI & FUNG LTD	104,000	42.30	4,399,200.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	26,500	19.00	503,500.00	
BANK OF EAST ASIA	60,440	34.30	2,073,092.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	171,000	25.20	4,309,200.00	
HANG SENG BANK LTD	33,700	116.30	3,919,310.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	92.85	696,375.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,000	181.90	8,003,600.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	60,682	121.70	7,384,999.40	
HANG LUNG GROUP LTD	36,000	51.85	1,866,600.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	37.30	3,655,400.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	49,426	57.55	2,844,466.30	
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	24.90	722,100.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	29.15	641,300.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	44.55	1,245,172.50	
NEW WORLD DEVELOPMENT	84,000	16.32	1,370,880.00	
SINO LAND CO	71,500	16.60	1,186,900.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	54,480	133.60	7,278,528.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	35,017	112.20	3,928,907.40	

WHARF HOLDINGS LTD	65,800	52.80	3,474,240.00	
WHELOCK & CO LTD	26,000	28.45	739,700.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	39,000	6.14	239,460.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	12,000	33.70	404,400.00	
CLP HOLDINGS LTD	88,500	64.30	5,690,550.00	
HONG KONG & CHINA GAS	193,779	18.92	3,666,298.68	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	52,500	50.65	2,659,125.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	70.60	458,900.00	
香港ドル小計	2,100,972		90,446,538.03 (940,643,995.00)	
シンガポールドル	株	シンガポールドル	シンガポールドル	
FRASER AND NEAVE LTD	43,000	6.23	267,890.00	
COSCO CORP SINGAPORE LTD	55,000	1.91	105,050.00	
KEPPEL CORP LTD	57,600	10.00	576,000.00	
NOBLE GROUP LTD	120,854	1.94	234,456.76	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,000	4.67	130,760.00	
SEMBCORP MARINE LTD	18,000	4.71	84,780.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	3.41	218,240.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.48	113,960.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	42,000	2.10	88,200.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	23,800	16.06	382,228.00	
GENTING SINGAPORE PLC	295,000	2.24	660,800.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	4.19	289,319.50	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,000	39.46	197,300.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	33,000	3.15	103,950.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	188,000	0.69	130,660.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,000	6.47	446,430.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	68,625	14.60	1,001,925.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	105,240	9.09	956,631.60	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	53,300	18.66	994,578.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	8.95	313,250.00	
CAPITALAND LTD	118,000	4.03	475,540.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	30,000	2.18	65,400.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	23,000	13.50	310,500.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	4.46	133,800.00	
UOL GROUP LTD	32,250	4.60	148,350.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	308,810	3.09	954,222.90	
シンガポールドル小計	1,992,529		9,384,221.76 (585,387,753.00)	
ニュージーランドドル	株	ニュージーランドドル	ニュージーランドドル	
FLETCHER BUILDING LTD	17,570	8.20	144,074.00	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	2.91	58,170.90	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	60,530	2.11	127,718.30	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	57,462	2.09	120,095.58	
CONTACT ENERGY LIMITED	4,685	5.85	27,407.25	
ニュージーランドドル小計	160,237		477,466.03 (29,029,934.00)	
スウェーデンクローナ	株	スウェーデンクローナ	スウェーデンクローナ	
BOLIDEN AB	10,875	116.20	1,263,675.00	
HOLMEN AB-B SHS	3,415	216.00	737,640.00	
SSAB AB-A SHARES	6,295	108.50	683,007.50	
SSAB SVENSKT STAL AB-SER B	2,765	95.50	264,057.50	
SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	23,220	106.50	2,472,930.00	
ALFA LAVAL AB	11,335	118.30	1,340,930.50	
ASSA ABLOY AB-B	10,180	170.80	1,738,744.00	

ATLAS COPCO AB-A SHS	29,680	140.70	4,175,976.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	18,695	127.40	2,381,743.00	
HEXAGON AB-B SHS	7,870	144.80	1,139,576.00	
SANDVIK AB	45,310	107.00	4,848,170.00	
SCANIA AB-B SHS	13,665	145.30	1,985,524.50	
SKANSKA AB-B SHS	13,305	130.20	1,732,311.00	
SKF AB-B SHS	12,919	176.10	2,275,035.90	
VOLVO AB-B SHARES	48,555	93.50	4,539,892.50	
SECURITAS AB-B SHS	14,469	74.85	1,083,004.65	
ELECTROLUX AB - B	7,870	171.40	1,348,918.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	11,315	46.59	527,165.85	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	2,085	489.60	1,020,816.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	41,548	240.90	10,008,913.20	
SWEDISH MATCH AB	10,915	176.50	1,926,497.50	
GETINGE AB-B SHS	8,670	146.70	1,271,889.00	
NORDEA BANK AB	131,408	73.50	9,658,488.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	63,290	53.60	3,392,344.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	21,775	220.50	4,801,387.50	
SWEDBANK AB - A SHARES	32,515	97.50	3,170,212.50	
INVESTOR AB-B SHS	18,940	138.40	2,621,296.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	8,000	137.70	1,101,600.00	
ERICSSON LM-B SHS	124,315	73.75	9,168,231.25	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,220	623.00	2,006,060.00	
TELE2 AB-B SHS	12,765	145.10	1,852,201.50	
TELIASONERA AB	94,075	56.15	5,282,311.25	
スウェーデンクローナ小計	865,259		91,820,549.60 (1,126,638,143.00)	
ノルウェークローネ	株	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	88.00	598,400.00	
SEADRILL LTD	13,075	177.00	2,314,275.00	
STATOIL ASA	43,329	127.10	5,507,115.90	
NORSK HYDRO A S	29,515	37.36	1,102,680.40	
YARA INTERNATIONAL ASA	7,150	296.80	2,122,120.00	
ORKLA ASA	25,995	56.50	1,468,717.50	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	20,750	22.13	459,197.50	
DNB NOR ASA	44,290	82.80	3,667,212.00	
TELENOR ASA	39,455	91.75	3,619,996.25	
ノルウェークローネ小計	230,359		20,859,714.55 (290,367,226.00)	
デンマーククローネ	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,440	688.50	991,440.00	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	7,160	200.00	1,432,000.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	28	46,250.00	1,295,000.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	58	47,800.00	2,772,400.00	
DSV A/S	7,370	116.90	861,553.00	
CARLSBERG AS-B	4,770	597.00	2,847,690.00	
COLOPLAST-B	1,041	681.50	709,441.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	409.20	409,200.00	
NOVO NORDISK A/S-B	17,700	543.50	9,619,950.00	
DANSKE BK A/S BEARER SHS	17,835	145.40	2,593,209.00	
TRYG A/S	1,045	281.10	293,749.50	
デンマーククローネ小計	59,447		23,825,633.00 (359,767,058.00)	
イスラエルシュケル	株	イスラエルシュケル	イスラエルシュケル	
ISRAEL CHEMICALS LTD	15,280	56.00	855,680.00	

ISRAEL CORP LIMITED/THE	153	3,973.00	607,869.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	37,885	191.10	7,239,823.50	
BANK HAPOALIM BM	51,145	16.67	852,587.15	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	59,050	16.97	1,002,078.50	
NICE SYSTEMS LTD	2,490	119.30	297,057.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	88,285	9.66	852,833.10	
イスラエルシュケル小計	254,288		11,707,928.25 (262,023,434.00)	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	7,340	18.45	135,423.00	
ENI SPA	105,786	16.18	1,711,617.48	
FUGRO NV-CVA	2,640	50.40	133,056.00	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	11,845	13.29	157,479.27	
NESTE OIL OYJ	6,515	11.64	75,834.60	
OMV AG	7,225	27.28	197,134.12	
REPSOL YPF SA	27,751	19.61	544,197.11	
SAIPEM SPA	11,025	32.12	354,123.00	
SBM OFFSHORE NV	9,070	14.71	133,465.05	
TECHNIP SA	4,043	62.59	253,051.37	
TENARIS SA	21,100	15.08	318,188.00	
ACERINOX SA	5,862	12.32	72,219.84	
AIR LIQUIDE	11,492	96.23	1,105,875.16	
AKZO NOBEL NV	8,978	43.01	386,143.78	
ARCELORMITTAL	34,881	25.02	872,722.62	
BASF SE	37,320	53.11	1,982,065.20	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	10,985	5.01	55,111.74	
CRH PLC	26,830	12.58	337,655.55	
ERAMET SLN	190	252.90	48,051.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,285	37.17	196,469.87	
IMERYS SA	2,170	44.80	97,216.00	
K+S AG	5,170	46.89	242,447.15	
KONINKLIJKE DSM NV	5,112	39.50	201,949.56	
LAFARGE SA	7,668	42.45	325,506.60	
LINDE AG	6,240	104.35	651,144.00	
OUTOKUMPU OYJ	4,060	12.97	52,658.20	
RAUTARUUKKI OYJ	5,440	15.50	84,320.00	
SALZGITTER AG	2,320	55.25	128,180.00	
SOLVAY ET CIE SA -A	2,016	81.60	164,505.60	
STORA ENSO OYJ-R SHS	17,665	7.50	132,487.50	
THYSSENKRUPP AG	12,485	27.12	338,593.20	
UMICORE	5,885	35.25	207,446.25	
UPM-KYMMENE OYJ	17,208	13.16	226,457.28	
VOESTALPINE AG	5,919	29.65	175,498.35	
WACKER CHEMIE AG	580	148.50	86,130.00	
ACCIONA SA	1,146	63.09	72,301.14	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,811	37.84	182,048.24	
ALSTOM	7,505	37.40	280,724.52	
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	31.00	88,519.27	
BOUYGUES SA	8,105	32.34	262,156.22	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14,736	34.81	512,960.16	
EADS NV	13,738	18.09	248,520.42	
EIFFAGE	2,505	35.87	89,866.87	
FINMECCANICA SPA	13,850	9.69	134,206.50	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,535	19.82	50,243.70	
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	10,950	5.04	55,264.65	

GEA GROUP AG	8,245	19.22	158,468.90
HOCHTIEF AG	2,000	64.80	129,600.00
KONE OYJ-B	7,307	39.42	288,041.94
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	40,066	22.83	914,907.11
LEGRAND SA	4,050	27.46	111,233.25
MAN SE	3,674	82.96	304,795.04
METSO OYJ	4,900	36.87	180,663.00
PRYSMIAN SPA	10,025	14.30	143,357.50
SAFRAN SA	5,250	21.84	114,660.00
SCHNEIDER ELECTRIC SA	9,769	101.75	993,995.75
SIEMENS AG-REG	33,431	83.26	2,783,465.06
THALES SA	3,110	29.00	90,190.00
VALLOUREC	4,030	77.05	310,511.50
VINCI SA	17,375	39.35	683,706.25
WARTSILA OYJ	2,560	51.80	132,608.00
ZARDOYA OTIS SA	5,219	12.53	65,394.07
BUREAU VERITAS SA	2,000	51.67	103,340.00
EDENRED	6,096	15.82	96,469.20
RANDSTAD HOLDING NV	3,095	36.10	111,729.50
SOCIETE BIC SA	1,640	64.70	106,108.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	9,736	14.08	137,131.56
ADP	1,175	61.81	72,626.75
AIR FRANCE-KLM	8,490	13.29	112,832.10
ATLANTIA SPA	8,971	15.86	142,280.06
BRISA-AUTO-ESTRADAS PORTUGAL	2,920	5.55	16,217.68
FERROVIAL SA	18,045	8.03	145,009.62
DEUTSCHE LUFTHANSA	9,250	15.11	139,813.75
DEUTSCHE POST AG	32,798	13.70	449,496.59
FRAPORT AG	2,375	44.61	105,948.75
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	25,120	7.09	178,276.64
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	31,085	3.22	100,373.46
MAPFRE SA	17,994	2.34	42,105.96
RYANAIR HOLDINGS PLC	16,845	4.17	70,327.87
TNT NV	13,270	19.59	259,959.30
TOTAL SA	85,882	39.05	3,353,692.10
VOPAK	2,855	36.70	104,778.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,270	50.72	723,774.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,270	35.00	114,450.00
CONTINENTAL AG	1,530	64.44	98,593.20
DAIMLER AG	36,652	49.70	1,821,604.40
FIAT SPA	26,775	12.24	327,726.00
MICHELIN (CGDE)-B	6,544	60.26	394,341.44
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	26.25	111,431.25
PEUGEOT SA	7,062	29.73	209,953.26
PIRELLI & C.	15,376	6.26	96,253.76
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	2,920	38.06	111,135.20
RENAULT SA	6,632	43.19	286,436.08
VOLKSWAGEN AG	1,716	89.71	153,942.36
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,393	103.35	764,066.55
ADIDAS AG	7,841	47.76	374,525.36
CHRISTIAN DIOR	2,500	106.95	267,375.00
HERMES INTERNATIONAL	1,829	202.85	371,012.65
LUXOTTICA GROUP SPA	3,021	21.36	64,528.56
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,949	116.00	1,154,084.00

PUMA AG	296	250.55	74,162.80
ACCOR SA	6,096	29.58	180,350.16
AUTOGRILL SPA	6,045	9.33	56,430.07
OPAP SA	9,265	13.60	126,004.00
SODEXO	3,690	47.30	174,537.00
TUI AG	8,370	8.70	72,819.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,400	28.05	123,442.00
GESTEVISION TELECINCO SA	6,845	8.76	59,989.58
JC DECAUX SA .	2,520	21.87	55,112.40
LAGARDERE S.C.A.	5,040	29.01	146,235.60
M6-METROPOLE TELEVISION	4,205	17.51	73,629.55
MEDIASET SPA	22,451	5.06	113,714.31
PAGESJAUNES	8,175	7.97	65,187.45
PUBLICIS GROUPE	5,530	36.63	202,591.55
REED ELSEVIER NV	25,748	9.43	242,829.38
SANOMA OYJ	3,275	16.66	54,561.50
SES	12,005	17.75	213,088.75
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	7,655	11.51	88,109.05
VIVENDI SA	49,562	20.52	1,017,012.24
WOLTERS KLUWER	9,117	16.51	150,521.67
INDITEX	8,555	60.30	515,866.50
METRO AG	4,635	50.83	235,597.05
PPR	2,637	117.25	309,188.25
CARREFOUR SA	24,348	38.96	948,598.08
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,819	66.99	121,854.81
COLRUYT SA	2,485	39.81	98,927.85
DELHAIZE GROUP	4,201	49.90	209,629.90
JERONIMO MARTINS	9,110	10.34	94,242.95
KESKO OYJ-B SHS	1,830	35.45	64,873.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	52,339	9.82	514,230.67
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	29,336	45.73	1,341,535.28
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	7,413	19.38	143,663.94
DANONE	23,694	45.67	1,082,104.98
HEINEKEN HOLDING NV	3,380	32.51	109,883.80
HEINEKEN NV	11,058	38.25	422,968.50
KERRY GROUP PLC-A	6,445	25.85	166,603.25
PARMALAT SPA	72,660	1.95	142,195.62
PERNOD-RICARD SA	8,456	65.35	552,599.60
SAP AG-COMMON	34,872	38.17	1,331,238.60
UNILEVER NV-CVA	66,190	21.60	1,430,034.95
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	36.19	184,930.90
L'OREAL	9,741	86.79	845,421.39
CELESIO AG	4,830	17.76	85,804.95
ESSILOR INTERNATIONAL	7,535	47.36	356,857.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,688	45.10	301,628.80
FRESENIUS SE	1,165	59.32	69,107.80
FRESENIUS SE-PREF	3,205	60.31	193,293.55
QIAGEN N.V.	7,635	13.39	102,232.65
BAYER AG	33,600	55.00	1,848,000.00
BEIERSDORF AG	2,825	49.00	138,425.00
ELAN CORP PLC	10,000	4.12	41,280.00
GRIFOLS SA	8,255	11.64	96,088.20
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,633	43.22	329,936.42
MERCK KGAA	2,325	61.14	142,150.50



ORION OYJ-CLASS B	4,485	14.85	66,602.25
SANOFI-AVENTIS	42,606	49.87	2,124,761.22
UCB SA	3,063	27.71	84,875.73
ALPHA BANK AE	18,998	5.48	104,109.04
BANCA CARIGE SPA	28,825	1.73	50,040.20
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	68,245	1.04	71,589.00
BANCA POPOLARE DI MILANO	23,677	3.39	80,265.03
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	144,678	9.66	1,398,023.51
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	75,702	0.66	50,039.02
BANCO DE SABADELL SA	37,387	3.50	131,190.98
BANCO DE VALENCIA SA	14,104	4.11	57,967.44
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	10,630	3.60	38,268.00
BANCO POPOLARE SCARL	25,264	4.05	102,445.52
BANCO POPULAR ESPANOL	28,917	4.66	134,782.13
BANCO SANTANDER SA	330,086	9.45	3,119,642.78
BANCO SANTANDER SA - RTS	340,226	0.12	41,167.34
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	22,840	4.17	95,242.80
BANK OF IRELAND	136,990	0.59	81,920.02
BANKINTER SA	17,680	5.02	88,824.32
BNP PARIBAS	38,507	52.84	2,034,709.88
COMMERZBANK AG	27,433	6.42	176,257.02
CREDIT AGRICOLE SA	35,922	11.91	427,831.02
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	37,915	41.86	1,587,121.90
DEUTSCHE POSTBANK AG	5,060	25.00	126,500.00
DEXIA SA	13,226	3.23	42,719.98
EFG EUROBANK ERGASIAS	14,653	5.12	75,023.36
ERSTE GROUP BANK AG	6,703	32.75	219,523.25
INTESA SANPAOLO	53,745	2.06	110,714.70
INTESA SANPAOLO	322,958	2.59	836,461.22
KBC GROEP NV	6,959	32.53	226,376.27
NATIONAL BANK OF GREECE	36,533	8.49	310,165.17
NATIXIS	15,000	4.44	66,645.00
PIRAEUS BANK S.A.	13,598	4.06	55,207.88
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	3,155	42.60	134,403.00
SOCIETE GENERALE	25,549	43.47	1,110,742.77
UBI BANCA SCPA	20,424	7.75	158,286.00
UNICREDIT SPA	548,196	1.89	1,036,090.44
CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE	1,545	38.83	59,992.35
CRITERIA CAIXACORP SA	26,440	3.97	104,966.80
DEUTSCHE BOERSE AG	7,309	52.27	382,041.43
EURAZEO	1,894	55.04	104,245.76
EXOR SPA	3,969	17.91	71,084.79
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,127	63.10	197,313.70
ING GROEP NV-CVA	155,650	8.12	1,263,878.00
MEDIOBANCA SPA	14,915	7.30	108,954.07
POHJOLA BANK PLC	8,995	9.11	81,989.42
AEGON NV	59,769	4.63	276,730.47
AGEAS	69,259	2.22	154,101.27
ALLIANZ SE-REG	18,443	89.08	1,642,902.44
ASSICURAZIONI GENERALI	49,503	15.70	777,197.10
AXA	70,367	13.35	939,399.45
CNP ASSURANCES	5,580	13.82	77,115.60
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	36.30	89,128.77
MEDIOLANUM SPA	8,725	3.45	30,166.68

