

【表紙】

| | |
|--------------------------------------|----------------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成24年1月26日 |
| 【発行者名】 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区赤坂九丁目7番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 雄谷 敦史 |
| 【電話番号】 | 03-6447-6147 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】 | 年金積立 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】**

- ・年金積立 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「DC Aナビ20」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。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

(7) 【申込期間】

平成24年1月27日から平成25年1月25日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。

国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

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

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

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

※シティグループ世界国債インデックス(除く日本)：同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変更す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。

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

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



主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

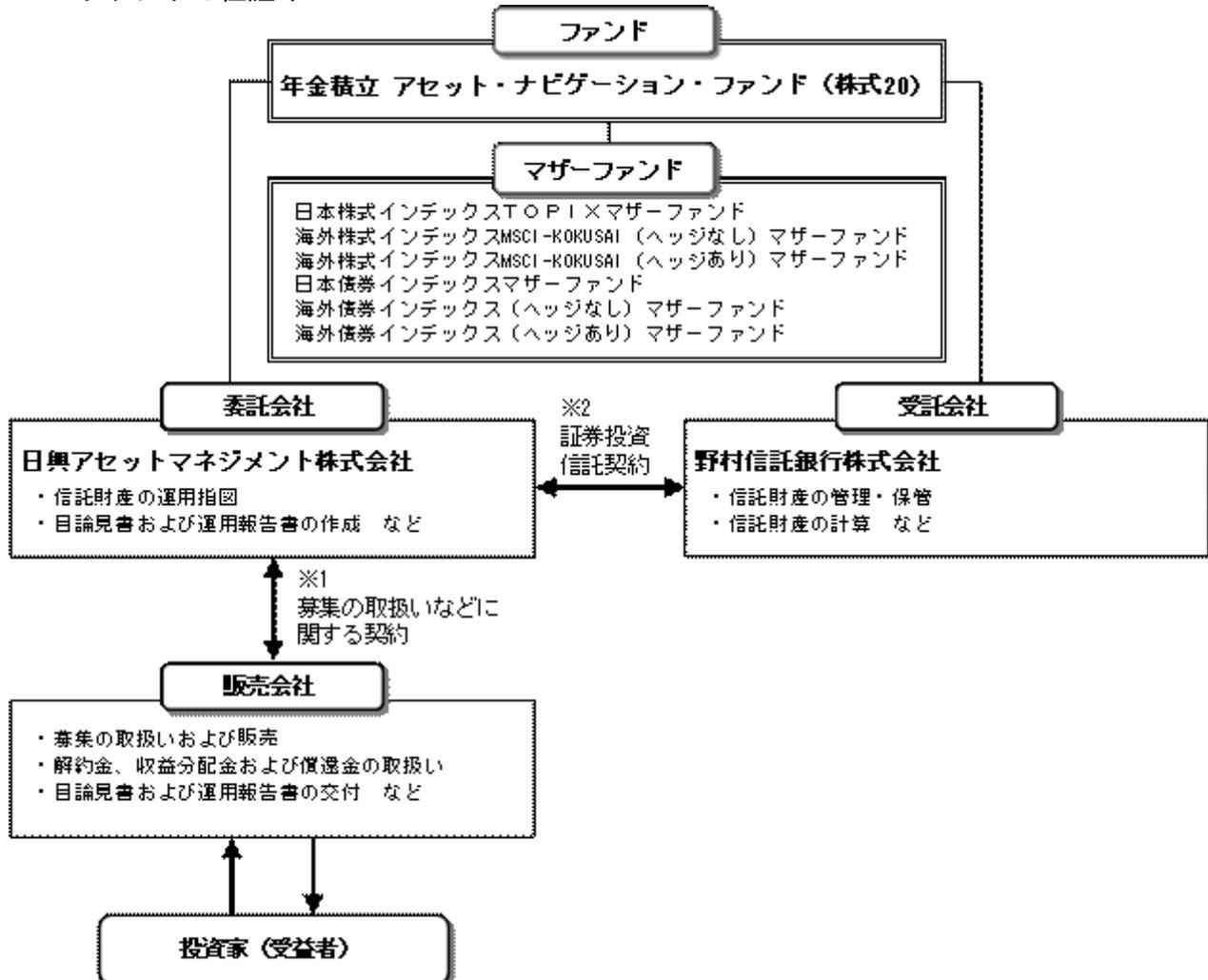
- ・ 1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成13年10月17日 ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（平成23年11月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

| 名称 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|---------------|-----------------------------------------------------------------|--------------|--------|
| 住友信託銀行株式会社 | 大阪府大阪市中央区北浜四丁目5番33号 | 179,869,100株 | 91.29% |
| DBS Bank Ltd. | 6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809 | 14,283,400株 | 7.24% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

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

株式の標準実質組入比率.....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があります。

- ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存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】

<年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

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

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券

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

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

4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券

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

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

- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 13) コマーシャル・ペーパー
- 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
- 16) 投資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、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 17) 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18)に定めるもの以外のもの
- 18) 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
- 19) 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。）
- 20) 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。）
- 21) 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。）
- 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23) 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。）
- 24) 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
- 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する

短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)を除きます。)には投資しません。

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号お

よび第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限りま。

- 5) 特定社債(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
 - 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。)
 - 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 有価証券の貸付
 - 5) 公社債の空売
 - 6) 公社債の借入

< 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限りま。)
- 5) 特定社債(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。)
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行

信託の受益証券に表示されるべきもの

- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 為替先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
 - 8) 外国為替予約取引

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

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

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

| 運用の基本方針 | |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針 | 世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 収益分配 | 収益分配は行ないません。 |
| ファンドに係る費用 | |
| 信託報酬 | ありません。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 信託財産留保額 | 解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり） |
| その他の費用など | 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。 |
| その他 | |
| 委託会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | 無期限（平成12年5月17日設定） |
| 決算日 | 毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日） |

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

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

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

| 運用の基本方針 | |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針 | 世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーフンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 収益分配 | 収益分配は行ないません。 |
| ファンドに係る費用 | |
| 信託報酬 | ありません。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 信託財産留保額 | 解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり） |
| その他の費用など | 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など、上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。 |
| その他 | |
| 委託会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | 無期限（平成12年5月17日設定） |
| 決算日 | 毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日） |

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

| 運用の基本方針 | |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針 | 世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | 内外の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 収益分配 | 収益分配は行ないません。 |
| ファンドに係る費用 | |
| 信託報酬 | ありません。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 信託財産留保額 | 解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり） |
| その他の費用など | 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。 |
| その他 | |
| 委託会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | 無期限（平成10年10月30日設定） |
| 決算日 | 毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日） |

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

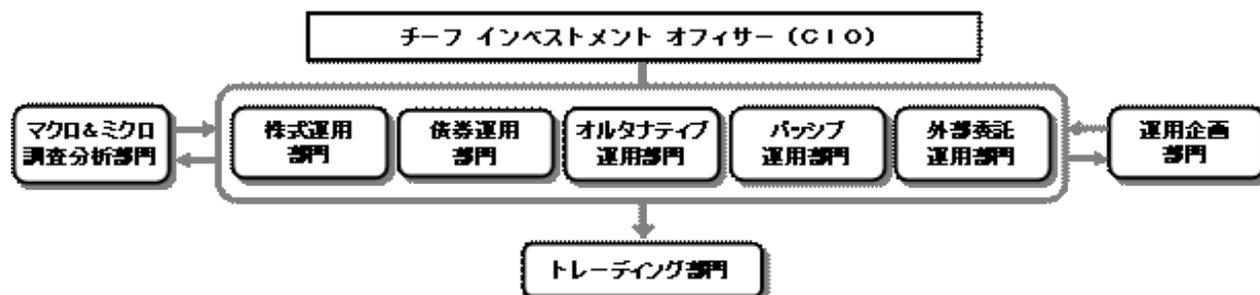
| 運用の基本方針 | |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基本方針 | 世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 |
| 主な投資対象 | 内外の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資方針 | <ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 収益分配 | 収益分配は行ないません。 |
| ファンドに係る費用 | |
| 信託報酬 | ありません。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 信託財産留保額 | 解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり） |
| その他の費用など | 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。 |
| その他 | |
| 委託会社 | 日興アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社 | 野村信託銀行株式会社 |
| 信託期間 | 無期限（平成10年10月30日設定） |
| 決算日 | 毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日） |

