

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年2月6日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	DCインデックスバランス（株式60）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【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】**

DCインデックスバランス（株式60）（以下「ファンド」といいます。）

当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう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に限るものとします。

（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】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

平成26年 2月 7日から平成27年 2月 6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。

(1 0) 【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。

(1 1) 【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。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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。

<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。

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

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

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

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

3. 株式に60%、債券などに40%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%とします。
組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	15%
日本債券インデックスマザーファンド	25%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

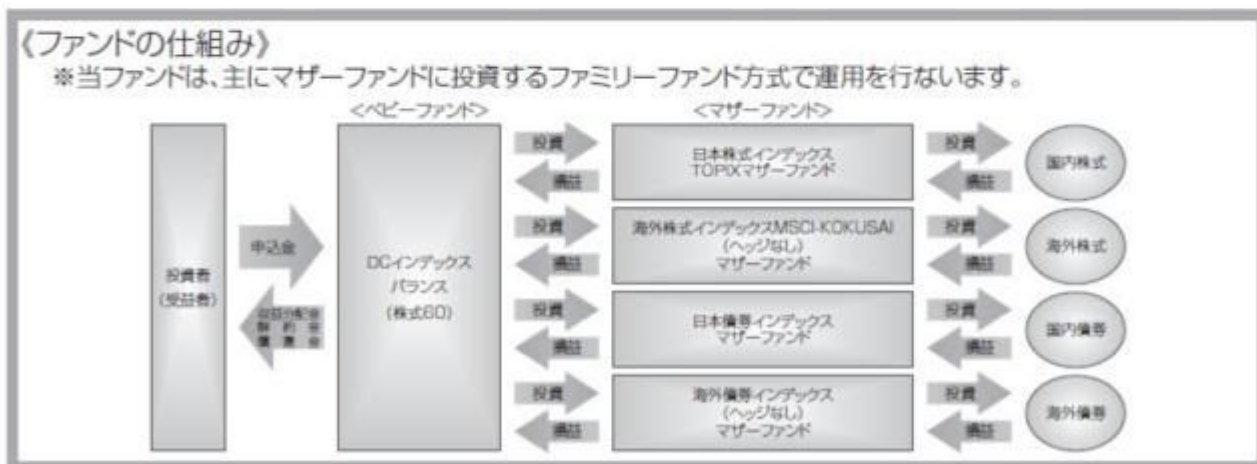
※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

※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。

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。

購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう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に限るものとします。



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70%未満とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の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な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。

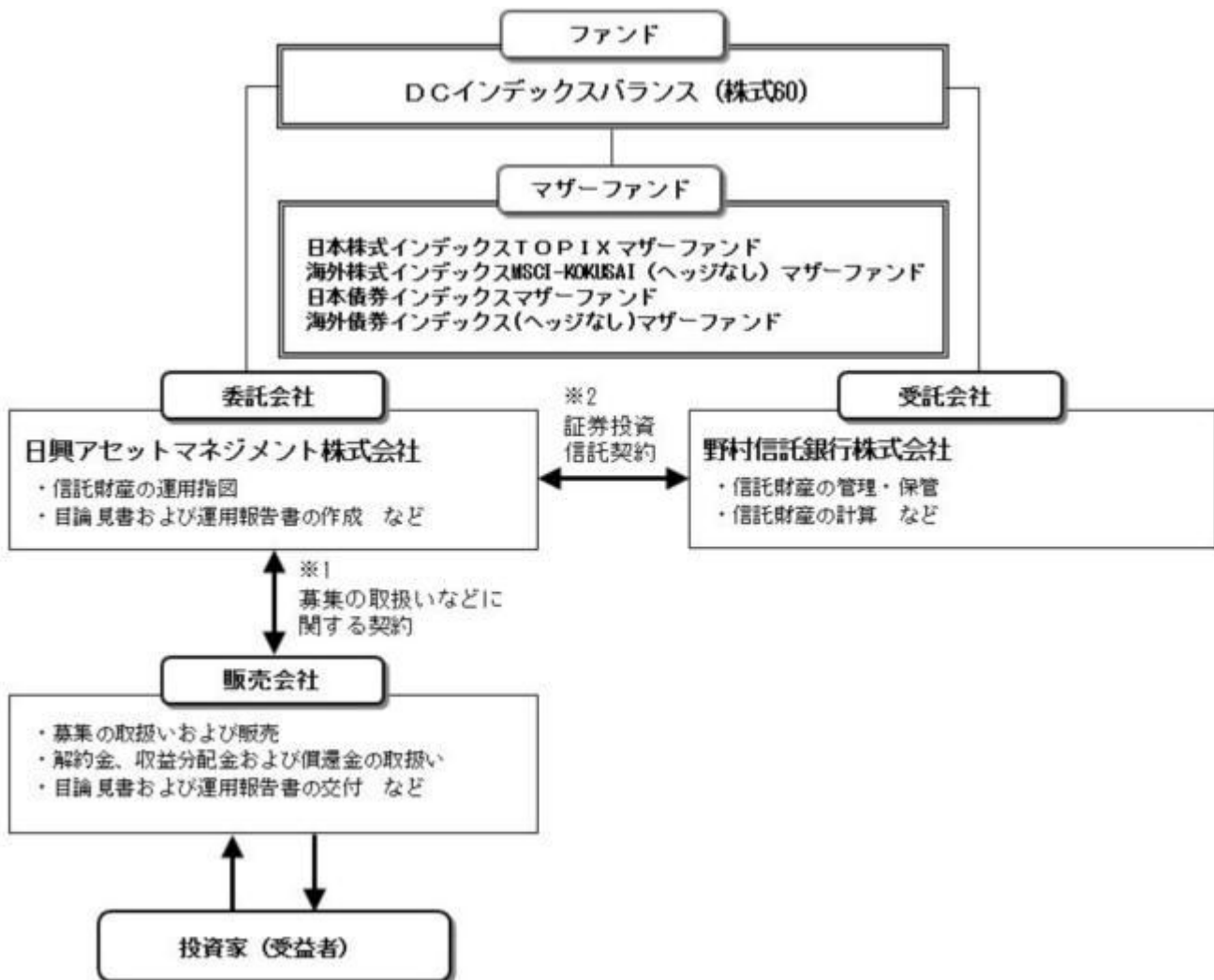
(2) 【ファンドの沿革】

平成14年12月10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25年11月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

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

致します。

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「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」

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

株式の標準実質組入比率.....60%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....40%

- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

< DCインデックスバランス（株式60）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「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」

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。）
 - 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「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
 - 4) 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
 - 5) 株券または新株引受権証書
 - 6) 国債証券
 - 7) 地方債証券
 - 8) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 9) 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。）
 - 10) 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。）
 - 11) コマーシャル・ペーパー
 - 12) 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
 - 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)～12)の証券または証書の性質を有するもの
 - 14) 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。）
 - 15) 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16)に定めるもの以外のもの
 - 16) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 17) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 18) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。）
 - 19) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 21) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。）
 - 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの

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

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引
- 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証券
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 11) オプションを表示する証券または証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 12) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 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せん。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証券
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 - 15) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入

- 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>
わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限り。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限り。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。）
 - 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。）
 - 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）

* T O P I X（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。

T O P I Xの指数値およびT O P I X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T O P I X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。

< 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いません。
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いません。 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"> 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。
収益分配	収益分配は行いません。
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S M B C 日興証券株式会社に帰属します。また、S M B C 日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有していま

す。

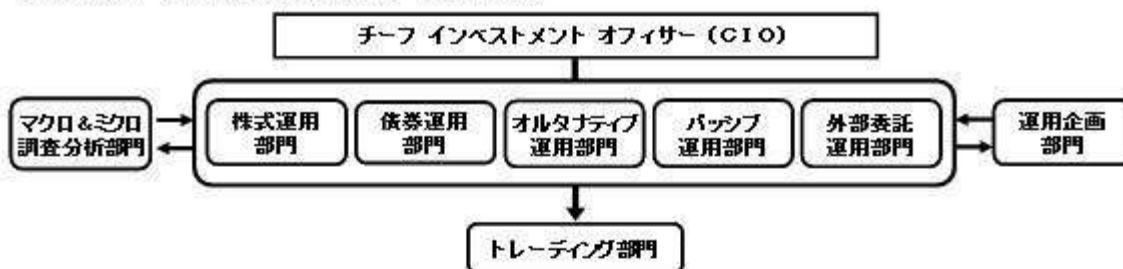
< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

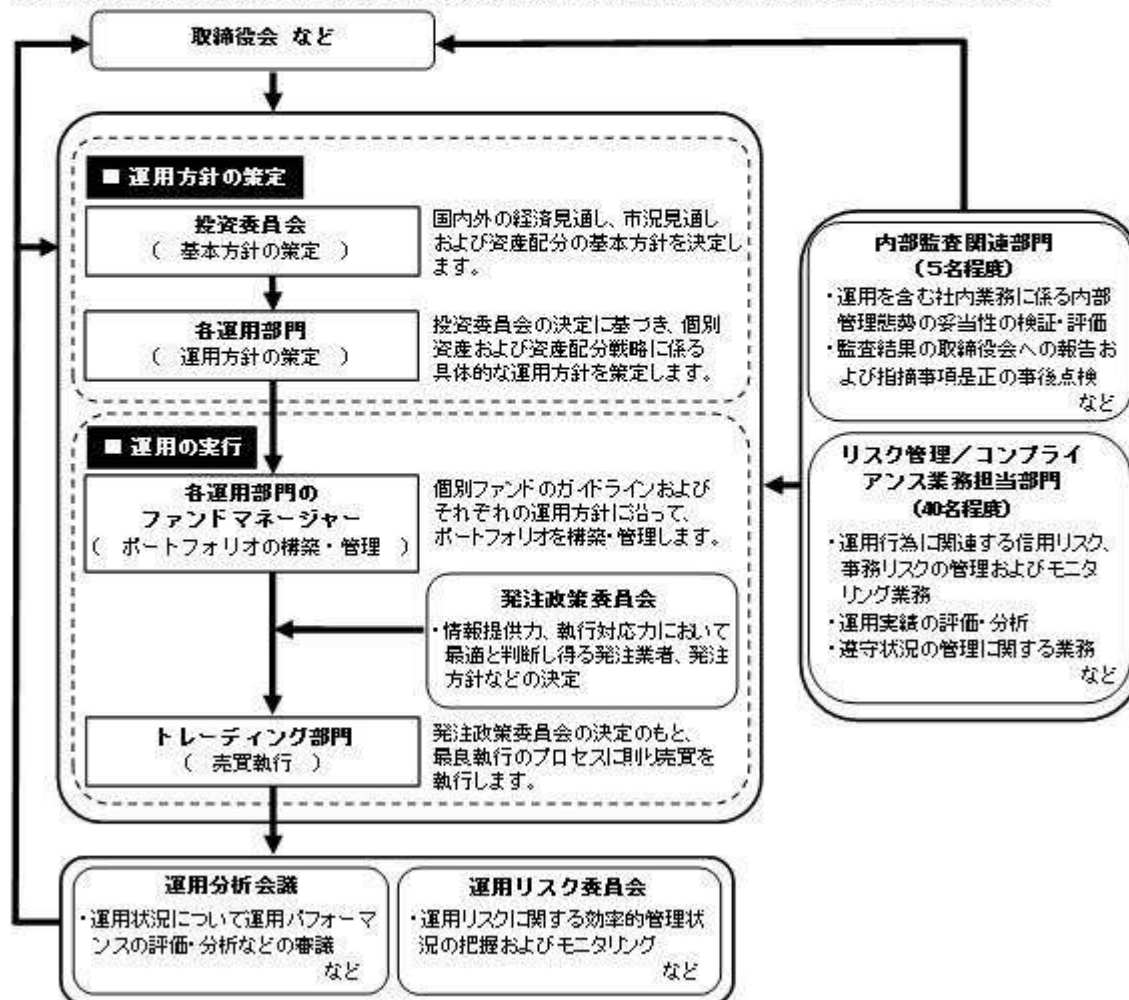
*シティグループ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（3）【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25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いません。
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

< DCインデックスバランス(株式60) >

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 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、当該取引の契約期間が、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払される日からその翌営業日までとします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

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

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商

品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨

にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。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。

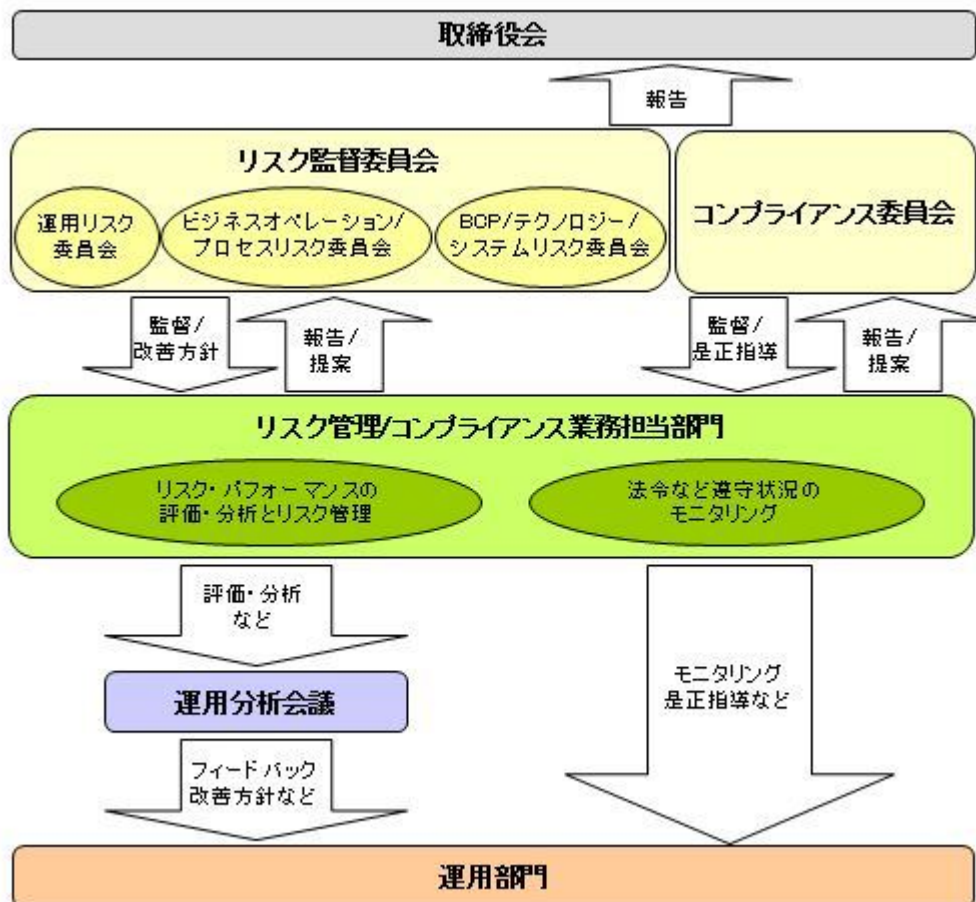
為替変動リスク

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。

< 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



全社的なリスク管理

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管理部門を設置し、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、リスク管理部門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いません。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、リスク管理/コンプライアンス業務担当部門が管理を行いません。問題点についてはリスク管理/コンプライアンス関連の委員会に報告され、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・監督を行いません。

上記体制は平成25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】

ありません。

(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0.25%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことであり、

（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0.336%*（税抜0.32%）の率を乗じて得た額とします。

*消費税率が8%になった場合は、0.3456%となります。

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
0.32%	0.19%	0.10%	0.03%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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せん。

確定拠出年金でない場合**個人受益者の場合****1) 収益分配金に対する課税**

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）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。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）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、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した
公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれ
るのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象
となります。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託などを購入する場合は、NISAをご利
用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額につい
ては配当所得として、15.315%（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。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれませ
ん。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した
値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法
が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元
本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

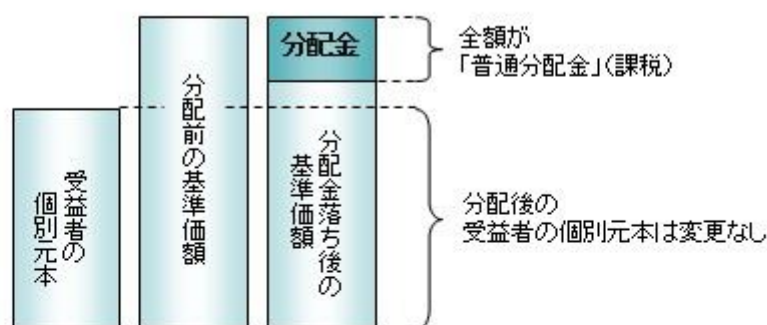
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場
合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益
分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から
元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

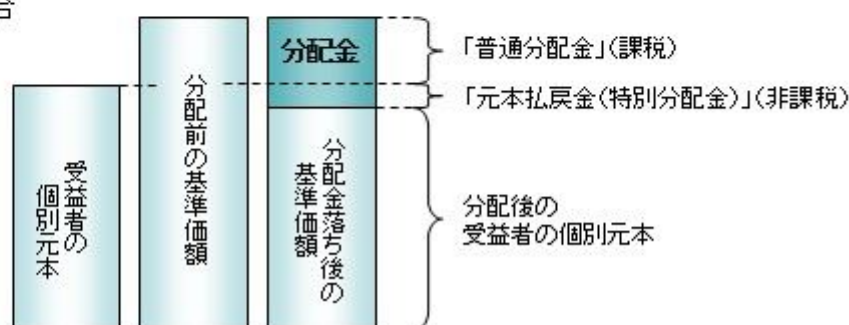
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益
者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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】