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,796	110.00	857,560.00
SAMPO OYJ-A SHS	19,469	20.44	397,946.36
SCOR SE	8,767	17.92	157,148.47
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	39.21	55,293.15
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	37,225	2.90	108,213.07
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
PRELIOS SPA(N)	15,376	0.43	6,688.56
ATOS ORIGIN SA	3,065	34.24	104,945.60
CAP GEMINI SA	5,469	37.33	204,185.11
DASSAULT SYSTEMES SA	3,320	51.76	171,843.20
INDRA SISTEMAS SA	6,099	14.39	87,764.61
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,965	13.12	104,540.62
ALCATEL-LUCENT	96,574	2.61	252,058.14
NEOPOST SA	1,792	59.17	106,032.64
NOKIA OYJ	152,171	7.96	1,211,281.16
BELGACOM SA	7,190	28.25	203,117.50
DEUTSCHE TELEKOM AG	115,191	10.04	1,156,517.64
ELISA OYJ	7,450	15.68	116,816.00
FRANCE TELECOM SA	75,334	16.69	1,257,701.13
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	11,930	5.88	70,148.40
KONINKLIJKE KPN NV	65,751	11.52	757,780.27
MOBISTAR SA	1,539	46.18	71,071.02
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	28,203	10.37	292,465.11
TELECOM ITALIA SPA	415,613	1.07	445,952.74
TELECOM ITALIA-RSP	252,797	0.87	220,312.58
TELEFONICA SA	166,903	19.31	3,223,731.44
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	11.27	158,075.50
A2A SPA	50,790	1.15	58,865.61
E.ON AG	73,174	22.41	1,640,195.21
EDP RENOVAVEIS SA	3,535	4.27	15,119.19
ELECTRICITE DE FRANCE	11,685	32.39	378,535.57
ENAGAS	9,825	15.33	150,666.37
ENEL SPA	267,459	4.03	1,078,528.41
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	84,701	2.69	227,845.69
FORTUM OYJ	16,510	20.58	339,775.80
GAS NATURAL SDG SA	7,130	10.63	75,827.55
GDF SUEZ	50,534	28.08	1,419,247.39
IBERDROLA RENOVABLES SA	21,775	2.42	52,804.37
IBERDROLA SA	164,010	5.95	975,859.50
PUBLIC POWER CORP	3,916	12.67	49,615.72
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,400	36.26	159,544.00
RWE AG	17,485	50.41	881,418.85
RWE AG-NON VTG PFD	2,070	47.66	98,666.55
SNAM RETE GAS	52,290	3.83	200,270.70
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	11,434	14.13	161,619.59
TERNA SPA	43,127	3.21	138,761.12
VEOLIA ENVIRONNEMENT	12,509	20.84	260,687.56
VERBUND AG	2,370	29.30	69,441.00
ASML HOLDING NV	16,962	23.64	400,981.68
INFINEON TECHNOLOGIES AG	49,585	5.80	287,593.00
STMICROELECTRONICS NV	31,453	5.91	185,887.23
ユ一ロ小計	7,519,497		96,846,598.24 (10,907,832,359.00)

合 計	株 43,550,798		円 67,507,160,823.00 (67,507,160,823.00)	
-----	-----------------	--	---	--

(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		米ドル	米ドル	
		AMB PROPERTY CORPORATION	8,410	234,891.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,575	392,284.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,282	479,235.86	
		DUKE REALTY CORPORATION	13,490	167,006.20	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,835	597,549.15	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,060	258,019.20	
		HCP INC	10,365	384,541.50	
		HEALTH CARE REIT INC	4,910	251,490.20	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	23,624	381,291.36	
		KIMCO REALTY CORPORATION	10,375	179,176.25	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	5,938	204,207.82	
		PLUM CREEK TIMBER CO	7,618	281,942.18	
		PROLOGIS	17,681	227,731.28	
		PUBLIC STORAGE	5,289	541,011.81	
		RAYONIER INC	4,030	207,746.50	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	4,550	194,694.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	11,894	1,164,422.60	
		THE MACERICH COMPANY	6,315	284,175.00	
	VENTAS INC	6,200	331,328.00		
VORNADO REALTY TRUST	7,011	638,561.88			
	投資証券小計		171,452	7,401,307.34 (597,433,528)	
米ドル合計				7,401,307.34 (597,433,528)	
加ドル	投資証券		加ドル	加ドル	
		ARC ENERGY TRUST	5,470	117,605.00	
		CANADIAN OIL SANDS TRUST	10,095	266,709.90	
		ENERPLUS RESOURCES FUND	7,630	211,351.00	
		PENN WEST ENERGY TRUST	13,938	321,549.66	
		PROVIDENT ENERGY TRUST	16,895	129,922.55	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	119,910.00	
	YELLOW PAGES INCOME FUND	16,485	101,053.05		
	投資証券小計		75,763	1,268,101.16 (100,408,249)	
加ドル合計				1,268,101.16 (100,408,249)	
豪ドル	投資証券		豪ドル	豪ドル	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	77,145	147,732.67	
		DEXUS PROPERTY GROUP	144,615	119,307.37	
		GOODMAN GROUP	325,245	217,914.15	
		GPT GROUP	60,000	175,200.00	
		MIRVAC GROUP	137,930	187,584.80	
		STOCKLAND	85,755	328,441.65	
	WESTFIELD GROUP	89,085	1,097,527.20		
	投資証券小計		919,775	2,273,707.84 (181,964,838)	
豪ドル合計				2,273,707.84 (181,964,838)	

英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	英ポンド 37,816	英ポンド 192,483.44	
		HAMMERSON PLC	35,465	147,889.05	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	31,634	214,636.69	
		CAPITAL SHOPPING CEN	26,445	102,209.92	
		SEGRO PLC	38,398	113,466.09	
	投資証券小計		169,758	770,685.19 (97,884,725)	
英ポンド合計				770,685.19 (97,884,725)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	香港ドル 94,500	香港ドル 2,277,450.00	
	投資証券小計		94,500	2,277,450.00 (23,685,480)	
香港ドル合計				2,277,450.00 (23,685,480)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	シンガポールドル 62,000	シンガポールドル 128,340.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	143,600.00	
	投資証券小計		133,800	271,940.00 (16,963,617)	
シンガポールドル合計				271,940.00 (16,963,617)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	ユーロ 2,210	ユーロ 119,052.70	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	81,354.75	
		GECINA SA	740	64,195.00	
		ICADE	1,215	95,839.20	
		KLEPIERRE	3,895	112,176.00	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,575	543,400.00	
	投資証券小計	12,640	1,016,017.65 (114,434,067)		
ユーロ合計				1,016,017.65 (114,434,067)	
合計				円 1,132,774,504 (1,132,774,504)	

(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

	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 569銘柄	98.4%		52.6%
	投資証券 20銘柄		1.6%	0.9%
加ドル	株式 89銘柄	97.4%		5.5%
	投資証券 7銘柄		2.6%	0.1%
豪ドル	株式 62銘柄	94.0%		4.2%
	投資証券 7銘柄		6.0%	0.3%
英ポンド	株式 101銘柄	98.7%		10.9%
	投資証券 5銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		4.1%
香港ドル	株式 38銘柄	97.5%		1.4%
	投資証券 1銘柄		2.5%	0.0%

シンガポールドル	株式	26銘柄	97.2%		0.9%
	投資証券	2銘柄		2.8%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%		0.0%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%		1.6%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%		0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシケル	株式	7銘柄	100.0%		0.4%
ユーロ	株式	260銘柄	99.0%		15.9%
	投資証券	6銘柄		1.0%	0.2%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成21年10月26日現在	平成22年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		3,386,338	4,578,412
コール・ローン		30,822,276	25,171,551
株式		1,089,074,181	1,090,489,356
新株予約権証券		79	
投資証券		12,863,763	17,736,023
派生商品評価勘定		3,773,391	23,146,729
未収入金		180,181	331,150
未収配当金		1,030,234	927,122
未収利息			59
差入委託証拠金		17,676,051	23,838,550
流動資産合計		1,158,806,494	1,186,218,952
資産合計			
		1,158,806,494	1,186,218,952
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		36,475,784	7,325,250
未払金		98,758	42,728
未払解約金		1,056,257	1,548,645
流動負債合計		37,630,799	8,916,623
負債合計			
		37,630,799	8,916,623
純資産の部			
元本等			
元本		1,614,863,595	1,538,197,145
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		493,687,900	360,894,816
元本等合計		1,121,175,695	1,177,302,329
純資産合計			
		1,121,175,695	1,177,302,329
負債純資産合計			
		1,158,806,494	1,186,218,952

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(1) デリバティブ取引 同左</p> <p>(2) 為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>



## (貸借対照表に関する注記)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1. 期首	平成20年10月28日	1. 期首	平成21年10月27日
期首元本額	2,111,169,382円	期首元本額	1,614,863,595円
期首からの追加設定元本額	720,307,858円	期首からの追加設定元本額	217,142,879円
期首からの一部解約元本額	1,216,613,645円	期首からの一部解約元本額	293,809,329円
平成21年10月26日現在の元本の内訳		平成22年10月26日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用)	34,028,818円	インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用)	38,654,679円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	32,553,964円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	28,632,726円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	28,677,076円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	25,403,258円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	49,627,650円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	43,971,345円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	64,108,543円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	55,609,612円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	317,515,437円	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	275,847,116円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	219,423,692円	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	175,788,379円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,386,052円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	50,868,457円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	134,557,152円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	134,748,767円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	174,261,269円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	179,699,924円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	185,127,119円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	174,322,044円
年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	323,596,823円	年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	354,650,838円
計	1,614,863,595円	計	1,538,197,145円
2. 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,614,863,595口	2. 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,538,197,145口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は493,687,900円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は360,894,816円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

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

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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>
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。

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## I 取引の状況に関する事項

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

取引の時価に関する事項  
株式関連  
(平成21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	16,353,820			16,725,239	371,419
	合計	16,353,820			16,725,239	371,419

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

(注) 時価の算定方法

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

## 通貨関連

（平成21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	1,089,957,758		1,123,031,570	33,073,812
	米ドル	581,713,038		593,258,170	11,545,132
	加ドル	54,143,918		55,838,810	1,694,892
	豪ドル	46,348,173		49,861,110	3,512,937
	英ポンド	117,889,605		122,235,180	4,345,575
	スイスフラン	44,911,906		46,451,340	1,539,434
	香港ドル	14,445,797		14,303,520	142,277
	シンガポールドル	6,554,135		6,659,000	104,865
	スウェーデンクローナ	14,067,944		14,617,680	549,736
	ノルウェークローネ	5,654,472		6,000,310	345,838
	デンマーククローネ	4,332,365		4,446,660	114,295
	ユーロ	199,896,405		209,359,790	9,463,385
合計		1,089,957,758		1,123,031,570	33,073,812

（平成22年10月26日現在）

（単位：円）

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

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1口当たり純資産額	0.6943円	1口当たり純資産額	0.7654円
(1万口当たり純資産額)	(6,943円)	(1万口当たり純資産額)	(7,654円)

[次へ](#)

(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	株	米ドル	米ドル	
ANADARKO PETROLEUM CORP	376	62.78	23,605.28	
APACHE CORP	238	101.07	24,054.66	
BAKER HUGHES INC	336	46.58	15,650.88	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	236	43.32	10,223.52	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	487	21.16	10,304.92	
CHEVRON CORP	1,317	84.87	111,773.79	
CONOCOPHILLIPS	926	61.34	56,800.84	
CONSOL ENERGY INC	216	38.53	8,322.48	
DEVON ENERGY CORPORATION	277	65.02	18,010.54	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	70	69.50	4,865.00	
EOG RESOURCES INC	204	97.46	19,881.84	
EXXON MOBIL CORP	3,343	66.20	221,306.60	
FMC TECHNOLOGIES INC	165	72.21	11,914.65	
HALLIBURTON CO	638	34.28	21,870.64	
HESS CORP	213	62.55	13,323.15	
MARATHON OIL CORP	534	35.89	19,165.26	
MURPHY OIL CORP	154	65.68	10,114.72	
NABORS INDUSTRIES LTD	307	19.33	5,934.31	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	308	47.97	14,774.76	
NOBLE CORP	219	34.25	7,500.75	
NOBLE ENERGY INC	158	78.33	12,376.14	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	535	80.06	42,832.10	
PEABODY ENERGY CORP	260	52.43	13,631.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	204	73.19	14,930.76	
QEP RESOURCES INC	225	31.45	7,076.25	
RANGE RESOURCES CORP	188	36.42	6,846.96	
SCHLUMBERGER LTD	895	68.53	61,334.35	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	310	33.96	10,527.60	
SPECTRA ENERGY CORP	649	23.74	15,407.26	
TRANSOCEAN LTD	197	64.74	12,753.78	
ULTRA PETROLEUM CORP	178	41.49	7,385.22	
VALERO ENERGY CORP	554	17.77	9,844.58	
WEATHERFORD INTL LTD	571	17.09	9,758.39	
WILLIAMS COS INC	581	20.83	12,102.23	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	170	85.74	14,575.80	
ALCOA INC	1,175	12.88	15,134.00	
DOW CHEMICAL	763	31.56	24,080.28	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	598	47.70	28,524.60	
FREEMONT-MCMORAN COPPER	286	96.07	27,476.02	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	84	79.91	6,712.44	
MONSANTO CO	356	58.71	20,900.76	
NEWMONT MINING CORP	327	59.37	19,413.99	
NUCOR CORP	319	38.26	12,204.94	
PRAXAIR INC	208	93.77	19,504.16	
SIGMA-ALDRICH	160	63.13	10,100.80	
UNITED STATES STEEL CORP	211	42.27	8,918.97	
VULCAN MATERIALS CO	164	36.94	6,058.16	
WEYERHAEUSER CO	591	15.99	9,450.09	



3M CO	443	90.90	40,268.70
BOEING CO	450	71.66	32,247.00
CATERPILLAR INC	414	79.05	32,726.70
COOPER INDUSTRIES PLC	235	52.96	12,445.60
CUMMINS INC	221	94.49	20,882.29
DANAHER CORP	363	42.86	15,558.18
DEERE & CO	300	77.24	23,172.00
DOVER CORP	264	53.40	14,097.60
EATON CORP	168	88.25	14,826.00
EMERSON ELECTRIC CO	497	54.95	27,310.15
FASTENAL CO	228	52.62	11,997.36
FLUOR CORP	192	49.57	9,517.44
GENERAL DYNAMICS CORP	197	64.06	12,619.82
GENERAL ELECTRIC CO.	7,003	16.06	112,468.18
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	481	47.53	22,861.93
ILLINOIS TOOL WORKS	305	46.94	14,316.70
INGERSOLL-RAND PLC	345	39.87	13,755.15
ITT CORP	145	48.15	6,981.75
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	169	39.06	6,601.14
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	82	70.46	5,777.72
LOCKHEED MARTIN CORP	186	71.41	13,282.26
MASCO CORP	595	10.89	6,479.55
NORTHROP GRUMMAN CORP	213	60.91	12,973.83
PACCAR INC	354	51.05	18,071.70
PARKER HANNIFIN CORP	178	77.19	13,739.82
PRECISION CASTPARTS CORP	134	138.12	18,508.08
RAYTHEON COMPANY	230	47.14	10,842.20
ROCKWELL COLLINS INC.	196	61.14	11,983.44
STANLEY BLACK & DECKER INC	204	60.80	12,403.20
TEXTRON INC	367	20.83	7,644.61
TYCO INTERNATIONAL LTD	398	38.84	15,458.32
UNITED TECHNOLOGIES CORP	580	75.01	43,505.80
EQUIFAX INC	231	33.02	7,627.62
IRON MOUNTAIN INC	302	22.90	6,915.80
ROBERT HALF INTL INC	339	27.44	9,302.16
WASTE MANAGEMENT INC	323	36.88	11,912.24
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	127	72.78	9,243.06
CSX CORP	298	61.24	18,249.52
EXPEDITORS INTL WASH INC	200	49.99	9,998.00
FEDEX CORP	201	89.56	18,001.56
NORFOLK SOUTHERN CORP	275	61.97	17,041.75
UNION PACIFIC CORP	334	87.19	29,121.46
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	471	69.32	32,649.72
FORD MOTOR COMPANY	1,959	14.15	27,719.85
HARLEY-DAVIDSON INC	282	31.47	8,874.54
JOHNSON CONTROLS INC	559	34.74	19,419.66
COACH INC	317	44.48	14,100.16
FORTUNE BRANDS INC	175	55.99	9,798.25
MATTEL INC	395	23.62	9,329.90
MOHAWK INDUSTRIES INC	97	58.19	5,644.43
NEWELL RUBBERMAID INC	451	18.13	8,176.63
NIKE INC -CL B	255	82.05	20,922.75
VF CORP	99	85.25	8,439.75
WHIRLPOOL CORP	116	84.81	9,837.96

APOLLO GROUP INC-CL A	89	36.44	3,243.16
CARNIVAL CORP	384	40.50	15,552.00
H&R BLOCK INC	341	10.78	3,675.98
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	356	37.57	13,374.92
MCDONALD'S CORP	705	78.70	55,483.50
STARBUCKS CORP	683	28.39	19,390.37
STARWOOD HOTELS & RESORTS	263	57.62	15,154.06
YUM! BRANDS INC	340	49.88	16,959.20
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	797	17.26	13,756.22
COMCAST CORP-CLASS A	1,357	19.77	26,827.89
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	641	18.63	11,941.83
DIRECTV-CLASS A	583	43.22	25,197.26
DISH NETWORK CORP-A	368	19.49	7,172.32
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	339	36.56	12,393.84
NEWS CORP-CL A	1,476	14.25	21,033.00
OMNICOM GROUP	320	43.60	13,952.00
THE WALT DISNEY CO.	1,225	35.46	43,438.50
TIME WARNER CABLE	346	57.88	20,026.48
TIME WARNER INC	752	31.64	23,793.28
VIACOM INC-CLASS B	530	37.78	20,023.40
WASHINGTON POST-CLASS B	13	370.57	4,817.41
AMAZON.COM INC	235	169.00	39,715.00
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	336	16.72	5,617.92
AUTOZONE INC	39	235.12	9,169.68
BED BATH & BEYOND INC	250	44.04	11,010.00
BEST BUY CO INC	277	43.08	11,933.16
GAMESTOP CORP-CLASS A	140	19.23	2,692.20
GAP INC/THE	413	19.36	7,995.68
GENUINE PARTS CO	164	47.67	7,817.88
HOME DEPOT INC	1,116	31.40	35,042.40
J.C. PENNEY CO INC	233	32.70	7,619.10
KOHL'S CORP	234	52.85	12,366.90
LIMITED INC/THE	477	29.16	13,909.32
LOWE'S COS INC	953	21.86	20,832.58
MACY'S INC	499	22.47	11,212.53
ROSS STORES INC	173	58.42	10,106.66
SEARS HOLDINGS CORP	86	75.72	6,511.92
STAPLES INC	489	21.00	10,269.00
TARGET CORP	462	53.76	24,837.12
TIFFANY & CO	179	51.50	9,218.50
TJX COMPANIES INC	345	45.69	15,763.05
COSTCO WHOLESALE CORP	266	64.11	17,053.26
CVS CAREMARK CORP	889	31.23	27,763.47
KROGER CO	268	21.76	5,831.68
SAFEWAY INC	273	22.50	6,142.50
SUPERVALU INC	256	10.49	2,685.44
SYSCO CORP	453	29.55	13,386.15
WALGREEN CO	638	34.44	21,972.72
WAL-MART STORES INC	1,337	53.95	72,131.15
ALTRIA GROUP INC	1,362	25.06	34,131.72
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	419	33.71	14,124.49
BUNGE LTD	126	62.56	7,882.56
COCA-COLA CO/THE	1,361	61.01	83,034.61
CONAGRA FOODS INC	397	22.92	9,099.24