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

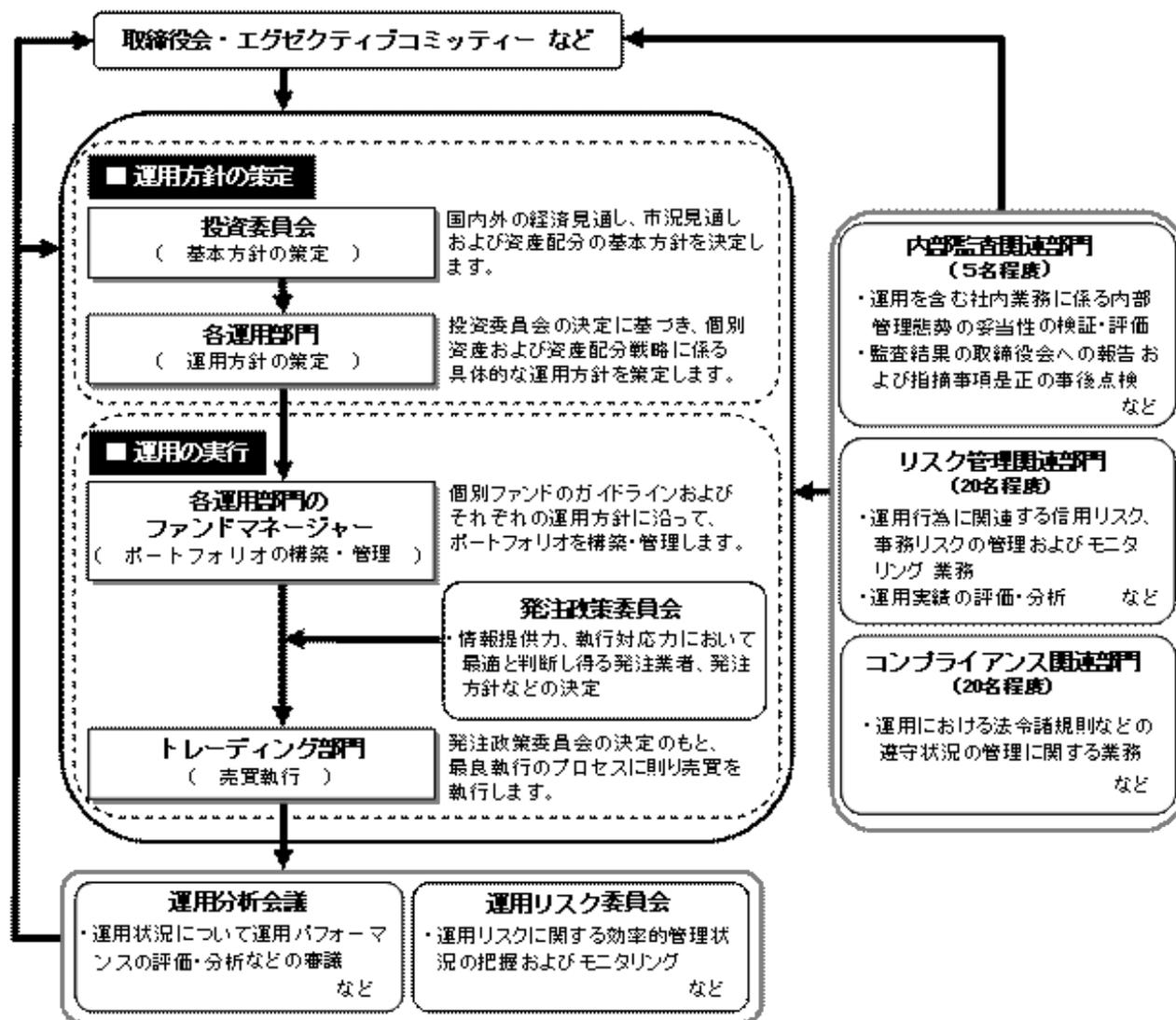
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

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

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は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

<年金積立 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) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることが指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として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。
- 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(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。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
 - ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

<日本株式インデックストップIXマザーファンド>

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

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

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

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

ます。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

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

条第8項第3号口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号八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号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範

囲内とします。

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

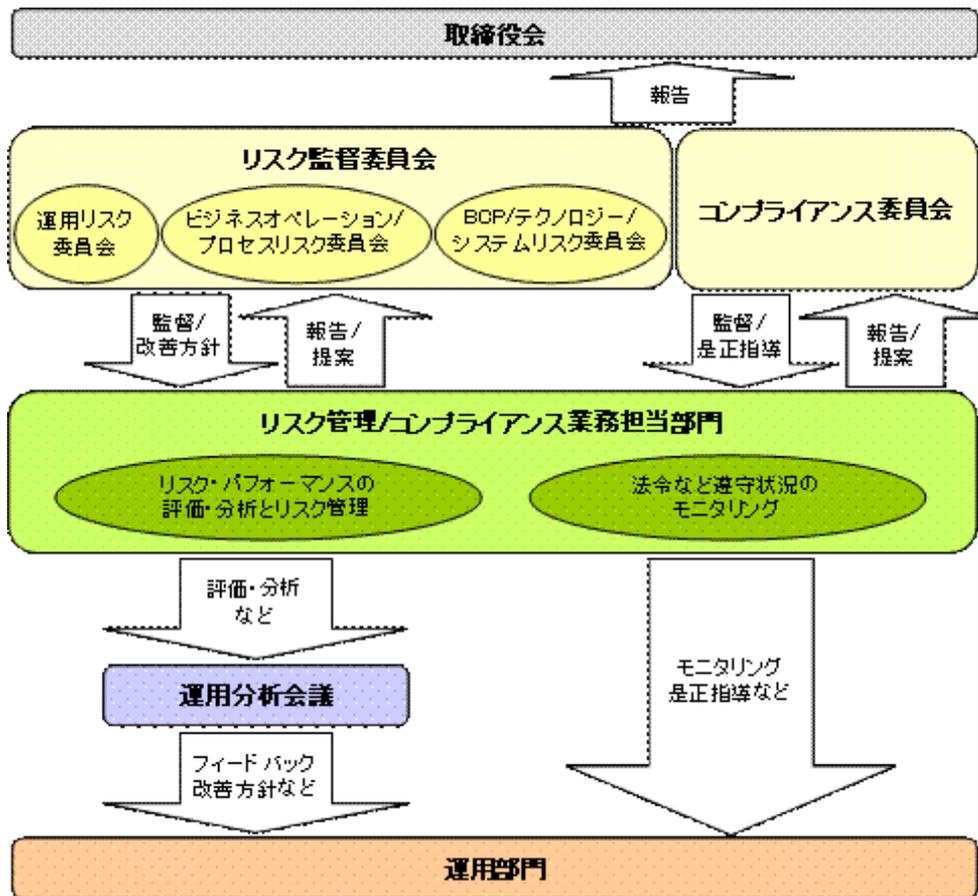
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

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

(2) リスク管理体制



全社的リスク管理

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

リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.05%（税抜1%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

(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% | 0.15750% | 0.36750% | 0.03675% |
| （0.535%） | （0.150%） | （0.350%） | （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。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

確定拠出年金でない場合

1) 個人受益者の場合

イ) 収益分配金に対する課税

- ・ 収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、平成25年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。
- ・ なお、平成26年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

ロ) 解約金および償還金に対する課税

- ・ 解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、平成25年12月31日までは軽減税率が適用され、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。
* 解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益
- ・ なお、平成26年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税5%）となる予定です。

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当等（申告分離課税を選択したものに限り、）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。

2) 法人受益者の場合

イ) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

- ・ 収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、平成25年12月31日までは軽減税率が適用され、7%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。
- ・ なお、平成26年1月1日以降は、上記の7%の税率は15%（所得税のみ）となる予定です。

ロ) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

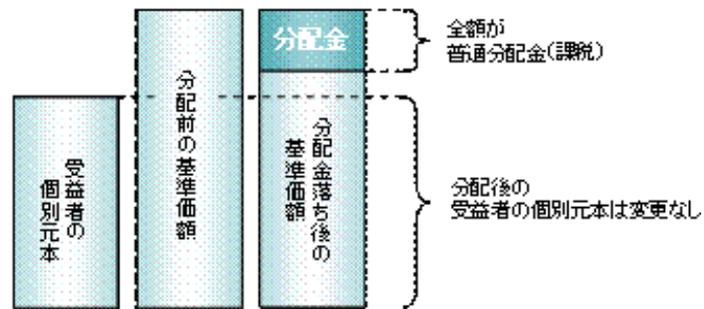
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と特別分配金

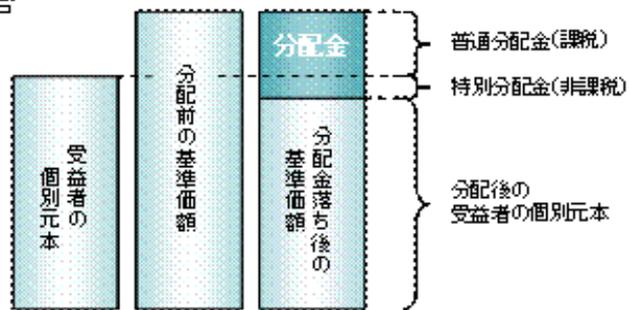
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から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

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は本書提出日現在のものであり、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

| 資産の種類 | 国・地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,543,440,948 | 95.02 |
| コール・ローン等、その他資産(負債控除後) | - | 80,863,516 | 4.98 |
| 合計(純資産総額) | | 1,624,304,464 | 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 | 857,034,625 | 1.2287 | 1,053,123,807 | 1.2255 | 1,050,295,932 | 64.66 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド | 435,235,271 | 0.5799 | 252,431,415 | 0.5665 | 246,560,781 | 15.18 |
| 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 | 58,682,715 | 1.3972 | 81,995,863 | 1.3940 | 81,803,704 | 5.04 |
| 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 | 64,526,877 | 1.2629 | 81,496,580 | 1.2558 | 81,032,852 | 4.99 |
| 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 | 53,552,543 | 0.7986 | 42,771,034 | 0.7853 | 42,054,812 | 2.59 |
| 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 | 56,918,590 | 0.7537 | 42,901,680 | 0.7325 | 41,692,867 | 2.57 |