【DCインデックスバランス(株式60)】

以下の運用状況は2013年11月29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	2,596,420,985	95.15
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		132,354,322	4.85
合計(純資産総額)		2,728,775,307	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	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,209,230,881	0.9695	1,172,349,340	1.0238	1,238,010,575	45.37
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	518,344,728	1.2835	665,300,442	1.2858	666,487,651	24.42
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	266,577,079	1.4744	393,041,246	1.5627	416,580,001	15.27
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	137,341,759	1.9148	262,982,001	2.0048	275,342,758	10.09

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.15
合計	95.15

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第2計算期間末 (2004年11月 8日)	124	124	1.1864	1.1864
第3計算期間末 (2005年11月 7日)	704	704	1.4271	1.4271
第4計算期間末 (2006年11月 6日)	1,087	1,087	1.5395	1.5405
第5計算期間末 (2007年11月 6日)	1,488	1,489	1.5896	1.5906
第6計算期間末 (2008年11月 6日)	1,250	1,251	1.1336	1.1346
第7計算期間末 (2009年11月 6日)	1,543	1,545	1.1600	1.1610
第8計算期間末 (2010年11月 8日)	1,707	1,709	1.1601	1.1611
第9計算期間末 (2011年11月 7日)	1,789	1,790	1.1104	1.1114
第10計算期間末 (2012年11月 6日)	1,972	1,973	1.1554	1.1564
第11計算期間末 (2013年11月 6日)	2,651	2,652	1.5855	1.5865
2012年11月末日	2,044		1.1919	
12月末日	2,161		1.2656	
2013年 1月末日	2,327		1.3473	
2月末日	2,375		1.3748	
3月末日	2,449		1.4316	
4月末日	2,609		1.5341	
5月末日	2,553		1.5293	
6月末日	2,479		1.5079	
7月末日	2,509		1.5200	
8月末日	2,500		1.5028	
9月末日	2,631		1.5734	
10月末日	2,659		1.5912	
11月末日	2,728		1.6474	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第2期	2003年11月 7日～2004年11月 8日	0.0000
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0.0000
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	0.0010
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	0.0010

第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	0.0010
------	-------------------------	--------

【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第2期	2003年11月 7日～2004年11月 8日	7.11
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	20.29
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	7.95
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	3.32
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	28.62
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.42
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.09
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	4.20
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	4.14
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	37.31

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第2期	2003年11月 7日～2004年11月 8日	92,350,899	2,927,912
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	403,896,673	15,141,759
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	273,043,849	60,611,294
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	302,235,212	72,140,595
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	291,424,215	124,332,611
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	339,597,238	112,048,719
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	274,906,943	133,566,015
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	270,923,990	131,707,074
第10期	2011年11月 8日～2012年11月 6日	280,700,352	185,136,062
第11期	2012年11月 7日～2013年11月 6日	276,014,975	310,793,361

(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2013年11月29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。

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	28,198,280,370	99.17
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		237,117,436	0.83
合計(純資産総額)		28,435,397,806	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	227,250,000	0.80

(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。

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	220,600	6,313.64	1,392,788,984	6,380.00	1,407,428,000	4.95
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,184,900	629.00	745,302,100	659.00	780,849,100	2.75
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	76,800	7,480.00	574,464,000	8,290.00	636,672,000	2.24
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	142,600	3,907.75	557,245,150	4,330.00	617,458,000	2.17
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	118,300	4,725.00	558,967,500	5,070.00	599,781,000	2.11
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,024,400	209.00	423,099,600	215.00	435,246,000	1.53
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	98,400	3,395.00	334,068,000	3,460.00	340,464,000	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	61,500	5,140.00	316,110,000	5,140.00	316,110,000	1.11
日本	株式	キヤノン	電気機器	91,900	3,150.00	289,485,000	3,410.00	313,379,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	48,600	5,126.37	249,141,582	6,430.00	312,498,000	1.10
日本	株式	三菱地所	不動産業	109,000	2,835.00	309,015,000	2,844.00	309,996,000	1.09
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	62,200	4,650.00	289,230,000	4,975.00	309,445,000	1.09
日本	株式	ファナック	電気機器	17,700	16,416.68	290,575,236	17,240.00	305,148,000	1.07
日本	株式	日立製作所	電気機器	381,000	673.00	256,413,000	755.00	287,655,000	1.01
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	319,800	742.00	237,291,600	811.00	259,357,800	0.91
日本	株式	三井不動産	不動産業	74,000	3,285.00	243,090,000	3,475.00	257,150,000	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	65,400	3,615.00	236,421,000	3,770.00	246,558,000	0.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	122,000	1,989.00	242,658,000	2,015.00	245,830,000	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	29,200	8,760.00	255,792,000	8,390.00	244,988,000	0.86
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	702,000	338.00	237,276,000	332.00	233,064,000	0.82
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	38,200	5,393.27	206,022,914	6,070.00	231,874,000	0.82
日本	株式	パナソニック	電気機器	181,100	946.00	171,320,600	1,175.00	212,792,500	0.75
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	128,900	1,535.00	197,861,500	1,650.00	212,685,000	0.75

日本	株式	日産自動車	輸送用機器	222,400	1,009.50	224,512,800	936.00	208,166,400	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	60,600	3,155.00	191,193,000	3,400.00	206,040,000	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	144,000	1,418.04	204,197,760	1,419.00	204,336,000	0.72
日本	株式	デンソー	輸送用機器	39,200	4,740.00	185,808,000	5,130.00	201,096,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	52,000	3,405.00	177,060,000	3,750.00	195,000,000	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	159,000	1,063.00	169,017,000	1,183.00	188,097,000	0.66
日本	株式	三菱重工業	機械	282,000	631.79	178,164,780	657.00	185,274,000	0.65

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	0.07
		鉱業	0.43
		建設業	2.50
		食料品	3.81
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.32
		医薬品	4.37
		石油・石炭製品	0.61
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	1.01
		鉄鋼	1.74
		非鉄金属	1.04
		金属製品	0.69
		機械	5.22
		電気機器	11.75
		輸送用機器	12.04
		精密機器	1.38
		その他製品	1.41
		電気・ガス業	2.22
		陸運業	3.73
		海運業	0.38
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	7.09
		卸売業	4.42
小売業	4.14		
銀行業	9.77		
証券、商品先物取引業	1.84		
保険業	2.32		
その他金融業	1.50		

	不動産業	3.62
	サービス業	2.13
合 計		99.17

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	東京証券取引所	東証株価指数先物 2013年12月	買建	18	日本円	215,844,231	227,250,000	0.80

(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。

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2013年11月29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。

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	44,533,446,109	55.46
	カナダ	3,539,773,238	4.41
	モーリシャス	10,322,400	0.01
	ドイツ	3,366,076,193	4.19
	イタリア	759,364,234	0.95
	フランス	3,453,302,492	4.30
	オランダ	1,154,780,247	1.44
	スペイン	1,194,140,236	1.49
	ベルギー	417,252,091	0.52
	オーストリア	100,791,290	0.13
	ルクセンブルク	115,008,049	0.14
	フィンランド	335,688,852	0.42
	アイルランド	688,485,836	0.86
	ポルトガル	61,448,963	0.08
	イギリス	7,481,199,579	9.32
	スイス	3,514,037,114	4.38
スウェーデン	1,130,044,846	1.41	
ノルウェー	291,150,128	0.36	
デンマーク	405,774,711	0.51	

	ケイマン	98,159,062	0.12
	オーストラリア	2,532,284,347	3.15
	パミューダ	116,251,168	0.14
	ニュージーランド	37,996,773	0.05
	香港	932,088,050	1.16
	シンガポール	524,753,962	0.65
	イスラエル	154,315,706	0.19
	ジャージー	402,615,038	0.50
	ガーンジー	21,650,098	0.03
	英ヴァージン諸島	42,748,469	0.05
	小計	77,414,949,281	96.40
投資証券	アメリカ	1,065,716,114	1.33
	カナダ	16,328,102	0.02
	フランス	105,292,509	0.13
	オランダ	8,968,063	0.01
	イギリス	99,610,597	0.12
	オーストラリア	212,458,126	0.26
	香港	29,710,611	0.04
	シンガポール	30,788,332	0.04
	小計	1,568,872,454	1.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,320,542,736	1.64
合計（純資産総額）		80,304,364,471	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	923,982,029	1.15
	買建	ドイツ	404,155,078	0.50

(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（％）
為替予約取引	買建		923,075,670	1.15
	売建		149,760,400	0.19

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE COMPUTER INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	24,536	53,893.40	1,322,328,560	55,917.22	1,371,984,988	1.71
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	118,841	9,009.88	1,070,744,029	9,606.99	1,141,705,012	1.42
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	213,874	3,659.46	782,664,760	3,850.99	823,627,063	1.03
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	7,370	103,975.75	766,301,350	108,883.72	802,473,062	1.00
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO.	資本財	274,773	2,650.62	728,321,447	2,747.92	755,056,585	0.94
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	75,881	9,431.85	715,698,801	9,727.85	738,159,107	0.92
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	52,251	12,350.82	645,343,103	12,538.25	655,136,435	0.82
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	86,953	7,416.98	644,928,879	7,490.52	651,324,055	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	74,049	8,193.59	606,727,886	8,631.95	639,187,828	0.80
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	135,950	4,389.72	596,782,597	4,534.13	616,415,436	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	102,130	5,404.70	551,982,358	5,887.10	601,249,686	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	177,110	3,135.07	555,253,346	3,265.14	578,290,646	0.72
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	503,101	1,138.45	572,758,352	1,141.80	574,442,935	0.72
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	18,938	28,140.40	532,922,990	28,536.42	540,422,911	0.67
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	145,386	3,604.15	523,994,376	3,626.69	527,270,272	0.66
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	28,382	18,112.97	514,082,513	18,330.10	520,245,108	0.65
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,312,805	378.36	496,724,978	382.63	502,329,617	0.63
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	61,973	7,960.10	493,311,432	8,056.27	499,271,840	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	各種金融	290,569	1,460.50	424,378,698	1,621.30	471,102,019	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	108,352	3,997.45	433,131,984	4,116.25	446,004,982	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	81,957	5,127.14	420,205,440	5,433.38	445,303,607	0.55
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	511,378	755.06	386,123,220	806.12	412,235,766	0.51

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	78,803	4,766.62	375,624,491	5,103.58	402,178,092	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	77,353	5,193.71	401,749,684	5,113.83	395,570,138	0.49
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	9,795	37,218.40	364,554,265	39,606.83	387,948,980	0.48
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	44,188	9,074.41	400,980,117	8,756.90	386,950,339	0.48
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品 小売り	44,482	7,792.11	346,608,797	8,288.85	368,704,652	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	41,821	8,536.70	357,013,624	8,646.29	361,596,762	0.45
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	132,841	2,685.41	356,733,453	2,697.97	358,401,470	0.45
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	57,597	6,215.73	358,007,528	6,214.33	357,927,203	0.45

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	9.99
		素材	5.54
		資本財	7.66
		商業・専門サービス	0.92
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.74
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.74
		メディア	2.97
		小売	3.18
		食品・生活必需品小売り	2.23
		食品・飲料・タバコ	6.13
		家庭用品・パーソナル用品	1.88
		ヘルスケア機器・サービス	2.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.72
		銀行	7.93
		各種金融	5.96
		保険	4.30
		不動産	0.61
		ソフトウェア・サービス	6.40
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.95		
電気通信サービス	3.52		
公益事業	3.14		

		半導体・半導体製造装置	1.43
投資証券			1.95
合 計			98.36

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

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)	契約額等(円)	評価額 (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 1312	買建	20	米ドル	8,877,250	909,207,944	9,021,500	923,982,029	1.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 1312	買建	100	ユーロ	2,890,770	403,146,783	2,898,000	404,155,078	0.50

(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	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	6,977,000.00	690,894,912	714,374,300	0.89
	ユーロ	買建	1,497,000.00	201,916,727	208,701,370	0.26
	米ドル	売建	1,000,000.00	102,020,000	102,410,000	0.13
	加ドル	売建	260,000.00	25,061,400	25,157,600	0.03
	香港ドル	売建	1,680,000.00	22,112,160	22,192,800	0.03

(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。

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2013年11月29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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	27,044,893,610	78.72
地方債証券	日本	2,317,407,000	6.75
特殊債証券	日本	2,576,876,946	7.50
社債券	日本	2,076,096,000	6.04
	オーストラリア	202,689,000	0.59
	小計	2,278,785,000	6.63
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		138,663,831	0.40

合計(純資産総額)	34,356,626,387	100.00
-----------	----------------	--------

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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	750,000,000	105.80	793,537,500	105.84	793,830,000	1.300	2019/3/20	2.31
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	673,000,000	106.22	714,860,600	106.28	715,304,780	1.300	2019/12/20	2.08
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	581,000,000	106.70	619,961,860	106.78	620,420,850	1.400	2019/9/20	1.81
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	545,000,000	107.49	585,820,500	107.55	586,180,200	1.400	2022/12/20	1.71
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	462,000,000	104.90	484,679,580	104.84	484,374,660	1.700	2016/12/20	1.41
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	460,000,000	100.47	462,198,800	100.43	462,019,400	0.500	2014/12/20	1.34
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	445,000,000	100.84	448,751,350	100.84	448,769,150	0.500	2015/12/20	1.31
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	406,000,000	105.30	427,554,540	105.30	427,554,540	1.400	2018/3/20	1.24
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	380,000,000	106.41	404,358,000	106.52	404,806,400	1.300	2021/3/20	1.18
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	361,000,000	101.96	368,097,260	101.83	367,620,740	1.500	2015/3/20	1.07
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	300,000,000	117.82	353,475,000	117.97	353,925,000	2.300	2026/6/20	1.03
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	350,000,000	100.73	352,576,000	100.77	352,709,000	0.400	2016/6/20	1.03
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	340,000,000	100.13	340,459,000	100.24	340,833,000	0.200	2017/9/20	0.99
日本	国債証券	第36回利付国債(30年)	310,000,000	108.44	336,173,300	108.00	334,800,000	2.000	2042/3/20	0.97
日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	330,000,000	100.51	331,699,500	100.49	331,626,900	0.400	2015/6/20	0.97
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	276,000,000	116.41	321,308,160	116.16	320,604,360	2.400	2038/9/20	0.93
日本	国債証券	第91回利付国債(20年)	260,000,000	117.80	306,287,800	118.02	306,875,400	2.300	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	287,000,000	104.87	300,988,380	104.88	301,014,210	1.300	2018/3/20	0.88
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	280,000,000	104.17	291,676,000	104.46	292,499,200	1.700	2032/9/20	0.85
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	280,000,000	100.51	281,442,000	100.59	281,657,600	0.300	2016/12/20	0.82
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	270,000,000	102.16	275,837,400	102.35	276,358,500	0.800	2022/9/20	0.80
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	275,000,000	100.13	275,365,750	100.30	275,849,750	0.600	2023/3/20	0.80
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	261,000,000	105.25	274,720,770	105.21	274,616,370	1.700	2017/3/20	0.80
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	237,000,000	110.80	262,617,330	110.87	262,769,010	1.900	2021/3/22	0.76

日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	241,000,000	106.61	256,939,740	106.58	256,879,490	1.700	2018/3/20	0.75
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	233,000,000	106.95	249,214,470	106.99	249,291,360	1.400	2020/3/20	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	208,000,000	115.40	240,036,160	115.34	239,921,760	2.400	2034/3/20	0.70
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	223,000,000	107.09	238,828,540	107.15	238,964,570	1.500	2019/6/20	0.70
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	221,000,000	105.59	233,367,160	105.62	233,435,670	1.300	2018/12/20	0.68
日本	国債証券	第141回利付国債(20年)	215,000,000	103.97	223,535,500	104.19	224,023,550	1.700	2032/12/20	0.65

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.72
地方債証券	6.75
特殊債券	7.50
社債券	6.63
合計	99.60

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。

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2013年11月29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。

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	88,640,757,648	38.90
	カナダ	5,674,571,044	2.49
	メキシコ	2,331,378,829	1.02
	ドイツ	20,075,881,456	8.81
	イタリア	22,966,693,137	10.08
	フランス	22,881,850,456	10.04
	オランダ	6,351,328,492	2.79
	スペイン	12,140,370,331	5.33
	ベルギー	6,215,825,261	2.73
	オーストリア	3,810,212,266	1.67

	フィンランド	1,454,503,430	0.64
	アイルランド	1,867,778,881	0.82
	イギリス	17,598,853,564	7.72
	スイス	869,772,750	0.38
	スウェーデン	1,252,523,515	0.55
	ノルウェー	739,471,448	0.32
	デンマーク	1,969,552,789	0.86
	ポーランド	1,831,524,691	0.80
	オーストラリア	3,245,972,201	1.42
	シンガポール	836,691,795	0.37
	マレーシア	1,143,665,151	0.50
	南アフリカ	1,129,516,638	0.50
	小計	225,028,695,773	98.75
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,841,751,634	1.25
合計（純資産総額）		227,870,447,407	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（％）
為替予約取引	売建		849,665,530	0.37

(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。

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）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,700,000	10,745.29	3,513,712,537	10,712.49	3,502,984,843	4.000	2015/2/15	1.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	27,700,000	10,680.35	2,958,459,056	10,643.67	2,948,298,927	4.250	2014/11/15	1.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,000,000	10,590.86	2,753,625,713	10,574.86	2,749,464,900	2.500	2015/4/30	1.21
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,700,000	11,459.03	2,715,791,924	11,430.23	2,708,964,991	5.125	2016/5/15	1.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	25,500,000	10,535.65	2,686,592,622	10,515.65	2,681,491,626	2.625	2014/12/31	1.18
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,500,000	11,209.38	2,522,112,504	11,182.98	2,516,171,344	4.500	2016/2/15	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	23,100,000	10,855.71	2,507,671,283	10,826.91	2,501,017,184	4.125	2015/5/15	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,200,000	11,116.57	2,467,878,713	11,083.76	2,460,595,691	4.500	2015/11/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	22,200,000	10,970.94	2,435,549,200	10,944.53	2,429,687,256	4.250	2015/8/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,800,000	11,418.22	2,032,444,885	11,298.20	2,011,080,713	3.625	2021/2/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,400,000	11,588.66	2,016,427,356	11,550.25	2,009,744,451	4.000	2018/8/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,000,000	10,960.54	1,972,897,256	10,956.53	1,972,177,115	2.750	2017/12/31	0.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,400,000	11,562.19	1,896,199,783	11,545.45	1,893,454,543	4.250	2017/11/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,300,000	11,452.63	1,866,779,733	11,359.01	1,851,519,954	3.625	2020/2/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,500,000	10,978.94	1,811,525,744	10,969.34	1,809,941,435	3.250	2016/5/31	0.79