CONSTELLATION BRANDS INC-A	306	19.50	5,967.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	342	35.97	12,301.74
GENERAL MILLS INC	431	37.50	16,162.50
HANSEN NATURAL CORPORATION	142	51.59	7,325.78
HJ HEINZ CO	245	49.72	12,181.40
KELLOGG CO	161	49.57	7,980.77
KRAFT FOODS INC-CLASS A	1,140	32.47	37,015.80
LORILLARD INC	112	85.14	9,535.68
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	271	58.38	15,820.98
PEPSICO INC	1,057	65.05	68,757.85
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,213	59.47	72,137.11
REYNOLDS AMERICAN INC	149	63.37	9,442.13
SARA LEE CORP	794	14.50	11,513.00
TYSON FOODS INC-CL A	464	15.74	7,303.36
AVON PRODUCTS	368	33.02	12,151.36
CLOROX COMPANY	77	67.52	5,199.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	320	76.87	24,598.40
KIMBERLY-CLARK CORP	266	66.47	17,681.02
PROCTER & GAMBLE CO	1,888	63.54	119,963.52
AETNA INC	378	31.27	11,820.06
AMERISOURCEBERGEN CORP	415	32.03	13,292.45
BAXTER INTERNATIONAL INC	382	50.43	19,264.26
BECTON DICKINSON AND CO	114	76.91	8,767.74
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,162	6.31	7,332.22
CARDINAL HEALTH INC	321	32.41	10,403.61
CAREFUSION CORP	342	24.68	8,440.56
CIGNA CORP	288	36.38	10,477.44
COVIDIEN PLC	344	40.19	13,825.36
CR BARD INC	48	83.47	4,006.56
DAVITA INC	132	71.77	9,473.64
EXPRESS SCRIPTS INC	393	49.10	19,296.30
HOSPIRA INC	207	58.53	12,115.71
HUMANA INC	181	57.46	10,400.26
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	78	78.81	6,147.18
MCKESSON CORP	215	61.68	13,261.20
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	301	52.45	15,787.45
MEDTRONIC INC	719	36.22	26,042.18
QUEST DIAGNOSTICS	126	49.41	6,225.66
ST JUDE MEDICAL INC	251	38.29	9,610.79
STRYKER CORP	223	51.27	11,433.21
UNITEDHEALTH GROUP INC	750	37.56	28,170.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	176	61.15	10,762.40
WELLPOINT INC	319	57.26	18,265.94
ZIMMER HOLDINGS INC	183	51.56	9,435.48
ABBOTT LABORATORIES	1,011	52.51	53,087.61
ALLERGAN INC	252	71.80	18,093.60
AMGEN INC	630	57.95	36,508.50
BIOGEN IDEC INC	230	59.90	13,777.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,124	27.16	30,527.84
CELGENE CORP	324	59.56	19,297.44
CEPHALON INC	82	64.79	5,312.78
COVANCE INC	114	47.13	5,372.82
ELI LILLY & CO	678	35.13	23,818.14
FOREST LABORATORIES INC	265	33.89	8,980.85

GENZYME CORP	193	72.32	13,957.76
GILEAD SCIENCES INC	581	39.54	22,972.74
JOHNSON & JOHNSON	1,808	63.98	115,675.84
MERCK & CO. INC.	2,043	37.42	76,449.06
PFIZER INC	5,287	17.62	93,156.94
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	330	50.23	16,575.90
WATERS CORP	130	73.26	9,523.80
BB&T CORP	507	22.32	11,316.24
COMERICA INC	263	35.23	9,265.49
HUDSON CITY BANCORP INC	210	11.48	2,410.80
KEYCORP	1,043	8.08	8,427.44
M & T BANK CORP	109	74.58	8,129.22
MARSHALL & ILSLEY CORP	679	6.10	4,141.90
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	423	16.78	7,097.94
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	83	12.66	1,050.78
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	354	54.00	19,116.00
REGIONS FINANCIAL CORP	1,087	7.03	7,641.61
SUNTRUST BANKS INC	423	25.51	10,790.73
US BANCORP	1,253	23.47	29,407.91
WELLS FARGO & CO	3,254	25.72	83,692.88
AMERICAN EXPRESS CO	713	39.30	28,020.90
AMERIPRISE FINANCIAL INC	294	51.19	15,049.86
BANK OF AMERICA CORPORATION	6,595	11.16	73,600.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	791	24.93	19,719.63
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	363	38.24	13,881.12
CITIGROUP INC	16,202	4.21	68,210.42
CME GROUP INC	44	282.98	12,451.12
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	642	17.52	11,247.84
FRANKLIN RESOURCES INC	157	115.78	18,177.46
GOLDMAN SACHS GROUP INC	320	157.39	50,364.80
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	76	115.61	8,786.36
INVESCO LTD	501	22.11	11,077.11
JPMORGAN CHASE & CO	2,615	37.07	96,938.05
MOODY'S CORP	306	26.48	8,102.88
MORGAN STANLEY	831	24.38	20,259.78
NORTHERN TRUST CORP	144	48.02	6,914.88
SCHWAB (CHARLES) CORP	672	15.00	10,080.00
STATE STREET CORP	362	40.26	14,574.12
T ROWE PRICE GROUP INC	261	54.69	14,274.09
ACE LTD	253	60.72	15,362.16
AFLAC INC	405	55.25	22,376.25
ALLSTATE CORP	420	33.11	13,906.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	114	41.10	4,685.40
AON CORP	181	40.30	7,294.30
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	247	34.66	8,561.02
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	542	83.33	45,164.86
CHUBB CORP	250	58.23	14,557.50
MARSH & MCLENNAN COS	432	25.12	10,851.84
METLIFE INC	591	40.16	23,734.56
OLD REPUBLIC INTL CORP	722	13.91	10,043.02
PROGRESSIVE CORP	663	21.01	13,929.63
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	355	52.98	18,807.90
TRAVELERS COS INC/THE	334	55.59	18,567.06
UNUM GROUP	573	22.35	12,806.55

WR BERKLEY CORP	283	28.09	7,949.47
ACCENTURE PLC-CL A	462	45.53	21,034.86
ACTIVISION BLIZZARD INC	463	11.33	5,245.79
ADOBE SYSTEMS INC	423	28.20	11,928.60
AUTODESK INC	308	35.43	10,912.44
AUTOMATIC DATA PROCESSING	375	43.99	16,496.25
BMC SOFTWARE INC	193	44.20	8,530.60
CA INC	421	22.75	9,577.75
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	349	67.26	23,473.74
COMPUTER SCIENCES CORP	169	49.51	8,367.19
EBAY INC	810	27.93	22,623.30
ELECTRONIC ARTS INC	236	15.62	3,686.32
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	369	28.82	10,634.58
FISERV INC	184	55.15	10,147.60
GOOGLE INC-CL A	161	616.50	99,256.50
INTUIT INC	319	47.19	15,053.61
MASTERCARD INC-CLASS A	77	245.15	18,876.55
MICROSOFT CORP	5,173	25.19	130,307.87
ORACLE CORP	2,630	28.84	75,849.20
PAYCHEX INC	297	28.04	8,327.88
SYMANTEC CORP	626	15.78	9,878.28
VISA INC-CLASS A SHARES	327	80.63	26,366.01
WESTERN UNION CO	616	18.11	11,155.76
YAHOO! INC	1,133	16.40	18,581.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	469	34.90	16,368.10
APPLE COMPUTER INC	598	308.84	184,686.32
CISCO SYSTEMS INC	3,755	23.61	88,655.55
CORNING INC	1,104	18.71	20,655.84
DELL INC	1,192	14.71	17,534.32
EMC CORP/MASS	1,356	21.28	28,855.68
HARRIS CORP	187	44.83	8,383.21
HEWLETT-PACKARD CO	1,539	42.88	65,992.32
INTL BUSINESS MACHINES CORP	841	139.84	117,605.44
JUNIPER NETWORKS INC	490	32.02	15,689.80
MOTOROLA INC	2,015	7.93	15,978.95
QUALCOMM INC	1,074	44.33	47,610.42
SEAGATE TECHNOLOGY	684	14.81	10,130.04
XEROX CORP	1,495	11.60	17,342.00
AMERICAN TOWER CORP-CL A	379	50.81	19,256.99
AT&T INC	3,874	28.36	109,866.64
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	431	8.70	3,749.70
NII HOLDINGS INC	258	39.27	10,131.66
SPRINT NEXTEL CORP	2,532	4.75	12,027.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,851	32.35	59,879.85
AES CORP	754	12.32	9,289.28
ALLEGHENY ENERGY INC	212	23.41	4,962.92
AMERICAN ELECTRIC POWER	387	36.46	14,110.02
CENTERPOINT ENERGY INC	633	16.40	10,381.20
CONSOLIDATED EDISON INC	238	49.20	11,709.60
CONSTELLATION ENERGY GROUP	207	31.24	6,466.68
DOMINION RESOURCES INC/VA	420	44.46	18,673.20
DUKE ENERGY CORP	853	17.77	15,157.81
EDISON INTERNATIONAL	272	36.06	9,808.32
ENERGY CORP	134	73.73	9,879.82

EQT CORP	212	37.47	7,943.64	
EXELON CORP	421	41.33	17,399.93	
FIRSTENERGY CORP	237	37.13	8,799.81	
NEXTERA ENERGY INC	277	54.85	15,193.45	
P G & E CORP	274	47.67	13,061.58	
PINNACLE WEST CAPITAL	279	42.02	11,723.58	
PPL CORPORATION	331	26.89	8,900.59	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	360	33.33	11,998.80	
SEMPRA ENERGY	197	53.79	10,596.63	
SOUTHERN CO	538	38.18	20,540.84	
WISCONSIN ENERGY CORP	194	59.56	11,554.64	
XCEL ENERGY INC	458	23.90	10,946.20	
ALTERA CORPORATION	496	30.24	14,999.04	
ANALOG DEVICES INC	326	32.27	10,520.02	
APPLIED MATERIALS INC	1,068	12.15	12,976.20	
BROADCOM CORP-CL A	465	37.51	17,442.15	
INTEL CORP	3,659	19.87	72,704.33	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	312	31.16	9,721.92	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	724	17.57	12,720.68	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	338	31.52	10,653.76	
TEXAS INSTRUMENTS INC	807	28.98	23,386.86	
XILINX INC	403	25.45	10,256.35	
米ドル小計	212,026		7,217,191.78 (582,571,720.00)	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
CAMECO CORP	395	31.58	12,474.10	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	718	36.71	26,357.78	
CENOVUS ENERGY INC	705	29.22	20,600.10	
ENBRIDGE INC	307	55.67	17,090.69	
ENCANA CORP	587	28.25	16,582.75	
HUSKY ENERGY INC	274	25.24	6,915.76	
IMPERIAL OIL LTD	262	39.35	10,309.70	
NEXEN INC	483	22.31	10,775.73	
SUNCOR ENERGY INC	1,029	33.47	34,440.63	
TALISMAN ENERGY INC	852	18.47	15,736.44	
TRANSCANADA CORP	461	38.48	17,739.28	
AGNICO-EAGLE MINES LTD	278	72.94	20,277.32	
AGRIUM INC	188	89.10	16,750.80	
BARRICK GOLD CORP	649	47.47	30,808.03	
GOLDCORP INC	485	43.55	21,121.75	
KINROSS GOLD CORP	1,145	18.07	20,690.15	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	195	146.90	28,645.50	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	564	46.26	26,090.64	
BOMBARDIER INC 'B'	1,784	5.16	9,205.44	
SNC-LAVALIN GROUP INC	208	52.61	10,942.88	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	311	68.30	21,241.30	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	174	66.78	11,619.72	
MAGNA INTERNATIONAL INC	119	91.60	10,900.40	
TIM HORTONS INC	245	38.84	9,515.80	
THOMSON REUTERS CORP	375	39.30	14,737.50	
BANK OF MONTREAL	370	61.57	22,780.90	
BANK OF NOVA SCOTIA	671	54.52	36,582.92	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	268	77.95	20,890.60	
NATIONAL BANK OF CANADA	152	66.84	10,159.68	
ROYAL BANK OF CANADA	931	55.33	51,512.23	

TORONTO-DOMINION BANK	569	74.77	42,544.13	
IGM FINANCIAL INC	275	42.52	11,693.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,244	12.82	15,948.08	
POWER CORP OF CANADA	445	27.48	12,228.60	
SUN LIFE FINANCIAL INC	499	28.02	13,981.98	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	539	31.14	16,784.46	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	605	18.21	11,017.05	
RESEARCH IN MOTION	327	52.89	17,295.03	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	435	41.31	17,969.85	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	299	45.22	13,520.78	
TRANSALTA CORP	329	21.69	7,136.01	
加ドル小計	20,751		763,615.49 (60,463,074.00)	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
ORIGIN ENERGY LTD	825	16.26	13,414.50	
SANTOS LTD	829	12.82	10,627.78	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	424	43.94	18,630.56	
WORLEYPARSONS LTD	266	23.19	6,168.54	
BHP BILLITON LTD	2,207	41.74	92,120.18	
BLUESCOPE STEEL LTD	2,556	2.14	5,469.84	
NEWCREST MINING LTD	589	40.62	23,925.18	
RIO TINTO LTD	307	84.10	25,818.70	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	240	38.11	9,146.40	
INTOLL GROUP	3,460	1.50	5,190.00	
CROWN LTD	995	8.57	8,527.15	
TABCORP HOLDINGS LTD	760	7.47	5,677.20	
FAIRFAX MEDIA LTD	4,742	1.47	6,970.74	
WESFARMERS LTD	706	33.84	23,891.04	
WOOLWORTHS LTD	809	29.00	23,461.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	1,065	12.62	13,440.30	
FOSTER'S GROUP LTD	2,311	6.13	14,166.43	
CSL LTD	453	32.85	14,881.05	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,669	23.90	39,889.10	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	1,014	50.95	51,663.30	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,386	25.01	34,663.86	
WESTPAC BANKING CORP	1,948	22.95	44,706.60	
MACQUARIE GROUP LTD	306	34.97	10,700.82	
AMP LTD	2,282	5.50	12,551.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	2,583	3.89	10,047.87	
QBE INSURANCE GROUP LTD	743	17.01	12,638.43	
SUNCORP-METWAY LIMITED	1,345	9.06	12,185.70	
LEND LEASE CORP LIMITED	1,257	7.59	9,540.63	
COMPUTERSHARE LTD	958	10.27	9,838.66	
TELSTRA CORPORATION LTD	3,318	2.64	8,759.52	
AGL ENERGY LTD	863	16.83	14,524.29	
豪ドル小計	43,216		593,236.37 (47,476,706.00)	
英bond	株	英bond	英bond	
BG GROUP PLC	2,216	11.96	26,503.36	
BP PLC	12,313	4.28	52,779.67	
COMPASS GROUP PLC	1,737	5.23	9,084.51	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,323	20.04	46,552.92	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,765	19.57	34,549.87	
ANGLO AMERICAN PLC	869	29.82	25,913.58	
BHP BILLITON PLC	1,453	22.52	32,728.82	

RIO TINTO PLC	954	42.08	40,144.32	
XSTRATA PLC	1,358	13.24	17,979.92	
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,945	3.54	6,889.19	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	1,905	6.38	12,163.42	
SMITHS GROUP PLC	489	12.02	5,877.78	
WOLSELEY PLC	351	17.03	5,977.53	
CAPITA GROUP PLC	652	7.81	5,092.12	

[次へ](#)



EXPERIAN PLC	1,253	7.26	9,096.78	
G4S PLC	2,313	2.70	6,258.97	
FIRSTGROUP PLC	678	3.98	2,698.44	
CARNIVAL PLC	225	26.54	5,971.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	593	12.25	7,264.25	
WHITBREAD PLC	328	17.29	5,671.12	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	1,304	7.05	9,193.20	
REED ELSEVIER PLC	1,058	5.50	5,819.00	
WPP PLC	1,405	7.44	10,460.22	
KINGFISHER PLC	2,317	2.47	5,729.94	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,151	4.26	4,906.71	
NEXT PLC	256	23.12	5,918.72	
SAINSBURY (J) PLC	961	3.87	3,727.71	
TESCO PLC	5,246	4.31	22,618.12	
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,320	2.99	3,950.76	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,314	24.32	31,963.05	
DIAGEO PLC	1,646	11.86	19,521.56	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	664	19.94	13,240.16	
UNILEVER PLC	838	18.56	15,553.28	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	402	34.18	13,740.36	
SMITH & NEPHEW PLC	824	5.78	4,762.72	
ASTRAZENECA PLC	944	33.00	31,152.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,402	12.87	43,783.74	
SHIRE PLC	655	14.78	9,680.90	
BARCLAYS PLC	7,537	2.81	21,205.34	
HSBC HOLDINGS PLC	11,481	6.68	76,739.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	26,929	0.68	18,311.72	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	13,363	0.45	6,066.80	
SABMILLER PLC	628	20.43	12,830.04	
STANDARD CHARTERED PLC	1,349	18.06	24,362.94	
STANDARD CHARTERED PLC-NPRTS	168	5.24	881.16	
MAN GROUP PLC	1,493	2.60	3,892.25	
AVIVA PLC	2,301	4.00	9,222.40	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,404	1.02	6,583.31	
OLD MUTUAL PLC	6,360	1.34	8,547.84	
PRUDENTIAL PLC	1,971	6.32	12,456.72	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	3,058	1.33	4,073.25	
STANDARD LIFE PLC	2,250	2.27	5,107.50	
SAGE GROUP PLC/THE	2,109	2.74	5,795.53	
BT GROUP PLC	6,145	1.56	9,592.34	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	4,711	0.69	3,292.98	
VODAFONE GROUP PLC	34,522	1.65	57,271.99	
CENTRICA PLC	3,782	3.24	12,261.24	
INTERNATIONAL POWER PLC	1,920	4.06	7,795.20	
NATIONAL GRID PLC	2,273	5.84	13,274.32	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	664	11.17	7,416.88	
SEVERN TRENT PLC	426	13.63	5,806.38	
英bond小計	203,271		947,707.35 (120,368,310.00)	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
GIVAUDAN-REG	11	1,023.00	11,253.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	207	60.70	12,564.90	
SYNGENTA AG-REG	67	281.20	18,840.40	
ABB LTD-REG	1,459	21.98	32,068.82	

GEBERIT AG-REG	66	188.30	12,427.80
ADECCO SA-REG	214	56.50	12,091.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	88	119.00	10,472.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	463	49.61	22,969.43
SWATCH GROUP AG/THE-BR	40	383.30	15,332.00
NESTLE SA-REG	2,274	53.10	120,749.40
NOBEL BIOCARE HOLDING AG-REG	202	16.65	3,363.30
SYNTHES INC	28	119.50	3,346.00
ACTELION LTD-REG	119	51.15	6,086.85
LONZA GROUP AG-REG	38	88.30	3,355.40
NOVARTIS AG-REG	1,383	56.90	78,692.70
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	460	143.50	66,010.00
CREDIT SUISSE GROUP-REG	742	40.69	30,191.98
GAM HOLDING LTD	477	15.75	7,512.75
JULIUS BAER GROUP LTD	202	40.07	8,094.14
UBS AG-REG	2,396	17.64	42,265.44
SWISS REINSURANCE CO LTD-REG	340	47.59	16,180.60
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	98	238.50	23,373.00
スイスフラン小計	11,374		557,240.91 (46,306,719.00)
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル
MONGOLIA ENERGY CO LTD	6,000	3.25	19,500.00
HUTCHISON WHAMPOA LTD	2,146	79.50	170,607.00
ESPRIT HOLDINGS LTD	1,129	44.15	49,845.35
LI & FUNG LTD	2,000	42.30	84,600.00
BANK OF EAST ASIA	2,680	34.30	91,924.00
HANG SENG BANK LTD	350	116.30	40,705.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	900	181.90	163,710.00
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1,044	121.70	127,054.80
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,000	37.30	111,900.00
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	2,000	57.55	115,100.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	933	133.60	124,648.80
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,254	112.20	140,698.80
HONG KONG & CHINA GAS	6,290	18.92	119,006.80
香港ドル小計	29,726		1,359,300.55 (14,136,725.00)
シンガポールドル	株	シンガポールドル	シンガポールドル
COSCO CORP SINGAPORE LTD	3,000	1.91	5,730.00
KEPPEL CORP LTD	2,000	10.00	20,000.00
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	4,000	4.19	16,760.00
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,423	14.60	20,775.80
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,000	18.66	18,660.00
SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,000	8.95	17,900.00
CITY DEVELOPMENTS LTD	1,500	13.50	20,250.00
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,000	3.09	24,720.00
シンガポールドル小計	22,923		144,795.80 (9,032,362.00)
スウェーデンクローナ	株	スウェーデンクローナ	スウェーデンクローナ
ASSA ABLOY AB-B	600	170.80	102,480.00
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,186	140.70	166,870.20
SANDVIK AB	1,325	107.00	141,775.00
SKANSKA AB-B SHS	699	130.20	91,009.80
VOLVO AB-B SHARES	1,548	93.50	144,738.00
SECURITAS AB-B SHS	958	74.85	71,706.30
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	675	240.90	162,607.50