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 | 95.02 |
| 合計 | 95.02 |

【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1計算期間末 | 2002年10月28日 | 35 | 35 | 0.9842 | 0.9842 |
| 第2計算期間末 | 2003年10月27日 | 327 | 327 | 1.0143 | 1.0143 |
| 第3計算期間末 | 2004年10月26日 | 469 | 469 | 1.0398 | 1.0398 |
| 第4計算期間末 | 2005年10月26日 | 690 | 690 | 1.0975 | 1.0985 |
| 第5計算期間末 | 2006年10月26日 | 943 | 944 | 1.1386 | 1.1396 |
| 第6計算期間末 | 2007年10月26日 | 1,232 | 1,233 | 1.1548 | 1.1558 |
| 第7計算期間末 | 2008年10月27日 | 1,186 | 1,187 | 1.0082 | 1.0092 |
| 第8計算期間末 | 2009年10月26日 | 1,364 | 1,365 | 1.0840 | 1.0850 |
| 第9計算期間末 | 2010年10月26日 | 1,518 | 1,520 | 1.0943 | 1.0953 |
| 第10計算期間末 | 2011年10月26日 | 1,622 | 1,623 | 1.0843 | 1.0853 |
| | 2010年11月末日 | 1,530 | - | 1.0919 | - |
| | 12月末日 | 1,558 | - | 1.1031 | - |
| | 2011年 1月末日 | 1,562 | - | 1.1030 | - |
| | 2月末日 | 1,579 | - | 1.1105 | - |
| | 3月末日 | 1,584 | - | 1.1022 | - |
| | 4月末日 | 1,589 | - | 1.1035 | - |
| | 5月末日 | 1,598 | - | 1.1021 | - |
| | 6月末日 | 1,614 | - | 1.1044 | - |
| | 7月末日 | 1,623 | - | 1.1019 | - |
| | 8月末日 | 1,618 | - | 1.0878 | - |
| | 9月末日 | 1,624 | - | 1.0855 | - |
| | 10月末日 | 1,637 | - | 1.0901 | - |
| | 11月末日 | 1,624 | - | 1.0763 | - |

【分配の推移】

| 期 | 期間 | 1口当たりの分配金(円) |
|------|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2001年10月17日～2002年10月28日 | 0 |
| 第2期 | 2002年10月29日～2003年10月27日 | 0 |
| 第3期 | 2003年10月28日～2004年10月26日 | 0 |
| 第4期 | 2004年10月27日～2005年10月26日 | 0.0010 |
| 第5期 | 2005年10月27日～2006年10月26日 | 0.0010 |
| 第6期 | 2006年10月27日～2007年10月26日 | 0.0010 |
| 第7期 | 2007年10月27日～2008年10月27日 | 0.0010 |
| 第8期 | 2008年10月28日～2009年10月26日 | 0.0010 |
| 第9期 | 2009年10月27日～2010年10月26日 | 0.0010 |
| 第10期 | 2010年10月27日～2011年10月26日 | 0.0010 |

【収益率の推移】

| 期 | 期間 | 収益率（％） |
|------|-------------------------|--------|
| 第1期 | 2001年10月17日～2002年10月28日 | 1.58 |
| 第2期 | 2002年10月29日～2003年10月27日 | 3.06 |
| 第3期 | 2003年10月28日～2004年10月26日 | 2.51 |
| 第4期 | 2004年10月27日～2005年10月26日 | 5.65 |
| 第5期 | 2005年10月27日～2006年10月26日 | 3.84 |
| 第6期 | 2006年10月27日～2007年10月26日 | 1.51 |
| 第7期 | 2007年10月27日～2008年10月27日 | 12.61 |
| 第8期 | 2008年10月28日～2009年10月26日 | 7.62 |
| 第9期 | 2009年10月27日～2010年10月26日 | 1.04 |
| 第10期 | 2010年10月27日～2011年10月26日 | 0.82 |

(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1期 | 2001年10月17日～2002年10月28日 | 37,200,331 | 1,266,360 |
| 第2期 | 2002年10月29日～2003年10月27日 | 298,482,503 | 11,311,142 |
| 第3期 | 2003年10月28日～2004年10月26日 | 163,598,864 | 34,921,579 |
| 第4期 | 2004年10月27日～2005年10月26日 | 243,203,075 | 66,085,606 |
| 第5期 | 2005年10月27日～2006年10月26日 | 309,671,372 | 110,123,559 |
| 第6期 | 2006年10月27日～2007年10月26日 | 378,593,991 | 139,738,607 |
| 第7期 | 2007年10月27日～2008年10月27日 | 248,517,312 | 139,283,463 |
| 第8期 | 2008年10月28日～2009年10月26日 | 197,072,016 | 115,211,172 |
| 第9期 | 2009年10月27日～2010年10月26日 | 244,582,570 | 114,951,085 |
| 第10期 | 2010年10月27日～2011年10月26日 | 198,251,017 | 89,951,708 |

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

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

その他の資産の投資状況

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

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

| | | | | | | | | | |
|----|----|--------------|-------|---------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 46,300 | 3,955.90 | 183,158,500 | 3,805.00 | 176,171,500 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 247,000 | 729.75 | 180,249,000 | 712.00 | 175,864,000 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | 国際石油開発帝石 | 鉱業 | 336 | 524,031.25 | 176,074,500 | 504,000.00 | 169,344,000 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 92,400 | 1,810.00 | 167,244,200 | 1,832.00 | 169,276,800 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 57,400 | 2,819.35 | 161,830,700 | 2,938.00 | 168,641,200 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 14,100 | 11,180.00 | 157,638,000 | 11,630.00 | 163,983,000 | 0.66 |

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
< 有価証券先物取引等 >

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 名称 | 建別 | 数量 | 通貨 | 契約額等 (各通貨) | 評価額(円) | 投資 比率 (%) |
|----------|----|-------------|---------------------------|----|----|-----|---------------|-------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | 日本 | 東京証券取引 所 | 東証株価指数先 物 2011年1 2月 | 買建 | 38 | 日本円 | 282,304,849 | 276,450,000 | 1.11 |

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

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

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

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

その他の資産の投資状況

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

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

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

| | |
|-----|-------|
| 合 計 | 97.61 |
|-----|-------|

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 < 有価証券先物取引等 >

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

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

< 為替予約取引 >

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

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

その他の資産の投資状況

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

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

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量又は額面総額 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|---------|----|-------------------------------------|----------------------------|----------|-----------|------------|-----------|------------|---------|
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 3,327 | 6,206.65 | 20,649,515 | 6,010.54 | 19,997,069 | 1.81 |
| アメリカ | 株式 | APPLE COMPUTER INC | テクノロジー・ハードウェア および機器 | 625 | 31,077.77 | 19,423,606 | 29,158.12 | 18,223,822 | 1.65 |
| アメリカ | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | ソフトウェア・サービス | 819 | 14,091.53 | 11,540,960 | 14,136.84 | 11,578,073 | 1.05 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 1,357 | 8,164.58 | 11,079,341 | 7,609.08 | 10,325,522 | 0.93 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 2,344 | 4,329.90 | 10,149,285 | 4,304.43 | 10,089,583 | 0.91 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 5,133 | 2,095.45 | 10,755,927 | 1,940.75 | 9,961,865 | 0.90 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 1,884 | 5,040.17 | 9,495,673 | 4,885.47 | 9,204,223 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス | 1,850 | 4,976.10 | 9,205,784 | 4,905.00 | 9,074,252 | 0.82 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 3,997 | 2,219.67 | 8,872,034 | 2,192.33 | 8,762,734 | 0.79 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO. | 資本財 | 7,157 | 1,267.27 | 9,069,841 | 1,165.70 | 8,342,912 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス | 5,332 | 1,474.31 | 7,861,037 | 1,515.72 | 8,081,829 | 0.73 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 171 | 45,562.29 | 7,791,151 | 45,544.32 | 7,788,078 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 1,394 | 5,230.80 | 7,291,740 | 5,171.42 | 7,208,966 | 0.65 |
| イギリス | 株式 | VODAFONE GROUP PLC | 電気通信サービス | 34,594 | 212.26 | 7,343,016 | 207.02 | 7,161,655 | 0.65 |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC | 銀行 | 12,022 | 640.08 | 7,695,041 | 593.20 | 7,131,471 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 食品・飲料・タバコ | 1,204 | 5,378.47 | 6,475,676 | 5,817.56 | 7,004,341 | 0.63 |
| イギリス | 株式 | BP PLC | エネルギー | 12,731 | 557.42 | 7,096,491 | 534.98 | 6,810,892 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 3,577 | 1,924.34 | 6,883,370 | 1,842.31 | 6,589,926 | 0.60 |
| スイス | 株式 | NOVARTIS AG-REG | 医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス | 1,579 | 4,253.49 | 6,716,260 | 4,145.67 | 6,546,008 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 3,390 | 1,996.22 | 6,767,190 | 1,881.37 | 6,377,845 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | ORACLE CORP | ソフトウェア・サービス | 2,740 | 2,529.07 | 6,929,646 | 2,323.59 | 6,366,626 | 0.58 |
| イギリス | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | エネルギー | 2,425 | 2,720.04 | 6,596,085 | 2,610.31 | 6,329,994 | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 各種金融 | 2,681 | 2,616.57 | 7,015,034 | 2,231.39 | 5,982,364 | 0.54 |
| オーストラリア | 株式 | BHP BILLITON LTD | 素材 | 2,174 | 2,920.82 | 6,349,859 | 2,748.73 | 5,975,735 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | WAL-MART STORES INC | 食品・生活必需品小売り | 1,288 | 4,430.75 | 5,706,808 | 4,544.82 | 5,853,730 | 0.53 |
| イギリス | 株式 | GLAXOSMITHKLINE PLC | 医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス | 3,492 | 1,684.93 | 5,883,790 | 1,666.65 | 5,819,929 | 0.53 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス | 476 | 11,987.88 | 5,706,230 | 12,021.84 | 5,722,395 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・バイオテクノロジー ・ライフサイエンス | 2,081 | 2,571.26 | 5,350,788 | 2,693.92 | 5,606,052 | 0.51 |
| フランス | 株式 | TOTAL SA | エネルギー | 1,431 | 3,930.48 | 5,624,512 | 3,881.00 | 5,553,713 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | V E R I Z O N COMMUNICATIONS INC | 電気通信サービス | 1,908 | 2,827.52 | 5,394,917 | 2,861.90 | 5,460,508 | 0.49 |