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,700,000	11,279.00	1,770,803,392	11,267.00	1,768,919,024	3.500	2018/2/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,000,000	14,734.87	1,768,185,281	14,562.04	1,747,445,231	8.000	2021/11/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,200,000	11,467.83	1,743,111,585	11,436.63	1,738,368,259	3.750	2018/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,400,000	11,713.77	1,686,783,658	11,693.48	1,683,861,615	4.750	2017/8/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,800,000	11,303.80	1,559,925,413	11,226.99	1,549,324,943	3.375	2019/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,700,000	10,507.65	1,544,624,825	10,491.64	1,542,272,366	2.250	2015/1/31	0.68
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	10,300,000	14,920.52	1,536,814,277	14,919.92	1,536,752,510	3.250	2016/4/25	0.67
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	10,550,000	14,481.52	1,527,801,035	14,553.50	1,535,394,430	3.750	2015/8/1	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	12,500,000	11,555.05	1,444,382,050	11,546.25	1,443,281,835	4.500	2017/5/15	0.63
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,750,000	15,950.04	1,395,628,518	15,978.95	1,398,158,513	3.250	2021/7/4	0.61
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,900,000	15,416.37	1,372,057,675	15,445.59	1,374,658,101	3.750	2017/4/25	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,000,000	10,571.66	1,374,316,368	10,555.66	1,372,235,962	2.500	2015/3/31	0.60
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000	14,600.92	1,314,083,257	14,750.45	1,327,541,370	3.750	2016/8/1	0.58
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	8,600,000	14,697.90	1,264,019,878	14,864.66	1,278,360,818	4.000	2017/2/1	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	14,014.73	1,261,326,304	13,921.91	1,252,972,673	8.125	2019/8/15	0.55

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.75
合計	98.75

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	3,280,000.00	333,874,456	335,904,800	0.15
	ユーロ	売建	2,600,000.00	358,899,135	362,570,000	0.16
	英ポンド	売建	447,000.00	73,892,706	74,829,480	0.03
	ポーランドズロチ	売建	1,078,000.00	35,236,586	35,789,600	0.02
	豪ドル	売建	296,000.00	27,351,080	27,542,800	0.01
	マレーシアリンギット	売建	411,134.44	12,958,011	13,028,850	0.01

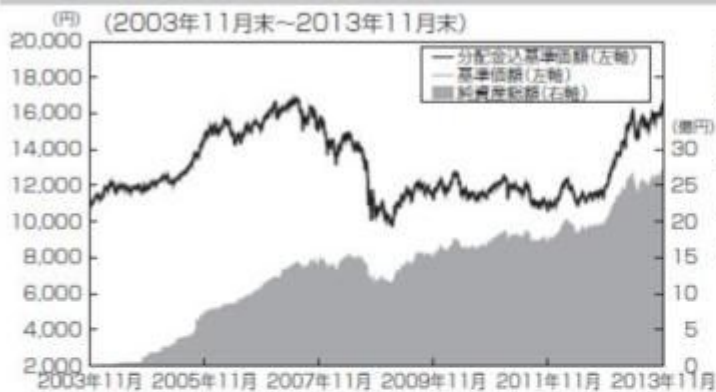
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2013年11月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………16,474円

純資産総額……………27.28億円

※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、2003年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金込基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	80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	45.37%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	15.27%
日本債券インデックスマザーファンド	24.42%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10.09%
現金その他	4.85%

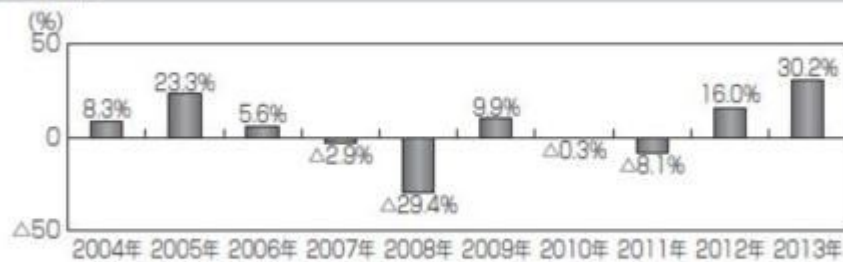
※当ファンドの対純資産総額比です。

<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	4.95%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	日本円	銀行業	2.75%	
	3 ソフトバンク	日本円	情報・通信業	2.24%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE COMPUTER INC	アメリカドル	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.71%	
	2 EXXON MOBIL CORP	アメリカドル	エネルギー	1.42%	
	3 MICROSOFT CORP	アメリカドル	ソフトウェア・サービス	1.03%	
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	2.31%
	2 第305回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2019/12/20	2.08%
	3 第303回利付国債(10年)	日本円	国債証券	2019/9/20	1.81%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン4.00%)	アメリカドル	国債証券	2015/2/15	1.54%
	2 US TREASURY N/B (クーポン4.25%)	アメリカドル	国債証券	2014/11/15	1.29%
	3 US TREASURY N/B (クーポン2.50%)	アメリカドル	国債証券	2015/4/30	1.21%

※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)を再投資したももの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。

※2013年は、2013年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう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に限るものとします。

(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です。

(5) 申込単位

1円以上1円単位

(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0.25%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、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の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(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】

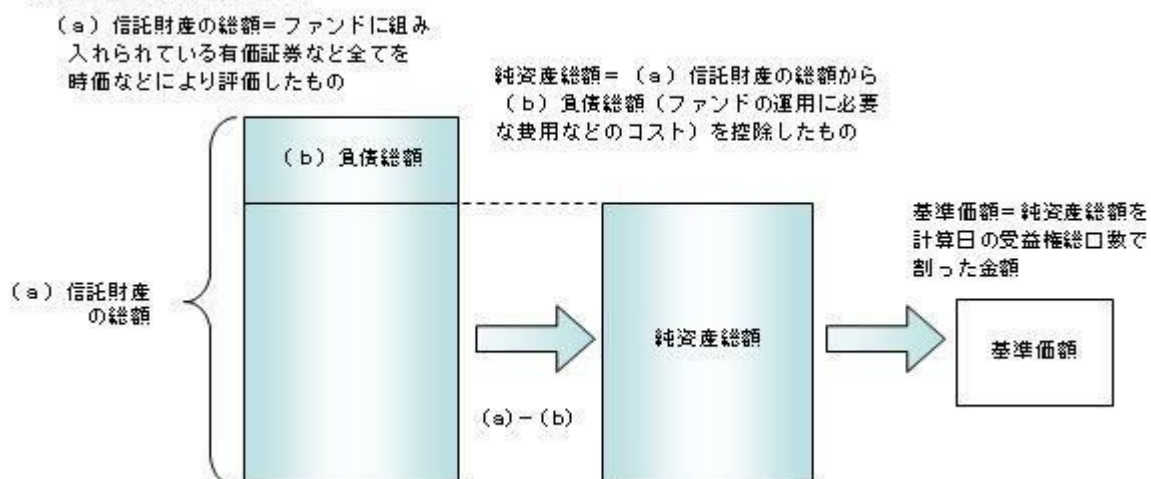
(1)【資産の評価】

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、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

< 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。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

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

^{*}外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（平成14年12月10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11月7日から翌年11月6日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

 - ・償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
 - ・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

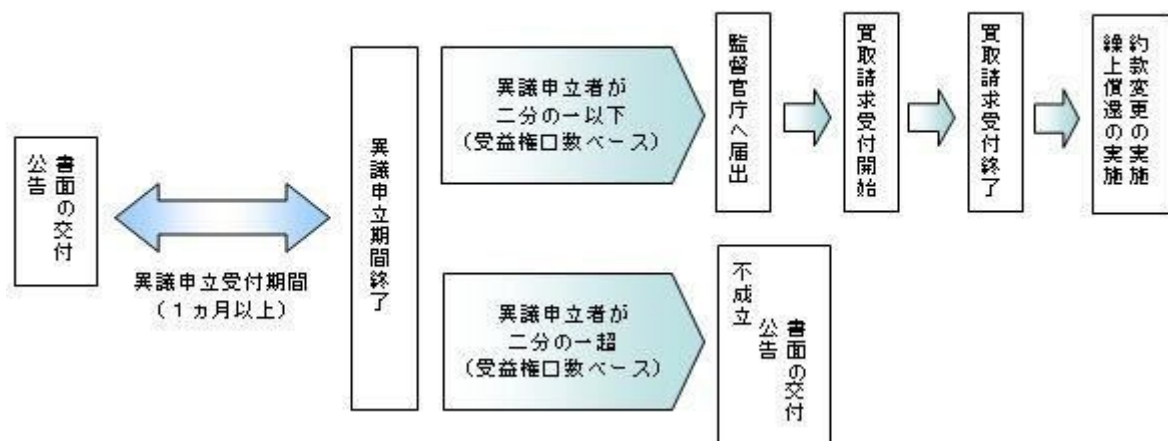
信託約款の変更

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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

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

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間(平成24年11月7日から平成25年11月6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】

【DCインデックスバランス（株式60）】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 平成24年11月 6日現在	第11期 平成25年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,483,267	138,738,973
親投資信託受益証券	1,875,763,435	2,521,003,125
未収入金	970,285	-
未収利息	191	232
流動資産合計	1,979,217,178	2,659,742,330
資産合計	1,979,217,178	2,659,742,330
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,706,957	1,672,179
未払解約金	1,942,958	2,437,430
未払受託者報酬	302,297	405,411
未払委託者報酬	2,922,864	3,919,572
その他未払費用	49,323	66,159
流動負債合計	6,924,399	8,500,751
負債合計	6,924,399	8,500,751
純資産の部		
元本等		
元本	1,706,957,547	1,672,179,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	265,335,232	979,062,418
（分配準備積立金）	208,360,903	475,936,912
元本等合計	1,972,292,779	2,651,241,579
純資産合計	1,972,292,779	2,651,241,579
負債純資産合計	1,979,217,178	2,659,742,330

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日	自	平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日
営業収益				
受取利息		64,834		76,281
有価証券売買等損益		81,510,222		745,244,596
営業収益合計		81,575,056		745,320,877
営業費用				
受託者報酬		596,636		766,124
委託者報酬		5,768,757		7,407,054
その他費用		97,352		125,027
営業費用合計		6,462,745		8,298,205
営業利益又は営業損失()		75,112,311		737,022,672
経常利益又は経常損失()		75,112,311		737,022,672
当期純利益又は当期純損失()		75,112,311		737,022,672
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()		5,243,634		93,516,465
期首剰余金又は期首欠損金()		177,834,981		265,335,232
剰余金増加額又は欠損金減少額		39,789,176		125,207,825
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		39,789,176		125,207,825
剰余金減少額又は欠損金増加額		20,450,645		53,314,667
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,450,645		53,314,667
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		1,706,957		1,672,179
期末剰余金又は期末欠損金()		265,335,232		979,062,418

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		第10期 平成24年11月 6日現在	第11期 平成25年11月 6日現在
1.	期首元本額	1,611,393,257円	1,706,957,547円
	期中追加設定元本額	280,700,352円	276,014,975円
	期中一部解約元本額	185,136,062円	310,793,361円
2.	受益権の総数	1,706,957,547口	1,672,179,161口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日		第11期 自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配 当等収益	39,149,970円	A 計算期末における費用控除後の配 当等収益 47,936,173円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益 256,116,026円
C	信託約款に定める収益調整金	561,019,348円	C 信託約款に定める収益調整金 580,685,860円
D	信託約款に定める分配準備積立金	170,917,890円	D 信託約款に定める分配準備積立金 173,556,892円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	771,087,208円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 1,058,294,951円
F	分配対象収益(1万口当たり)	4,517円	F 分配対象収益(1万口当たり) 6,328円
G	分配金額	1,706,957円	G 分配金額 1,672,179円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第10期 自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日	第11期 自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6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管理部門を設置し、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10期 平成24年11月 6日現在	第11期 平成25年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第10期（平成24年11月 6日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	74,057,890
合計	74,057,890

第11期(平成25年11月6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	598,082,559
合計	598,082,559

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第10期 平成24年11月6日現在		第11期 平成25年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.1554円	1口当たり純資産額	1.5855円
(1万口当たり純資産額)	(11,554円)	(1万口当たり純資産額)	(15,855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	275,730,948	406,537,709	
	日本債券インデックスマザーファンド	514,807,475	660,755,394	

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	137,934,008	264,116,038	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,226,891,486	1,189,593,984	
合計	2,155,363,917	2,521,003,125	

(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。

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-KOKUSA I(ヘッジなし)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」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	109,117,287	163,429,816
株式	23,925,212,740	27,322,939,646
派生商品評価勘定	1,132,833	754,205
未収入金	48,584,905	-
未収配当金	246,081,944	206,715,885
未収利息	203	273
前払金	-	5,510,000
流動資産合計	24,330,129,912	27,699,349,825
資産合計	24,330,129,912	27,699,349,825
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,707,144	2,814,432
前受金	935,000	-
未払金	25,008	-
未払解約金	50,590,183	5,435,292
流動負債合計	53,257,335	8,249,724

負債合計	53,257,335	8,249,724
純資産の部		
元本等		
元本	40,912,921,379	28,560,407,434
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,636,048,802	869,307,333
元本等合計	24,276,872,577	27,691,100,101
純資産合計	24,276,872,577	27,691,100,101
負債純資産合計	24,330,129,912	27,699,349,825

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
1. 期首	平成23年11月 8日	平成24年11月 7日
期首元本額	43,750,772,096円	40,912,921,379円
期首からの追加設定元本額	2,717,504,083円	1,278,780,247円
期首からの一部解約元本額	5,555,354,800円	13,631,294,192円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	230,169,756円	168,495,504円
DCインデックスバランス（株式40）	816,416,494円	640,206,089円
DCインデックスバランス（株式60）	1,497,870,967円	1,226,891,486円
DCインデックスバランス（株式80）	1,632,750,011円	1,474,076,768円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	979,927,142円	1,064,138,558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	15,130,521,780円	9,628,079,002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	17,536,711円	10,879,626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）	122,929,147円	28,627,449円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	186,247,107円	122,665,512円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	159,004,123円	89,674,943円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	260,564,095円	143,464,536円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	328,797,306円	180,221,257円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	14,743,790,180円	9,894,065,129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）	97,317,179円	54,520,360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）	119,432,906円	75,912,879円
3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	44,505,368円	- 円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	76,434,642円	55,661,438円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	424,922,894円	311,541,321円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,136,153,450円	894,916,667円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,464,496,096円	1,233,661,971円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,443,134,025円	1,262,706,939円
計	40,912,921,379円	28,560,407,434円
2. 受益権の総数	40,912,921,379口	28,560,407,434口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	16,636,048,802円	869,307,333円
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	220,550,000円	362,338,000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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6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管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成24年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	119,963,160
合計	119,963,160

(平成25年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	146,176,154
合計	146,176,154

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(平成24年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	343,630,000	-	343,160,000	470,000
合計		343,630,000	-	343,160,000	470,000

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	372,240,000	-	370,295,000	1,945,000
合計		372,240,000	-	370,295,000	1,945,000

(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24年11月 6日現在		平成25年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	0.5934円	1口当たり純資産額	0.9696円
(1万口当たり純資産額)	(5,934円)	(1万口当たり純資産額)	(9,696円)

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	
極洋	7,000	265.00	1,855,000	
日本水産	22,400	210.00	4,704,000	
マルハニチロホールディングス	35,000	183.00	6,405,000	
サカタのタネ	2,700	1,341.00	3,620,700	
ホクト	2,000	1,881.00	3,762,000	
住石ホールディングス	5,100	140.00	714,000	
日鉄鉱業	5,000	525.00	2,625,000	
三井松島産業	12,000	152.00	1,824,000	
国際石油開発帝石	88,400	1,152.00	101,836,800	
日本海洋掘削	400	6,820.00	2,728,000	
関東天然瓦斯開発	2,000	698.00	1,396,000	
石油資源開発	2,600	4,010.00	10,426,000	
ショーボンドホールディングス	1,600	4,600.00	7,360,000	
ミライト・ホールディングス	5,200	878.00	4,565,600	
タマホーム	800	1,059.00	847,200	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,970.00	394,000	
安藤・間	11,600	375.00	4,350,000	
東急建設	6,500	566.00	3,679,000	
コムシスホールディングス	8,800	1,386.00	12,196,800	
ミサワホーム	2,000	1,722.00	3,444,000	
高松コンストラクショングループ	1,400	1,848.00	2,587,200	
東建コーポレーション	680	5,300.00	3,604,000	
ヤマウラ	900	292.00	262,800	
大成建設	92,000	497.00	45,724,000	