NORDEA BANK AB	2,109	73.50	155,011.50	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,306	53.60	70,001.60	
ERICSSON LM-B SHS	1,989	73.75	146,688.75	
TELIASONERA AB	2,140	56.15	120,161.00	
スウェーデンクローナ小計	14,535		1,373,049.65 (16,847,319.00)	
ノルウェークローネ	株	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	
STATOIL ASA	599	127.10	76,132.90	
NORSK HYDRO A S	2,517	37.36	94,035.12	
YARA INTERNATIONAL ASA	217	296.80	64,405.60	
ORKLA ASA	635	56.50	35,877.50	
DNB NOR ASA	872	82.80	72,201.60	
TELENOR ASA	846	91.75	77,620.50	
ノルウェークローネ小計	5,686		420,273.22 (5,850,203.00)	
デンマーククローネ	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	188	200.00	37,600.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	2	47,800.00	95,600.00	
DSV A/S	542	116.90	63,359.80	
NOVO NORDISK A/S-B	287	543.50	155,984.50	
デンマーククローネ小計	1,019		352,544.30 (5,323,418.00)	
イスラエルシュケル	株	イスラエルシュケル	イスラエルシュケル	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	614	191.10	117,335.40	
イスラエルシュケル小計	614		117,335.40 (2,625,966.00)	
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ	
ENI SPA	1,703	16.18	27,554.54	
OMV AG	156	27.28	4,256.46	
REPSOL YPF SA	613	19.61	12,020.93	
SAIPEM SPA	355	32.12	11,402.60	
TECHNIP SA	141	62.59	8,825.19	
ACERINOX SA	395	12.32	4,866.40	
AIR LIQUIDE	187	96.23	17,995.01	
AKZO NOBEL NV	233	43.01	10,021.33	
ARCELORMITTAL	635	25.02	15,887.70	
BASF SE	605	53.11	32,131.55	
CRH PLC	581	12.58	7,311.88	
K+S AG	141	46.89	6,612.19	
KONINKLIJKE DSM NV	183	39.50	7,229.41	
LINDE AG	145	104.35	15,130.75	
SOLVAY ET CIE SA -A	68	81.60	5,548.80	
THYSSENKRUPP AG	390	27.12	10,576.80	
UMICORE	312	35.25	10,998.00	
UPM-KYMMENE OYJ	733	13.16	9,646.28	
ACCIONA SA	69	63.09	4,353.21	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	125	37.84	4,730.00	
ALSTOM	186	37.40	6,957.33	
BOUYGUES SA	212	32.34	6,857.14	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	332	34.81	11,556.92	
EADS NV	464	18.09	8,393.76	
FINMECCANICA SPA	283	9.69	2,742.27	
KONE OYJ-B	183	39.42	7,213.86	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	652	22.83	14,888.42	
MAN SE	145	82.96	12,029.20	

SCHNEIDER ELECTRIC SA	169	101.75	17,195.75
SIEMENS AG-REG	541	83.26	45,043.66
VALLOUREC	137	77.05	10,555.85
VINCI SA	326	39.35	12,828.10
WARTSILA OYJ	179	51.80	9,272.20
EDENRED	339	15.82	5,364.67
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	491	14.08	6,915.73
ATLANTIA SPA	357	15.86	5,662.02
DEUTSCHE POST AG	730	13.70	10,004.65
TNT NV	341	19.59	6,680.19
TOTAL SA	1,385	39.05	54,084.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	315	50.72	15,976.80
DAIMLER AG	595	49.70	29,571.50
MICHELIN (CGDE)-B	141	60.26	8,496.66
PEUGEOT SA	168	29.73	4,994.64
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	73	38.06	2,778.38
VOLKSWAGEN AG	11	89.71	986.81
VOLKSWAGEN AG-PFD	128	103.35	13,228.80
ADIDAS AG	211	47.76	10,078.41
HERMES INTERNATIONAL	48	202.85	9,736.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	162	116.00	18,792.00
ACCOR SA	183	29.58	5,414.05
OPAP SA	185	13.60	2,516.00
SODEXO	102	47.30	4,824.60
LAGARDERE S.C.A.	164	29.01	4,758.46
MEDIASET SPA	1,912	5.06	9,684.28
SES	380	17.75	6,745.00
VIVENDI SA	802	20.52	16,457.04
WOLTERS KLUWER	392	16.51	6,471.92
INDITEX	186	60.30	11,215.80
PPR	90	117.25	10,552.50
CARREFOUR SA	401	38.96	15,622.96
DELHAIZE GROUP	124	49.90	6,187.60
KONINKLIJKE AHOLD NV	625	9.82	6,140.62
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	476	45.73	21,767.48
DANONE	381	45.67	17,400.27
HEINEKEN NV	204	38.25	7,803.00
PARMALAT SPA	2,914	1.95	5,702.69
PERNOD-RICARD SA	178	65.35	11,632.30
SAP AG-COMMON	566	38.17	21,607.05
UNILEVER NV-CVA	1,065	21.60	23,009.32
L'OREAL	132	86.79	11,456.28
ESSILOR INTERNATIONAL	186	47.36	8,808.96
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	157	45.10	7,080.70
FRESENIUS SE-PREF	116	60.31	6,995.96
BAYER AG	541	55.00	29,755.00
BEIERSDORF AG	89	49.00	4,361.00
GRIFOLS SA	179	11.64	2,083.56
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	269	43.22	11,627.52
MERCK KGAA	70	61.14	4,279.80
SANOFI-AVENTIS	686	49.87	34,210.82
UCB SA	152	27.71	4,211.92
ALPHA BANK AE	642	5.48	3,518.16
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	2,782		

BANCA POPOLARE DI MILANO	974	3.39	3,301.86	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,327	9.66	22,485.80	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	6,367	0.66	4,208.58	
BANCO DE SABADELL SA	838	3.50	2,940.54	
BANCO POPOLARE SCARL	763	4.05	3,093.96	
BANCO POPULAR ESPANOL	960	4.66	4,474.56	
BANCO SANTANDER SA	5,392	9.45	50,959.79	
BANCO SANTANDER SA - RTS	5,392	0.12	652.43	
BNP PARIBAS	620	52.84	32,760.80	
COMMERZBANK AG	651	6.42	4,182.67	
CREDIT AGRICOLE SA	610	11.91	7,265.10	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	613	41.86	25,660.18	
ERSTE GROUP BANK AG	270	32.75	8,842.50	
INTESA SANPAOLO	5,080	2.59	13,157.20	
NATIONAL BANK OF GREECE	623	8.49	5,289.27	
PIRAEUS BANK S.A.	634	4.06	2,574.04	
SOCIETE GENERALE	410	43.47	17,824.75	
UBI BANCA SCPA	523	7.75	4,053.25	
UNICREDIT SPA	8,907	1.89	16,834.23	
DEUTSCHE BOERSE AG	153	52.27	7,997.31	
ING GROEP NV-CVA	2,528	8.12	20,527.36	
MEDIOBANCA SPA	602	7.30	4,397.61	
AGEAS	2,274	2.22	5,059.65	
ALLIANZ SE-REG	299	89.08	26,634.92	
ASSICURAZIONI GENERALI	761	15.70	11,947.70	
AXA	1,168	13.35	15,592.80	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	120	110.00	13,200.00	
SAMPO OYJ-A SHS	514	20.44	10,506.16	
CAP GEMINI SA	205	37.33	7,653.67	
ALCATEL-LUCENT	2,776	2.61	7,245.36	
NOKIA OYJ	2,444	7.96	19,454.24	
BELGACOM SA	183	28.25	5,169.75	
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,870	10.04	18,774.80	
FRANCE TELECOM SA	1,211	16.69	20,217.64	
KONINKLIJKE KPN NV	1,024	11.52	11,801.60	
MOBISTAR SA	74	46.18	3,417.32	
TELECOM ITALIA SPA	10,447	1.07	11,209.63	
TELEFONICA SA	2,691	19.31	51,976.66	
TELEKOM AUSTRIA AG	651	11.27	7,340.02	
E.ON AG	1,178	22.41	26,404.87	
ELECTRICITE DE FRANCE	161	32.39	5,215.59	
ENEL SPA	4,295	4.03	17,319.58	
FORTUM OYJ	436	20.58	8,972.88	
GDF SUEZ	812	28.08	22,805.02	
IBERDROLA SA	2,667	5.95	15,868.65	
RWE AG	273	50.41	13,761.93	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	414	14.13	5,851.89	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	362	20.84	7,544.08	
ASML HOLDING NV	568	23.64	13,427.52	
STMICROELECTRONICS NV	990	5.91	5,850.90	
ユーロ小計	120,510		1,593,597.04 (179,486,834.00)	
合 計	株 685,651		円 1,090,489,356.00 (1,090,489,356.00)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	米ドル 124	米ドル 13,606.52	
		BOSTON PROPERTIES INC	167	15,151.91	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	339	17,116.11	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	947	15,284.58	
		KIMCO REALTY CORPORATION	500	8,635.00	
		PUBLIC STORAGE	163	16,673.27	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	174	7,445.46	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	204	19,971.60	
		VORNADO REALTY TRUST	187	17,031.96	
		投資証券小計		2,805	130,916.41 (10,567,572)
米ドル合計				130,916.41 (10,567,572)	
加ドル	投資証券	CANADIAN OIL SANDS TRUST	加ドル 278	加ドル 7,344.76	
		ENERPLUS RESOURCES FUND	294	8,143.80	
		PENN WEST ENERGY TRUST	592	13,657.44	
		投資証券小計		1,164	29,146.00 (2,307,780)
加ドル合計				29,146.00 (2,307,780)	
豪ドル	投資証券	WESTFIELD GROUP	豪ドル 1,651	豪ドル 20,340.32	
		投資証券小計		1,651	20,340.32 (1,627,835)
豪ドル合計				20,340.32 (1,627,835)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	英ポンド 814	英ポンド 4,143.26	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	613	4,159.20	
		投資証券小計		1,427	8,302.46 (1,054,495)
英ポンド合計				8,302.46 (1,054,495)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	香港ドル 3,500	香港ドル 84,350.00	
		投資証券小計		3,500	84,350.00 (877,240)
香港ドル合計				84,350.00 (877,240)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	ユーロ 76	ユーロ 11,552.00	
		投資証券小計		76	11,552.00 (1,301,101)
ユーロ合計				11,552.00 (1,301,101)	
合計				円 17,736,023 (17,736,023)	

(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

	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 340銘柄	98.2%		52.5%
	投資証券 9銘柄		1.8%	1.0%
加ドル	株式 41銘柄	96.3%		5.5%
	投資証券 3銘柄		3.7%	0.2%
豪ドル	株式 31銘柄	96.7%		4.3%
	投資証券 1銘柄		3.3%	0.1%
英ポンド	株式 61銘柄	99.1%		10.9%
	投資証券 2銘柄		0.9%	0.1%
スイスフラン	株式 22銘柄	100.0%		4.2%
香港ドル	株式 13銘柄	94.2%		1.3%
	投資証券 1銘柄		5.8%	0.1%
シンガポールドル	株式 8銘柄	100.0%		0.8%
スウェーデンクローナ	株式 11銘柄	100.0%		1.5%
ノルウェークローネ	株式 6銘柄	100.0%		0.5%
デンマーククローネ	株式 4銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシェケル	株式 1銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 132銘柄	99.3%		16.2%
	投資証券 1銘柄		0.7%	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21年10月26日現在	平成22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		11,002,267	14,267,461
国債証券		27,559,845,220	27,754,346,676
地方債証券		2,375,039,000	2,632,304,000
特殊債券		4,004,019,863	3,554,777,000
社債券		3,369,249,000	3,344,688,000
未収入金			126,824,740
未収利息		121,613,411	114,979,217
前払費用		4,673,104	2,027,180
流動資産合計		37,445,441,865	37,544,214,274
資産合計			
		37,445,441,865	37,544,214,274
負債の部			
流動負債			
未払解約金		4,154,423	71,607,336
流動負債合計		4,154,423	71,607,336
負債合計			
		4,154,423	71,607,336
純資産の部			
元本等			
元本		32,047,347,137	30,762,768,556
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		5,393,940,305	6,709,838,382
元本等合計		37,441,287,442	37,472,606,938
純資産合計			
		37,441,287,442	37,472,606,938
負債純資産合計			
		37,445,441,865	37,544,214,274

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、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事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、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 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1. 期首	平成20年10月28日	1. 期首	平成21年10月27日
期首元本額	30,966,595,295円	期首元本額	32,047,347,137円
期首からの追加設定元本額	9,783,515,337円	期首からの追加設定元本額	3,350,844,157円
期首からの一部解約元本額	8,702,763,495円	期首からの一部解約元本額	4,635,422,738円
平成21年10月26日現在の元本の 内訳		平成22年10月26日現在の元本の 内訳	
DCインデックスバランス(株 式20)	365,696,274円	DCインデックスバランス(株 式20)	388,029,008円
DCインデックスバランス(株 式40)	464,703,468円	DCインデックスバランス(株 式40)	489,494,266円
DCインデックスバランス(株 式60)	331,606,826円	DCインデックスバランス(株 式60)	343,462,663円
DCインデックスバランス(株 式80)	55,266,785円	DCインデックスバランス(株 式80)	56,702,947円
インデックスファンド日本債券 (DC専用)	889,301,975円	インデックスファンド日本債券 (DC専用)	1,007,601,193円
世界の財産3分法ファンド(不 動産・債券・株式)毎月分配型	14,441,109,369円	世界の財産3分法ファンド(不 動産・債券・株式)毎月分配型	12,249,463,950円
全世界株式債券ファンド(日本 ・先進国・新興国)毎月分配型	8,590,141円	全世界株式債券ファンド(日本 ・先進国・新興国)毎月分配型	8,345,587円
日興ストラテジック・アローケー ション・ファンド(債券資産)	343,634,465円	日興ストラテジック・アローケー ション・ファンド(債券資産)	325,399,586円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式80)	9,429,220円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式80)	8,799,680円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式60)	55,121,412円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式60)	52,735,661円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式40)	256,266,695円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式40)	240,783,526円
アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式20)	975,445,379円	アセット・ナビゲーション・ ファンド(株式20)	886,263,682円
国際分散型ファンド40(適格機 関投資家向け)	7,950,831,489円	国際分散型ファンド40(適格機 関投資家向け)	8,271,026,934円
世界アセットバランスファンド 40(適格機関投資家向け)	154,270,272円	世界アセットバランスファンド 40(適格機関投資家向け)	139,502,268円
世界アセットバランスファンド 25(適格機関投資家向け)	298,513,863円	世界アセットバランスファンド 25(適格機関投資家向け)	248,939,352円
3資産バランスファンド(適格 機関投資家向け)	121,241,924円	3資産バランスファンド(適格 機関投資家向け)	79,034,403円
グローバルバランスファンド35 (適格機関投資家向け)	43,294,234円	グローバルバランスファンド35 (適格機関投資家向け)	35,012,949円
年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式20)	754,616,539円	年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式20)	812,888,389円
年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式40)	685,295,201円	年金積立 アセット・ナビゲー ション・ファンド(株式40)	730,770,394円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	338,167,489円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	348,506,290円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	52,600,344円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	52,952,859円
年金積立 インデックスファンド日本債券	3,365,835,661円	年金積立 インデックスファンド日本債券	3,884,998,668円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	86,508,112円	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	102,054,301円
計	32,047,347,137円	計	30,762,768,556円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	32,047,347,137口	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	30,762,768,556口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

#### Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	27,559,845,220	145,890,960
地方債証券	2,375,039,000	53,140,000
特殊債券	4,004,019,863	63,510,000
社債券	3,369,249,000	50,742,000
合計	37,308,153,083	313,282,960

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

平成21年10月26日現在		平成22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)	1.1683円 (11,683円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2181円 (12,181円)

## (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285回利付国債(2年)	71,000,000	71,064,116	
	第286回利付国債(2年)	90,000,000	90,178,200	
	第287回利付国債(2年)	580,000,000	581,241,200	
	第288回利付国債(2年)	183,000,000	183,175,680	
	第289回利付国債(2年)	100,000,000	100,103,000	
	第290回利付国債(2年)	362,000,000	362,394,580	
	第291回利付国債(2年)	120,000,000	120,139,200	
	第292回利付国債(2年)	120,000,000	120,147,600	
	第293回利付国債(2年)	130,000,000	130,157,300	
	第294回利付国債(2年)	80,000,000	80,095,200	
	第295回利付国債(2年)	200,000,000	200,250,000	
	第296回利付国債(2年)	80,000,000	79,947,200	
	第62回利付国債(5年)	98,000,000	99,329,860	
	第63回利付国債(5年)	117,000,000	118,759,680	
	第64回利付国債(5年)	417,000,000	426,386,670	
	第65回利付国債(5年)	124,000,000	126,589,120	
	第66回利付国債(5年)	147,000,000	149,678,340	
	第68回利付国債(5年)	170,000,000	173,485,000	
	第69回利付国債(5年)	483,000,000	490,839,090	
	第70回利付国債(5年)	197,000,000	200,071,230	
	第71回利付国債(5年)	45,000,000	46,237,050	
	第72回利付国債(5年)	30,000,000	31,065,300	
	第74回利付国債(5年)	57,000,000	58,274,520	
	第75回利付国債(5年)	176,000,000	180,788,960	
	第76回利付国債(5年)	173,000,000	178,205,570	
	第78回利付国債(5年)	113,000,000	115,577,530	
	第79回利付国債(5年)	143,000,000	145,390,960	
	第81回利付国債(5年)	464,000,000	473,688,320	
	第83回利付国債(5年)	132,000,000	135,339,600	
	第84回利付国債(5年)	72,000,000	73,301,040	
	第85回利付国債(5年)	207,000,000	210,794,310	
	第87回利付国債(5年)	540,000,000	545,535,000	
	第88回利付国債(5年)	245,000,000	247,496,550	
第89回利付国債(5年)	210,000,000	211,201,200		
第90回利付国債(5年)	50,000,000	50,068,500		