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 < 有価証券先物取引等 >

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

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

[次へ](#)

< 為替予約取引 >

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

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

（参考）日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）投資状況

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率（％） | 償還期限 | 数量又は額面総額 | 簿価単価（円） | 簿価金額（円） | 評価単価（円） | 評価金額（円） | 投資比率（％） |
|------|------|----------------|-------|------------|-------------|---------|-------------|---------|-------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 第299回利付国債（10年） | 1.300 | 2019/03/20 | 750,000,000 | 104.98 | 787,395,000 | 104.27 | 782,010,000 | 2.48 |
| 日本 | 国債証券 | 第69回利付国債（5年） | 0.900 | 2012/12/20 | 633,000,000 | 100.88 | 638,590,050 | 100.81 | 638,133,630 | 2.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第60回利付国債（20年） | 1.400 | 2022/12/20 | 545,000,000 | 102.97 | 561,219,200 | 102.30 | 557,524,100 | 1.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第290回利付国債（10年） | 1.400 | 2018/03/20 | 446,000,000 | 105.69 | 471,413,080 | 105.10 | 468,750,460 | 1.49 |
| 日本 | 国債証券 | 第81回利付国債（5年） | 0.800 | 2014/03/20 | 444,000,000 | 101.50 | 450,691,080 | 101.48 | 450,575,640 | 1.43 |
| 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債（10年） | 1.400 | 2019/09/20 | 361,000,000 | 105.46 | 380,739,480 | 104.75 | 378,133,060 | 1.20 |
| 日本 | 国債証券 | 第268回利付国債（10年） | 1.500 | 2015/03/20 | 361,000,000 | 104.28 | 376,454,410 | 104.11 | 375,837,100 | 1.19 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債（10年） | 1.300 | 2019/12/20 | 358,000,000 | 104.49 | 374,102,840 | 103.74 | 371,382,040 | 1.18 |
| 日本 | 国債証券 | 第313回利付国債（10年） | 1.300 | 2021/03/20 | 340,000,000 | 103.37 | 351,461,400 | 102.59 | 348,816,200 | 1.11 |
| 日本 | 国債証券 | 第88回利付国債（20年） | 2.300 | 2026/06/20 | 300,000,000 | 111.13 | 333,402,000 | 110.07 | 330,222,000 | 1.05 |
| 日本 | 国債証券 | 第93回利付国債（5年） | 0.500 | 2015/12/20 | 300,000,000 | 100.85 | 302,574,000 | 100.72 | 302,154,000 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第291回利付国債（10年） | 1.300 | 2018/03/20 | 287,000,000 | 105.04 | 301,482,020 | 104.49 | 299,897,780 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第282回利付国債（10年） | 1.700 | 2016/09/20 | 274,000,000 | 106.53 | 291,914,120 | 106.21 | 291,020,880 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第250回利付国債（10年） | 0.500 | 2013/06/20 | 285,000,000 | 100.59 | 286,695,750 | 100.58 | 286,641,600 | 0.91 |
| 日本 | 国債証券 | 第261回利付国債（10年） | 1.800 | 2014/06/20 | 270,000,000 | 104.26 | 281,510,100 | 104.14 | 281,164,500 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第29回利付国債（30年） | 2.400 | 2038/09/20 | 246,000,000 | 110.57 | 272,002,200 | 109.85 | 270,235,920 | 0.86 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|-------|------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第310回利付国債(10年) | 1.000 | 2020/09/20 | 268,000,000 | 101.23 | 271,320,520 | 100.53 | 269,415,040 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付国債(10年) | 1.500 | 2017/12/20 | 254,000,000 | 106.23 | 269,844,520 | 105.71 | 268,500,860 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第292回利付国債(10年) | 1.700 | 2018/03/20 | 241,000,000 | 107.58 | 259,289,490 | 106.96 | 257,763,960 | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第50回利付国債(20年) | 1.900 | 2021/03/22 | 237,000,000 | 108.70 | 257,628,480 | 107.84 | 255,571,320 | 0.81 |
| 日本 | 国債証券 | 第88回利付国債(5年) | 0.500 | 2015/03/20 | 245,000,000 | 100.92 | 247,261,350 | 100.85 | 247,077,600 | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第33回利付国債(20年) | 3.800 | 2016/09/20 | 200,000,000 | 116.77 | 233,550,000 | 116.23 | 232,462,000 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第252回利付国債(10年) | 1.000 | 2013/06/20 | 228,000,000 | 101.41 | 231,217,080 | 101.34 | 231,064,320 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第298回利付国債(10年) | 1.300 | 2018/12/20 | 221,000,000 | 105.04 | 232,138,400 | 104.31 | 230,516,260 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第285回利付国債(10年) | 1.700 | 2017/03/20 | 216,000,000 | 106.99 | 231,102,720 | 106.57 | 230,182,560 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第251回利付国債(10年) | 0.900 | 2013/06/20 | 227,000,000 | 101.24 | 229,832,960 | 101.19 | 229,701,300 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第264回利付国債(10年) | 1.500 | 2014/09/20 | 221,000,000 | 103.77 | 229,347,170 | 103.67 | 229,101,860 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第70回利付国債(5年) | 0.800 | 2013/03/20 | 227,000,000 | 100.93 | 229,115,640 | 100.87 | 228,968,090 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第14回利付国債(30年) | 2.400 | 2034/03/20 | 208,000,000 | 110.72 | 230,299,680 | 109.72 | 228,213,440 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第92回利付国債(20年) | 2.100 | 2026/12/20 | 210,000,000 | 108.13 | 227,083,500 | 107.17 | 225,048,600 | 0.71 |

ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

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

その他の資産の投資状況

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

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.59 |
| 合計 | 98.59 |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
<為替予約取引>

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考) 海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

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

その他の資産の投資状況

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

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.32 |
| 合計 | 96.32 |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
 < 為替予約取引 >

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

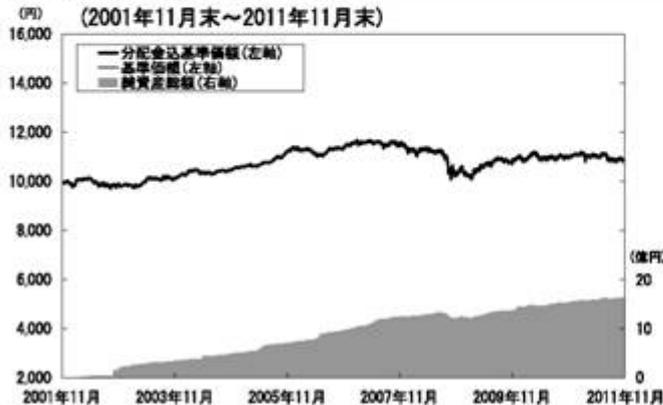
(注) 為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(参考情報)

運用実績

2011年11月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....10,763円

純資産総額.....16.24億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金込基準価額は、2001年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金込基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したも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)

| 2007年10月 | 2008年10月 | 2009年10月 | 2010年10月 | 2011年10月 | 設定来累計 |
|----------|----------|----------|----------|----------|-------|
| 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 10円 | 70円 |

主要な資産の状況

＜資産構成比率＞

| 組入資産 | 比率 |
|-----------------------------------------|--------|
| 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド | 15.18% |
| 海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド | 2.59% |
| 海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジあり) マザーファンド | 2.57% |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 64.66% |
| 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド | 5.04% |
| 海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド | 4.99% |
| 現金その他 | 4.98% |

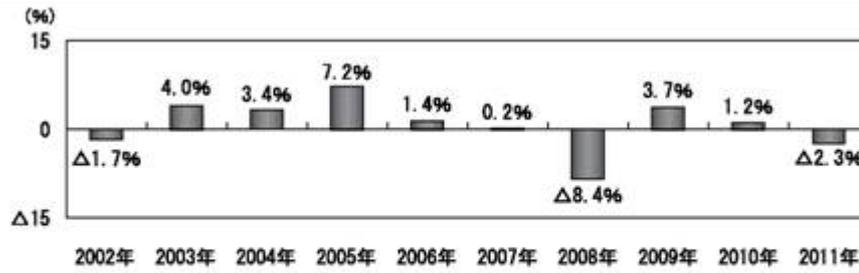
※当ファンドの対純資産総額比です。

＜組入上位銘柄＞

| 組入資産 | 銘柄 | 通貨 | 業種 | 比率 | |
|------------------------------------------------|------------------------------------|--------|------------------------|------------|-------|
| 日本株式インデックス TOPIXマザーファンド | 1 トヨタ自動車 | 日本円 | 輸送用機器 | 3.20% | |
| | 2 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本円 | 銀行業 | 2.44% | |
| | 3 キヤノン | 日本円 | 電気機器 | 2.11% | |
| 海外株式インデックス MSCI-KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド | 1 EXXON MOBIL CORP | アメリカドル | エネルギー | 1.88% | |
| | 2 APPLE COMPUTER INC | アメリカドル | テクノロジー・ハード ウェアおよび機器 | 1.71% | |
| | 3 INTL BUSINESS MACHINES CORP | アメリカドル | ソフトウェア・サービス | 1.09% | |
| 海外株式インデックス MSCI-KOKUSA I (ヘッジあり) マザーファンド | 1 EXXON MOBIL CORP | アメリカドル | エネルギー | 1.81% | |
| | 2 APPLE COMPUTER INC | アメリカドル | テクノロジー・ハード ウェアおよび機器 | 1.65% | |
| | 3 INTL BUSINESS MACHINES CORP | アメリカドル | ソフトウェア・サービス | 1.05% | |
| 組入資産 | 銘柄 | 通貨 | 種類 | 償還期限 | 比率 |
| 日本債券インデックス マザーファンド | 1 第299回利付国債(10年) | 日本円 | 国債証券 | 2019/3/20 | 2.48% |
| | 2 第69回利付国債(5年) | 日本円 | 国債証券 | 2012/12/20 | 2.02% |
| | 3 第60回利付国債(20年) | 日本円 | 国債証券 | 2022/12/20 | 1.77% |
| 海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド | 1 US TREASURY N/B(クーポン3.625%) | アメリカドル | 国債証券 | 2020/2/15 | 0.95% |
| | 2 US TREASURY N/B(クーポン3.625%) | アメリカドル | 国債証券 | 2021/2/15 | 0.82% |
| | 3 US TREASURY N/B(クーポン3.625%) | アメリカドル | 国債証券 | 2013/5/15 | 0.81% |
| 海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド | 1 US TREASURY N/B(クーポン3.625%) | アメリカドル | 国債証券 | 2020/2/15 | 1.12% |
| | 2 US TREASURY N/B(クーポン0.5%) | アメリカドル | 国債証券 | 2012/11/30 | 1.05% |
| | 3 BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND(クーポン4%) | ユーロ | 国債証券 | 2016/7/4 | 0.94% |