大林組	55,000	618.00	33,990,000	
清水建設	56,000	497.00	27,832,000	
飛島建設	11,200	186.00	2,083,200	
長谷工コーポレーション	24,200	734.00	17,762,800	
松井建設	2,000	421.00	842,000	
銭高組	2,000	267.00	534,000	
鹿島建設	80,000	417.00	33,360,000	
不動テトラ	12,900	198.00	2,554,200	
大末建設	7,000	141.00	987,000	
鉄建建設	10,000	328.00	3,280,000	
日鉄住金テックスエンジ	3,000	400.00	1,200,000	
西松建設	24,000	346.00	8,304,000	
三井住友建設	48,800	128.00	6,246,400	
大豊建設	5,000	395.00	1,975,000	
前田建設工業	11,000	691.00	7,601,000	
ナカノフドー建設	1,400	249.00	348,600	
奥村組	16,000	462.00	7,392,000	
大和小田急建設	1,000	287.00	287,000	
東鉄工業	2,200	2,183.00	4,802,600	
イチケン	2,000	185.00	370,000	
浅沼組	6,000	192.00	1,152,000	
戸田建設	21,000	352.00	7,392,000	
熊谷組	14,000	298.00	4,172,000	
青木あすなる建設	1,100	575.00	632,500	
北野建設	4,000	224.00	896,000	
植木組	2,000	222.00	444,000	
三井ホーム	2,000	481.00	962,000	
矢作建設工業	2,500	759.00	1,897,500	
ピーエス三菱	1,400	505.00	707,000	
大東建託	6,900	9,820.00	67,758,000	
新日本建設	2,200	330.00	726,000	
N I P P O	4,000	1,817.00	7,268,000	
東亜道路工業	4,000	553.00	2,212,000	
前田道路	6,000	1,695.00	10,170,000	
日本道路	5,000	597.00	2,985,000	

東亜建設工業	16,000	235.00	3,760,000	
若築建設	10,000	140.00	1,400,000	
東洋建設	5,700	360.00	2,052,000	
五洋建設	21,500	300.00	6,450,000	
大林道路	2,000	587.00	1,174,000	
福田組	3,000	409.00	1,227,000	
住友林業	12,500	1,156.00	14,450,000	
日本基礎技術	2,000	408.00	816,000	
日成ビルド工業	5,000	216.00	1,080,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	8,000	137.00	1,096,000	
巴コーポレーション	2,300	471.00	1,083,300	
パナホーム	7,000	678.00	4,746,000	
大和ハウス工業	50,000	1,916.00	95,800,000	
ライト工業	3,800	799.00	3,036,200	
積水ハウス	48,000	1,371.00	65,808,000	
日特建設	2,200	432.00	950,400	
北陸電気工事	1,000	408.00	408,000	
ユアテック	3,000	316.00	948,000	
西部電気工業	2,000	442.00	884,000	
四電工	2,000	355.00	710,000	
中電工	2,600	1,561.00	4,058,600	
関電工	8,000	616.00	4,928,000	
きんでん	12,000	1,069.00	12,828,000	
東京エネシス	2,000	520.00	1,040,000	
トーエネック	3,000	612.00	1,836,000	
住友電設	1,300	1,465.00	1,904,500	
日本電設工業	3,000	1,264.00	3,792,000	
協和エクシオ	7,000	1,173.00	8,211,000	
新日本空調	1,500	612.00	918,000	
N D S	3,000	284.00	852,000	
九電工	3,000	598.00	1,794,000	
三機工業	4,000	595.00	2,380,000	
日揮	18,000	3,760.00	67,680,000	
中外炉工業	5,000	252.00	1,260,000	
ヤマト	2,000	347.00	694,000	

太平電業	3,000	710.00	2,130,000	
高砂熱学工業	5,200	807.00	4,196,400	
三晃金属工業	2,000	275.00	550,000	
朝日工業社	2,000	349.00	698,000	
明星工業	3,000	416.00	1,248,000	
大気社	2,400	2,179.00	5,229,600	
ダイダン	2,000	535.00	1,070,000	
日比谷総合設備	2,200	1,140.00	2,508,000	
東芝プラントシステム	3,000	1,627.00	4,881,000	
東洋エンジニアリング	10,000	410.00	4,100,000	
千代田化工建設	15,000	1,234.00	18,510,000	
新興プランテック	3,700	792.00	2,930,400	
日本製粉	11,000	479.00	5,269,000	
日清製粉グループ本社	18,100	1,050.00	19,005,000	
日東富士製粉	2,000	301.00	602,000	
昭和産業	8,000	300.00	2,400,000	
鳥越製粉	1,500	664.00	996,000	
協同飼料	6,000	111.00	666,000	
中部飼料	1,700	555.00	943,500	
日本配合飼料	6,000	122.00	732,000	
東洋精糖	3,000	103.00	309,000	
日本甜菜製糖	9,000	183.00	1,647,000	
三井製糖	7,000	341.00	2,387,000	
森永製菓	18,000	207.00	3,726,000	
中村屋	4,000	401.00	1,604,000	
江崎グリコ	7,000	1,048.00	7,336,000	
名糖産業	800	1,022.00	817,600	
不二家	10,000	191.00	1,910,000	
山崎製パン	13,000	1,005.00	13,065,000	
第一屋製パン	3,000	150.00	450,000	
モロゾフ	3,000	310.00	930,000	
亀田製菓	1,000	2,841.00	2,841,000	
カルビー	6,600	2,575.00	16,995,000	
森永乳業	15,000	305.00	4,575,000	
六甲バター	800	827.00	661,600	

ヤクルト本社	10,600	4,945.00	52,417,000	
明治ホールディングス	5,400	5,400.00	29,160,000	
雪印メグミルク	3,900	1,339.00	5,222,100	
プリマハム	9,000	205.00	1,845,000	
日本ハム	13,000	1,485.00	19,305,000	
伊藤ハム	10,000	418.00	4,180,000	
林兼産業	6,000	87.00	522,000	
丸大食品	9,000	307.00	2,763,000	
米久	600	775.00	465,000	
S Foods	1,000	987.00	987,000	
サッポロホールディングス	30,000	440.00	13,200,000	
アサヒグループホールディングス	36,500	2,760.00	100,740,000	
キリンホールディングス	78,000	1,449.00	113,022,000	
宝ホールディングス	14,000	945.00	13,230,000	
オエノンホールディングス	4,000	251.00	1,004,000	
養命酒製造	1,000	803.00	803,000	
コカ・コーラウエスト	5,600	2,258.00	12,644,800	
コカ・コーライーストジャパン	3,800	1,735.00	6,593,000	
サントリー食品インターナショナル	9,300	3,260.00	30,318,000	
ダイドードリンコ	800	4,215.00	3,372,000	
伊藤園	5,000	2,201.00	11,005,000	
キーコーヒー	1,700	1,547.00	2,629,900	
ユニカフェ	500	552.00	276,000	
ジャパンフーズ	300	1,222.00	366,600	
日清オイリオグループ	8,000	323.00	2,584,000	
不二製油	4,400	1,689.00	7,431,600	
かどや製油	200	2,686.00	537,200	
J - オイルミルズ	8,000	294.00	2,352,000	
キッコーマン	15,000	1,827.00	27,405,000	
味の素	43,000	1,360.00	58,480,000	
キューピー	9,200	1,458.00	13,413,600	
ハウス食品グループ本社	6,400	1,540.00	9,856,000	
カゴメ	7,000	1,678.00	11,746,000	
焼津水産化学工業	900	871.00	783,900	
アリアケジャパン	1,700	2,322.00	3,947,400	

ニチレイ	19,000	496.00	9,424,000	
東洋水産	9,000	2,956.00	26,604,000	
日清食品ホールディングス	7,100	4,115.00	29,216,500	
永谷園	2,000	880.00	1,760,000	
フジッコ	2,000	1,215.00	2,430,000	
ロック・フィールド	1,000	1,870.00	1,870,000	
日本たばこ産業	100,700	3,505.00	352,953,500	
ケンコーマヨネーズ	600	891.00	534,600	
わらべや日洋	1,100	1,821.00	2,003,100	
なとり	800	968.00	774,400	
ミヨシ油脂	6,000	157.00	942,000	
片倉工業	2,000	1,135.00	2,270,000	
ゲンゼ	14,000	261.00	3,654,000	
東洋紡	72,000	190.00	13,680,000	
ユニチカ	46,000	61.00	2,806,000	
富士紡ホールディングス	9,000	200.00	1,800,000	
日清紡ホールディングス	11,000	849.00	9,339,000	
倉敷紡績	17,000	170.00	2,890,000	
シキボウ	10,000	129.00	1,290,000	
日本毛織	5,000	778.00	3,890,000	
大東紡織	3,000	83.00	249,000	
トーア紡コーポレーション	7,000	80.00	560,000	
ダイドーリミテッド	1,900	656.00	1,246,400	
帝国繊維	2,000	905.00	1,810,000	
帝人	70,000	217.00	15,190,000	
東レ	123,000	612.00	75,276,000	
サカイオーベックス	5,000	149.00	745,000	
住江織物	5,000	288.00	1,440,000	
日本フェルト	1,000	442.00	442,000	
イチカワ	1,000	290.00	290,000	
日本バイリーン	2,000	563.00	1,126,000	
日東製網	2,000	127.00	254,000	
芦森工業	3,000	131.00	393,000	
アツギ	14,000	116.00	1,624,000	
ダイニック	3,000	172.00	516,000	

セーレン	4,600	642.00	2,953,200	
東海染工	3,000	123.00	369,000	
小松精練	3,000	484.00	1,452,000	
ワコールホールディングス	10,000	1,090.00	10,900,000	
ホギメディカル	1,100	5,600.00	6,160,000	
レナウン	4,100	130.00	533,000	
クラウドディア	200	1,102.00	220,400	
T S Iホールディングス	8,200	669.00	5,485,800	
三陽商会	9,000	277.00	2,493,000	
ナイガイ	6,000	87.00	522,000	
オンワードホールディングス	11,000	792.00	8,712,000	
ルック	3,000	298.00	894,000	
キムラタン	57,000	15.00	855,000	
ゴールドウイン	4,000	446.00	1,784,000	
デサント	4,000	708.00	2,832,000	
キング	800	414.00	331,200	
ヤマトインターナショナル	1,000	435.00	435,000	
特種東海製紙	10,000	202.00	2,020,000	
王子ホールディングス	75,000	447.00	33,525,000	
日本製紙	8,800	1,594.00	14,027,200	
三菱製紙	24,000	88.00	2,112,000	
北越紀州製紙	11,500	445.00	5,117,500	
中越パルプ工業	7,000	157.00	1,099,000	
巴川製紙所	3,000	179.00	537,000	
大王製紙	6,000	750.00	4,500,000	
レンゴー	14,000	512.00	7,168,000	
トーマク	5,000	320.00	1,600,000	
ザ・バック	1,200	1,877.00	2,252,400	
クラレ	26,900	1,160.00	31,204,000	
旭化成	106,000	756.00	80,136,000	
共和レザー	1,100	468.00	514,800	
コープケミカル	3,000	139.00	417,000	
昭和電工	113,000	138.00	15,594,000	
住友化学	125,000	365.00	45,625,000	
日本化成	3,000	142.00	426,000	

住友精化	3,000	641.00	1,923,000	
日産化学工業	11,500	1,536.00	17,664,000	
ラサ工業	7,000	211.00	1,477,000	
クレハ	12,000	379.00	4,548,000	
多木化学	1,000	767.00	767,000	
テイカ	3,000	292.00	876,000	
石原産業	30,000	88.00	2,640,000	
片倉チッカリン	1,000	269.00	269,000	
日本曹達	11,000	615.00	6,765,000	
東ソー	45,000	414.00	18,630,000	
トクヤマ	26,000	394.00	10,244,000	
セントラル硝子	16,000	339.00	5,424,000	
東亜合成	20,000	440.00	8,800,000	
ダイソー	7,000	294.00	2,058,000	
関東電化工業	4,000	205.00	820,000	
電気化学工業	34,000	410.00	13,940,000	
信越化学工業	30,500	5,690.00	173,545,000	
日本カーバイド工業	5,000	306.00	1,530,000	
堺化学工業	7,000	324.00	2,268,000	
エア・ウォーター	14,000	1,377.00	19,278,000	
大陽日酸	22,000	622.00	13,684,000	
日本化学工業	6,000	166.00	996,000	
日本パーカライズン	4,000	1,930.00	7,720,000	
高圧ガス工業	3,000	546.00	1,638,000	
四国化成工業	2,000	729.00	1,458,000	
戸田工業	3,000	297.00	891,000	
ステラ ケミファ	900	1,773.00	1,595,700	
保土谷化学工業	5,000	195.00	975,000	
日本触媒	14,000	1,183.00	16,562,000	
大日精化工業	7,000	410.00	2,870,000	
カネカ	21,000	614.00	12,894,000	
三菱瓦斯化学	27,000	788.00	21,276,000	
三井化学	77,000	229.00	17,633,000	
J S R	15,500	1,853.00	28,721,500	
東京応化工業	3,300	2,114.00	6,976,200	

大阪有機化学工業	1,100	441.00	485,100	
三菱ケミカルホールディングス	106,500	439.00	46,753,500	
日本合成化学工業	4,000	929.00	3,716,000	
ダイセル	22,000	800.00	17,600,000	
住友ベークライト	13,000	347.00	4,511,000	
積水化学工業	35,000	1,100.00	38,500,000	
日本ゼオン	13,000	1,179.00	15,327,000	
アイカ工業	4,800	2,028.00	9,734,400	
宇部興産	86,000	196.00	16,856,000	
積水樹脂	2,000	1,426.00	2,852,000	
タキロン	4,000	409.00	1,636,000	
旭有機材工業	6,000	218.00	1,308,000	
日立化成	7,400	1,493.00	11,048,200	
ニチバン	2,000	382.00	764,000	
リケンテクノス	3,000	449.00	1,347,000	
大倉工業	4,000	341.00	1,364,000	
積水化成成品工業	5,000	271.00	1,355,000	
群栄化学工業	4,000	467.00	1,868,000	
タイガースポリマー	900	441.00	396,900	
ミライアル	400	1,574.00	629,600	
日本化薬	12,000	1,358.00	16,296,000	
カーリットホールディングス	1,400	490.00	686,000	
日本精化	1,400	649.00	908,600	
A D E K A	7,300	1,130.00	8,249,000	
日油	13,000	723.00	9,399,000	
新日本理化	2,000	285.00	570,000	
ハリマ化成グループ	1,500	461.00	691,500	
花王	44,100	3,230.00	142,443,000	
第一工業製薬	3,000	243.00	729,000	
三洋化成工業	5,000	647.00	3,235,000	
大日本塗料	10,000	165.00	1,650,000	
日本ペイント	15,000	1,660.00	24,900,000	
関西ペイント	21,000	1,292.00	27,132,000	
神東塗料	1,000	224.00	224,000	
中国塗料	5,000	572.00	2,860,000	

日本特殊塗料	1,300	477.00	620,100
藤倉化成	2,200	534.00	1,174,800
太陽ホールディングス	1,400	2,936.00	4,110,400
D I C	60,000	285.00	17,100,000
サカタインクス	4,000	938.00	3,752,000
東洋インキ S C ホールディングス	15,000	492.00	7,380,000
T & K T O K A	600	2,013.00	1,207,800
富士フイルムホールディングス	38,800	2,461.00	95,486,800
資生堂	30,300	1,673.00	50,691,900
ライオン	19,000	574.00	10,906,000
高砂香料工業	6,000	563.00	3,378,000
マンダム	1,700	3,345.00	5,686,500
ミルボン	900	4,015.00	3,613,500
ファンケル	3,900	1,157.00	4,512,300
コーセー	2,700	3,040.00	8,208,000
ドクターシーラボ	12	327,000.00	3,924,000
シーボン	200	2,006.00	401,200
ポーラ・オルビスホールディングス	1,700	3,415.00	5,805,500
ノエビアホールディングス	1,100	1,599.00	1,758,900
エステー	1,100	1,003.00	1,103,300
コニシ	1,200	1,956.00	2,347,200
長谷川香料	2,200	1,380.00	3,036,000
星光 P M C	700	485.00	339,500
小林製薬	2,800	5,390.00	15,092,000
荒川化学工業	1,300	908.00	1,180,400
メック	1,300	482.00	626,600
日本高純度化学	5	218,400.00	1,092,000
J C U	300	3,835.00	1,150,500
新田ゼラチン	1,000	1,082.00	1,082,000
アース製薬	1,200	3,640.00	4,368,000
イハラケミカル工業	3,000	739.00	2,217,000
北興化学工業	2,000	298.00	596,000
大成ラミック	500	2,513.00	1,256,500
クミアイ化学工業	4,000	727.00	2,908,000
日本農薬	4,000	1,167.00	4,668,000

アキレス	14,000	159.00	2,226,000	
有沢製作所	2,800	562.00	1,573,600	
日東電工	14,000	5,230.00	73,220,000	
レック	500	1,222.00	611,000	
きもと	1,300	978.00	1,271,400	
藤森工業	1,500	2,829.00	4,243,500	
前澤化成工業	1,200	1,037.00	1,244,400	
J S P	1,100	1,536.00	1,689,600	
エフピコ	800	7,590.00	6,072,000	
天馬	1,400	1,276.00	1,786,400	
信越ポリマー	3,300	354.00	1,168,200	
東リ	4,000	207.00	828,000	
ニフコ	3,800	2,605.00	9,899,000	
日本バルカー工業	7,000	271.00	1,897,000	
ユニ・チャーム	10,300	5,920.00	60,976,000	
協和発酵キリン	20,000	1,059.00	21,180,000	
武田薬品工業	63,700	4,695.00	299,071,500	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	39,100	5,640.00	220,524,000	
大日本住友製薬	11,900	1,354.00	16,112,600	
塩野義製薬	26,600	2,186.00	58,147,600	
田辺三菱製薬	14,100	1,366.00	19,260,600	
わかもと製薬	2,000	265.00	530,000	
あすか製薬	2,000	688.00	1,376,000	
日本新薬	4,000	1,634.00	6,536,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,441.00	732,300	
中外製薬	16,900	2,251.00	38,041,900	
科研製薬	6,000	1,537.00	9,222,000	
エーザイ	20,900	3,910.00	81,719,000	
ロート製薬	7,000	1,402.00	9,814,000	
小野薬品工業	7,600	7,510.00	57,076,000	
久光製薬	5,200	5,230.00	27,196,000	
有機合成薬品工業	1,000	272.00	272,000	
持田製薬	1,300	6,260.00	8,138,000	
参天製薬	6,200	4,835.00	29,977,000	
扶桑薬品工業	6,000	315.00	1,890,000	