第91回利付国債(5年)	180,000,000	180,997,200
第2回利付国債(40年)	40,000,000	42,474,800
第236回利付国債(10年)	48,000,000	48,761,280
第237回利付国債(10年)	32,000,000	32,614,400
第238回利付国債(10年)	215,000,000	218,831,300
第239回利付国債(10年)	275,000,000	280,742,000
第240回利付国債(10年)	401,000,000	408,715,240
第241回利付国債(10年)	200,000,000	204,418,000
第245回利付国債(10年)	160,000,000	162,596,800
第247回利付国債(10年)	17,000,000	17,265,030
第250回利付国債(10年)	285,000,000	287,622,000
第251回利付国債(10年)	227,000,000	231,478,710
第252回利付国債(10年)	228,000,000	233,098,080
第253回利付国債(10年)	35,000,000	36,456,350
第254回利付国債(10年)	52,000,000	53,864,200
第256回利付国債(10年)	198,000,000	205,611,120
第258回利付国債(10年)	72,000,000	74,703,600
第259回利付国債(10年)	7,000,000	7,309,960
第261回利付国債(10年)	340,000,000	359,597,600
第262回利付国債(10年)	85,000,000	90,206,250
第264回利付国債(10年)	251,000,000	263,349,200
第265回利付国債(10年)	100,000,000	105,146,000
第266回利付国債(10年)	118,000,000	123,588,480
第268回利付国債(10年)	361,000,000	380,425,410
第269回利付国債(10年)	90,000,000	94,061,700
第270回利付国債(10年)	88,000,000	92,154,480
第271回利付国債(10年)	146,000,000	152,222,520
第272回利付国債(10年)	98,000,000	103,297,880
第273回利付国債(10年)	111,000,000	117,535,680
第274回利付国債(10年)	73,000,000	77,474,900
第276回利付国債(10年)	35,000,000	37,322,950
第278回利付国債(10年)	80,000,000	86,340,800
第279回利付国債(10年)	70,000,000	76,290,200
第280回利付国債(10年)	71,000,000	77,194,040
第281回利付国債(10年)	182,000,000	198,885,960
第282回利付国債(10年)	369,000,000	397,759,860
第283回利付国債(10年)	50,000,000	54,186,000
第284回利付国債(10年)	377,000,000	407,110,990
第285回利付国債(10年)	228,000,000	246,540,960
第286回利付国債(10年)	156,000,000	169,963,560
第287回利付国債(10年)	70,000,000	76,717,900
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,517,220
第289回利付国債(10年)	434,000,000	465,048,360
第290回利付国債(10年)	446,000,000	474,771,460
第291回利付国債(10年)	347,000,000	366,910,860
第292回利付国債(10年)	241,000,000	261,979,050
第293回利付国債(10年)	236,000,000	258,294,920
第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,787,520

第295回利付国債(10年)	317,000,000	339,830,340	
第296回利付国債(10年)	176,000,000	188,504,800	
第297回利付国債(10年)	333,000,000	353,679,300	
第298回利付国債(10年)	301,000,000	317,356,340	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	789,090,000	
第300回利付国債(10年)	201,000,000	214,760,460	
第301回利付国債(10年)	148,000,000	157,904,160	
第302回利付国債(10年)	79,000,000	83,608,070	
第303回利付国債(10年)	361,000,000	381,356,790	
第305回利付国債(10年)	373,000,000	389,881,980	
第306回利付国債(10年)	115,000,000	120,971,950	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	145,678,400	
第309回利付国債(10年)	52,000,000	53,158,040	
第310回利付国債(10年)	248,000,000	250,480,000	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	229,105,760	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	181,558,260	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	61,592,300	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	177,064,280	
第26回利付国債(30年)	140,000,000	154,063,000	
第27回利付国債(30年)	134,000,000	150,451,180	
第28回利付国債(30年)	54,000,000	60,656,040	
第29回利付国債(30年)	246,000,000	271,141,200	
第30回利付国債(30年)	177,000,000	191,290,980	
第31回利付国債(30年)	65,000,000	68,829,800	
第32回利付国債(30年)	115,000,000	124,495,550	
第33回利付国債(30年)	30,000,000	30,455,700	
第23回利付国債(20年)	100,000,000	115,411,000	
第26回利付国債(20年)	37,000,000	43,121,280	
第27回利付国債(20年)	16,000,000	18,959,840	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	131,014,400	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	46,853,600	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	240,118,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	101,668,500	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	74,310,390	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	98,974,820	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,814,130	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	205,938,880	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	86,445,140	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,724,970	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,576,910	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	114,096,510	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,410,790	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	259,033,890	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	42,978,780	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,821,300	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	72,637,620	
第57回利付国債(20年)	102,000,000	111,050,460	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	146,666,700	



第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,045,670	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	560,112,850	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	26,431,650	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,095,910	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,220,100	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	150,697,400	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,171,920	
第67回利付国債(20年)	54,000,000	58,025,700	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	42,237,000	
第70回利付国債(20年)	49,000,000	55,631,660	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	46,034,940	
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,061,840	
第74回利付国債(20年)	78,000,000	85,300,800	
第76回利付国債(20年)	206,000,000	219,385,880	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	332,934,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	170,670,240	
第91回利付国債(20年)	200,000,000	221,670,000	
第92回利付国債(20年)	210,000,000	226,373,700	
第94回利付国債(20年)	100,000,000	107,609,000	
第95回利付国債(20年)	182,000,000	200,853,380	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	105,268,660	
第97回利付国債(20年)	195,000,000	211,966,950	
第98回利付国債(20年)	44,000,000	47,176,360	
第99回利付国債(20年)	137,000,000	146,609,180	
第100回利付国債(20年)	140,000,000	151,736,200	
第101回利付国債(20年)	96,000,000	106,956,480	
第102回利付国債(20年)	106,000,000	117,990,720	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,075,910	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,221,560	
第105回利付国債(20年)	82,000,000	87,398,880	
第106回利付国債(20年)	142,000,000	153,530,400	
第107回利付国債(20年)	30,000,000	31,929,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	138,483,640	
第109回利付国債(20年)	119,000,000	122,763,970	
第110回利付国債(20年)	148,000,000	157,284,040	
第111回利付国債(20年)	90,000,000	96,918,300	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	21,189,400	
第114回利付国債(20年)	157,000,000	166,189,210	
第116回利付国債(20年)	185,000,000	198,632,650	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	31,749,600	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	72,823,800	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	50,365,000	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	68,215,700	
第121回利付国債(20年)	147,000,000	150,475,080	
国債証券 合計	26,302,000,000	27,754,346,676	

[次△](#)

地方債証券	第596回東京都公募公債	100,000,000	101,246,000	
	第597回東京都公募公債	100,000,000	101,027,000	
	第598回東京都公募公債	100,000,000	100,794,000	
	第636回東京都公募公債	100,000,000	109,221,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	104,035,000	
	平成14年度第4回北海道公募公債	100,000,000	101,958,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,801,000	
	第123回神奈川県公募公債	100,000,000	103,907,000	
	第1回大阪府公募公債(7年)	100,000,000	104,132,000	
	第261回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,606,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	108,711,000	
	平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	103,522,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	108,324,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,609,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	109,713,000	
	平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,330,000	
	平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	106,149,000	
	平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	104,525,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	109,087,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,233,000	
	平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	104,770,000	
	第12回め号名古屋市公募公債	100,000,000	105,658,000	
	平成15年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,008,000	
	平成14年度第7回札幌市公募公債	100,000,000	101,222,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	108,716,000		
地方債証券 合計	合計	2,500,000,000	2,632,304,000	
特殊債券	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,587,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,208,000	
	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	108,072,000	
	第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,593,000	
	第329回政府保証道路債券	100,000,000	104,928,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	104,797,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	104,585,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	104,660,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	105,225,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	104,564,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,048,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	104,661,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	108,989,000	
	第809回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,442,000	
	第812回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,797,000	
	第820回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,240,000	
	第832回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,573,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,948,000	

	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	105,162,000	
	第20回中小企業債券	100,000,000	101,362,000	
	第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	104,041,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	108,597,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	104,760,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	209,454,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,396,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	208,582,000	
	い第677号農林債	100,000,000	101,134,000	
	い第709号農林債	100,000,000	102,836,000	
	い第714号農林債	100,000,000	102,004,000	
	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	103,272,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	103,393,000	
	第234回信金中金債(5年)	100,000,000	102,867,000	
特殊債券 合計		3,400,000,000	3,554,777,000	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	117,873,000	
	第3回ドイツ銀行A G ロンドン支店円貨社債(2007)	100,000,000	100,753,000	
	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	101,129,000	
	第4回キッコーマン株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,031,000	
	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	105,711,000	
	第30回大日本インキ化学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	100,847,000	
	第19回日石三菱株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,199,000	
	第16回太平洋セメント株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,176,000	
	第49回新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,347,000	
	第8回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債(J F E スチール株式会社保証付)	100,000,000	101,580,000	
	第20回三菱マテリアル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,072,000	
	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	105,717,000	
	第17回三菱重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	101,056,000	
	第66回丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,083,000	
	第85回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,266,000	
	第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,307,000	
	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	108,441,000	
	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	99,871,000	

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	104,313,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	108,851,000	
第6回福山通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,739,000	
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	112,140,000	
第26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	102,242,000	
第496回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,059,000	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,542,000	
第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,288,000	
第461回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,670,000	
第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,865,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,097,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	118,505,000	
第434回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,511,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,407,000	
社債券 合計	3,200,000,000	3,344,688,000	
合計	35,402,000,000	37,286,115,676	

## 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21年10月26日現在	平成22年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		167,407,122	840,571,803
コール・ローン		137,385,907	83,641,208
国債証券		714,012,210,023	585,998,483,362
派生商品評価勘定			4,740,769
未収入金			716,979,210
未収利息		10,243,226,776	7,018,318,388
前払費用		766,432,695	356,017,201
流動資産合計		725,326,662,523	595,018,751,941
資産合計		725,326,662,523	595,018,751,941
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		89,700	82,410
未払金		64,476,025	
未払解約金		160,186,079	755,304,389
流動負債合計		224,751,804	755,386,799
負債合計		224,751,804	755,386,799
純資産の部			
元本等			
元本		449,277,081,384	410,189,621,640
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		275,824,829,335	184,073,743,502
元本等合計		725,101,910,719	594,263,365,142
純資産合計		725,101,910,719	594,263,365,142
負債純資産合計		725,326,662,523	595,018,751,941

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1. 期首	平成20年10月28日	1. 期首	平成21年10月27日
期首元本額	444,628,186,777円	期首元本額	449,277,081,384円
期首からの追加設定元本額	61,931,959,357円	期首からの追加設定元本額	8,920,901,490円
期首からの一部解約元本額	57,283,064,750円	期首からの一部解約元本額	48,008,361,234円
平成21年10月26日現在の元本の内訳		平成22年10月26日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	8,060,127,791円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	8,849,948,042円
DCインデックスバランス(株式20)	41,810,491円	DCインデックスバランス(株式20)	49,187,094円
DCインデックスバランス(株式40)	77,088,517円	DCインデックスバランス(株式40)	89,554,451円
DCインデックスバランス(株式60)	99,139,127円	DCインデックスバランス(株式60)	112,983,693円
DCインデックスバランス(株式80)	82,223,185円	DCインデックスバランス(株式80)	93,970,833円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	245,731,313,235円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	225,223,007,785円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	10,594,265,493円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	10,242,566,040円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	163,693,803,361円	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	144,889,238,618円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	42,823,442円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	51,255,807円
日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,513,043,585円	日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,504,839,282円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	436,606円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	5,135,051円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	217,794,606円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	222,618,134円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,044,043円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,304,227円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,293,797円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,756,942円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	21,414,946円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	22,154,363円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	56,088,292円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	56,414,494円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,429,503,892円	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	2,818,081,237円

国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,998,589,896円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,299,362,018円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	162,259,567円	世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	159,927,712円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	256,319,280円	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	232,958,379円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	90,956,960円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	64,943,397円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	73,354,107円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	66,195,683円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	43,743,637円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,923,379円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	57,047,488円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	67,179,164円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	50,614,396円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	57,748,422円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	39,119,042円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	43,776,744円
年金積立インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)	12,646,496,208円	年金積立インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)	12,696,715,761円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	182,366,394円	海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	201,874,888円
計	449,277,081,384円	計	410,189,621,640円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	449,277,081,384円	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	410,189,621,640円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額



## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

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

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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>
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。

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## I 取引の状況に関する事項

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

## 取引の時価に関する事項

## 通貨関連

（平成21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	86,123,200		86,212,900	89,700
	豪ドル	36,446,800		36,511,300	64,500
	ユーロ	49,676,400		49,701,600	25,200
合計		86,123,200		86,212,900	89,700

（平成22年10月26日現在）

（単位：円）

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

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成21年10月26日現在	平成22年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6139円	1口当たり純資産額	1.4488円
(1万口当たり純資産額)	(16,139円)	(1万口当たり純資産額)	(14,488円)

[次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券		米ドル	米ドル	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	19,000,000	19,852,031.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	20,000,000	21,340,625.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	15,000,000	16,434,375.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	11,900,000	12,950,546.87	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	13,050,000	15,374,531.25	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	16,000,000	17,265,000.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	15,000,000	16,413,281.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	10,000,000	10,847,656.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	12,200,000	14,283,531.22	
		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	35,900,000	37,319,171.83	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	19,000,000	20,163,750.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	14,900,000	16,241,000.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	16,000,000	19,007,499.98	
		US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,818,124.99	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	17,900,000	20,699,671.87	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	14,700,000	16,248,093.75	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	19,450,000	21,996,734.37	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	22,400,000	25,504,499.99	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	32,800,000	36,664,250.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	19,000,000	20,221,640.62	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	11,500,000.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	12,700,000	13,533,437.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	15,000,000	15,963,281.25	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	18,000,000	20,452,500.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	14,300,000	14,968,078.12	
		US TREASURY N/B-1.875%-15/06/30	14,300,000	14,800,500.00	
		US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	3,000,000	3,086,015.62	
		US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	16,100,000	18,469,718.74	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	19,100,000	22,239,562.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	15,800,000	18,399,593.73	
		US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	13,690,312.49	
		US TREASURY N/B-2.375%-16/03/31	12,500,000	13,166,015.62	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	15,000,000	17,667,187.49	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	13,000,000	15,606,093.72	
		US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,829,375.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	11,600,000	12,749,124.99	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	15,000,000	16,495,312.50	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	15,600,000	17,142,937.48	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	12,000,000	14,287,500.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	13,800,000	14,960,062.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	16,200,000	17,549,156.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	40,000,000	42,568,749.98	
		US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	11,200,000	11,949,000.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	17,000,000	18,848,750.00	

US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	7,370,000	9,376,021.87	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	6,100,000	7,556,375.00	
US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	7,700,000	9,531,156.24	
US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	6,000,000	8,176,874.99	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	10,000,000	13,850,000.00	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	11,300,000	14,199,156.22	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	12,900,000	14,323,031.25	
US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	10,400,000	12,000,624.97	
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,555,468.73	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	12,000,000	13,035,000.00	
US TREASURY N/B-6.625%-27/02/15	4,000,000	5,681,250.00	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	16,450,000	15,303,640.61	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	22,300,000	23,631,031.24	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	21,000,000	23,185,312.50	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	19,000,000	20,549,687.50	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	23,500,000	26,477,890.62	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	16,500,000	17,848,359.37	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	8,500,000	8,449,531.25	
US TREASURY N/B-4.5%-11/09/30	10,000,000	10,401,171.87	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	10,500,000	12,578,671.87	
US TREASURY N/B-8.125%-21/08/15	4,060,000	6,131,234.35	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	37,500,000	41,285,156.25	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,163,906.22	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	33,500,000	36,111,953.11	
US TREASURY N/B-8.5%-20/02/15	5,400,000	8,135,437.49	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	39,700,000	43,552,140.60	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	29,000,000	31,437,812.50	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,257,906.25	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	12,500,000	12,574,218.75	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	8,700,000	11,800,734.35	
US TREASURY N/B-8.125%-21/05/15	3,000,000	4,514,531.24	
US TREASURY N/B-6.375%-27/08/15	4,000,000	5,557,500.00	
US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	5,778,124.99	
US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	14,800,000	19,926,812.45	
US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,500,000	9,764,218.74	
US TREASURY N/B-7.625%-25/02/15	3,000,000	4,560,937.50	
US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,181,250.00	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	8,300,000	11,050,671.86	
US TREASURY N/B-6.75%-26/08/15	3,310,000	4,738,989.05	
US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	3,786,328.12	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	15,000,000	22,542,187.47	
US TREASURY N/B-7.875%-21/02/15	5,000,000	7,390,625.00	
US TREASURY N/B-1.75%-12/08/15	21,500,000	22,042,539.04	
US TREASURY N/B-1.375%-12/05/15	20,350,000	20,682,277.33	
US TREASURY N/B-4.75%-12/05/31	9,110,000	9,756,240.62	
US TREASURY N/B-0.75%-12/05/31	19,000,000	19,126,171.87	
US TREASURY N/B-1.875%-12/06/15	16,000,000	16,406,249.99	
US TREASURY N/B-4.875%-12/06/30	8,430,000	9,078,714.82	
US TREASURY N/B-0.625%-12/06/30	19,000,000	19,089,062.50	
US TREASURY N/B-1.5%-12/07/15	26,800,000	27,348,562.50	
US TREASURY N/B-4.625%-12/07/31	27,700,000	29,827,273.43	
US TREASURY N/B-3.625%-12/12/31	9,800,000	10,497,484.36	
US TREASURY N/B-4.375%-12/08/15	14,000,000	15,030,312.48	
US TREASURY N/B-1.375%-12/04/15	19,700,000	20,012,429.68	

US TREASURY N/B-4.125%-12/08/31	10,000,000	10,697,656.23	
US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	11,490,000.00	
US TREASURY N/B-4.25%-12/09/30	10,000,000	10,756,250.00	
US TREASURY N/B-3.875%-12/10/31	9,800,000	10,497,484.35	
US TREASURY N/B-4.0%-12/11/15	14,400,000	15,484,499.99	
US TREASURY N/B-1.375%-12/11/15	20,100,000	20,506,710.93	
US TREASURY N/B-3.375%-12/11/30	10,350,000	11,013,855.46	
US TREASURY N/B-1.125%-12/12/15	27,200,000	27,612,250.00	
US TREASURY N/B-1.0%-11/09/30	14,700,000	14,802,210.93	
US TREASURY N/B-4.75%-12/01/31	8,000,000	8,454,374.99	
US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	29,000,000	30,685,625.00	
US TREASURY N/B-4.625%-11/10/31	10,400,000	10,860,281.24	
US TREASURY N/B-1.0%-11/10/31	24,000,000	24,182,812.50	
US TREASURY N/B-1.75%-11/11/15	12,750,000	12,949,716.80	
US TREASURY N/B-0.75%-11/11/30	26,500,000	26,638,710.92	
US TREASURY N/B-4.5%-11/11/30	11,830,000	12,383,607.00	
US TREASURY N/B-1.125%-11/12/15	15,350,000	15,500,501.95	
US TREASURY N/B-1.0%-11/12/31	23,200,000	23,396,656.21	
US TREASURY N/B-1.0%-12/04/30	19,000,000	19,195,937.50	
US TREASURY N/B-1.125%-12/01/15	22,500,000	22,732,031.25	
US TREASURY N/B-4.5%-12/04/30	9,100,000	9,681,546.85	
US TREASURY N/B-0.875%-12/01/31	16,500,000	16,620,527.34	
US TREASURY N/B-1.375%-12/02/15	23,500,000	23,835,976.55	
US TREASURY N/B-4.875%-12/02/15	16,000,000	16,962,499.98	
US TREASURY N/B-4.625%-12/02/29	9,100,000	9,631,781.25	
US TREASURY N/B-0.875%-12/02/29	19,000,000	19,141,015.62	
US TREASURY N/B-1.375%-12/03/15	21,000,000	21,323,203.11	
US TREASURY N/B-4.5%-12/03/31	9,450,000	10,022,906.25	
US TREASURY N/B-1.0%-12/03/31	25,000,000	25,253,906.25	
US TREASURY N/B-1.375%-12/10/15	18,000,000	18,352,968.75	
US TREASURY N/B-4.625%-11/12/31	10,000,000	10,515,625.00	
US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	13,000,000	14,679,843.74	
US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	18,200,000	18,718,984.37	
US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,290,546.86	
US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	14,780,000	16,415,037.50	
US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	12,500,000	12,999,023.43	
US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	24,100,000	24,615,890.61	
US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	20,500,000	21,326,406.25	
US TREASURY N/B-1.375%-12/09/15	15,000,000	15,283,593.74	
US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	22,600,000	23,818,281.24	
US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	16,900,000	17,643,335.93	
US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	20,000,000	21,348,437.46	
US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	17,500,000	18,122,070.30	
US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	24,000,000	25,396,874.98	
US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	24,600,000	26,051,015.62	
US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	27,000,000	28,584,140.61	
US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	15,000,000	17,039,062.50	
US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	26,000,000	27,263,437.50	
US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	21,500,000	22,983,164.04	
US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	22,800,000	24,016,593.74	
US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	4,301,250.00	
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	24,000,000	27,056,249.96	
US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	22,500,000	24,015,234.35	
US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	10,000,000	10,221,875.00	