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2011年は、2011年11月末までの繰落率です。

※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。

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。なお、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、当該規定に従うものとします。

(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。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

<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。

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、解約価額に基づいて計算された金額となります。

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関でない場合、解約価額から所得税および地方税が差し引かれます。

税法または確定拠出年金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。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

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

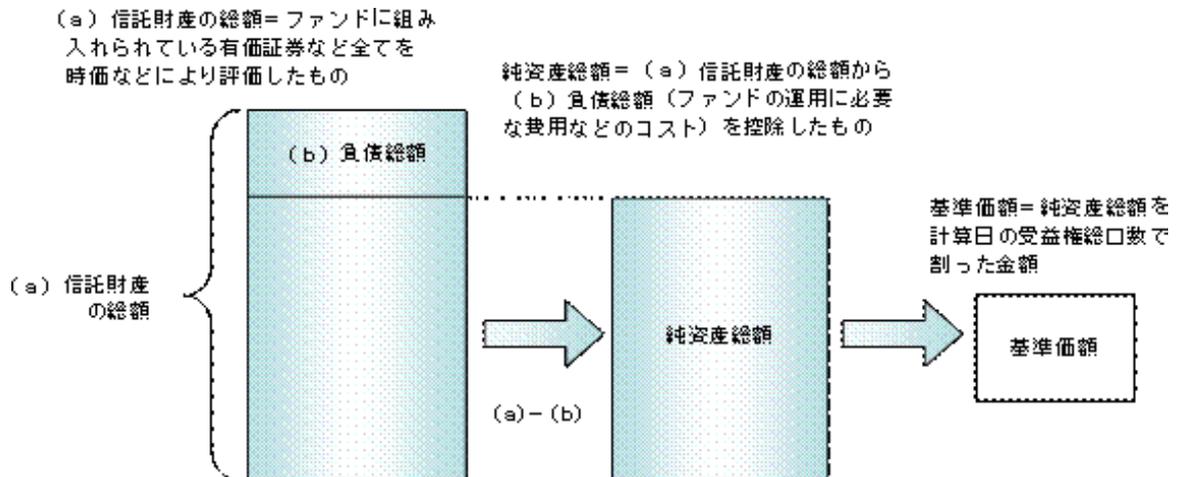
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

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

c) 価格情報会社の提供する価額

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

^{*}外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします（平成13年10月17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、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。
- 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。

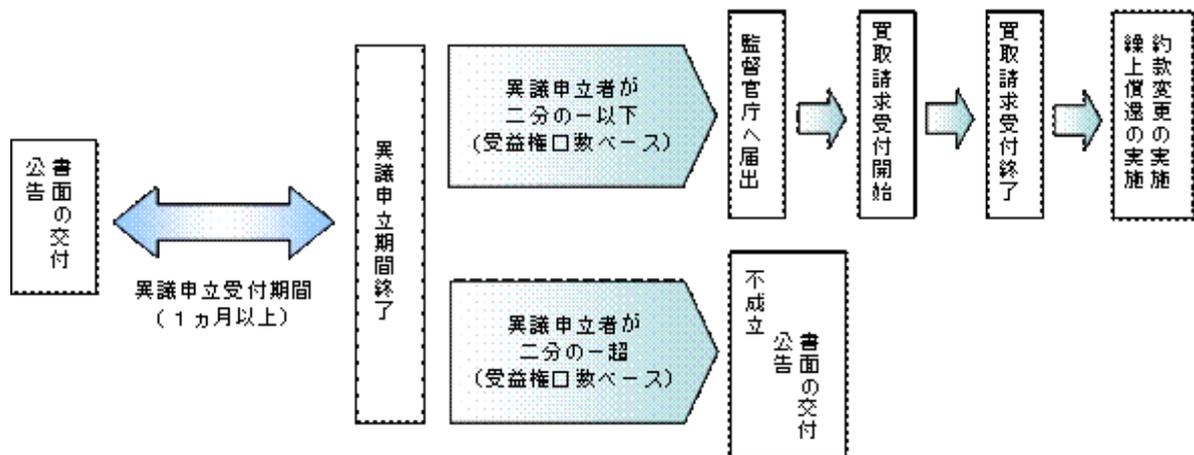
信託約款の変更

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

異議の申立て

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

< 繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ >



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

委託会社は、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9期計算期間（平成21年10月27日から平成22年10月26日まで）及び第10期計算期間（平成22年10月27日から平成23年10月26日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第9期 平成22年10月26日現在 | 第10期 平成23年10月26日現在 |
|-----------------|----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 80,666,433 | 86,006,582 |
| 親投資信託受益証券 | 1,444,406,562 | 1,542,498,077 |
| 未収利息 | 191 | 160 |
| その他未収収益 | 86 | - |
| 流動資産合計 | 1,525,073,272 | 1,628,504,819 |
| 資産合計 | 1,525,073,272 | 1,628,504,819 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 1,388,029 | 1,496,328 |
| 未払解約金 | 499,256 | 263 |
| 未払受託者報酬 | 274,870 | 296,412 |
| 未払委託者報酬 | 3,927,562 | 4,235,364 |
| その他未払費用 | 47,066 | 50,766 |
| 流動負債合計 | 6,136,783 | 6,079,133 |
| 負債合計 | 6,136,783 | 6,079,133 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,388,029,461 | 1,496,328,770 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 130,907,028 | 126,096,916 |
| （分配準備積立金） | 98,379,921 | 110,463,819 |
| 元本等合計 | 1,518,936,489 | 1,622,425,686 |
| 純資産合計 | 1,518,936,489 | 1,622,425,686 |
| 負債純資産合計 | 1,525,073,272 | 1,628,504,819 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第9期 | 第10期 |
|-------------------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 73,409 | 56,602 |
| 有価証券売買等損益 | 23,299,326 | 5,337,860 |
| その他収益 | 86 | - |
| 営業収益合計 | 23,372,821 | 5,281,258 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 536,984 | 582,149 |
| 委託者報酬 | 7,672,871 | 8,318,163 |
| その他費用 | 91,949 | 99,697 |
| 営業費用合計 | 8,301,804 | 9,000,009 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 15,071,017 | 14,281,267 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 15,071,017 | 14,281,267 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 15,071,017 | 14,281,267 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 1,182,760 | 223,087 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 105,677,428 | 130,907,028 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 22,285,867 | 19,585,012 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 22,285,867 | 19,585,012 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 9,556,495 | 8,394,442 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 9,556,495 | 8,394,442 |
| 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 | 1,388,029 | 1,496,328 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 130,907,028 | 126,096,916 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 期別 | 第9期 | 第10期 |
|-----------------|----|--------------------------------------------------|--------------------------------|
| | | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 | 親投資信託受益証券 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| | 第9期 | 第10期 |
|---------------------|----------------|----------------|
| | 平成22年10月26日現在 | 平成23年10月26日現在 |
| 1. 期首元本額 | 1,258,397,976円 | 1,388,029,461円 |
| 期中追加設定元本額 | 244,582,570円 | 198,251,017円 |
| 期中一部解約元本額 | 114,951,085円 | 89,951,708円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 1,388,029,461口 | 1,496,328,770口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| | 第9期 | 第10期 |
|-----------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
| 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 | 17,232,597円 | 19,402,991円 |
| B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 | 0円 | 0円 |
| C 信託約款に定める収益調整金 | 161,288,350円 | 187,647,345円 |
| D 信託約款に定める分配準備積立金 | 82,535,353円 | 92,557,156円 |
| E 分配対象収益(A+B+C+D) | 261,056,300円 | 299,607,492円 |
| F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり) | 0.1880円 1,880円 | 0.2002円 2,002円 |
| G 分配金額 | 1,388,029円 | 1,496,328円 |
| H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり) | 0.0010円 10円 | 0.0010円 10円 |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

I 金融商品の状況に関する事項

| | 第9期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 第10期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

| | 第9期 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 第10期 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。 | 同左 |
| 時価の算定方法 | (1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。 | (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左 |
| 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

第9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 | 21,025,690 |
| 合計 | 21,025,690 |

第10期（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 8,441,467 |
| 合計 | 8,441,467 |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

| 第9期 平成22年10月26日現在 | | 第10期 平成23年10月26日現在 | |
|----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0943円 | 1口当たり純資産額 | 1.0843円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,943円) | (1万口当たり純資産額) | (10,843円) |