日本ケミファ	2,000	457.00	914,000	
ツムラ	5,000	3,010.00	15,050,000	
日医工	2,700	2,305.00	6,223,500	
キッセイ薬品工業	3,200	2,202.00	7,046,400	
生化学工業	3,600	1,270.00	4,572,000	
栄研化学	1,300	1,907.00	2,479,100	
日水製薬	700	1,084.00	758,800	
鳥居薬品	1,200	2,554.00	3,064,800	
東和薬品	900	4,625.00	4,162,500	
富士製薬工業	500	1,728.00	864,000	
沢井製薬	2,400	6,910.00	16,584,000	
ゼリア新薬工業	2,700	2,261.00	6,104,700	
第一三共	53,600	1,874.00	100,446,400	
キョーリン製薬ホールディングス	4,500	2,027.00	9,121,500	
大幸薬品	800	1,655.00	1,324,000	
ダイト	600	1,404.00	842,400	
大塚ホールディングス	33,700	2,759.00	92,978,300	
大正製薬ホールディングス	4,100	7,010.00	28,741,000	
日本コークス工業	13,700	118.00	1,616,600	
昭和シェル石油	15,200	1,030.00	15,656,000	
コスモ石油	47,000	175.00	8,225,000	
ニチレキ	2,000	1,052.00	2,104,000	
東燃ゼネラル石油	26,000	928.00	24,128,000	
ユシロ化学工業	900	908.00	817,200	
ビーピー・カストロール	700	463.00	324,100	
富士石油	4,300	356.00	1,530,800	
MORESCO	400	1,645.00	658,000	
出光興産	2,000	8,590.00	17,180,000	
JXホールディングス	188,600	513.00	96,751,800	
横浜ゴム	19,000	954.00	18,126,000	
東洋ゴム工業	14,000	561.00	7,854,000	
ブリヂストン	53,300	3,270.00	174,291,000	
住友ゴム工業	13,200	1,327.00	17,516,400	
藤倉ゴム工業	1,100	430.00	473,000	
オカモト	6,000	316.00	1,896,000	

フコク	700	846.00	592,200	
ニッタ	1,700	2,148.00	3,651,600	
東海ゴム工業	3,100	920.00	2,852,000	
三ツ星ベルト	4,000	512.00	2,048,000	
バンドー化学	6,000	394.00	2,364,000	
日東紡績	12,000	468.00	5,616,000	
旭硝子	84,000	605.00	50,820,000	
日本板硝子	82,000	125.00	10,250,000	
石塚硝子	2,000	382.00	764,000	
日本山村硝子	7,000	183.00	1,281,000	
日本電気硝子	34,000	517.00	17,578,000	
オハラ	700	604.00	422,800	
住友大阪セメント	32,000	395.00	12,640,000	
太平洋セメント	100,000	417.00	41,700,000	
デイ・シイ	1,700	723.00	1,229,100	
日本ヒューム	2,000	893.00	1,786,000	
日本コンクリート工業	3,000	587.00	1,761,000	
三谷セキサン	800	1,461.00	1,168,800	
ジャパンパイル	1,300	1,033.00	1,342,900	
東海カーボン	16,000	331.00	5,296,000	
日本カーボン	9,000	190.00	1,710,000	
東洋炭素	900	1,799.00	1,619,100	
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	266.00	2,394,000	
TOTO	25,000	1,448.00	36,200,000	
日本碍子	22,000	1,667.00	36,674,000	
日本特殊陶業	15,000	2,253.00	33,795,000	
ダントーホールディングス	2,000	119.00	238,000	
MARUWA	400	3,590.00	1,436,000	
品川リフラクトリーズ	4,000	209.00	836,000	
黒崎播磨	4,000	243.00	972,000	
ヨータイ	1,000	303.00	303,000	
イソライト工業	600	187.00	112,200	
東京窯業	2,000	236.00	472,000	
ニッカトー	600	418.00	250,800	
フジミインコーポレーテッド	1,600	1,328.00	2,124,800	

エーアンドエーマテリアル	3,000	145.00	435,000	
ニチアス	8,000	663.00	5,304,000	
ニチハ	2,100	1,412.00	2,965,200	
新日鐵住金	717,000	321.00	230,157,000	
神戸製鋼所	236,000	172.00	40,592,000	
合同製鐵	9,000	179.00	1,611,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	43,400	2,230.00	96,782,000	
日新製鋼ホールディングス	7,200	1,322.00	9,518,400	
東京製鐵	9,400	525.00	4,935,000	
共英製鋼	1,600	1,970.00	3,152,000	
大和工業	3,500	3,435.00	12,022,500	
東京鐵鋼	4,000	407.00	1,628,000	
大阪製鐵	900	1,920.00	1,728,000	
淀川製鋼所	12,000	455.00	5,460,000	
東洋鋼鈹	4,000	447.00	1,788,000	
丸一鋼管	5,700	2,365.00	13,480,500	
モリ工業	3,000	418.00	1,254,000	
大同特殊鋼	29,000	534.00	15,486,000	
日本高周波鋼業	7,000	106.00	742,000	
日本冶金工業	13,500	318.00	4,293,000	
山陽特殊製鋼	8,000	490.00	3,920,000	
愛知製鋼	9,000	473.00	4,257,000	
日立金属	15,000	1,304.00	19,560,000	
日本金属	5,000	131.00	655,000	
大平洋金属	12,000	371.00	4,452,000	
日本電工	7,000	288.00	2,016,000	
栗本鐵工所	9,000	264.00	2,376,000	
虹技	2,000	198.00	396,000	
日本鑄鉄管	2,000	243.00	486,000	
三菱製鋼	10,000	287.00	2,870,000	
日亜鋼業	2,000	358.00	716,000	
日本精線	1,000	431.00	431,000	
シンニッタン	1,600	369.00	590,400	
新家工業	4,000	172.00	688,000	
大紀アルミニウム工業所	3,000	272.00	816,000	

日本軽金属ホールディングス	38,400	139.00	5,337,600	
三井金属鉱業	43,000	259.00	11,137,000	
東邦亜鉛	9,000	297.00	2,673,000	
三菱マテリアル	106,000	388.00	41,128,000	
住友金属鉱山	44,000	1,354.00	59,576,000	
DOWAホールディングス	19,000	914.00	17,366,000	
古河機械金属	28,000	202.00	5,656,000	
エス・サイエンス	5,800	64.00	371,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,900	2,161.00	4,105,900	
東邦チタニウム	2,900	781.00	2,264,900	
UACJ	21,000	317.00	6,657,000	
古河電気工業	54,000	239.00	12,906,000	
住友電気工業	63,900	1,466.00	93,677,400	
フジクラ	27,000	442.00	11,934,000	
昭和電線ホールディングス	22,000	112.00	2,464,000	
タツタ電線	2,500	553.00	1,382,500	
沖電線	2,000	165.00	330,000	
カナレ電気	300	1,525.00	457,500	
平河ヒューテック	400	757.00	302,800	
リョービ	10,000	448.00	4,480,000	
アサヒホールディングス	2,600	1,654.00	4,300,400	
稲葉製作所	700	1,255.00	878,500	
宮地エンジニアリンググループ	6,000	226.00	1,356,000	
トーカロ	1,000	1,622.00	1,622,000	
アルファC o	600	1,041.00	624,600	
SUMCO	10,400	857.00	8,912,800	
川田テクノロジーズ	400	2,840.00	1,136,000	
東洋製罐グループホールディングス	12,100	1,989.00	24,066,900	
ホッカンホールディングス	4,000	309.00	1,236,000	
コロナ	900	1,112.00	1,000,800	
横河ブリッジホールディングス	3,000	1,442.00	4,326,000	
駒井ハルテック	3,000	321.00	963,000	
高田機工	2,000	219.00	438,000	
三和ホールディングス	14,000	635.00	8,890,000	
文化シャッター	4,000	558.00	2,232,000	

三協立山	2,200	2,065.00	4,543,000	
東洋シャッター	500	604.00	302,000	
LIXILグループ	23,600	2,293.00	54,114,800	
日本フィルコン	1,100	441.00	485,100	
ノーリツ	3,300	2,302.00	7,596,600	
長府製作所	1,800	2,239.00	4,030,200	
リンナイ	2,600	7,680.00	19,968,000	
ダイニチ工業	900	823.00	740,700	
日東精工	3,000	360.00	1,080,000	
三洋工業	2,000	181.00	362,000	
岡部	3,400	1,311.00	4,457,400	
中国工業	300	766.00	229,800	
東プレ	3,300	1,394.00	4,600,200	
高周波熱錬	2,500	937.00	2,342,500	
東京製綱	12,000	167.00	2,004,000	
サンコール	1,000	613.00	613,000	
モリテック スチール	900	272.00	244,800	
パイオラックス	800	3,110.00	2,488,000	
日本発條	13,500	1,028.00	13,878,000	
中央発條	2,000	306.00	612,000	
アドバネクス	4,000	123.00	492,000	
三益半導体工業	1,300	856.00	1,112,800	
アタカ大機	1,000	450.00	450,000	
日本製鋼所	24,000	514.00	12,336,000	
三浦工業	2,500	2,645.00	6,612,500	
タクマ	5,000	846.00	4,230,000	
ツガミ	5,000	502.00	2,510,000	
オークマ	11,000	865.00	9,515,000	
東芝機械	9,000	539.00	4,851,000	
アマダ	26,000	852.00	22,152,000	
アイダエンジニアリング	4,000	956.00	3,824,000	
滝澤鉄工所	4,000	144.00	576,000	
富士機械製造	5,200	893.00	4,643,600	
牧野フライス製作所	9,000	720.00	6,480,000	
オーエスジー	7,000	1,585.00	11,095,000	

ダイジェット工業	2,000	157.00	314,000	
旭ダイヤモンド工業	4,400	868.00	3,819,200	
D M G 森精機	8,800	1,568.00	13,798,400	
ディスコ	1,900	6,080.00	11,552,000	
日東工器	1,000	1,852.00	1,852,000	
豊和工業	1,000	881.00	881,000	
大阪機工	7,000	142.00	994,000	
東洋機械金属	1,300	381.00	495,300	
津田駒工業	4,000	156.00	624,000	
島精機製作所	2,200	2,024.00	4,452,800	
日阪製作所	2,000	911.00	1,822,000	
やまびこ	700	2,895.00	2,026,500	
ペガサスミシン製造	1,600	379.00	606,400	
ナブテスコ	7,700	2,241.00	17,255,700	
三井海洋開発	1,400	2,976.00	4,166,400	
レオン自動機	2,000	490.00	980,000	
S M C	4,800	22,700.00	108,960,000	
新川	1,400	634.00	887,600	
ホソカワミクロン	3,000	668.00	2,004,000	
ユニオンツール	700	2,255.00	1,578,500	
オイレス工業	1,600	2,102.00	3,363,200	
日精エー・エス・ピー機械	500	2,016.00	1,008,000	
サトーホールディングス	1,800	2,018.00	3,632,400	
日本エアテック	500	495.00	247,500	
日精樹脂工業	1,200	614.00	736,800	
ワイエイシイ	700	615.00	430,500	
小松製作所	79,200	2,105.00	166,716,000	
住友重機械工業	46,000	461.00	21,206,000	
日立建機	8,700	2,065.00	17,965,500	
日工	3,000	529.00	1,587,000	
巴工業	600	1,535.00	921,000	
井関農機	17,000	320.00	5,440,000	
T O W A	1,400	464.00	649,600	
丸山製作所	4,000	272.00	1,088,000	
北川鉄工所	8,000	200.00	1,600,000	

クボタ	89,000	1,563.00	139,107,000	
荏原実業	500	1,344.00	672,000	
三菱化工機	6,000	174.00	1,044,000	
月島機械	3,000	1,082.00	3,246,000	
帝国電機製作所	600	2,144.00	1,286,400	
新東工業	4,000	735.00	2,940,000	
澁谷工業	1,100	1,879.00	2,066,900	
アイチ コーポレーション	2,400	501.00	1,202,400	
小森コーポレーション	4,100	1,585.00	6,498,500	
鶴見製作所	1,000	1,027.00	1,027,000	
住友精密工業	3,000	406.00	1,218,000	
酒井重工業	3,000	418.00	1,254,000	
荏原製作所	37,000	522.00	19,314,000	
石井鐵工所	3,000	284.00	852,000	
西島製作所	1,800	861.00	1,549,800	
ダイキン工業	22,100	5,790.00	127,959,000	
オルガノ	3,000	474.00	1,422,000	
トーヨーカネツ	9,000	283.00	2,547,000	
栗田工業	10,100	2,135.00	21,563,500	
椿本チエイン	9,000	659.00	5,931,000	
大同工業	3,000	278.00	834,000	
日本コンベヤ	5,000	142.00	710,000	
木村化工機	1,600	530.00	848,000	
アネスト岩田	3,000	497.00	1,491,000	
ダイフク	7,000	1,272.00	8,904,000	
加藤製作所	4,000	678.00	2,712,000	
油研工業	3,000	216.00	648,000	
タダノ	7,000	1,310.00	9,170,000	
フジテック	5,000	1,201.00	6,005,000	
C K D	4,600	923.00	4,245,800	
キトー	1,000	1,573.00	1,573,000	
平和	3,500	1,612.00	5,642,000	
理想科学工業	1,200	2,230.00	2,676,000	
S A N K Y O	4,900	4,670.00	22,883,000	
日本金銭機械	1,500	2,051.00	3,076,500	

マースエンジニアリング	900	1,907.00	1,716,300	
福島工業	900	1,496.00	1,346,400	
オーイズミ	600	1,219.00	731,400	
ダイコク電機	700	2,118.00	1,482,600	
アマノ	4,600	971.00	4,466,600	
J U K I	10,000	184.00	1,840,000	
サンデン	9,000	383.00	3,447,000	
蛇の目マシン工業	16,000	80.00	1,280,000	
マックス	3,000	1,083.00	3,249,000	
グローリー	4,800	2,412.00	11,577,600	
新晃工業	1,100	796.00	875,600	
大和冷機工業	3,000	616.00	1,848,000	
セガサミーホールディングス	17,500	2,588.00	45,290,000	
日本ピストンリング	6,000	178.00	1,068,000	
リケン	6,000	423.00	2,538,000	
T P R	1,800	1,760.00	3,168,000	
ホシザキ電機	3,600	3,530.00	12,708,000	
大豊工業	1,200	1,163.00	1,395,600	
日本精工	36,000	1,034.00	37,224,000	
N T N	38,000	420.00	15,960,000	
ジェイテクト	17,200	1,252.00	21,534,400	
不二越	15,000	479.00	7,185,000	
日本トムソン	5,000	527.00	2,635,000	
T H K	10,100	2,062.00	20,826,200	
ユーシン精機	700	1,990.00	1,393,000	
前澤給装工業	600	1,274.00	764,400	
イーグル工業	2,000	1,563.00	3,126,000	
前澤工業	1,200	362.00	434,400	
日本ピラー工業	2,000	661.00	1,322,000	
キッツ	7,300	417.00	3,044,100	
日立工機	4,400	712.00	3,132,800	
マキタ	10,600	4,995.00	52,947,000	
日立造船	12,000	777.00	9,324,000	
三菱重工業	289,000	637.00	184,093,000	
I H I	111,000	406.00	45,066,000	

イビデン	9,900	1,660.00	16,434,000	
コニカミノルタ	43,000	862.00	37,066,000	
ブラザー工業	21,000	1,012.00	21,252,000	
ミネベア	22,000	633.00	13,926,000	
日立製作所	389,000	681.00	264,909,000	
東芝	320,000	410.00	131,200,000	
三菱電機	162,000	1,089.00	176,418,000	
富士電機	45,000	443.00	19,935,000	
東洋電機製造	3,000	315.00	945,000	
安川電機	18,000	1,269.00	22,842,000	
シンフォニアテクノロジー	10,000	171.00	1,710,000	
明電舎	15,000	364.00	5,460,000	
オリジン電気	2,000	325.00	650,000	
山洋電気	2,000	638.00	1,276,000	
デンヨー	1,600	1,190.00	1,904,000	
東芝テック	10,000	597.00	5,970,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	238.00	714,000	
マブチモーター	2,300	5,430.00	12,489,000	
日本電産	8,800	9,370.00	82,456,000	
東光高岳ホールディングス	900	2,061.00	1,854,900	
宮越ホールディングス	600	284.00	170,400	
ダイヘン	10,000	416.00	4,160,000	
ヤーマン	200	1,260.00	252,000	
JVCケンウッド	11,200	190.00	2,128,000	
第一精工	700	1,504.00	1,052,800	
日新電機	3,000	616.00	1,848,000	
大崎電気工業	3,000	551.00	1,653,000	
オムロン	18,300	3,835.00	70,180,500	
日東工業	2,400	1,609.00	3,861,600	
I D E C	2,100	842.00	1,768,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	31,000	584.00	18,104,000	
サクサホールディングス	4,000	153.00	612,000	
メルコホールディングス	800	1,293.00	1,034,400	
テクノメディカ	400	2,138.00	855,200	
日本電気	223,000	217.00	48,391,000	