		US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	10,000,000	10,572,656.22	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	23,600,000	24,116,250.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	15,050,000	17,196,976.54	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/02/28	10,900,000	11,503,757.80	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	18,000,000	20,036,250.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-13/03/31	12,800,000	13,460,999.98	
		US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	25,000,000	25,802,734.37	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/04/30	14,600,000	15,602,609.37	
		US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	8,000,000	8,662,499.99	
		US TREASURY N/B-1.375%-13/05/15	11,500,000	11,768,632.80	
		US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	34,400,000	38,033,500.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-13/02/15	13,550,000	14,642,468.75	
		US TREASURY N/B-3.5%-13/05/31	14,900,000	16,097,820.30	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/08/31	15,100,000	16,224,242.18	
		US TREASURY N/B-3.375%-13/07/31	12,500,000	13,508,789.06	
		US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	10,500,000	11,193,164.06	
		US TREASURY N/B-1.0%-13/07/15	8,500,000	8,620,195.31	
		US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	13,950,000	15,049,652.34	
		US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	9,500,000	9,663,281.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	10,900,000	11,730,273.42	
	国債証券小計		2,636,690,000	2,883,278,765.65 (232,738,261,963)	
米ドル合計				2,883,278,765.65 (232,738,261,963)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	加ドル 8,600,000	加ドル 11,780,796.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	3,500,000	3,724,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	7,150,000	7,896,674.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,000,000	2,106,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	7,300,000	8,098,109.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	6,700,000	7,552,240.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	12,000,000	13,033,704.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,000,000	1,034,800.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-23/06/01	1,600,000	2,429,520.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	1,300,000	2,183,363.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	8,200,000	10,972,584.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	9,000,000	11,463,300.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	6,500,000	7,264,140.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	6,900,000	7,716,201.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	4,500,000	7,258,545.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/06/01	4,700,000	4,713,348.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,371,369.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	7,550,000	8,453,131.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-11/12/01	5,400,000	5,401,188.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/03/01	3,800,000	3,811,134.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-12/06/01	5,200,000	5,399,888.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-12/09/01	8,600,000	8,700,792.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/12/01	2,000,000	2,004,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-13/03/01	4,500,000	4,532,535.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-13/06/01	10,800,000	11,356,416.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	6,000,000	6,577,980.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-13/09/01	5,300,000	5,444,160.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	9,800,000	10,266,284.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	10,300,000	10,416,287.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-12/06/01	7,250,000	7,701,240.00	
	国債証券小計		179,750,000	201,664,328.50 (15,967,781,530)	
加ドル合計				201,664,328.50 (15,967,781,530)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	豪ドル 7,500,000	豪ドル 7,853,287.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	1,100,000	1,080,429.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	3,100,000	3,232,422.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	6,150,000	6,412,549.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	5,400,000	5,123,892.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	6,900,000	6,934,431.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	600,000	587,628.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	7,300,000	7,587,882.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	1,900,000	1,924,719.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	10,100,000	10,465,710.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-12/11/15	3,000,000	2,986,764.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-12/04/15	8,900,000	9,004,761.90	



		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	7,600,000	7,945,298.40	
	国債証券小計		69,550,000	71,139,778.35 (5,693,316,461)	
豪ドル合計				71,139,778.35 (5,693,316,461)	
英ポンド	国債証券	TSY 4 1/4% 2040-4.25%-40/12/07	英ポンド 5,950,000	英ポンド 6,132,798.39	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	7,500,000	8,050,577.83	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	10,140,000	11,843,845.28	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	1,684,467.10	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	7,300,000	9,481,055.20	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	10,000,000	10,462,232.41	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	6,000,000	6,459,386.43	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	10,600,000	11,004,145.18	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	10,500,000	11,768,354.84	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	11,900,000	12,833,132.98	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	9,200,000	9,791,550.07	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	11,000,000	11,398,530.51	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	8,500,000	8,823,488.18	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	10,000,000	10,427,317.03	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	8,500,000	12,354,146.72	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	7,500,000	7,759,628.24	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	10,000,000	10,521,627.47	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	2,700,000	2,862,609.93	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	9,000,000	10,082,403.76	
		UK TREASURY-5.0%-12/03/07	16,750,000	17,739,044.05	
		UK TREASURY-5.25%-12/06/07	14,400,000	15,454,183.90	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	16,800,000	18,253,976.77	
		UK TREASURY-8.0%-13/09/27	2,800,000	3,373,078.91	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	11,700,000	13,322,240.25	
		UK TREASURY-3.25%-11/12/07	9,730,000	10,014,187.39	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	11,500,000	13,145,612.25	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	4,000,000	5,239,487.38	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	12,500,000	13,908,171.93	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	5,300,000	7,507,285.03	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	6,900,000	8,081,086.85	
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	12,000,000	13,585,180.88	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	12,400,000	13,276,608.07	
UK TREASURY-4.75%-20/03/07	9,800,000	11,257,313.87			
UK TREASURY-2.25%-14/03/07	16,500,000	17,114,914.00			
	国債証券小計		321,070,000	355,013,669.08 (45,090,286,109)	
英ポンド合計				355,013,669.08 (45,090,286,109)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	スイスフラン 400,000	スイスフラン 453,564.00	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	1,900,000	2,554,798.90	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	4,500,000	5,685,619.50	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	9,000,000	10,102,491.00	
		SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	5,000,000	5,419,200.00	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	4,950,000	5,510,389.50	
	SWITZERLAND-4.0%-13/02/11	6,000,000	6,482,130.00		
	国債証券小計		31,750,000	36,208,192.90 (3,008,900,829)	

スイスフラン合計				36,208,192.90 (3,008,900,829)		
シンガポ ールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	シンガポールドル 1,200,000	シンガポールドル 1,284,399.99		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	2,300,000	2,552,087.87		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,061,100.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-12/07/01	1,600,000	1,679,927.90		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	1,750,000	1,911,739.43		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	2,550,000	2,831,601.36		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	1,150,000	1,213,403.32		
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	2,300,000	2,704,800.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	1,070,000	1,061,868.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,300,000	1,419,556.67		
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	900,000	925,890.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	3,200,000	3,577,665.62		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	1,900,000	1,998,367.58		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-12/10/01	2,800,000	2,915,738.84		
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-12/04/01	2,850,000	2,929,684.29		
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	3,050,000	3,510,754.53		
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-13/04/01	1,300,000	1,343,454.52		
		国債証券小計	32,220,000	34,922,039.92 (2,178,436,850)		
		シンガポールドル合計				34,922,039.92 (2,178,436,850)

マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.718%-12/06/15	マレーシアリンギット 7,500,000	マレーシアリンギット 7,572,089.91	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	2,000,000	2,052,949.18	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	5,200,000	5,444,070.57	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,046,513.58	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	5,000,000	5,041,659.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	16,000,000	16,948,958.67	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	5,000,000	5,025,415.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.21%-13/05/31	3,100,000	3,106,778.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-2.509%-12/08/27	8,500,000	8,423,962.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-2.711%-12/02/14	4,300,000	4,295,905.58	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	6,000,000	6,037,098.48	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	10,000,000	10,177,060.49	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	9,000,000	9,331,657.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,800,000	4,376,233.46	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	10,200,000	10,635,570.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	3,800,000	3,486,606.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	3,000,000	3,486,528.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	6,000,000	6,211,276.55	
			国債証券小計	110,400,000	113,700,334.12 (2,965,304,713)
	マレーシアリンギット合計			113,700,334.12 (2,965,304,713)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/ 05	スウェーデンクローナ 48,500,000	スウェーデンクローナ 56,558,867.07	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	25,400,000	26,227,081.14	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	42,900,000	52,494,487.05	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/ 12	46,400,000	52,949,073.18	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/ 12	30,500,000	33,456,759.03	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	30,180,000	33,448,413.34	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.5%-12/10/08	39,000,000	42,170,334.14	
	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	25,900,000	26,977,292.58		
	国債証券小計	288,780,000	324,282,307.53 (3,978,943,913)		
スウェーデンクローナ合計			324,282,307.53 (3,978,943,913)		

ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	ノルウェークローネ 15,600,000	ノルウェークローネ 17,454,621.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	36,000,000	40,645,908.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	27,900,000	31,713,204.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	21,300,000	23,015,421.87	
	国債証券小計		100,800,000	112,829,156.07 (1,570,581,852)	
ノルウェークローネ合計				112,829,156.07 (1,570,581,852)	

[次へ](#)

デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-6.0%- 11/11/15	デンマーククローネ 28,300,000	デンマーククローネ 29,791,919.40	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%- 12/11/15	44,800,000	47,334,784.00	
		KINGDOM OF DENMARK-5.0%- 13/11/15	46,600,000	51,538,015.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%- 15/11/15	48,400,000	53,281,962.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%- 17/11/15	32,600,000	36,320,964.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%- 19/11/15	43,700,000	48,715,099.40	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%- 24/11/10	14,000,000	20,689,998.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%- 39/11/15	59,100,000	76,706,067.30	
		国債証券小計	317,500,000	364,378,810.50 (5,502,120,038)	
デンマーククローネ合計				364,378,810.50 (5,502,120,038)	
メキシコペ ソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	メキシコペソ 72,000,000	メキシコペソ 81,800,784.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	80,000,000	88,629,120.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	43,000,000	58,597,562.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	60,000,000	70,705,200.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	75,000,000	100,433,175.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	62,000,000	71,372,106.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-12/06/21	105,000,000	109,836,195.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	70,000,000	75,698,350.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	103,000,000	111,631,400.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	60,000,000	64,565,580.00	
		国債証券小計	730,000,000	833,269,472.00 (5,432,916,957)	
メキシコペソ合計				833,269,472.00 (5,432,916,957)	

ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	ポーランドズロチ 17,500,000	ポーランドズロチ 18,278,750.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	17,900,000	18,087,950.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	4,900,000	4,770,150.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	16,900,000	16,773,250.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	5,000,000	5,027,900.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	8,500,000	8,606,250.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	19,000,000	19,456,000.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	13,500,000	13,554,000.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/04/25	16,200,000	16,378,200.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-12/04/25	55,400,000	55,510,800.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	14,400,000	14,342,400.00		
		国債証券小計		189,200,000	190,785,650.00 (5,469,824,585)	
		ポーランドズロチ合計			190,785,650.00 (5,469,824,585)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	ユーロ 5,950,000	ユーロ 6,260,335.92		
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	8,300,000	10,009,412.32		
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	5,200,000	6,066,349.11		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	5,700,000	6,108,378.18		
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-12/09/28	8,100,000	8,656,820.70		
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	8,200,000	8,465,981.73		
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	4,300,000	5,332,891.37		
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	8,300,000	10,305,582.92		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-13/03/28	7,200,000	7,621,805.48		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	6,000,000	6,394,819.20		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	7,700,000	8,260,673.91		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	7,100,000	7,495,296.74		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	7,600,000	8,220,409.28		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	5,900,000	6,305,715.86		
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	6,800,000	7,225,112.17		
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,514,931.30		
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	7,100,000	7,369,491.86		
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-12/12/24	4,400,000	5,007,557.71		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	2,250,000	2,430,648.67		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	6,800,000	7,296,446.91		
		BELGIUM KINGDOM-2.0%-12/03/28	3,950,000	3,993,414.84		
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	8,200,000	8,595,349.88		
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-13/07/30	10,200,000	10,699,892.80		
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	8,300,000	8,653,397.40		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	3,700,000	3,727,709.30				

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	7,000,000	7,154,517.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.3%-13/04/30	5,600,000	5,599,071.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	10,300,000	10,281,859.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	3,200,000	3,095,736.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	9,300,000	8,396,143.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-13/10/31	1,000,000	1,001,005.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	9,700,000	10,809,479.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	8,400,000	8,558,004.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	11,850,000	13,643,158.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	8,200,000	8,266,331.43	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%-20/10/31	6,500,000	6,903,517.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-14/01/31	9,200,000	9,691,280.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.0%-12/07/30	8,000,000	8,398,542.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	5,600,000	5,595,377.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.15%-13/01/31	9,900,000	10,745,758.94	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.75%-14/07/30	10,800,000	11,618,501.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-12/04/30	6,200,000	6,273,939.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	8,000,000	8,202,327.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,302,349.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-12/10/31	9,600,000	9,934,692.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	9,300,000	9,484,048.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.35%-11/10/31	8,500,000	8,800,240.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	11,000,000	11,683,871.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	8,000,000	9,000,177.53	
BUNDESOBLIGATION-2.5%-14/10/10	9,800,000	10,210,580.80	
BUNDESOBLIGATION-4.0%-13/10/11	9,500,000	10,287,471.15	
BUNDESOBLIGATION-2.25%-14/04/11	10,450,000	10,807,058.71	
BUNDESOBLIGATION-3.5%-11/10/14	11,300,000	11,582,952.00	
BUNDESOBLIGATION-4.25%-12/10/12	11,000,000	11,695,514.60	
BUNDESOBLIGATION-2.5%-15/02/27	10,200,000	10,613,560.02	
BUNDESOBLIGATION-3.5%-13/04/12	10,800,000	11,451,942.00	
BUNDESOBLIGATION-2.25%-15/04/10	5,500,000	5,665,294.25	

BUNDESobligation-4.0%-12/04/13	14,150,000	14,783,904.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	14,700,000	15,703,232.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	12,600,000	14,327,505.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	14,000,000	15,210,530.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	12,000,000	13,468,879.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	14,200,000	15,724,111.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	12,800,000	14,617,749.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	16,250,000	17,692,816.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	17,000,000	18,549,429.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	2,900,000	3,530,962.27	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	12,060,000	13,457,144.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	13,200,000	14,583,349.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	6,650,000	9,792,539.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.0%-12/01/04	16,000,000	16,788,695.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	7,600,000	10,202,379.07	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	8,550,000	10,613,475.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	12,300,000	14,437,778.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.0%-12/07/04	16,150,000	17,239,015.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	11,000,000	14,136,568.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	10,200,000	13,946,127.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	12,700,000	13,635,763.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	16,000,000	17,646,865.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	13,000,000	13,979,605.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	6,080,000	7,545,698.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	9,500,000	12,862,364.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	7,500,000	11,010,081.71	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	12,000,000	12,840,730.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	7,000,000	9,730,684.56	



BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	14,000,000	15,317,689.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	11,000,000	11,518,225.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	3,000,000	3,174,857.70	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN- 1.25%-11/12/16	11,800,000	11,851,324.10	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN- 0.5%-12/06/15	4,500,000	4,467,707.55	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN- 1.0%-12/03/16	10,200,000	10,216,479.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	13,300,000	14,056,780.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	9,500,000	9,710,786.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	11,400,000	10,476,596.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	14,200,000	16,026,507.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	13,200,000	14,075,863.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	8,400,000	8,889,615.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	15,000,000	15,676,495.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	12,200,000	12,950,864.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	11,800,000	12,706,280.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	13,600,000	14,701,696.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	13,000,000	13,929,988.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	13,490,000	14,164,816.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	8,100,000	9,400,075.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	18,900,000	22,422,595.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	17,000,000	17,040,099.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	16,500,000	18,062,792.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	11,450,000	12,252,911.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	12,200,194.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	13,100,000	14,148,653.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	14,000,000	17,358,158.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	7,000,000	9,254,953.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	12,700,000	13,410,515.42	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	11,800,000	12,534,385.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-12/07/01	9,500,000	9,614,009.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-13/06/01	2,900,000	2,894,966.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-12/04/15	9,050,000	9,346,111.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	14,400,000	15,377,780.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,621,336.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	10,900,000	11,308,819.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	18,200,000	19,080,594.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-12/02/01	17,000,000	17,702,516.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/04/15	12,300,000	12,954,727.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-12/03/01	8,700,000	8,848,742.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	13,300,000	14,122,519.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	17,400,000	18,520,243.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-12/12/15	8,600,000	8,624,668.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	11,800,000	12,326,602.13	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	9,900,000	10,051,096.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	16,950,000	17,929,113.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-12/10/15	10,500,000	10,986,814.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	18,000,000	18,866,057.37	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07 /04	3,000,000	3,417,800.40	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04 /15	3,050,000	3,225,841.04	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-12/09/ 15	3,500,000	3,708,976.60	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09 /15	3,500,000	3,861,626.61	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07 /04	3,500,000	3,884,231.40	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/0 4	3,050,000	3,412,400.06	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/ 15	1,500,000	1,486,365.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/ 04	3,000,000	3,333,175.79	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09 /15	4,100,000	4,352,094.24	

FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	10,970,000	14,353,355.29	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-12/12/26	4,360,000	5,038,553.74	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-12/10/25	13,400,000	14,356,269.56	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	6,550,000	9,608,561.14	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	12,500,000	13,518,566.25	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	12,000,000	12,821,410.73	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	12,400,000	13,530,313.32	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	13,200,000	14,326,461.60	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	8,400,000	11,305,323.12	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	17,000,000	18,330,459.08	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	11,700,000	12,611,282.58	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	7,000,000	11,034,876.25	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	13,100,000	13,879,376.64	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-12/04/25	11,020,000	11,669,603.61	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	10,200,000	11,776,665.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	15,200,000	17,613,022.80	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-11/10/25	10,000,000	10,400,751.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	14,000,000	14,873,779.17	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	7,000,000	8,550,059.69	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	13,600,000	14,814,994.06	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	18,360,000	19,300,944.49	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	13,000,000	14,613,476.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	12,500,000	14,147,822.50	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	12,500,000	13,819,801.24	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	12,500,000	13,420,827.46	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	16,600,000	18,649,655.11	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	9,800,000	12,113,970.10	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	13,000,000	17,970,674.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	11,500,000	12,914,249.30	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	2,600,000	3,027,617.58	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	10,500,000	11,775,846.60	
FRANCE(GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,500,000	3,633,543.20	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	13,310,000	13,770,561.93	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	8,600,000	9,338,959.28	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	13,000,000	13,413,294.69	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-12/01/12	11,750,000	12,145,465.02	
FRENCH TREASURY NOTE-0.75%-12/09/20	4,000,000	3,974,413.60	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-13/01/12	11,500,000	12,154,209.69	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,610,471.84	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	9,800,000	10,312,888.87	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-12/07/12	14,100,000	14,916,982.20	
IRISH TREASURY-3.9%-12/03/05	3,600,000	3,597,753.60	
IRISH TREASURY-4.0%-11/11/11	2,800,000	2,820,746.88	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	5,500,000	4,809,835.25	
IRISH TREASURY-5.0%-13/04/18	3,900,000	3,954,596.10	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	6,700,000	5,804,768.71	

IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	5,300,000	4,798,167.91	
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	4,550,000	4,418,622.39	
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	3,500,000	3,109,304.80	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	4,800,000	4,616,533.88	
IRISH TREASURY-4.0%-14/01/15	6,300,000	6,146,697.68	
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	5,100,000	4,493,990.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	7,850,000	8,195,677.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	7,700,000	8,545,432.28	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	7,000,000	8,150,439.47	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	7,500,000	8,336,496.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-13/01/15	5,200,000	5,275,838.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	8,600,000	9,304,089.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	6,100,000	8,107,752.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.0%-12/07/15	9,250,000	9,873,450.89	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	7,900,000	8,431,634.41	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-12/01/15	8,500,000	8,658,655.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	6,900,000	7,384,821.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	8,000,000	9,121,582.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	3,000,000	3,407,322.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	5,600,000	6,126,116.63	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	9,700,000	10,493,299.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	2,400,000	3,561,369.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	7,800,000	8,632,020.50	
OBRIGACOES DO TESOURO-3.35%-15/10/15	5,200,000	4,944,975.36	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.1%-37/04/15	4,700,000	3,461,477.57	
OBRIGACOES DO TESOURO-5.0%-12/06/15	5,200,000	5,353,559.63	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.45%-18/06/15	4,100,000	3,882,148.96	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.2%-16/10/15	3,300,000	3,199,189.29	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.35%-17/10/16	3,800,000	3,645,221.44	
OBRIGACOES DO TESOURO-3.85%-21/04/15	4,250,000	3,592,618.05	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.75%-19/06/14	4,600,000	4,348,756.71	