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|--------------------------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド | 51,872,631 | 41,492,917 | |
| | 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド | 55,334,366 | 41,782,979 | |
| | 日本債券インデックスマザーファンド | 859,272,618 | 1,055,960,120 | |
| | 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド | 57,928,997 | 80,949,980 | |
| | 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド | 64,172,278 | 81,062,421 | |
| | 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド | 415,732,657 | 241,249,660 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 1,504,313,547 | 1,542,498,077 | |
| 合計 | | 1,504,313,547 | 1,542,498,077 | |

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考）

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

1. 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> | <p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> | <p>デリバティブ取引 同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成22年10月26日現在 | | 平成23年10月26日現在 | |
|------------------------------|-----------------|------------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 平成21年10月27日 | 1. 期首 | 平成22年10月27日 |
| 期首元本額 | 47,548,685,652円 | 期首元本額 | 49,105,983,953円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 5,523,889,970円 | 期首からの追加設定元本額 | 5,609,550,412円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 3,966,591,669円 | 期首からの一部解約元本額 | 11,025,064,797円 |
| 平成22年10月26日現在の元本の内訳 | | 平成23年10月26日現在の元本の内訳 | |
| DCインデックスバランス(株式20) | 172,322,155円 | DCインデックスバランス(株式20) | 206,215,746円 |
| DCインデックスバランス(株式40) | 629,565,241円 | DCインデックスバランス(株式40) | 727,392,748円 |
| DCインデックスバランス(株式60) | 1,189,744,460円 | DCインデックスバランス(株式60) | 1,350,038,732円 |
| DCインデックスバランス(株式80) | 1,316,027,100円 | DCインデックスバランス(株式80) | 1,458,941,916円 |
| インデックスファンド日本株式(DC専用) | 813,409,526円 | インデックスファンド日本株式(DC専用) | 858,875,812円 |
| 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 23,716,643,805円 | 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 17,904,058,440円 |
| 全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型 | 16,256,389円 | 全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型 | 18,463,705円 |
| 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産) | 210,234,997円 | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産) | 115,263,678円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 204,289,499円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 189,329,485円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 183,434,010円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 179,388,657円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 307,907,482円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 287,530,250円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 395,508,371円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 370,262,226円 |
| 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 15,717,656,118円 | 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 15,412,394,449円 |
| 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 107,980,343円 | 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 100,153,698円 |
| 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 137,633,484円 | 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 119,668,905円 |
| 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け) | 149,865,311円 | 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け) | 87,210,578円 |
| グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け) | 86,264,583円 | グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け) | 80,792,748円 |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 363,391,246円 | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 415,732,657円 |

| | | | |
|--------------------------------------------------------------------|-----------------|----------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40) | 941,367,712円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40) | 1,073,051,458円 |
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60) | 1,223,412,493円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60) | 1,386,467,143円 |
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80) | 1,223,069,628円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80) | 1,349,236,537円 |
| 計 | 49,105,983,953円 | 計 | 43,690,469,568円 |
| 2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数 | 49,105,983,953口 | 2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数 | 43,690,469,568口 |
| 3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は18,632,035,463円であります。 | | 3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は18,338,211,224円であります。 | |
| 4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりであります。 | | 4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりでありま す。 | |
| 株式 | 215,771,500円 | 株式 | 205,666,000円 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

I 金融商品の状況に関する事項

| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

対象期間(自平成21年10月27日 至 平成22年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

対象期間(自平成22年10月27日 至 平成23年10月26日)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

(平成23年10月26日現在)

(単位:円)

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

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

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

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

（単位：円）

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> | <p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>(1) デリバティブ取引 同左</p> <p>(2) 為替予約取引 同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

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

| | | | |
|--------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80） | 154,166,467円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80） | 171,518,965円 |
| 年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし） | 7,934,385,820円 | 年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし） | 8,188,362,160円 |
| 計 | 83,174,708,677円 | 計 | 76,714,471,608円 |
| 2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数 | 83,174,708,677口 | 2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数 | 76,714,471,608口 |
| 3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は12,695,734,540円であります。 | | 3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は15,347,453,540円であります。 | |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位：円)

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

(平成23年10月26日現在)

(単位：円)

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

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位：円)

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

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

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

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

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

(3) 附属明細表
 第1 有価証券明細表
 (1) 株式

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表 該当事項はありません。

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

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> | <p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>(1) デリバティブ取引 同左</p> <p>(2) 為替予約取引 同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成22年10月26日現在 | | 平成23年10月26日現在 | |
|-------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------------------------------------------|----------------|
| 1. 期首 | 平成21年10月27日 | 1. 期首 | 平成22年10月27日 |
| 期首元本額 | 1,614,863,595円 | 期首元本額 | 1,538,197,145円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 217,142,879円 | 期首からの追加設定元本額 | 272,831,118円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 293,809,329円 | 期首からの一部解約元本額 | 274,027,568円 |
| 平成22年10月26日現在の元本の内訳 | | 平成23年10月26日現在の元本の内訳 | |
| インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用) | 38,654,679円 | インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用) | 64,752,515円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 28,632,726円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 25,492,804円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 25,403,258円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 23,400,681円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 43,971,345円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 37,805,820円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 55,609,612円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 48,704,085円 |
| 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 275,847,116円 | 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 249,152,260円 |
| 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 175,788,379円 | 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 148,559,996円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 50,868,457円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 55,334,366円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 134,748,767円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 144,048,458円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 179,699,924円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 186,651,352円 |
| 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 174,322,044円 | 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 181,869,179円 |
| 年金積立 インデックスファンド海外株式(ヘッジあり) | 354,650,838円 | 年金積立 インデックスファンド海外株式(ヘッジあり) | 371,229,179円 |
| 計 | 1,538,197,145円 | 計 | 1,537,000,695円 |
| 2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 1,538,197,145口 | 2. 本報告書における開示対象ファンドの当計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 1,537,000,695口 |
| 3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は360,894,816円であります。 | | 3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は376,375,604円であります。 | |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

[次へ](#)

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

(平成23年10月26日現在)

(単位:円)

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

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成22年10月26日現在)

(単位:円)

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

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

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

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

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

(3) 附属明細表
 第1 有価証券明細表
 (1) 株式

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

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

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成22年10月26日現在 | | 平成23年10月26日現在 | |
|------------------------------|-----------------|------------------------------|-----------------|
| 1. 期首 | 平成21年10月27日 | 1. 期首 | 平成22年10月27日 |
| 期首元本額 | 32,047,347,137円 | 期首元本額 | 30,762,768,556円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 3,350,844,157円 | 期首からの追加設定元本額 | 1,834,319,535円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 4,635,422,738円 | 期首からの一部解約元本額 | 6,609,299,655円 |
| 平成22年10月26日現在の元本の内訳 | | 平成23年10月26日現在の元本の内訳 | |
| DCインデックスバランス(株式20) | 388,029,008円 | DCインデックスバランス(株式20) | 423,709,192円 |
| DCインデックスバランス(株式40) | 489,494,266円 | DCインデックスバランス(株式40) | 516,868,348円 |
| DCインデックスバランス(株式60) | 343,462,663円 | DCインデックスバランス(株式60) | 356,183,324円 |
| DCインデックスバランス(株式80) | 56,702,947円 | DCインデックスバランス(株式80) | 57,515,142円 |
| インデックスファンド日本債券(DC専用) | 1,007,601,193円 | インデックスファンド日本債券(DC専用) | 942,608,257円 |
| 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 12,249,463,950円 | 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 8,531,446,815円 |
| 全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型 | 8,345,587円 | 全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型 | 8,870,100円 |
| 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産) | 325,399,586円 | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産) | 107,254,030円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 8,799,680円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 7,509,748円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 52,735,661円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 47,227,701円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 240,783,526円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 206,207,797円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 886,263,682円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 763,311,408円 |
| 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 8,271,026,934円 | 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 7,235,704,540円 |
| 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 139,502,268円 | 世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け) | 120,739,574円 |
| 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 248,939,352円 | 世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け) | 202,158,237円 |
| 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け) | 79,034,403円 | 3資産バランスファンド(適格機関投資家向け) | 43,921,010円 |
| グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け) | 35,012,949円 | グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け) | 31,153,491円 |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 812,888,389円 | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 859,272,618円 |
| 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 730,770,394円 | 年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 766,664,045円 |

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

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

[次へ](#)

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

(単位：円)

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

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

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

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

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

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

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

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

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

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

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

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

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

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>為替予約取引 同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p> |

[次へ](#)