富士通	157,000	431.00	67,667,000	
沖電気工業	63,000	226.00	14,238,000	
岩崎通信機	8,000	97.00	776,000	
電気興業	5,000	660.00	3,300,000	
サンケン電気	8,000	530.00	4,240,000	
ナカヨ通信機	2,000	324.00	648,000	
アイホン	900	1,609.00	1,448,100	
ルネサスエレクトロニクス	8,400	536.00	4,502,400	
セイコーエプソン	11,100	2,120.00	23,532,000	
ワコム	12,700	742.00	9,423,400	
アルバック	2,700	999.00	2,697,300	
アクセル	800	1,844.00	1,475,200	
E I Z O	1,500	2,707.00	4,060,500	
日本信号	4,100	743.00	3,046,300	
京三製作所	4,000	313.00	1,252,000	
能美防災	2,000	976.00	1,952,000	
ホーチキ	1,000	523.00	523,000	
エレコム	600	1,425.00	855,000	
日本無線	4,000	346.00	1,384,000	
パナソニック	185,400	1,033.00	191,518,200	
シャープ	117,000	288.00	33,696,000	
アンリツ	9,400	1,253.00	11,778,200	
富士通ゼネラル	4,000	1,190.00	4,760,000	
日立国際電気	3,000	1,253.00	3,759,000	
ソニー	88,900	1,689.00	150,152,100	
T D K	9,800	4,195.00	41,111,000	
帝国通信工業	4,000	170.00	680,000	
ミツミ電機	6,200	683.00	4,234,600	
タムラ製作所	6,000	256.00	1,536,000	
アルプス電気	11,800	910.00	10,738,000	
池上通信機	5,000	102.00	510,000	
パイオニア	22,500	179.00	4,027,500	
日本電波工業	1,500	899.00	1,348,500	
日本トリム	300	8,520.00	2,556,000	
ローランド ディー . ジー .	700	2,906.00	2,034,200	

フォスター電機	1,700	1,977.00	3,360,900	
クラリオン	10,000	123.00	1,230,000	
S M K	5,000	466.00	2,330,000	
ヨコオ	1,400	548.00	767,200	
東光	8,000	344.00	2,752,000	
ティアック	9,000	63.00	567,000	
ホシデン	4,800	539.00	2,587,200	
ヒロセ電機	2,800	14,910.00	41,748,000	
日本航空電子工業	4,000	973.00	3,892,000	
T O A	1,800	844.00	1,519,200	
古野電気	1,600	643.00	1,028,800	
ユニデン	5,000	242.00	1,210,000	
アルパイン	3,500	1,299.00	4,546,500	
スミダコーポレーション	1,300	463.00	601,900	
アイコム	900	2,267.00	2,040,300	
リオン	500	1,495.00	747,500	
船井電機	1,600	1,045.00	1,672,000	
横河電機	17,500	1,292.00	22,610,000	
新電元工業	5,000	644.00	3,220,000	
アズビル	4,900	2,291.00	11,225,900	
日本光電工業	3,500	3,960.00	13,860,000	
チノー	3,000	230.00	690,000	
共和電業	2,000	432.00	864,000	
日本電子材料	700	359.00	251,300	
堀場製作所	2,900	3,540.00	10,266,000	
アドバンテスト	11,100	1,117.00	12,398,700	
小野測器	2,000	435.00	870,000	
エスベック	1,700	788.00	1,339,600	
パナソニック デバイスSUNX	1,400	457.00	639,800	
キーエンス	3,700	40,450.00	149,665,000	
日置電機	900	1,386.00	1,247,400	
シスメックス	6,800	6,410.00	43,588,000	
メガチップス	1,500	1,531.00	2,296,500	
O B A R A G R O U P	1,000	2,475.00	2,475,000	
日本電産コバル電子	1,700	600.00	1,020,000	

澤藤電機	1,000	240.00	240,000	
コーセル	2,300	1,219.00	2,803,700	
日立メディコ	1,000	1,316.00	1,316,000	
新日本無線	1,000	394.00	394,000	
オブテックス	1,000	1,623.00	1,623,000	
千代田インテグレ	700	1,859.00	1,301,300	
レーザーテック	1,200	953.00	1,143,600	
スタンレー電気	11,700	2,254.00	26,371,800	
岩崎電気	6,000	218.00	1,308,000	
ウシオ電機	9,900	1,228.00	12,157,200	
岡谷電機産業	900	342.00	307,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	280.00	392,000	
日本セラミック	900	1,397.00	1,257,300	
遠藤照明	700	2,289.00	1,602,300	
日本デジタル研究所	1,200	1,207.00	1,448,400	
古河電池	1,000	547.00	547,000	
双信電機	800	363.00	290,400	
山一電機	1,800	241.00	433,800	
図研	1,100	806.00	886,600	
日本電子	6,000	432.00	2,592,000	
カシオ計算機	16,800	953.00	16,010,400	
ファナック	18,100	15,360.00	278,016,000	
日本シイエムケイ	3,800	281.00	1,067,800	
エンプラス	600	6,140.00	3,684,000	
大真空	2,000	374.00	748,000	
ローム	8,600	3,740.00	32,164,000	
浜松ホトニクス	6,300	3,725.00	23,467,500	
三井ハイテック	2,200	683.00	1,502,600	
新光電気工業	5,500	796.00	4,378,000	
京セラ	28,900	4,935.00	142,621,500	
太陽誘電	7,900	1,232.00	9,732,800	
村田製作所	17,000	7,950.00	135,150,000	
ユーシン	2,300	734.00	1,688,200	
双葉電子工業	3,000	1,361.00	4,083,000	
北陸電気工業	7,000	138.00	966,000	

ニチコン	5,100	972.00	4,957,200	
日本ケミコン	9,000	395.00	3,555,000	
K O A	2,100	937.00	1,967,700	
市光工業	4,000	185.00	740,000	
小糸製作所	9,000	1,845.00	16,605,000	
ミツバ	3,000	1,381.00	4,143,000	
スター精密	3,100	1,095.00	3,394,500	
大日本スクリーン製造	15,000	506.00	7,590,000	
キャノン電子	1,500	1,809.00	2,713,500	
キャノン	94,000	3,090.00	290,460,000	代用有価証券 10,000株
リコー	49,000	1,006.00	49,294,000	
M U T O Hホールディングス	2,000	433.00	866,000	
東京エレクトロン	14,600	5,450.00	79,570,000	
トヨタ紡織	5,700	1,250.00	7,125,000	
鬼怒川ゴム工業	3,000	516.00	1,548,000	
ユニプレス	2,600	1,895.00	4,927,000	
豊田自動織機	14,800	4,330.00	64,084,000	
モリタホールディングス	3,000	863.00	2,589,000	
三櫻工業	2,100	705.00	1,480,500	
デンソー	40,100	4,755.00	190,675,500	
東海理化電機製作所	4,300	2,029.00	8,724,700	
三井造船	63,000	186.00	11,718,000	
佐世保重工業	12,000	97.00	1,164,000	
川崎重工業	126,000	397.00	50,022,000	
名村造船所	2,400	1,470.00	3,528,000	
サノヤスホールディングス	1,500	180.00	270,000	
日本車輛製造	6,000	517.00	3,102,000	
ニチユ三菱フォークリフト	2,000	461.00	922,000	
近畿車輛	3,000	298.00	894,000	
日産自動車	227,600	885.00	201,426,000	
いすゞ自動車	94,000	605.00	56,870,000	
トヨタ自動車	225,800	6,350.00	1,433,830,000	代用有価証券 35,000株
日野自動車	20,000	1,342.00	26,840,000	
三菱自動車工業	37,600	1,114.00	41,886,400	

エフテック	600	1,559.00	935,400	
G M B	200	1,189.00	237,800	
武蔵精密工業	1,700	2,193.00	3,728,100	
日産車体	8,000	1,598.00	12,784,000	
新明和工業	7,000	743.00	5,201,000	
極東開発工業	2,800	1,233.00	3,452,400	
日信工業	3,300	1,788.00	5,900,400	
トピー工業	13,000	196.00	2,548,000	
ティラド	6,000	307.00	1,842,000	
曙ブレーキ工業	7,500	488.00	3,660,000	
タチエス	2,400	1,523.00	3,655,200	
N O K	7,800	1,551.00	12,097,800	
フタバ産業	4,900	346.00	1,695,400	
カヤバ工業	14,000	569.00	7,966,000	
シロキ工業	4,000	212.00	848,000	
大同メタル工業	2,000	971.00	1,942,000	
プレス工業	6,000	422.00	2,532,000	
カルソニックカンセイ	11,000	473.00	5,203,000	
太平洋工業	3,300	683.00	2,253,900	
ケーヒン	3,700	1,547.00	5,723,900	
河西工業	2,000	578.00	1,156,000	
アイシン精機	14,900	3,860.00	57,514,000	
富士機工	2,000	341.00	682,000	
マツダ	241,000	434.00	104,594,000	
ダイハツ工業	17,200	1,825.00	31,390,000	
今仙電機製作所	1,200	1,361.00	1,633,200	
本田技研工業	146,000	3,930.00	573,780,000	
スズキ	33,900	2,477.00	83,970,300	
富士重工業	55,200	2,688.00	148,377,600	
ヤマハ発動機	24,700	1,435.00	35,444,500	
ショーワ	3,800	1,483.00	5,635,400	
T B K	2,000	566.00	1,132,000	
エクセディ	2,000	2,964.00	5,928,000	
豊田合成	5,200	2,356.00	12,251,200	
愛三工業	2,000	989.00	1,978,000	

ヨロズ	1,200	1,951.00	2,341,200	
エフ・シー・シー	2,600	2,211.00	5,748,600	
シマノ	7,000	8,490.00	59,430,000	
タカタ	2,900	2,455.00	7,119,500	
テイ・エス テック	3,400	3,485.00	11,849,000	
テルモ	12,400	4,750.00	58,900,000	
クリエートメディック	600	935.00	561,000	
日機装	5,000	1,303.00	6,515,000	
島津製作所	21,000	956.00	20,076,000	
JMS	3,000	317.00	951,000	
ショットモリテックス	400	279.00	111,600	
長野計器	1,100	690.00	759,000	
ブイ・テクノロジー	3	255,300.00	765,900	
東京計器	5,000	300.00	1,500,000	
愛知時計電機	2,000	286.00	572,000	
東京精密	2,900	1,831.00	5,309,900	
マニー	500	3,755.00	1,877,500	
ニコン	30,200	1,759.00	53,121,800	
トプコン	4,300	1,509.00	6,488,700	
オリンパス	24,200	3,135.00	75,867,000	
理研計器	1,400	750.00	1,050,000	
タムロン	1,300	1,954.00	2,540,200	
H O Y A	39,400	2,581.00	101,691,400	
ノーリツ鋼機	1,500	613.00	919,500	
エー・アンド・デイ	1,500	612.00	918,000	
シチズンホールディングス	20,000	697.00	13,940,000	
リズム時計工業	7,000	142.00	994,000	
大研医器	600	1,850.00	1,110,000	
松風	800	879.00	703,200	
セイコーホールディングス	11,000	440.00	4,840,000	
ニプロ	8,600	904.00	7,774,400	
パラマウントベッドホールディングス	1,600	3,140.00	5,024,000	
S H O - B I	500	422.00	211,000	
前田工織	1,200	1,168.00	1,401,600	
永大産業	2,000	493.00	986,000	

ダンロップスポーツ	900	1,228.00	1,105,200	
バンダイナムコホールディングス	17,900	1,849.00	33,097,100	
共立印刷	3,000	267.00	801,000	
フランスベッドホールディングス	10,000	197.00	1,970,000	
パイロットコーポレーション	1,400	3,640.00	5,096,000	
トッパン・フォームズ	2,900	913.00	2,647,700	
フジシールインターナショナル	2,000	2,906.00	5,812,000	
タカラトミー	5,300	501.00	2,655,300	
廣済堂	1,500	572.00	858,000	
アーク	4,800	255.00	1,224,000	
タカノ	700	479.00	335,300	
プロネクサス	1,700	639.00	1,086,300	
ホクシン	1,200	177.00	212,400	
ウッドワン	3,000	277.00	831,000	
大建工業	7,000	252.00	1,764,000	
凸版印刷	46,000	781.00	35,926,000	
大日本印刷	50,000	1,045.00	52,250,000	
図書印刷	3,000	272.00	816,000	
共同印刷	5,000	270.00	1,350,000	
日本写真印刷	2,700	1,678.00	4,530,600	
光村印刷	2,000	263.00	526,000	
宝印刷	900	682.00	613,800	
アシックス	16,100	1,718.00	27,659,800	
ツツミ	800	2,358.00	1,886,400	
ローランド	1,600	1,208.00	1,932,800	
小松ウオール工業	600	2,001.00	1,200,600	
ヤマハ	11,900	1,454.00	17,302,600	
河合楽器製作所	6,000	191.00	1,146,000	
クリナップ	1,700	864.00	1,468,800	
ビジョン	2,700	4,950.00	13,365,000	
兼松日産農林	3,000	160.00	480,000	
キングジム	1,400	697.00	975,800	
リンテック	3,800	2,016.00	7,660,800	
T A S A K I	300	624.00	187,200	
イトーキ	3,400	498.00	1,693,200	

任天堂	10,000	12,040.00	120,400,000	
三菱鉛筆	1,300	2,435.00	3,165,500	
タカラスタANDARD	7,000	817.00	5,719,000	
コクヨ	8,400	746.00	6,266,400	
ナカバヤシ	4,000	207.00	828,000	
岡村製作所	6,000	720.00	4,320,000	
美津濃	8,000	532.00	4,256,000	
アデランス	2,000	1,172.00	2,344,000	
東京電力	137,600	533.00	73,340,800	
中部電力	53,400	1,420.00	75,828,000	
関西電力	66,200	1,197.00	79,241,400	
中国電力	22,400	1,496.00	33,510,400	
北陸電力	15,900	1,403.00	22,307,700	
東北電力	40,600	1,133.00	45,999,800	
四国電力	14,600	1,687.00	24,630,200	
九州電力	35,900	1,327.00	47,639,300	
北海道電力	15,200	1,242.00	18,878,400	
沖縄電力	1,100	3,290.00	3,619,000	
電源開発	10,100	3,100.00	31,310,000	
東京瓦斯	189,000	511.00	96,579,000	
大阪瓦斯	168,000	403.00	67,704,000	
東邦瓦斯	41,000	502.00	20,582,000	
北海道瓦斯	3,000	267.00	801,000	
西部瓦斯	18,000	243.00	4,374,000	
静岡瓦斯	4,100	635.00	2,603,500	
東武鉄道	92,000	499.00	45,908,000	
相鉄ホールディングス	28,000	368.00	10,304,000	
東京急行電鉄	96,000	663.00	63,648,000	
京浜急行電鉄	42,000	908.00	38,136,000	
小田急電鉄	52,000	926.00	48,152,000	
京王電鉄	45,000	670.00	30,150,000	
京成電鉄	24,000	1,009.00	24,216,000	
富士急行	4,000	817.00	3,268,000	
東日本旅客鉄道	29,900	8,400.00	251,160,000	
西日本旅客鉄道	14,900	4,420.00	65,858,000	

東海旅客鉄道	14,400	12,510.00	180,144,000	
鴻池運輸	900	1,595.00	1,435,500	
西日本鉄道	21,000	381.00	8,001,000	
ハマキョウレックス	500	2,750.00	1,375,000	
サカイ引越センター	300	3,275.00	982,500	
近畿日本鉄道	163,000	359.00	58,517,000	
阪急阪神ホールディングス	109,000	548.00	59,732,000	
南海電気鉄道	34,000	370.00	12,580,000	
京阪電気鉄道	34,000	399.00	13,566,000	
神戸電鉄	4,000	346.00	1,384,000	
名糖運輸	700	645.00	451,500	
名古屋鉄道	57,000	291.00	16,587,000	
山陽電気鉄道	6,000	423.00	2,538,000	
日本通運	64,000	490.00	31,360,000	
ヤマトホールディングス	30,200	2,085.00	62,967,000	
山九	20,000	350.00	7,000,000	
丸運	1,000	247.00	247,000	
丸全昭和運輸	5,000	359.00	1,795,000	
センコー	7,000	538.00	3,766,000	
トナミホールディングス	3,000	217.00	651,000	
日本梱包運輸倉庫	5,000	1,778.00	8,890,000	
日本石油輸送	2,000	230.00	460,000	
福山通運	10,000	569.00	5,690,000	
セイノーホールディングス	12,000	942.00	11,304,000	
神奈川中央交通	2,000	504.00	1,008,000	
日立物流	3,400	1,516.00	5,154,400	
日本郵船	137,000	301.00	41,237,000	
商船三井	91,000	415.00	37,765,000	
川崎汽船	71,000	224.00	15,904,000	
N S ユナイテッド海運	7,000	286.00	2,002,000	
乾汽船	1,900	370.00	703,000	
明治海運	1,500	436.00	654,000	
飯野海運	6,700	632.00	4,234,400	
共栄タンカー	2,000	235.00	470,000	
日本航空	13,700	5,620.00	76,994,000	

ANAホールディングス	319,000	208.00	66,352,000	
パスコ	2,000	451.00	902,000	
ランコム	500	2,923.00	1,461,500	
日新	6,000	277.00	1,662,000	
三菱倉庫	11,000	1,305.00	14,355,000	
三井倉庫	8,000	482.00	3,856,000	
住友倉庫	11,000	559.00	6,149,000	
澁澤倉庫	4,000	408.00	1,632,000	
東陽倉庫	3,000	265.00	795,000	
日本トランスシティ	3,000	323.00	969,000	
ケイヒン	3,000	182.00	546,000	
中央倉庫	900	939.00	845,100	
安田倉庫	1,300	1,189.00	1,545,700	
東洋埠頭	5,000	260.00	1,300,000	
宇徳	1,300	324.00	421,200	
上組	19,000	861.00	16,359,000	
サンリツ	400	531.00	212,400	
キムラユニティー	400	993.00	397,200	
キューソー流通システム	500	1,055.00	527,500	
郵船ロジスティクス	1,500	1,108.00	1,662,000	
近鉄エクスプレス	1,500	3,740.00	5,610,000	
東海運	900	284.00	255,600	
エーアイティー	600	768.00	460,800	
NEC ネットエスアイ	1,800	2,492.00	4,485,600	
システナ	1,600	720.00	1,152,000	
デジタルアーツ	400	881.00	352,400	
新日鉄住金ソリューションズ	1,300	2,220.00	2,886,000	
コア	600	749.00	449,400	
ソフトクリエイイトホールディングス	500	938.00	469,000	
ITホールディングス	5,700	1,370.00	7,809,000	
ネオス	300	1,523.00	456,900	
電算システム	400	1,445.00	578,000	
グリー	8,300	810.00	6,723,000	
コーエーテクモホールディングス	3,200	1,200.00	3,840,000	
三菱総合研究所	600	2,077.00	1,246,200	