OBRIGACOES DO TESOURO-4.95%-23/10/25	3,900,000	3,508,852.23	
OBRIGACOES DO TESOURO-5.45%-13/09/23	4,900,000	5,115,971.41	
OBRIGACOES DO TESOURO-3.6%-14/10/15	3,800,000	3,709,902.00	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.375%-14/06/16	3,800,000	3,833,601.88	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.8%-20/06/15	2,800,000	2,605,218.56	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	4,200,000	5,786,167.32	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	7,000,000	7,343,781.18	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	6,200,000	6,810,390.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	3,000,000	3,157,910.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	4,300,000	5,111,840.86	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	7,200,000	7,828,042.28	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	6,000,000	6,730,764.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	6,600,000	7,059,279.47	
REPUBLIC OF AUSTRIA-5.0%-12/07/15	5,650,000	6,018,892.41	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	5,450,000	5,967,667.15	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	4,850,000	5,459,536.35	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	6,700,000	7,640,828.07	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	6,450,000	6,858,136.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	7,300,000	7,802,934.96	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	3,950,000	4,414,648.77	
国債証券小計	2,091,260,000	2,276,496,560.09 (256,401,807,562)	
ユーロ合計		2,276,496,560.09 (256,401,807,562)	
合計		585,998,483,362 (585,998,483,362)	

(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

	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 172銘柄	100.0%	39.7%
加ドル	国債証券 30銘柄	100.0%	2.7%
豪ドル	国債証券 13銘柄	100.0%	1.0%
英ポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	7.7%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 18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%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 238銘柄	100.0%	43.8%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

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

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成21年10月26日現在	平成22年10月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		22,355,246	67,523,893
コール・ローン		35,270,706	718,308,802
国債証券		28,350,145,585	29,610,061,407
派生商品評価勘定		20,343,773	632,749,845
未収入金		555,960,557	690
未収利息		423,314,053	345,692,679
前払費用		45,484,427	28,371,455
流動資産合計		29,452,874,347	31,402,708,771
資産合計		29,452,874,347	31,402,708,771
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,075,550,672	644,445,478
未払金		50,794	154,668
未払解約金		3,156,099	1,792,188
流動負債合計		1,078,757,565	646,392,334
負債合計		1,078,757,565	646,392,334
純資産の部			
元本等			
元本		24,087,399,964	24,647,191,029
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,286,716,818	6,109,125,408
元本等合計		28,374,116,782	30,756,316,437
純資産合計		28,374,116,782	30,756,316,437
負債純資産合計		29,452,874,347	31,402,708,771

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>



## (貸借対照表に関する注記)

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1. 期首	平成20年10月28日	1. 期首	平成21年10月27日
期首元本額	22,771,913,202円	期首元本額	24,087,399,964円
期首からの追加設定元本額	6,580,146,707円	期首からの追加設定元本額	4,111,777,417円
期首からの一部解約元本額	5,264,659,945円	期首からの一部解約元本額	3,551,986,352円
平成21年10月26日現在の元本の内訳		平成22年10月26日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用)	381,702,768円	インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用)	447,657,497円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	9,364,038円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,584,894円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	10,912,688円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	10,283,159円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	28,190,249円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	26,116,094円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	74,411,068円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	66,470,527円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	20,968,849,954円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	21,639,487,030円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	57,741,982円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	60,963,586円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	75,430,980円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	79,166,893円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	67,216,040円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	67,866,539円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	52,310,431円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	51,684,917円
年金積立 インデックスファンド海外債券(ヘッジあり)	2,361,269,766円	年金積立 インデックスファンド海外債券(ヘッジあり)	2,188,909,893円
計	24,087,399,964円	計	24,647,191,029円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	24,087,399,964円	2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	24,647,191,029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）

## （追加情報）

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

## Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日
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。
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>
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。

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成20年10月28日 至 平成21年10月26日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## I 取引の状況に関する事項

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

取引の時価に関する事項  
通貨関連  
(平成21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	28,475,644,481		29,530,851,380	1,055,206,899
	米ドル	9,154,399,058		9,355,407,140	201,008,082
	加ドル	772,082,399		798,622,020	26,539,621
	豪ドル	192,044,477		206,641,860	14,597,383
	英ポンド	2,225,670,645		2,293,568,390	67,897,745
	スイスフラン	181,097,644		185,805,360	4,707,716
	シンガポールドル	125,610,538		127,886,960	2,276,422
	マレーシアリングット	164,543,326		169,564,800	5,021,474
	スウェーデンクローナ	221,094,885		229,557,240	8,462,355
	ノルウェークローネ	100,678,587		106,584,600	5,906,013
	デンマーククローネ	289,288,643		298,754,750	9,466,107
	ポーランドズロチ	286,614,707		292,912,110	6,297,403
	ユーロ	14,762,519,572		15,465,546,150	703,026,578
合計		28,475,644,481		29,530,851,380	1,055,206,899

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

(注) 時価の算定方法

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報 )

平成21年10月26日現在		平成22年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1780円	1口当たり純資産額	1.2479円
(1万口当たり純資産額)	(11,780円)	(1万口当たり純資産額)	(12,479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		米ドル	米ドル	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	1,800,000	1,951,312.50	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	1,650,000	1,823,765.62	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	480,000	555,075.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-17/07/31	2,900,000	3,003,765.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	1,000,000	1,061,250.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	820,000	960,040.61	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	1,050,000	1,139,003.90	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	1,620,000	1,772,634.37	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	1,430,000	1,556,242.18	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	1,250,000	1,369,531.25	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	2,100,000	2,367,421.86	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	1,000,000	1,090,000.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	1,800,000	2,012,062.49	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	1,460,000	1,738,312.50	
		US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	670,000	804,314.06	
		US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	430,000	500,748.43	
		US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	1,250,000	1,455,468.75	
		US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	2,000,000	2,057,343.75	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	2,000,000	2,093,437.50	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	1,580,000	1,795,275.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	2,000,000	2,128,437.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	2,500,000	2,660,742.18	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	940,000	994,637.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	1,160,000	1,366,262.49	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	970,000	1,291,464.02	
		US TREASURY N/B-1.0%-11/09/30	2,000,000	2,013,906.25	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	930,000	1,005,998.43	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	1,600,000	1,802,750.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	1,600,000	1,730,500.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,720,000	1,898,987.50	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	1,540,000	1,432,681.25	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	1,000,000	1,086,250.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	300,000	346,171.87	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	840,000	932,662.50	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	930,000	1,288,050.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	1,600,000	1,809,500.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	980,000	1,329,278.11	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	1,200,000	1,366,312.49	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	1,130,000	1,521,439.01	
		US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	950,000	1,364,437.50	

US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	970,000	1,457,728.11	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	500,000	502,968.75	
US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	390,000	601,331.25	
US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	1,500,000	1,626,093.75	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	3,400,000	3,729,906.24	
US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	1,900,000	2,091,781.25	
US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	1,830,000	1,902,342.18	
US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	1,700,000	1,809,171.87	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	660,000	817,575.00	
US TREASURY N/B-1.0%-12/03/31	2,000,000	2,020,312.50	
US TREASURY N/B-1.375%-12/11/15	1,980,000	2,020,064.05	
US TREASURY N/B-4.0%-12/11/15	870,000	935,521.87	
US TREASURY N/B-1.375%-12/10/15	2,000,000	2,039,218.75	
US TREASURY N/B-0.375%-12/08/31	2,200,000	2,200,515.62	
US TREASURY N/B-1.75%-12/08/15	1,970,000	2,019,711.70	
US TREASURY N/B-4.375%-12/08/15	1,400,000	1,503,031.22	
US TREASURY N/B-1.5%-12/07/15	1,000,000	1,020,468.75	
US TREASURY N/B-0.625%-12/06/30	1,600,000	1,607,499.99	
US TREASURY N/B-0.75%-12/05/31	2,100,000	2,113,945.31	
US TREASURY N/B-1.375%-12/05/15	700,000	711,429.68	
US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	2,000,000	2,042,812.50	
US TREASURY N/B-1.375%-12/04/15	1,000,000	1,015,859.37	
US TREASURY N/B-1.0%-11/10/31	300,000	302,285.15	
US TREASURY N/B-1.375%-12/03/15	2,000,000	2,030,781.23	
US TREASURY N/B-0.875%-12/02/29	1,800,000	1,813,359.37	
US TREASURY N/B-4.875%-12/02/15	1,840,000	1,950,687.48	
US TREASURY N/B-1.125%-12/01/15	1,600,000	1,616,500.00	
US TREASURY N/B-1.125%-11/12/15	700,000	706,863.28	
US TREASURY N/B-4.5%-11/11/30	260,000	272,167.18	
US TREASURY N/B-0.75%-11/11/30	750,000	753,925.78	
US TREASURY N/B-1.75%-11/11/15	1,800,000	1,828,195.30	
US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	550,000	788,562.50	
US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	2,000,000	2,155,937.47	
US TREASURY N/B-1.0%-12/04/30	1,420,000	1,434,643.75	
US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	2,000,000	2,221,250.00	
US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	1,000,000	1,068,984.37	
US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	1,450,000	1,520,460.93	
US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	700,000	795,156.25	
US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	900,000	952,804.68	
US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	600,000	635,390.62	
US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	1,000,000	1,058,203.12	
US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	1,210,000	1,366,354.67	
US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	1,100,000	1,174,078.12	
US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	1,730,000	1,976,795.28	
US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	1,600,000	1,656,874.99	
US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	1,000,000	1,057,265.62	
US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	1,220,000	1,254,789.05	
US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	2,750,000	2,838,300.78	
US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	1,550,000	1,583,906.25	
US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	1,200,000	1,248,375.00	
US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	600,000	613,312.50	
US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	760,000	845,975.00	
US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	1,350,000	1,461,796.87	
US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	1,000,000	1,017,187.50	
US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	2,000,000	2,157,656.24	
US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	1,600,000	1,769,000.00	
US TREASURY N/B-0.75%-13/08/15	2,000,000	2,014,375.00	
US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	1,400,000	1,506,640.62	

	国債証券小計		134,590,000	145,715,605.65 (11,762,163,688)	
米ドル合計				145,715,605.65 (11,762,163,688)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-4.0%- 41/06/01	加ドル 200,000	加ドル 223,658.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%- 37/06/01	910,000	1,159,067.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%- 29/06/01	530,000	709,203.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%- 27/06/01	450,000	725,854.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%- 14/06/01	770,000	806,636.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%- 20/06/01	400,000	425,600.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%- 19/06/01	350,000	380,149.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%- 16/06/01	550,000	607,436.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%- 14/12/01	480,000	485,419.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%- 13/06/01	1,070,000	1,173,073.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%- 12/06/01	1,360,000	1,444,646.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%- 11/12/01	350,000	350,077.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%- 18/06/01	900,000	1,014,480.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%- 15/06/01	650,000	670,169.50	
		国債証券小計			8,970,000
加ドル合計				10,175,471.10 (805,693,801)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%- 15/04/15	豪ドル 250,000	豪ドル 261,776.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%- 21/05/15	620,000	646,468.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%- 17/02/15	480,000	501,808.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%- 14/06/15	550,000	571,689.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%- 13/05/15	560,000	580,277.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%- 12/04/15	500,000	505,885.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%- 19/03/15	500,000	502,495.00	
		国債証券小計			3,460,000
豪ドル合計				3,570,400.33 (285,739,138)	

英ポンド	国債証券	UK TREASURY-8.0%-21/06/07	英ポンド 570,000	英ポンド 828,454.54	
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	1,290,000	1,481,830.09	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	1,000,000	1,036,230.02	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	340,000	366,660.93	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	920,000	1,031,132.04	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	910,000	944,695.47	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,010,000	1,056,685.46	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	360,000	420,491.53	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	930,000	969,740.41	
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	710,000	831,532.12	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	580,000	645,339.17	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	1,150,000	1,314,561.20	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	1,050,000	1,195,585.65	
		UK TREASURY-2.25%-14/03/07	400,000	414,907.00	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	1,670,000	1,814,532.18	
		UK TREASURY-5.0%-12/03/07	1,120,000	1,186,133.09	
		UK TREASURY-3.25%-11/12/07	450,000	463,143.28	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	890,000	1,155,909.46	
	UK TREASURY-4.5%-19/03/07	680,000	769,826.90		
	国債証券小計	16,030,000	17,927,390.54 (2,276,957,872)		
英ポンド合計				17,927,390.54 (2,276,957,872)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	スイスフラン 450,000	スイスフラン 538,667.55	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	100,000	134,463.10	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	350,000	392,874.65	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	400,000	445,284.00	
		SWITZERLAND-2.75%-12/06/10	350,000	363,186.60	
	SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	140,000	176,885.94		
	国債証券小計	1,790,000	2,051,361.84 (170,468,168)		
スイスフラン合計				2,051,361.84 (170,468,168)	
シンガポールドドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-12/07/01	シンガポールドドル 550,000	シンガポールドドル 577,475.22	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	600,000	690,640.23	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	400,000	470,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	250,000	277,400.85		
	国債証券小計	1,800,000	2,015,916.30 (125,752,858)		
シンガポールドドル合計				2,015,916.30 (125,752,858)	
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-2.711%-12/02/14	マレーシアリングット 2,200,000	マレーシアリングット 2,197,905.18	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	1,700,000	1,759,861.69	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	2,150,000	2,229,229.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	600,000	625,621.80		
	国債証券小計	6,650,000	6,812,617.97 (177,673,076)		
マレーシアリングット合計				6,812,617.97 (177,673,076)	



スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	スウェーデンクローナ 4,760,000	スウェーデンクローナ 4,957,988.87	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.5%-12/10/08	2,800,000	3,027,613.73	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%- 19/03/12	1,500,000	1,711,715.73	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	3,100,000	3,793,307.92	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	1,500,000	1,548,843.37	
		SWEDISH GOVERNMENT-6.75%- 14/05/05	2,250,000	2,623,864.96	
	国債証券小計		15,910,000	17,663,334.58 (216,729,115)	
スウェーデンクローナ合計					17,663,334.58 (216,729,115)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%- 13/05/15	ノルウェークローネ 1,200,000	ノルウェークローネ 1,354,863.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%- 15/05/15	1,000,000	1,136,674.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%- 17/05/19	1,600,000	1,728,857.98	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%- 19/05/22	1,000,000	1,118,886.00	
	国債証券小計		4,800,000	5,339,281.58 (74,322,799)	
ノルウェークローネ合計					5,339,281.58 (74,322,799)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-6.0%-11/11/15	デンマーククローネ 2,150,000	デンマーククローネ 2,263,343.70	
		KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	4,100,000	4,534,460.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	4,000,000	4,456,560.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	1,800,000	2,006,571.60	
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	600,000	886,714.20	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,750,000	3,569,233.25	
	国債証券小計		15,400,000	17,716,883.35 (267,524,938)	
デンマーククローネ合計					17,716,883.35 (267,524,938)
メキシコペ ソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	メキシコペソ 9,000,000	メキシコペソ 10,360,467.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	3,000,000	3,524,409.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	13,000,000	14,089,400.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	6,000,000	7,070,520.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	6,000,000	6,816,732.00	
	国債証券小計		37,000,000	41,861,528.00 (272,937,162)	
メキシコペソ合計					41,861,528.00 (272,937,162)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	ポーランドズロチ 900,000	ポーランドズロチ 909,450.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	2,300,000	2,282,750.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	800,000	835,600.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	2,150,000	2,158,600.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-12/04/25	2,850,000	2,855,700.00	

国債証券小計			9,000,000	9,042,100.00 (259,237,007)	
ポーランドズロチ合計				9,042,100.00 (259,237,007)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	ユーロ 720,000	ユーロ 868,286.36	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	1,220,000	1,308,834.04	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	450,000	486,734.76	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	380,000	471,821.86	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	1,050,000	1,119,093.36	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	720,000	839,956.03	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-12/09/28	820,000	876,369.49	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	1,200,000	1,275,019.79	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	350,000	364,902.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	130,000	144,869.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-13/07/30	600,000	629,405.46	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.75%-14/07/30	1,490,000	1,602,922.88	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	930,000	1,070,728.89	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.15%-13/01/31	1,560,000	1,693,271.09	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	1,250,000	1,247,798.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	1,460,000	1,530,391.54	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-12/04/30	410,000	414,889.53	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	1,000,000	1,019,790.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,380,000	1,245,879.29	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.35%-11/10/31	440,000	455,541.85	
		BUNDES OBLIGATION-4.0%-12/04/13	950,000	992,558.95	
		BUNDES OBLIGATION-3.5%-11/10/14	630,000	645,775.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,020,000	1,266,169.04	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,310,000	1,773,652.35	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	430,000	475,063.65	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	620,000	861,860.63	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	1,050,000	1,121,659.45	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	490,000	546,766.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	700,000	732,977.98	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	1,540,000	1,680,360.04	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	2,300,000	2,469,469.06	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	890,000	981,606.88	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	1,270,000	1,365,699.96	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	200,000	217,757.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	270,000	307,017.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	720,000	984,432.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	1,350,000	1,541,715.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	1,440,000	1,540,887.67	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	810,000	896,938.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	750,000	841,804.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	1,000,000	1,094,120.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	910,000	1,068,160.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.0%-12/01/04	950,000	996,828.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.0%-12/07/04	1,520,000	1,622,495.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	1,110,000	1,172,100.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	1,900,000	2,045,926.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	240,000	251,547.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	700,000	715,531.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	1,840,000	1,962,090.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	900,000	945,021.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	300,000	317,070.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	100,000	112,862.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	280,000	302,681.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	1,230,000	1,313,518.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,550,000	1,646,465.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-12/10/15	1,370,000	1,433,517.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	1,580,000	1,671,268.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	650,000	711,564.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-12/04/15	450,000	464,723.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,100,000	1,363,855.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	1,090,000	1,157,409.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	2,000,000	2,128,763.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	900,000	1,067,742.63	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-12/02/01	1,240,000	1,291,242.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,510,000	1,387,689.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	430,000	638,987.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	200,000	211,657.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	1,690,000	1,771,769.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	1,030,000	1,032,429.56	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07 /04	210,000	239,246.02	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07 /04	400,000	443,912.16	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	100,000	111,881.97	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	200,000	222,211.72	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%- 17/09/15	400,000	441,328.75	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	590,000	865,503.98	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	540,000	746,474.18	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	860,000	1,125,240.24	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	1,280,000	1,380,175.73	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	830,000	1,025,979.09	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	1,070,000	1,157,189.27	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	800,000	847,595.52	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	810,000	910,532.01	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	500,000	565,912.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	950,000	1,067,299.54	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	1,360,000	1,460,186.03	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-12/04/25	520,000	550,652.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-12/10/25	1,230,000	1,317,776.98	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	1,620,000	1,730,890.44	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	1,080,000	1,164,118.39	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	1,180,000	1,280,698.84	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	1,100,000	1,200,269.73	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	1,020,000	1,072,274.69	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	620,000	715,836.50	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	410,000	435,589.24	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	540,000	625,725.81	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	420,000	471,033.86	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	300,000	326,801.34	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-11/10/25	580,000	603,243.55	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	1,700,000	1,879,492.96	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-12/01/12	600,000	620,193.96	
IRISH TREASURY-5.0%-13/04/18	300,000	304,199.70	
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,050,000	909,702.57	
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	450,000	432,800.04	
IRISH TREASURY-4.0%-14/01/15	150,000	146,349.94	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	200,000	174,903.10	
IRISH TREASURY-4.0%-11/11/11	250,000	251,852.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%- 18/07/15	570,000	632,583.94	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	520,000	691,152.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.0%-12/07/15	830,000	885,942.08	

NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	810,000	876,244.63	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	570,000	608,358.43	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-12/01/15	300,000	305,599.59	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	650,000	756,826.52	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	730,000	789,765.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	550,000	588,645.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	460,000	509,067.86	
OBRIGACOES DO TESOURO-5.45%-13/09/23	100,000	104,407.58	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.1%-37/04/15	200,000	147,296.92	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.2%-16/10/15	260,000	252,057.33	
OBRIGACOES DO TESOURO-3.85%-21/04/15	750,000	633,991.40	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.45%-18/06/15	300,000	284,059.68	
OBRIGACOES DO TESOURO-5.0%-12/06/15	500,000	514,765.35	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.375%-14/06/16	500,000	504,421.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	300,000	337,703.28	
REPUBLIC OF AUSTRIA-5.0%-12/07/15	520,000	553,951.15	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	440,000	481,793.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	200,000	224,358.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	850,000	909,149.63	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	600,000	652,336.85	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	170,000	186,736.51	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	920,000	1,049,188.31	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	400,000	551,063.54	
国債証券小計	105,290,000	114,666,268.18 (12,914,861,785)	
ユーロ合計		114,666,268.18 (12,914,861,785)	
合計		29,610,061,407 (29,610,061,407)	

(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

	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 98銘柄	100.0%	39.7%
加ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	2.7%
豪ドル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.0%
英ポンド	国債証券 19銘柄	100.0%	7.7%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
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git	国債証券 4銘柄	100.0%	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 132銘柄	100.0%	43.6%

## 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2010年11月30日現在です。

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,648,629,701 円
負債総額	2,857,273 円
純資産総額( - )	1,645,772,428 円
発行済口数	1,526,321,223 口
1口当たり純資産額( / )	1.0783 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	31,282,863,718 円
負債総額	139,114,045 円
純資産総額( - )	31,143,749,673 円
発行済口数	47,678,855,116 口
1口当たり純資産額( / )	0.6532 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	70,277,978,491 円
負債総額	210,234,640 円
純資産総額( - )	70,067,743,851 円
発行済口数	81,086,065,628 口
1口当たり純資産額( / )	0.8641 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	1,176,136,799 円
負債総額	30,132,060 円
純資産総額( - )	1,146,004,739 円
発行済口数	1,513,312,847 口
1口当たり純資産額( / )	0.7573 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	36,821,351,262 円
負債総額	54,563,819 円
純資産総額( - )	36,766,787,443 円
発行済口数	30,574,389,695 口
1口当たり純資産額( / )	1.2025 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	585,806,138,421 円
負債総額	2,630,559,465 円
純資産総額( - )	583,175,578,956 円
発行済口数	405,760,077,064 口
1口当たり純資産額( / )	1.4372 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	30,939,333,194 円
負債総額	867,976,449 円
純資産総額（ - ）	30,071,356,745 円
発行済口数	24,639,963,667 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2204 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、
- ・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、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、
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (4) 受益証券の再発行

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

## (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、

## (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22年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	220,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

##### 過去5年間における主な資本金の増減

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

##### (2) 会社の意思決定機関

###### ・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行いません。

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

###### ・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

###### ・監査役会

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

（平成22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。

## 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22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	399	67,926
株式投資信託	327	55,639
単位型	42	1,588
追加型	285	54,051
公社債投資信託	72	12,287
単位型	55	805
追加型	17	11,482
投資法人合計	1	33

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第50期事業年度(平成20年4月1日から平成21年3月31日まで)については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、改正前の「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて、第51期事業年度(平成21年4月1日から平成22年3月31日まで)については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第50期事業年度(平成20年4月1日から平成21年3月31日まで)及び第51期事業年度(平成21年4月1日から平成22年3月31日まで)の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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



## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

## 重要な会計方針

	第50期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第51期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時 価法(評価差額は、全部純資産直入 法により処理し、売却原価は、総平 均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左  時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方 法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。た だし、ソフトウェア(自社利用分)に ついては、社内における利用可能期 間(5年)に基づく定額法によってお ります。	(1) 有形固定資産 同左  (2) 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充て るため、支払見込額に基づき当事業 年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てる ため、支払見込額に基づき当事業年 度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当 事業年度末における退職給付債務及 び年金資産の見込額に基づき計上し ております。 数理計算上の差異は、各事業年度の 発生時における従業員の平均残存勤 務期間以内の一定の年数(10年)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。	(1) 賞与引当金 同左  (2) 役員賞与引当金 同左  (3) 退職給付引当金 同左

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

## 会計方針の変更

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

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

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

## （損益計算書関係）

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第50期（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第51期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

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



## （金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

### 1 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（（注）2を参照ください。）。

（単位：百万円）

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

## (有価証券関係)

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

## 1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

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

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

## 2 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,196	199	278

## 3 時価評価されていない有価証券

## その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

## 4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位：百万円)

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

## 5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位：百万円)

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

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

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

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

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

## (持分法損益等)

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

## （退職給付関係）

第50期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)																																																														
<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度、キャッシュバランスプラン型退職金制度、適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td style="text-align: right;">1,429</td></tr> <tr><td>ロ 年金資産</td><td style="text-align: right;">676</td></tr> <tr><td>ハ 未積立退職給付債務</td><td style="text-align: right;">753</td></tr> <tr><td>ニ 未認識数理計算上の差異</td><td style="text-align: right;">141</td></tr> <tr><td>ホ 退職給付引当金残高</td><td style="text-align: right;">612</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 勤務費用</td><td style="text-align: right;">107</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td style="text-align: right;">30</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益</td><td style="text-align: right;">5</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">34</td></tr> <tr><td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td style="text-align: right;">169</td></tr> <tr><td>ヘ 退職給付費用合計</td><td style="text-align: right;">336</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td style="text-align: right;">勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td style="text-align: right;">2.0%</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益率</td><td style="text-align: right;">0.7%</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">10年</td></tr> </table> <p>5 割増退職金に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 流動負債</td><td style="text-align: right;">16</td></tr> <tr><td>ロ 割増退職金</td><td style="text-align: right;">433</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	1,429	ロ 年金資産	676	ハ 未積立退職給付債務	753	ニ 未認識数理計算上の差異	141	ホ 退職給付引当金残高	612	イ 勤務費用	107	ロ 利息費用	30	ハ 期待運用収益	5	ニ 数理計算上の差異の費用処理額	34	ホ 確定拠出型企業年金への掛金	169	ヘ 退職給付費用合計	336	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	2.0%	ハ 期待運用収益率	0.7%	ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年	イ 流動負債	16	ロ 割増退職金	433	<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。なお当社は、当事業年度末に適格退職年金制度を終了しております。制度終了による影響額は、22百万円の損失で、内訳は退職給付債務と年金資産の消滅による利益3百万円及び数理計算上の未認識差異の一括償却による損失26百万円であります。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td style="text-align: right;">838</td></tr> <tr><td>ロ 未積立退職給付債務</td><td style="text-align: right;">838</td></tr> <tr><td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td style="text-align: right;">94</td></tr> <tr><td>ニ 退職給付引当金残高</td><td style="text-align: right;">743</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 勤務費用</td><td style="text-align: right;">96</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td style="text-align: right;">28</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益</td><td style="text-align: right;">5</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">33</td></tr> <tr><td>ホ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td style="text-align: right;">162</td></tr> <tr><td>ヘ 退職給付費用合計</td><td style="text-align: right;">315</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td style="text-align: right;">勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td style="text-align: right;">1.7%</td></tr> <tr><td>ハ 期待運用収益率</td><td style="text-align: right;">0.7%</td></tr> <tr><td>ニ 数理計算上の差異の処理年数</td><td style="text-align: right;">10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	838	ロ 未積立退職給付債務	838	ハ 未認識数理計算上の差異	94	ニ 退職給付引当金残高	743	イ 勤務費用	96	ロ 利息費用	28	ハ 期待運用収益	5	ニ 数理計算上の差異の費用処理額	33	ホ 確定拠出型企業年金への掛金	162	ヘ 退職給付費用合計	315	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.7%	ハ 期待運用収益率	0.7%	ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	1,429																																																														
ロ 年金資産	676																																																														
ハ 未積立退職給付債務	753																																																														
ニ 未認識数理計算上の差異	141																																																														
ホ 退職給付引当金残高	612																																																														
イ 勤務費用	107																																																														
ロ 利息費用	30																																																														
ハ 期待運用収益	5																																																														
ニ 数理計算上の差異の費用処理額	34																																																														
ホ 確定拠出型企業年金への掛金	169																																																														
ヘ 退職給付費用合計	336																																																														
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																														
ロ 割引率	2.0%																																																														
ハ 期待運用収益率	0.7%																																																														
ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																														
イ 流動負債	16																																																														
ロ 割増退職金	433																																																														
イ 退職給付債務	838																																																														
ロ 未積立退職給付債務	838																																																														
ハ 未認識数理計算上の差異	94																																																														
ニ 退職給付引当金残高	743																																																														
イ 勤務費用	96																																																														
ロ 利息費用	28																																																														
ハ 期待運用収益	5																																																														
ニ 数理計算上の差異の費用処理額	33																																																														
ホ 確定拠出型企業年金への掛金	162																																																														
ヘ 退職給付費用合計	315																																																														
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																														
ロ 割引率	1.7%																																																														
ハ 期待運用収益率	0.7%																																																														
ニ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																														

## (ストックオプション等関係)

第50期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

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

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



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

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

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

## 単価情報

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

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

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

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

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

## 第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

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

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

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

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

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

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

## 単価情報

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



## （税効果会計関係）

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

## ( 関連当事者情報 )

第50期(自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

Citigroup Inc.(ニューヨーク証券取引所等に上場)

日興シティホールディングス株式会社

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第51期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1 平成21年10月1日、当社は、当社取締役から取得した新株予約権（権利行使価格：1株当たり159円）を行使した住友信託銀行株式会社に対し12,000,000株の普通株式を発行しております。

2 議決権等の被所有割合は、自己株式（85,000株）を控除して計算しております。

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 平成21年10月1日に住友信託銀行株式会社が当社の親会社となり、日興コーディアル証券株式会社は当社の関連当事者ではなくなりました。上記の金額は、平成21年4月1日から平成21年9月30日までの期間の取引金額であります。また、資本金又は出資金の金額は、平成21年9月30日の資本金額を記載しております。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

## ( 1株当たり情報 )

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

## (注) 算定上の基礎

## 1 1株当たり純資産額

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

## 2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

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

## （重要な後発事象）

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

1. 当社の中間財務諸表は、改正後の「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第52期中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

## 中間財務諸表等

## ( 1 ) 中間貸借対照表

( 単位：百万円 )

第52期中間会計期間末  
(平成22年9月30日現在)

資産の部	
流動資産	
現金及び預金	27,119
未収委託者報酬	5,665
未収収益	839
繰延税金資産	1,304
その他	2
流動資産合計	35,656
固定資産	
有形固定資産	1
無形固定資産	50
投資その他の資産	
投資有価証券	7,294
関係会社株式	8,659
長期差入保証金	973
繰延税金資産	1,126
その他	60
子会社投資損失引当金	576
投資その他の資産合計	17,537
固定資産合計	17,873
資産合計	53,530

（単位：百万円）

第52期中間会計期間末  
（平成22年9月30日現在）

負債の部	
流動負債	
未払金	3,313
未払費用	3,370
未払法人税等	402
未払消費税等	168
賞与引当金	955
特別賞与引当金	1,204
役員賞与引当金	110
役員特別賞与引当金	106
その他	151
流動負債合計	9,782
固定負債	
退職給付引当金	804
その他	102
固定負債合計	906
負債合計	10,689
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
その他資本剰余金	4
資本剰余金合計	5,225
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	20,228
利益剰余金合計	20,228
自己株式	53
株主資本合計	42,763
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	78
評価・換算差額等合計	78
純資産合計	42,841
負債純資産合計	53,530



## ( 2 ) 中間損益計算書

( 単位：百万円 )

第52期中間会計期間  
( 自 平成22年 4 月 1 日  
至 平成22年 9 月30日 )

営業収益		
委託者報酬		25,088
その他営業収益		1,394
営業収益合計		26,483
営業費用及び一般管理費	1	25,076
営業利益		1,406
営業外収益	2	1,085
営業外費用	3	114
経常利益		2,377
特別利益	4	49
特別損失	5	58
税引前中間純利益		2,367
法人税、住民税及び事業税		373
法人税等調整額		275
中間純利益		1,719

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:百万円)

第52期中間会計期間  
(自平成22年4月1日  
至平成22年9月30日)

株主資本		
資本金		
前期末残高		17,363
当中間期末残高		<u>17,363</u>
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高		5,220
当中間期末残高		<u>5,220</u>
その他資本剰余金		
前期末残高		4
当中間期末残高		<u>4</u>
資本剰余金合計		
前期末残高		5,225
当中間期末残高		<u>5,225</u>
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
前期末残高		18,814
当中間期変動額		
剰余金の配当		305
中間純利益		<u>1,719</u>
当中間期変動額合計		<u>1,414</u>
当中間期末残高		<u>20,228</u>
利益剰余金合計		
前期末残高		18,814
当中間期変動額		
剰余金の配当		305
中間純利益		<u>1,719</u>
当中間期変動額合計		<u>1,414</u>
当中間期末残高		<u>20,228</u>
自己株式		
前期末残高		53
当中間期末残高		<u>53</u>
株主資本合計		
前期末残高		41,349
当中間期変動額		
剰余金の配当		305
中間純利益		<u>1,719</u>
当中間期変動額合計		<u>1,414</u>
当中間期末残高		<u>42,763</u>
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高		121
当中間期変動額		

株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)			<u>43</u>
当中間期変動額合計		<u>43</u>	
当中間期末残高	<u>78</u>		
評価・換算差額等合計			
前期末残高	121		
当中間期変動額			
株主資本以外の項目の当中間 期変動額(純額)	<u>43</u>		
当中間期変動額合計	<u>43</u>		
当中間期末残高	<u>78</u>		
純資産合計			
前期末残高	41,470		
当中間期変動額			
剰余金の配当	305		
中間純利益	1,719		
株主資本以外の項目の当中間 期変動額(純額)	<u>43</u>		
当中間期変動額合計	<u>1,370</u>		
当中間期末残高	<u>42,841</u>		
-			
	-		

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第52期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、 売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。但し、ソフトウェア (自社利用分)については、社内における利用可 能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支 払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上 しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支 払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上 しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末 における退職給付債務及び年金資産の見込額に 基づき当中間会計期間末において発生している と認められる額を計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時にお ける従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年 数(10年)で按分した額をそれぞれ発生の翌事 業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備 えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる 額を計上しております。</p> <p>(5) 特別賞与引当金 従業員に支給する特別賞与の支払に充てるた め、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額 を計上しております。</p> <p>(6) 役員特別賞与引当金 役員に支給する特別賞与の支払に充てるため、 支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計 上しております。</p>
4 その他中間財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理について 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式に よっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期 間の費用として処理しております。</p>

## 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

第52期中間会計期間  
(自 平成22年4月1日  
至 平成22年9月30日)

「資産除去債務に関する会計基準」等の適用  
当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。これにより、営業利益、経常利益はそれぞれ9百万円減少、税引前中間純利益は68百万円減少しております。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

第52期中間会計期間末  
(平成22年9月30日現在)

- 1 有形固定資産の減価償却累計額  
1,477 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 保証債務  
当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務150百万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198百万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52期中間会計期間  
(自 平成22年4月1日  
至 平成22年9月30日)

- 1 減価償却実施額
 

有形固定資産	72 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	1 百万円
受取配当金	1,069 百万円
為替差益	11 百万円
- 3 営業外費用のうち主要なもの
 

支払利息	5 百万円
支払源泉所得税	106 百万円
- 4 特別利益のうち主要なもの
 

投資有価証券売却益	49 百万円
-----------	--------
- 5 特別損失のうち主要なもの
 

過年度敷金償却費用	58 百万円
-----------	--------

(中間株主資本等変動計算書関係)

第52期中間会計期間（自平成22年4月1日至平成22年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	197,012,500	-	-	197,012,500

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	85,000	-	-	85,000

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる株 式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計 期間末残高( 百万円)
		前事業年度末	当中間会計期 間増加	当中間会計期 間減少	当中間会計期 間末	
平成21年度ストックオプション (1)	普通株式	19,559,110	-	151,810	19,407,300	-
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		19,559,110	4,012,800	151,810	23,420,100	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の消滅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)及び平成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。

3 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52期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)	
1 オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	822 百万円
1年超	2,597 百万円
合計	3,420 百万円

## (金融商品関係)

第52期中間会計期間末(平成22年9月30日現在)

## 1 金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません(注)2を参照ください。)

	中間貸借対照表 計上額( )(百万円)	時価( ) (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金及び預金	27,119	27,119	-
(2) 未収委託者報酬	5,665	5,665	-
(3) 未収収益	839	839	-
(4) 投資有価証券			
其他有価証券	7,146	7,146	-
(5) 関係会社株式			
子会社株式	1,404	1,619	215
(6) 未払金	(3,313)	(3,313)	-
(7) 未払費用	(3,370)	(3,370)	-

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

## (4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

## 2 非上場株式等(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 其他有価証券」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4,362百万円)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52期中間会計期間末(平成22年9月30日現在)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
子会社株式	1,404	1,619	215
合計	1,404	1,619	215

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

## 2 その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株式	22	7	14
	その他	5,936	5,761	175
	小計	5,959	5,769	189
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	1,187	1,245	58
	小計	1,187	1,245	58
合計		7,146	7,014	131

(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52期中間会計期間 (自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	(単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額	2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	4,157
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	511

## （ストックオプション等関係）

第52期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

当中間会計期間において、ストックオプションを付与しておりますが、当該ストックオプションの付与による影響が当社の財政状態、経営成績等にとって重要でないと認められるため注記を省略しております。



（セグメント情報等）

第52期中間会計期間(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## ( 1 株当たり情報 )

第52期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)	
1株当たり純資産額	217円54銭
1株当たり中間純利益	8円73銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>	

## (注) 算定上の基礎

## 1 1株当たり純資産額

項目	第52期中間会計期間末 (平成22年 9月30日現在)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額 (百万円)	42,841
普通株式に係る純資産額(百万円)	42,841
差額の主な内訳(百万円)	
新株予約権	-
普通株式の発行済株式数(千株)	197,013
普通株式の自己株式数(千株)	85
1株当たり純資産額の算定に用いられた 普通株式の数(千株)	196,928

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

項目	第52期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)
中間純利益(百万円)	1,719
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)	1,719
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,928
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整 後1株当たり中間純利益の算定に含まれな かった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 19,407,300株 平成21年度ストックオプション(2) 1,702,800株 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株

## (重要な後発事象)

第52期中間会計期間(自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)

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22年7月20日現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成22年3月末現在)	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
日興コーディアル証券株式会社	10,000百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
楽天証券株式会社	7,477百万円	
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	37,461百万円	
株式会社東北銀行	8,233百万円	
株式会社もみじ銀行	74,965百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
株式会社琉球銀行	54,127百万円	
ソニー生命保険株式会社	70,000百万円	
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。

株式会社第三銀行およびソニー生命保険株式会社は、募集の取扱いを行いません。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成21年12月2日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成20年10月28日から平成21年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成21年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

- 
- (注) 1 . 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2 . 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年12月8日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成21年10月27日から平成22年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成22年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

2 . 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月19日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

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

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

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

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

以上

---

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



独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

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

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

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

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

以 上

---

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22年11月24日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第52期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成22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22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

---

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