(貸借対照表に関する注記)

| 平成22年10月26日現在 | | 平成23年10月26日現在 | |
|------------------------------|------------------|------------------------------|------------------|
| 1. 期首 | 平成21年10月27日 | 1. 期首 | 平成22年10月27日 |
| 期首元本額 | 449,277,081,384円 | 期首元本額 | 410,189,621,640円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 8,920,901,490円 | 期首からの追加設定元本額 | 13,628,129,297円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 48,008,361,234円 | 期首からの一部解約元本額 | 95,509,887,179円 |
| 平成22年10月26日現在の元本の内訳 | | 平成23年10月26日現在の元本の内訳 | |
| インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用) | 8,849,948,042円 | インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用) | 9,633,553,500円 |
| DCインデックスバランス(株式20) | 49,187,094円 | DCインデックスバランス(株式20) | 57,256,999円 |
| DCインデックスバランス(株式40) | 89,554,451円 | DCインデックスバランス(株式40) | 100,709,226円 |
| DCインデックスバランス(株式60) | 112,983,693円 | DCインデックスバランス(株式60) | 124,636,684円 |
| DCインデックスバランス(株式80) | 93,970,833円 | DCインデックスバランス(株式80) | 100,852,481円 |
| 財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 225,223,007,785円 | 財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 187,390,740,040円 |
| 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 10,242,566,040円 | 世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 | 7,487,871,813円 |
| 日興五大陸債券ファンド(毎月分配型) | 144,889,238,618円 | 日興五大陸債券ファンド(毎月分配型) | 104,969,488,141円 |
| 全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型 | 51,255,807円 | 全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型 | 48,580,292円 |
| 日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,504,839,282円 | 日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,425,651,209円 |
| 財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型 | 5,135,051円 | 財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型 | 10,057,099円 |
| 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産) | 222,618,134円 | 日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産) | 76,715,712円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 7,304,227円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80) | 6,525,478円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 8,756,942円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60) | 8,247,647円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 22,154,363円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40) | 20,058,227円 |
| アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 56,414,494円 | アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20) | 51,489,457円 |
| 世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け) | 2,818,081,237円 | 世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け) | 1,462,974,398円 |
| 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 2,299,362,018円 | 国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け) | 2,125,182,549円 |

| | | | |
|-----------------------------------------------------------|------------------|-----------------------------------------------------------|------------------|
| 世界アセットバランス ファンド40(適格機関投 資家向け) | 159,927,712円 | 世界アセットバランス ファンド40(適格機関投 資家向け) | 148,756,891円 |
| 世界アセットバランス ファンド25(適格機関投 資家向け) | 232,958,379円 | 世界アセットバランス ファンド25(適格機関投 資家向け) | 203,306,467円 |
| 3資産バランスファンド (適格機関投資家向け) | 64,943,397円 | 3資産バランスファンド (適格機関投資家向け) | 37,440,232円 |
| グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け) | 66,195,683円 | グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け) | 61,780,456円 |
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式20) | 51,923,379円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式20) | 57,928,997円 |
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40) | 67,179,164円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40) | 74,856,500円 |
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60) | 57,748,422円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60) | 63,788,903円 |
| 年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80) | 43,776,744円 | 年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80) | 46,675,278円 |
| 年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし) | 12,696,715,761円 | 年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし) | 12,293,693,031円 |
| 海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け) | 201,874,888円 | 海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け) | 219,046,051円 |
| 計 | 410,189,621,640円 | 計 | 328,307,863,758円 |
| 2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数 | 410,189,621,640口 | 2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数 | 328,307,863,758口 |

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

I 金融商品の状況に関する事項

| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成22年10月26日現在）

（単位：円）

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

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

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

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

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

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

[次へ](#)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

| 種類 | 銘柄数 | 組入債券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|-------------|------------|--------------|----------------|
| 米ドル | 国債証券 138銘柄 | 100.0% | 39.8% |
| 加ドル | 国債証券 24銘柄 | 100.0% | 2.8% |
| 豪ドル | 国債証券 14銘柄 | 100.0% | 1.4% |
| 英ポンド | 国債証券 33銘柄 | 100.0% | 8.6% |
| スイスフラン | 国債証券 7銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| シンガポールドル | 国債証券 15銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| マレーシアリングgit | 国債証券 17銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 9銘柄 | 100.0% | 0.7% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 5銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| デンマーククローネ | 国債証券 7銘柄 | 100.0% | 0.9% |
| メキシコペソ | 国債証券 10銘柄 | 100.0% | 0.9% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 11銘柄 | 100.0% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券 200銘柄 | 100.0% | 42.4% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

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

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目 | 対象期間 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> | <p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> | <p>為替予約取引 同左</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p> | <p>外貨建取引等の処理基準 同左</p> |

[次へ](#)

(貸借対照表に関する注記)

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

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| | 自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日 | 自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日 |
|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |
| 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。 | 同左 |

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年10月27日 至 平成22年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

対象期間（自 平成22年10月27日 至 平成23年10月26日）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成22年10月26日現在）

（単位：円）

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

（平成23年10月26日現在）

（単位：円）

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

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

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

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2011年11月30日現在です。

【純資産額計算書】

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 1,625,564,230 円 |
| 負債総額 | 1,259,766 円 |
| 純資産総額(-) | 1,624,304,464 円 |
| 発行済口数 | 1,509,210,449 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0763 円 |

(参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 24,904,978,794 円 |
| 負債総額 | 86,673,572 円 |
| 純資産総額(-) | 24,818,305,222 円 |
| 発行済口数 | 43,807,297,125 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.5665 円 |

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

純資産額計算書

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 59,379,663,243 円 |
| 負債総額 | 77,157,354 円 |
| 純資産総額(-) | 59,302,505,889 円 |
| 発行済口数 | 75,511,309,186 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.7853 円 |

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

純資産額計算書

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 1,122,654,830 円 |
| 負債総額 | 17,357,326 円 |
| 純資産総額(-) | 1,105,297,504 円 |
| 発行済口数 | 1,508,991,585 口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.7325 円 |

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

| | |
|------|------------------|
| 資産総額 | 31,651,981,733 円 |
|------|------------------|

| | |
|----------------|------------------|
| 負債総額 | 97,301,010 円 |
| 純資産総額（ - ） | 31,554,680,723 円 |
| 発行済口数 | 25,747,841,010 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2255 円 |

（参考）海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|-------------------|
| 資産総額 | 439,765,198,262 円 |
| 負債総額 | 1,968,162,447 円 |
| 純資産総額（ - ） | 437,797,035,815 円 |
| 発行済口数 | 314,052,972,172 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3940 円 |

（参考）海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 27,837,116,683 円 |
| 負債総額 | 522,640,633 円 |
| 純資産総額（ - ） | 27,314,476,050 円 |
| 発行済口数 | 21,751,347,466 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2558 円 |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

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

過去5年間における主な資本金の増減

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

(2) 会社の意思決定機関

・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行ないます。

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

・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

・監査役会

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

（平成23年11月末現在）

(3) 運用の意思決定プロセス

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

（平成23年11月末現在）

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成23年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

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

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、改正前の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて、第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第51期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）及び第52期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

| | 第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日) | 第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) |
|--------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 資産の評価基準及び評価方法 | (1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時 価法(評価差額は、全部純資産直入 法により処理し、売却原価は、総平 均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法 | (1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左 |
| 2 固定資産の減価償却の方 法 | (1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 4年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。た だし、ソフトウェア(自社利用分)に ついては、社内における利用可能期 間(5年)に基づく定額法によってお ります。 | (1) 有形固定資産 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りで あります。 建物 5年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 同左 |
| 3 引当金の計上基準 | (1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充て るため、支払見込額に基づき当事業 年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てる ため、支払見込額に基づき当事業年 度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当 事業年度末における退職給付債務及 び年金資産の見込額に基づき計上し ております。 数理計算上の差異は、各事業年度の 発生時における従業員の平均残存勤 務期間以内の一定の年数(10年)按分 した額をそれぞれ発生の翌事業年度 から費用処理することとしておりま す。 | (1) 賞与引当金 同左 (2) 役員賞与引当金 同左 (3) 退職給付引当金 同左 |

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

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

(株主資本等変動計算書関係)

第51期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

第52期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

| 株式の種類 | 前事業年度末 株式数(株) | 当事業年度 増加株式数(株) | 当事業年度 減少株式数(株) | 当事業年度末 株式数(株) |
|-------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 普通株式 | 85,000 | 24,600 | - | 109,600 |

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

2 平成21年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第52期(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

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

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(持分法損益等)

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

（退職給付関係）

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

(ストックオプション等関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

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

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

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

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

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

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

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

単価情報

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第52期(自 平成22年4月1日至 平成23年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

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

| | 平成22年度ストックオプション(1) |
|----------|--------------------|
| 付与日 | 平成22年 8 月20日 |
| 権利確定前(株) | |
| 期首 | - |
| 付与 | 2,310,000 |
| 失効 | 0 |
| 権利確定 | 0 |
| 権利未確定残 | 2,310,000 |
| 権利確定後(株) | |
| 期首 | - |
| 権利確定 | - |
| 権利行使 | - |
| 失効 | - |
| 権利未行使残 | - |

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

| 第51期 (平成22年3月31日) | 第52期 (平成23年3月31日) |
|----------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|
| 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円) | 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：百万円) |
| 繰延税金資産(流動) | 繰延税金資産(流動) |
| 賞与引当金繰入超過額 1,309 | 賞与引当金繰入超過額 886 |
| その他 334 | その他 255 |
| 1,644 | 1,142 |
| 繰延税金資産(固定) | 繰延税金資産(固定) |
| 投資有価証券等評価損 79 | 投資有価証券等評価損 60 |
| 関係会社株式評価損 185 | 関係会社株式評価損 185 |
| 退職給付引当金超過額 302 | 退職給付引当金超過額 333 |
| 子会社投資損失引当金 234 | 固定資産減価償却超過額 234 |
| 固定資産減価償却超過額 249 | その他 99 |
| その他 64 | 912 |
| 1,115 | 繰延税金資産合計 2,054 |
| 繰延税金資産合計 2,759 | |
| 繰延税金負債(固定) | 繰延税金負債(固定) |
| その他有価証券評価差額金 83 | その他有価証券評価差額金 43 |
| 繰延税金負債合計 83 | 繰延税金負債合計 43 |
| 繰延税金資産の純額 2,676 | 繰延税金資産の純額 2,010 |
| 2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 | 2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳 |
| 法定実効税率 40.6% | 法定実効税率 40.6% |
| (調整) | (調整) |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 30.3% | 交際費等永久に損金に算入されない項目 2.7% |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 27.1% | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 7.3% |
| 海外子会社の留保利益の影響額等 13.9% | 海外子会社の留保利益の影響額等 0.5% |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 23.5% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.5% |