ボルテージ	200	1,051.00	210,200
電算	100	1,951.00	195,100
ヒト・コミュニケーションズ	200	1,461.00	292,200
ブレインパッド	100	1,222.00	122,200
K L a b	1,100	746.00	820,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	500	2,969.00	1,484,500
ネクソン	13,300	1,140.00	15,162,000
アイスタイル	500	710.00	355,000
エムアップ	300	1,125.00	337,500
エイチーム	200	2,434.00	486,800
ブロードリーフ	1,600	1,882.00	3,011,200
ハーツユナイテッドグループ	400	2,088.00	835,200
ダウンゴ	1,400	1,725.00	2,415,000
ベリサーブ	100	1,850.00	185,000
マクロミル	2,600	624.00	1,622,400
ティーガイア	1,600	1,014.00	1,622,400
テクマトリックス	500	573.00	286,500
GMOペイメントゲートウェイ	600	3,620.00	2,172,000
ザッパラス	900	745.00	670,500
インターネットイニシアティブ	2,300	2,766.00	6,361,800
ビットアイル	1,200	854.00	1,024,800
S R Aホールディングス	800	1,093.00	874,400
朝日ネット	1,500	488.00	732,000
パナソニック インフォメーションシステムズ	300	2,698.00	809,400
フェイス	500	1,042.00	521,000
野村総合研究所	9,100	3,170.00	28,847,000
サイバネットシステム	1,300	350.00	455,000
インテージホールディングス	900	1,273.00	1,145,700
ソースネクスト	800	785.00	628,000
クレスコ	400	746.00	298,400
フジ・メディア・ホールディングス	15,500	1,971.00	30,550,500
オービック	5,500	2,991.00	16,450,500
T D Cソフトウェアエンジニアリング	400	796.00	318,400
ヤフー	115,900	473.00	54,820,700
トレンドマイクロ	7,100	3,590.00	25,489,000

日本オラクル	3,200	3,875.00	12,400,000	
アルファシステムズ	500	1,286.00	643,000	
フューチャーアーキテクト	1,900	563.00	1,069,700	
シーエーシー	1,000	870.00	870,000	
ソフトバンク・テクノロジー	400	1,713.00	685,200	
トーセ	400	667.00	266,800	
オービックビジネスコンサルタント	800	3,385.00	2,708,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	1,900	3,860.00	7,334,000	
アイティフォー	1,800	404.00	727,200	
東計電算	300	1,426.00	427,800	
エクスネット	200	1,335.00	267,000	
大塚商会	1,400	12,320.00	17,248,000	
サイボウズ	24	28,700.00	688,800	
ソフトブレーン	2,200	132.00	290,400	
アグレックス	400	863.00	345,200	
電通国際情報サービス	1,000	1,141.00	1,141,000	
E Mシステムズ	200	1,997.00	399,400	
ウェザーニューズ	400	2,122.00	848,800	
C I J	1,500	406.00	609,000	
WOWOW	500	3,590.00	1,795,000	
日本コロムビア	800	642.00	513,600	
ネットワンシステムズ	6,300	672.00	4,233,600	
アルゴグラフィックス	600	1,589.00	953,400	
マーベラスAQL	2,400	576.00	1,382,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	2,900	2,441.00	7,078,900	
日本ユニシス	3,900	802.00	3,127,800	
兼松エレクトロニクス	1,000	1,267.00	1,267,000	
東京放送ホールディングス	8,600	1,314.00	11,300,400	
日本テレビホールディングス	15,900	1,809.00	28,763,100	
テレビ朝日	4,100	2,346.00	9,618,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	12,100	554.00	6,703,400	
テレビ東京ホールディングス	1,300	1,685.00	2,190,500	
コネクシオ	1,400	816.00	1,142,400	
日本電信電話	62,900	5,060.00	318,274,000	代用有価証券 12,300株
K D D I	49,700	5,470.00	271,859,000	

光通信	1,500	7,450.00	11,175,000
NTTドコモ	131,800	1,556.00	205,080,800
GMOインターネット	5,400	1,156.00	6,242,400
学研ホールディングス	5,000	298.00	1,490,000
ゼンリン	2,100	1,023.00	2,148,300
昭文社	1,000	615.00	615,000
KADOKAWA	1,500	3,500.00	5,250,000
インプレスホールディングス	1,100	133.00	146,300
アイネット	700	709.00	496,300
松竹	11,000	964.00	10,604,000
東宝	11,400	2,097.00	23,905,800
東映	7,000	582.00	4,074,000
AOI Pro.	800	641.00	512,800
エヌ・ティ・ティ・データ	11,300	3,245.00	36,668,500
DTS	1,500	1,665.00	2,497,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,700	1,641.00	9,353,700
シーイーシー	1,000	623.00	623,000
カプコン	4,100	1,827.00	7,490,700
ジャステック	1,000	837.00	837,000
SCSK	3,800	2,353.00	8,941,400
日本システムウエア	600	421.00	252,600
アイネス	2,200	631.00	1,388,200
TKC	1,400	1,621.00	2,269,400
富士ソフト	2,000	1,989.00	3,978,000
NSD	3,400	1,172.00	3,984,800
コナミ	7,200	2,416.00	17,395,200
福井コンピュータホールディングス	200	800.00	160,000
JBCCHホールディングス	1,300	789.00	1,025,700
ミロク情報サービス	1,000	387.00	387,000
ソフトバンク	78,600	7,550.00	593,430,000
ハウスイ	1,000	131.00	131,000
高千穂交易	700	953.00	667,100
伊藤忠食品	400	3,180.00	1,272,000
エレマテック	800	1,478.00	1,182,400
JALUX	500	1,146.00	573,000

あらた	4,000	345.00	1,380,000	
トーメンデバイス	300	1,663.00	498,900	
東京エレクトロン デバイス	300	1,569.00	470,700	
双日	107,100	188.00	20,134,800	
アルフレッサ ホールディングス	4,700	5,400.00	25,380,000	
横浜冷凍	4,000	770.00	3,080,000	
神栄	2,000	305.00	610,000	
山下医科器械	100	1,788.00	178,800	
ラサ商事	700	455.00	318,500	
アルコニックス	500	2,052.00	1,026,000	
神戸物産	200	2,228.00	445,600	
あい ホールディングス	2,900	1,232.00	3,572,800	
ダイワボウホールディングス	15,000	189.00	2,835,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,000	683.00	2,049,000	
八洲電機	1,300	423.00	549,900	
U K C ホールディングス	1,000	1,643.00	1,643,000	
T O K A I ホールディングス	7,800	342.00	2,667,600	
ミタチ産業	400	420.00	168,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,300	3,900.00	8,970,000	
富士興産	600	642.00	385,200	
協栄産業	2,000	193.00	386,000	
小野建	1,400	1,230.00	1,722,000	
佐島電機	1,200	585.00	702,000	
エコートレーディング	400	728.00	291,200	
伯東	1,000	942.00	942,000	
コンドーテック	1,300	741.00	963,300	
中山福	900	770.00	693,000	
ナガイレーベン	2,100	1,611.00	3,383,100	
三菱食品	1,800	2,527.00	4,548,600	
松田産業	1,200	1,379.00	1,654,800	
メディバルホールディングス	16,000	1,285.00	20,560,000	
アドヴァン	800	1,194.00	955,200	
S P K	400	1,781.00	712,400	
アズワン	1,100	2,205.00	2,425,500	
スズデン	600	519.00	311,400	

シモジマ	1,100	939.00	1,032,900	
ドウシシャ	1,700	1,479.00	2,514,300	
高速	1,000	920.00	920,000	
黒田電気	2,300	1,419.00	3,263,700	
丸文	1,400	484.00	677,600	
ハビネット	1,000	742.00	742,000	
トーメンエレクトロニクス	800	1,112.00	889,600	
エクセル	700	1,122.00	785,400	
マルカキカイ	500	1,466.00	733,000	
ガリバーインターナショナル	5,400	578.00	3,121,200	
日本エム・ディ・エム	1,400	284.00	397,600	
進和	1,000	1,139.00	1,139,000	
エスケイジャパン	400	277.00	110,800	
ダイトエレクトロン	800	382.00	305,600	
シークス	1,000	1,233.00	1,233,000	
田中商事	500	586.00	293,000	
オーハシテクニカ	900	847.00	762,300	
マクニカ	800	2,792.00	2,233,600	
白銅	500	797.00	398,500	
伊藤忠商事	127,600	1,230.00	156,948,000	
丸紅	140,000	763.00	106,820,000	
高島	3,000	274.00	822,000	
長瀬産業	9,100	1,220.00	11,102,000	
蝶理	1,000	1,167.00	1,167,000	
豊田通商	17,900	2,466.00	44,141,400	
三共生興	2,700	331.00	893,700	
兼松	34,000	135.00	4,590,000	
ツカモトコーポレーション	3,000	154.00	462,000	
三井物産	147,400	1,364.00	201,053,600	
日本紙パルプ商事	8,000	313.00	2,504,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,800	2,183.00	10,478,400	
カメイ	2,100	727.00	1,526,700	
東都水産	3,000	209.00	627,000	
OUGホールディングス	2,000	181.00	362,000	
スターゼン	6,000	267.00	1,602,000	

山善	6,200	632.00	3,918,400
椿本興業	2,000	268.00	536,000
住友商事	94,500	1,260.00	119,070,000
内田洋行	4,000	286.00	1,144,000
三菱商事	124,900	1,977.00	246,927,300
第一実業	4,000	426.00	1,704,000
キャノンマーケティングジャパン	4,600	1,420.00	6,532,000
西華産業	6,000	239.00	1,434,000
佐藤商事	1,400	600.00	840,000
菱洋エレクトロ	1,900	926.00	1,759,400
東京産業	1,600	329.00	526,400
ユアサ商事	16,000	199.00	3,184,000
神鋼商事	4,000	199.00	796,000
小林産業	1,100	339.00	372,900
阪和興業	16,000	457.00	7,312,000
カナデン	2,000	653.00	1,306,000
菱電商事	2,000	669.00	1,338,000
フルサト工業	900	1,077.00	969,300
岩谷産業	18,000	450.00	8,100,000
すてきナイスグループ	7,000	240.00	1,680,000
昭光通商	5,000	157.00	785,000
ニチモウ	3,000	202.00	606,000
極東貿易	2,000	216.00	432,000
イワキ	3,000	216.00	648,000
三愛石油	4,000	435.00	1,740,000
稲畑産業	3,900	984.00	3,837,600
G S I クレオス	4,000	149.00	596,000
明和産業	1,500	314.00	471,000
ワキタ	2,000	1,269.00	2,538,000
東邦ホールディングス	5,100	1,882.00	9,598,200
サンゲツ	2,800	2,592.00	7,257,600
ミツウロコグループホールディングス	2,600	471.00	1,224,600
シナネン	4,000	377.00	1,508,000
伊藤忠エネクス	3,500	532.00	1,862,000
サンリオ	4,000	4,995.00	19,980,000

サンワテクノス	800	886.00	708,800
リョーサン	2,400	1,979.00	4,749,600
新光商事	1,800	851.00	1,531,800
トーホー	3,000	354.00	1,062,000
三信電気	2,000	634.00	1,268,000
東陽テクニカ	2,200	1,110.00	2,442,000
モスフードサービス	2,100	1,896.00	3,981,600
加賀電子	1,400	1,018.00	1,425,200
ソーダニッカ	2,000	415.00	830,000
立花エレテック	1,000	1,210.00	1,210,000
P a l t a c	2,200	1,325.00	2,915,000
太平洋興発	6,000	107.00	642,000
ヤマタネ	8,000	184.00	1,472,000
丸紅建材リース	2,000	215.00	430,000
日鉄住金物産	10,000	291.00	2,910,000
トラスコ中山	1,800	2,069.00	3,724,200
オートバックスセブン	5,600	1,489.00	8,338,400
加藤産業	2,300	1,994.00	4,586,200
イノテック	1,500	444.00	666,000
イエローハット	1,400	1,870.00	2,618,000
富士エレクトロニクス	800	1,339.00	1,071,200
J Kホールディングス	1,400	597.00	835,800
日伝	700	2,292.00	1,604,400
北沢産業	1,500	181.00	271,500
杉本商事	900	902.00	811,800
因幡電機産業	2,200	2,964.00	6,520,800
バイテック	600	884.00	530,400
ミスミグループ本社	6,400	2,801.00	17,926,400
江守商事	500	1,852.00	926,000
アルテック	800	270.00	216,000
タキヒヨー	3,000	402.00	1,206,000
スズケン	6,600	3,475.00	22,935,000
ジェコス	1,100	725.00	797,500
ローソン	6,600	7,730.00	51,018,000
サンエー	1,200	2,859.00	3,430,800

キリン堂	600	648.00	388,800
ダイユーエイト	300	660.00	198,000
カワチ薬品	1,100	1,861.00	2,047,100
エーピーシー・マート	2,300	4,915.00	11,304,500
ハードオフコーポレーション	800	748.00	598,400
アスクル	1,400	3,035.00	4,249,000
ゲオホールディングス	2,800	922.00	2,581,600
アダストリアホールディングス	1,200	4,420.00	5,304,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	219.00	438,000
くらコーポレーション	900	1,580.00	1,422,000
キャンドウ	800	1,606.00	1,284,800
パル	900	2,656.00	2,390,400
エディオン	7,300	480.00	3,504,000
サーラコーポレーション	1,400	521.00	729,400
あみやき亭	300	3,475.00	1,042,500
ひらまつ	1,700	624.00	1,060,800
ゲンキー	200	2,116.00	423,200
大黒天物産	300	2,909.00	872,700
ハニーズ	1,270	1,091.00	1,385,570
アルペン	1,200	1,851.00	2,221,200
クオール	1,200	605.00	726,000
ジェイアイエヌ	800	3,800.00	3,040,000
ビックカメラ	61	49,850.00	3,040,850
D C Mホールディングス	7,900	716.00	5,656,400
MonotaRO	2,500	2,293.00	5,732,500
J.フロント リテイリング	38,000	747.00	28,386,000
ドトール・日レスホールディングス	2,800	1,802.00	5,045,600
マツモトキヨシホールディングス	3,300	3,290.00	10,857,000
ブロンコビリー	300	1,912.00	573,600
スタートトゥデイ	5,000	2,898.00	14,490,000
物語コーポレーション	200	4,020.00	804,000
ココカラファイン	1,700	2,689.00	4,571,300
三越伊勢丹ホールディングス	31,800	1,475.00	46,905,000
ウエルシアホールディングス	600	6,040.00	3,624,000
クリエイティブSDホールディングス	700	3,550.00	2,485,000

丸善C H Iホールディングス	1,400	285.00	399,000	
エー・ピーカンパニー	200	2,270.00	454,000	
ブックオフコーポレーション	900	665.00	598,500	
あさひ	900	1,611.00	1,449,900	
日本調剤	200	2,674.00	534,800	
コスモス薬品	800	11,620.00	9,296,000	
一六堂	200	475.00	95,000	
セブン&アイ・ホールディングス	66,900	3,600.00	240,840,000	
ツルハホールディングス	1,600	8,810.00	14,096,000	
サンマルクホールディングス	500	5,010.00	2,505,000	
フェリシモ	500	994.00	497,000	
トリドール	1,400	808.00	1,131,200	
クスリのアオキ	200	6,000.00	1,200,000	
メディカルシステムネットワーク	1,300	432.00	561,600	
総合メディカル	400	3,750.00	1,500,000	
はるやま商事	700	670.00	469,000	
カップバ・クリエイトホールディングス	1,150	1,827.00	2,101,050	
ライトオン	1,200	796.00	955,200	
ジーンズメイト	500	254.00	127,000	
良品計画	1,700	9,820.00	16,694,000	
三城ホールディングス	2,000	456.00	912,000	
コナカ	2,100	896.00	1,881,600	
ハウス オブ ローゼ	200	1,334.00	266,800	
G - 7ホールディングス	500	756.00	378,000	
イオン北海道	1,000	649.00	649,000	
コジマ	2,300	269.00	618,700	
ヒマラヤ	400	1,367.00	546,800	
コーナン商事	2,100	1,024.00	2,150,400	
エコス	600	607.00	364,200	
ワタミ	1,900	1,490.00	2,831,000	
マルシェ	400	842.00	336,800	
ドン・キホーテ	4,700	6,260.00	29,422,000	
西松屋チェーン	3,200	733.00	2,345,600	
ゼンショーホールディングス	6,100	1,067.00	6,508,700	
幸楽苑	1,000	1,230.00	1,230,000	