(関連当事者情報)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残高 (百万円) |
|-----|------------|--------|-------------------|-------|---------------------------|---------------|-----------------------------------------------|---------------|-------|---------------|
| 親会社 | 住友信託銀行株式会社 | 大阪市中央区 | 342,037 | 信託銀行業 | (被所有) 直接 98.60 (注2) | 投資信託受益証券の募集販売 | 信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1) | 308 | 未払手数料 | 24 |

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成22年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

| | |
|-------|----------|
| 資産合計 | 9,325百万円 |
| 負債合計 | 1,342百万円 |
| 純資産合計 | 7,982百万円 |

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

(セグメント情報等)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| 第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日) | | 第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) | |
|-------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| 1株当たり純資産額 | 210円58銭 | 1株当たり純資産額 | 224円92銭 |
| 1株当たり当期純損失 | 3円64銭 | 1株当たり当期純利益 | 16円22銭 |
| <p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、当事業年度は1株当たり当期純損失であるため、記載しておりません。</p> | | <p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p> | |

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

| 項目 | 第51期 (平成22年 3月31日) | 第52期 (平成23年 3月31日) |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円) | 41,470 | 44,287 |
| 普通株式に係る純資産額(百万円) | 41,470 | 44,287 |
| 差額の主な内訳(百万円) | | |
| 新株予約権 | - | - |
| 普通株式の発行済株式数(千株) | 197,013 | 197,013 |
| 普通株式の自己株式数(千株) | 85 | 110 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(千株) | 196,928 | 196,903 |

2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

| 項目 | 第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日) | 第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) |
|--------------------------------------------------|------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|
| 損益計算書上の当期純利益又は当期純損失() (百万円) | 696 | 3,195 |
| 普通株式に係る当期純利益又は当期純損失() (百万円) | 696 | 3,195 |
| 普通株主に帰属しない金額(百万円) | - | - |
| 普通株式の期中平均株式数(千株) | 190,975 | 196,926 |
| 希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要 | 平成21年度ストックオプション(1) 19,559,100株 | 平成21年度ストックオプション(1) 19,328,100株、平成21年度ストックオプション(2) 1,702,800株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株 |

(重要な後発事象)

| 第51期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日) | 第52期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日) |
|------------------------------------------|------------------------------------------|
| - | - |

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

- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期中間会計期間(平成23年4月1日から平成23年9月30日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

| 資産の部 | | |
|------------|---|--------|
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | | 17,081 |
| 未収委託者報酬 | | 5,482 |
| 未収収益 | | 589 |
| 関係会社短期貸付金 | | 434 |
| 繰延税金資産 | | 678 |
| その他 | 2 | 1,292 |
| 流動資産合計 | | 25,558 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | 1 | 217 |
| 無形固定資産 | | 84 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 2,765 |
| 関係会社株式 | | 24,320 |
| 長期差入保証金 | | 784 |
| 繰延税金資産 | | 982 |
| その他 | | 60 |
| 投資その他の資産合計 | | 28,913 |
| 固定資産合計 | | 29,214 |
| 資産合計 | | 54,773 |

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(平成23年9月30日)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第53期中間会計期間
(自 平成23年4月1日
至 平成23年9月30日)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

| 項目 | 第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日) |
|-----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 資産の評価基準及び評価方法 | <p>有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p> |
| 2 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。但し、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> |
| 3 引当金の計上基準 | <p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）で按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。</p> |
| 4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>消費税等の会計処理について 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式により、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p> |

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| 第53期中間会計期間 (平成23年 9月30日) |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1 有形固定資産の減価償却累計額 1,578 百万円</p> <p>2 信託資産 その他流動資産のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドンウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務101百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務146百万円に対して保証を行っております。</p> |

(中間損益計算書関係)

| 第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日) | |
|------------------------------------------------|---------|
| 1 減価償却実施額 | |
| 有形固定資産 | 47 百万円 |
| 無形固定資産 | 16 百万円 |
| 2 営業外収益のうち主要なもの | |
| 受取利息 | 3 百万円 |
| 受取配当金 | 752 百万円 |
| 時効成立分配金・償還金 | 34 百万円 |
| 有価証券償還益 | 19 百万円 |
| 3 営業外費用のうち主要なもの | |
| 支払利息 | 5 百万円 |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | 70 百万円 |
| 支払源泉所得税 | 74 百万円 |
| 4 特別利益のうち主要なもの | |
| 投資有価証券売却益 | 1 百万円 |
| 5 特別損失のうち主要なもの | |
| 固定資産処分損 | 1 百万円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第53期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 株式数(株) | 当中間会計期間 増加株式数(株) | 当中間会計期間 減少株式数(株) | 当中間会計期間末 株式数(株) |
|-------|-------------------|---------------------|---------------------|--------------------|
| 普通株式 | 109,600 | 14,283,400 | 14,283,400 | 109,600 |

3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

| 新株予約権の内訳 | 新株予約権の 目的となる株 式の種類 | 新株予約権の目的となる株式の数(株) | | | | 当中間会計 期間末残高 (百万円) |
|------------------------|--------------------------|--------------------|---------------|---------------|--------------|-------------------------|
| | | 当事業年度期首 | 当中間会計期 間増加 | 当中間会計期 間減少 | 当中間会計期 間末 | |
| 平成21年度ストックオプション (1) | 普通株式 | 19,328,100 | - | 49,500 | 19,278,600 | - |
| 平成21年度ストックオプション (2) | 普通株式 | 1,702,800 | - | 9,900 | 1,692,900 | - |
| 平成22年度ストックオプション (1) | 普通株式 | 2,310,000 | - | - | 2,310,000 | - |
| 第1回新株予約権 | 普通株式 | - | 2,955,200 | - | 2,955,200 | - |
| 合計 | | 23,340,900 | 2,955,200 | 59,400 | 26,236,700 | - |

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

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

| 第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日) | |
|------------------------------------------------|-----------|
| 1 オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料 | |
| 1年内 | 736 百万円 |
| 1年超 | 1,918 百万円 |
| 合計 | 2,655 百万円 |

(金融商品関係)

第53期中間会計期間（平成23年9月30日）

1 金融商品の時価等に関する事項

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

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

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

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

(有価証券関係)

第53期中間会計期間(平成23年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

| | 中間貸借対照表計上額 (百万円) | 時価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|-------|---------------------|-------------|-------------|
| 子会社株式 | 1,404 | 1,408 | 3 |
| 合計 | 1,404 | 1,408 | 3 |

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

2 その他有価証券

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

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

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

(持分法損益等)

| 第53期中間会計期間 (自平成23年4月1日 至平成23年9月30日) | |
|-------------------------------------------|----------|
| 関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 | (単位：百万円) |
| (1) 関連会社に対する投資の金額 | 2,892 |
| (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 | 4,320 |
| (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 | 467 |

(ストックオプション等関係)

第53期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

1 セグメント情報

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

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスは単一であるため、記載しておりません。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

(1株当たり情報)

| 第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日) | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| 1株当たり純資産額 | 223円59銭 |
| 1株当たり中間純利益 | 10円23銭 |
| <p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p> | |

(注) 算定上の基礎

1 1株当たり純資産額

| 項目 | 第53期中間会計期間 (平成23年 9月30日) |
|------------------------------|-----------------------------|
| 中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円) | 44,027 |
| 普通株式に係る純資産額(百万円) | 44,027 |
| 差額の主な内訳(百万円) | |
| 新株予約権 | - |
| 普通株式の発行済株式数(千株) | 197,013 |
| 普通株式の自己株式数(千株) | 110 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(千株) | 196,903 |

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

| 項目 | 第53期中間会計期間 (自 平成23年 4月 1日 至 平成23年 9月30日) |
|--------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 中間純利益(百万円) | 2,002 |
| 普通株主に帰属しない金額(百万円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益(百万円) | 2,002 |
| 普通株式の期中平均株式数(千株) | 195,654 |
| 希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要 | 平成21年度ストックオプション(1) 19,278,600株 平成21年度ストックオプション(2) 1,692,900株 平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株 第1回新株予約権 2,955,200株 |

(重要な後発事象)

第53期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

新株予約権（ストックオプション）の付与

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

| 名称 | 資本金の額 (平成23年3月末現在) | 事業の内容 |
|-----------------|-----------------------|-------------------------------|
| S M B C日興証券株式会社 | 10,000百万円 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 損保ジャパンDC証券株式会社 | 3,000百万円 | |
| 株式会社伊予銀行 | 20,948百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社大垣共立銀行 | 36,166百万円 | |
| 株式会社紀陽銀行 | 80,096百万円 | |
| 株式会社きらやか銀行 | 17,700百万円 | |
| 株式会社佐賀銀行 | 16,062百万円 | |
| 株式会社山陰合同銀行 | 20,705百万円 | |
| 株式会社十八銀行 | 24,404百万円 | |
| 株式会社百十四銀行 | 37,322百万円 | |
| 株式会社広島銀行 | 54,573百万円 | |
| 株式会社福岡銀行 | 82,329百万円 | |
| 株式会社宮崎銀行 | 14,697百万円 | |
| 株式会社横浜銀行 | 215,628百万円 | |
| 第一生命保険株式会社 | 210,200百万円 | 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。 |
| 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。 |

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成22年12月16日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金積立アセット・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、年金積立アセット・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23年11月30日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 和 田 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」に掲げられている年金積立 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27日から平成23年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、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、年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の平成23年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

2 . 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

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

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

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

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成23年6月17日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

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

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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