ハークスレイ	500	758.00	379,000	
サイゼリヤ	2,400	1,203.00	2,887,200	
ポプラ	400	540.00	216,000	
ユニテッドアローズ	2,100	4,090.00	8,589,000	
ハイデイ日高	900	2,078.00	1,870,200	
京都きもの友禅	1,100	1,034.00	1,137,400	
コロワイド	5,500	997.00	5,483,500	
壱番屋	600	4,090.00	2,454,000	
トップカルチャー	600	447.00	268,200	
P L A N T	300	919.00	275,700	
スギホールディングス	2,900	4,110.00	11,919,000	
スクロール	2,100	277.00	581,700	
ヨンドシーホールディングス	1,200	1,324.00	1,588,800	
ファミリーマート	5,400	4,305.00	23,247,000	
木曽路	1,900	1,796.00	3,412,400	
サトレストランシステムズ	1,500	672.00	1,008,000	
千趣会	2,900	847.00	2,456,300	
タカキュー	1,500	321.00	481,500	
ケーヨー	2,700	461.00	1,244,700	
上新電機	3,000	785.00	2,355,000	
日本瓦斯	2,400	1,062.00	2,548,800	
ベスト電器	5,200	151.00	785,200	
マルエツ	3,000	317.00	951,000	
ロイヤルホールディングス	2,700	1,558.00	4,206,600	
東天紅	1,000	192.00	192,000	
いなげや	1,800	1,007.00	1,812,600	
島忠	3,600	2,354.00	8,474,400	
チヨダ	1,900	2,128.00	4,043,200	
ライフコーポレーション	1,200	1,611.00	1,933,200	
カスミ	3,300	604.00	1,993,200	
リンガーハット	1,600	1,430.00	2,288,000	
さが美	1,000	107.00	107,000	
MrMax	1,600	330.00	528,000	
テンアライド	1,200	323.00	387,600	
AOKIホールディングス	1,400	3,325.00	4,655,000	

オークワ	2,000	876.00	1,752,000	
コメリ	2,500	2,442.00	6,105,000	
青山商事	4,400	2,535.00	11,154,000	
しまむら	1,900	10,790.00	20,501,000	
C F S コーポレーション	1,100	388.00	426,800	
はせがわ	600	715.00	429,000	
高島屋	22,000	936.00	20,592,000	
松屋	3,200	1,170.00	3,744,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,000	843.00	7,587,000	
近鉄百貨店	6,000	354.00	2,124,000	
丸栄	3,000	239.00	717,000	
ニッセンホールディングス	3,100	313.00	970,300	
パルコ	1,500	1,022.00	1,533,000	
丸井グループ	20,900	923.00	19,290,700	
アクシアル リテイリング	900	1,532.00	1,378,800	
ダイエー	9,900	334.00	3,306,600	
イズミヤ	6,000	466.00	2,796,000	
イオン	62,900	1,338.00	84,160,200	
ユニーグループ・ホールディングス	15,300	617.00	9,440,100	
イズミ	3,600	3,145.00	11,322,000	
東武ストア	2,000	258.00	516,000	
平和堂	3,300	1,509.00	4,979,700	
フジ	1,800	1,759.00	3,166,200	
ヤオコー	800	3,790.00	3,032,000	
ゼビオ	1,900	2,074.00	3,940,600	
ケーズホールディングス	3,400	2,980.00	10,132,000	
O l y m p i c グループ	1,000	712.00	712,000	
日産東京販売ホールディングス	3,000	299.00	897,000	
アインファーマシーズ	1,000	4,280.00	4,280,000	
元気寿司	500	1,255.00	627,500	
ヤマダ電機	63,200	280.00	17,696,000	
アーランドサカモト	1,100	1,517.00	1,668,700	
ニトリホールディングス	3,200	9,050.00	28,960,000	
愛眼	1,300	278.00	361,400	
吉野家ホールディングス	4,400	1,131.00	4,976,400	

松屋フーズ	800	1,592.00	1,273,600	
サガミチェーン	2,000	874.00	1,748,000	
関西スーパーマーケット	1,200	884.00	1,060,800	
王将フードサービス	800	3,255.00	2,604,000	
プレナス	1,800	2,273.00	4,091,400	
ミニストップ	1,200	1,547.00	1,856,400	
アークス	2,700	1,826.00	4,930,200	
パロー	3,500	1,282.00	4,487,000	
藤久	100	1,650.00	165,000	
ベルク	800	1,760.00	1,408,000	
大庄	800	1,261.00	1,008,800	
ファーストリテイリング	3,700	32,250.00	119,325,000	
サンドラッグ	3,400	4,715.00	16,031,000	
東京デリカ	800	1,548.00	1,238,400	
ヤマザワ	400	1,523.00	609,200	
やまや	300	1,433.00	429,900	
ベルーナ	4,000	499.00	1,996,000	
島根銀行	400	1,300.00	520,000	
じもとホールディングス	11,500	200.00	2,300,000	
新生銀行	139,000	223.00	30,997,000	
あおぞら銀行	83,000	282.00	23,406,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,212,600	618.00	749,386,800	
りそなホールディングス	152,100	508.00	77,266,800	
三井住友トラスト・ホールディングス	322,000	466.00	150,052,000	
三井住友フィナンシャルグループ	121,000	4,720.00	571,120,000	
第四銀行	21,000	345.00	7,245,000	
北越銀行	18,000	203.00	3,654,000	
西日本シティ銀行	56,000	268.00	15,008,000	
千葉銀行	62,000	704.00	43,648,000	
横浜銀行	106,000	548.00	58,088,000	
常陽銀行	60,000	497.00	29,820,000	
群馬銀行	35,000	570.00	19,950,000	
武蔵野銀行	2,600	3,420.00	8,892,000	
千葉興業銀行	3,300	730.00	2,409,000	
筑波銀行	6,700	332.00	2,224,400	

東京都民銀行	2,800	1,035.00	2,898,000	
七十七銀行	25,000	484.00	12,100,000	
青森銀行	12,000	258.00	3,096,000	
秋田銀行	11,000	240.00	2,640,000	
山形銀行	10,000	408.00	4,080,000	
岩手銀行	1,000	4,480.00	4,480,000	
東邦銀行	14,000	306.00	4,284,000	
東北銀行	8,000	143.00	1,144,000	
みちのく銀行	9,000	200.00	1,800,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	65,000	446.00	28,990,000	
静岡銀行	47,000	1,102.00	51,794,000	
十六銀行	19,000	391.00	7,429,000	
スルガ銀行	16,000	1,560.00	24,960,000	
八十二銀行	29,000	605.00	17,545,000	
山梨中央銀行	10,000	424.00	4,240,000	
大垣共立銀行	20,000	278.00	5,560,000	
福井銀行	14,000	211.00	2,954,000	
北國銀行	18,000	354.00	6,372,000	
清水銀行	600	2,775.00	1,665,000	
滋賀銀行	15,000	534.00	8,010,000	
南都銀行	16,000	387.00	6,192,000	
百五銀行	14,000	398.00	5,572,000	
京都銀行	30,000	849.00	25,470,000	
紀陽銀行	6,300	1,302.00	8,202,600	
三重銀行	7,000	201.00	1,407,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	109,000	201.00	21,909,000	
広島銀行	47,000	414.00	19,458,000	
山陰合同銀行	10,000	725.00	7,250,000	
中国銀行	11,900	1,392.00	16,564,800	
鳥取銀行	5,000	186.00	930,000	
伊予銀行	17,000	1,010.00	17,170,000	
百十四銀行	17,000	362.00	6,154,000	
四国銀行	11,000	225.00	2,475,000	
阿波銀行	13,000	513.00	6,669,000	
鹿児島銀行	11,000	659.00	7,249,000	

大分銀行	10,000	372.00	3,720,000	
宮崎銀行	11,000	285.00	3,135,000	
肥後銀行	13,000	557.00	7,241,000	
佐賀銀行	10,000	207.00	2,070,000	
十八銀行	10,000	229.00	2,290,000	
沖縄銀行	1,200	3,725.00	4,470,000	
琉球銀行	3,100	1,086.00	3,366,600	
八千代銀行	800	2,647.00	2,117,600	
セブン銀行	60,000	353.00	21,180,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,071,600	206.00	426,749,600	
山口フィナンシャルグループ	16,000	934.00	14,944,000	
長野銀行	5,000	175.00	875,000	
名古屋銀行	15,000	342.00	5,130,000	
北洋銀行	24,100	406.00	9,784,600	
愛知銀行	600	4,405.00	2,643,000	
第三銀行	9,000	162.00	1,458,000	
中京銀行	7,000	178.00	1,246,000	
東日本銀行	7,000	216.00	1,512,000	
大光銀行	6,000	217.00	1,302,000	
愛媛銀行	10,000	238.00	2,380,000	
トマト銀行	6,000	173.00	1,038,000	
みなと銀行	14,000	171.00	2,394,000	
京葉銀行	13,000	498.00	6,474,000	
関西アーバン銀行	22,000	115.00	2,530,000	
栃木銀行	8,000	375.00	3,000,000	
北日本銀行	500	2,423.00	1,211,500	
東和銀行	19,000	90.00	1,710,000	
福島銀行	20,000	85.00	1,700,000	
大東銀行	10,000	101.00	1,010,000	
トモニホールディングス	12,300	368.00	4,526,400	
フィデアホールディングス	9,200	192.00	1,766,400	
池田泉州ホールディングス	12,000	482.00	5,784,000	
F P G	1,100	1,060.00	1,166,000	
S B Iホールディングス	19,200	1,217.00	23,366,400	
ジャフコ	2,200	5,020.00	11,044,000	

大和証券グループ本社	159,000	917.00	145,803,000
野村ホールディングス	327,200	729.00	238,528,800
岡三証券グループ	12,000	832.00	9,984,000
丸三証券	4,700	811.00	3,811,700
東洋証券	7,000	337.00	2,359,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,000	817.00	13,889,000
光世証券	4,000	261.00	1,044,000
水戸証券	5,000	464.00	2,320,000
いちよし証券	3,100	1,372.00	4,253,200
松井証券	8,200	1,046.00	8,577,200
だいこう証券ビジネス	800	671.00	536,800
マネックスグループ	17,400	351.00	6,107,400
カブドットコム証券	6,200	500.00	3,100,000
極東証券	2,000	1,710.00	3,420,000
岩井コスモホールディングス	1,500	1,228.00	1,842,000
マネーパートナーズグループ	1,200	272.00	326,400
N K S Jホールディングス	35,600	2,533.00	90,174,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	47,900	2,542.00	121,761,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	15,300	1,775.00	27,157,500
第一生命保険	80,600	1,381.00	111,308,600
東京海上ホールディングス	61,900	3,175.00	196,532,500
T & Dホールディングス	55,000	1,179.00	64,845,000
全国保証	1,900	4,000.00	7,600,000
クレディセゾン	13,100	2,598.00	34,033,800
芙蓉総合リース	1,700	4,145.00	7,046,500
興銀リース	2,800	2,838.00	7,946,400
東京センチュリーリース	3,800	3,270.00	12,426,000
日本証券金融	7,000	698.00	4,886,000
アイフル	29,100	447.00	13,007,700
ポケットカード	1,600	839.00	1,342,400
リコーリース	1,100	2,845.00	3,129,500
イオンフィナンシャルサービス	9,300	2,837.00	26,384,100
アコム	32,200	365.00	11,753,000
ジャックス	10,000	443.00	4,430,000
オリエン트コーポレーション	35,800	248.00	8,878,400

日立キャピタル	3,200	2,688.00	8,601,600
アプラスフィナンシャル	5,800	150.00	870,000
オリックス	97,300	1,703.00	165,701,900
三菱UFJリース	40,500	570.00	23,085,000
日本取引所グループ	23,500	2,240.00	52,640,000
イー・ギャランティ	500	2,185.00	1,092,500
アサックス	300	1,358.00	407,400
NECキャピタルソリューション	600	2,400.00	1,440,000
日本駐車場開発	174	7,340.00	1,277,160
ヒューリック	26,900	1,551.00	41,721,900
東京建物不動産販売	800	455.00	364,000
三栄建築設計	500	830.00	415,000
野村不動産ホールディングス	10,600	2,458.00	26,054,800
常和ホールディングス	600	2,942.00	1,765,200
フージャースホールディングス	2,400	777.00	1,864,800
オープンハウス	600	2,499.00	1,499,400
東急不動産ホールディングス	38,800	954.00	37,015,200
飯田グループホールディングス	7,072	1,953.00	13,811,616
パーク24	8,400	1,910.00	16,044,000
パラカ	400	913.00	365,200
三井不動産	76,000	3,225.00	245,100,000
三菱地所	112,000	2,779.00	311,248,000
平和不動産	3,200	1,715.00	5,488,000
東京建物	33,000	915.00	30,195,000
ダイビル	4,700	1,256.00	5,903,200
京阪神ビルディング	2,700	545.00	1,471,500
住友不動産	38,000	4,600.00	174,800,000
大京	27,000	280.00	7,560,000
テーオーシー	5,500	781.00	4,295,500
東京楽天地	3,000	490.00	1,470,000
レオパレス21	15,400	641.00	9,871,400
フジ住宅	2,100	648.00	1,360,800
空港施設	1,900	832.00	1,580,800
明和地所	800	454.00	363,200
住友不動産販売	1,100	3,125.00	3,437,500

ゴールドクレスト	1,300	2,723.00	3,539,900	
日本エスリード	600	1,050.00	630,000	
日神不動産	1,100	793.00	872,300	
タカラレーベン	5,300	402.00	2,130,600	
サンヨーハウジング名古屋	800	1,159.00	927,200	
イオンモール	10,300	2,841.00	29,262,300	
ファースト住建	500	1,460.00	730,000	
トーセイ	2,200	754.00	1,658,800	
穴吹興産	1,000	315.00	315,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	9,900	1,248.00	12,355,200	
サンフロンティア不動産	1,500	1,127.00	1,690,500	
ランドビジネス	1,100	427.00	469,700	
グランディハウス	1,000	346.00	346,000	
日本空港ビルデング	5,400	2,195.00	11,853,000	
日本工営	6,000	462.00	2,772,000	
ネクスト	500	3,505.00	1,752,500	
日本M&Aセンター	900	7,700.00	6,930,000	
ノバレーゼ	500	701.00	350,500	
アコーディア・ゴルフ	6,800	1,144.00	7,779,200	
タケエイ	1,200	1,535.00	1,842,000	
パソナグループ	17	76,600.00	1,302,200	
リンクアンドモチベーション	11	30,100.00	331,100	
G C Aサヴィアン	1,000	981.00	981,000	
エス・エム・エス	1,000	2,105.00	2,105,000	
テンプホールディングス	3,700	2,870.00	10,619,000	
リニカル	300	1,172.00	351,600	
クックパッド	1,000	3,340.00	3,340,000	
エスクリ	600	933.00	559,800	
アイ・ケイ・ケイ	400	752.00	300,800	
学情	600	864.00	518,400	
スタジオアリス	700	1,297.00	907,900	
シミックホールディングス	700	1,332.00	932,400	
N E Cフィールドディング	1,400	1,092.00	1,528,800	
総合警備保障	6,200	1,928.00	11,953,600	
カカクコム	10,300	1,895.00	19,518,500	

ルネサンス	800	742.00	593,600
ツクイ	1,800	1,040.00	1,872,000
総合臨床ホールディングス	500	580.00	290,000
キャリアデザインセンター	4	109,500.00	438,000
エムスリー	56	255,000.00	14,280,000
ベストプライダル	1,000	682.00	682,000
日本E R I	300	1,238.00	371,400
アウトソーシング	600	931.00	558,600
ディー・エヌ・エー	9,100	2,195.00	19,974,500
博報堂D Yホールディングス	23,400	764.00	17,877,600
ぐるなび	1,200	2,234.00	2,680,800
一休	12	146,200.00	1,754,400
ジャパンベストレスキューシステム	11	80,400.00	884,400
ジェイコムホールディングス	300	804.00	241,200
P G Mホールディングス	2,400	960.00	2,304,000
バリューコマース	1,100	1,551.00	1,706,100
J Pホールディングス	2,800	435.00	1,218,000
イーピーエス	18	104,900.00	1,888,200
アミューズ	500	1,861.00	930,500
ドリームインキュベータ	5	182,800.00	914,000
T A C	1,000	346.00	346,000
ケネディクス	20,000	500.00	10,000,000
電通	16,000	3,710.00	59,360,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,847.00	1,108,200
ぴあ	500	1,683.00	841,500
イオンファンタジー	600	1,531.00	918,600
みらかホールディングス	4,400	4,455.00	19,602,000
アルプス技研	700	1,055.00	738,500
サニックス	2,500	1,042.00	2,605,000
ダイオーズ	300	714.00	214,200
日本空調サービス	400	918.00	367,200
オリエンタルランド	4,600	15,390.00	70,794,000
ダスキン	4,600	1,992.00	9,163,200
明光ネットワークジャパン	1,700	1,114.00	1,893,800
ファルコS Dホールディングス	900	1,305.00	1,174,500

秀英予備校	300	331.00	99,300	
田谷	300	767.00	230,100	
ラウンドワン	4,800	528.00	2,534,400	
リゾートトラスト	2,900	3,640.00	10,556,000	
ビー・エム・エル	1,100	3,375.00	3,712,500	
ワタベウェディング	600	661.00	396,600	
もしもしホットライン	3,200	1,165.00	3,728,000	
リソー教育	1,900	647.00	1,229,300	
早稲田アカデミー	300	748.00	224,400	
ユー・エス・エス	20,500	1,472.00	30,176,000	
東京個別指導学院	800	237.00	189,600	
テー・オー・ダブリュー	600	565.00	339,000	
セントラルスポーツ	500	1,527.00	763,500	
リゾートソリューション	2,000	224.00	448,000	
リブセンス	400	4,885.00	1,954,000	
リロ・ホールディング	600	4,545.00	2,727,000	
エイチ・アイ・エス	1,400	5,200.00	7,280,000	
共立メンテナンス	800	3,760.00	3,008,000	
イチネンホールディングス	1,800	682.00	1,227,600	
建設技術研究所	1,000	893.00	893,000	
スペース	800	878.00	702,400	
燦ホールディングス	400	1,392.00	556,800	
スバル興業	1,000	374.00	374,000	
東京テアトル	7,000	159.00	1,113,000	
よみうりランド	3,000	741.00	2,223,000	
東京都競馬	13,000	401.00	5,213,000	
常磐興産	5,000	171.00	855,000	
カナモト	2,000	2,582.00	5,164,000	
東京ドーム	13,000	680.00	8,840,000	
西尾レントオール	900	2,663.00	2,396,700	
トランス・コスモス	2,200	1,724.00	3,792,800	
乃村工藝社	3,000	862.00	2,586,000	
藤田観光	4,000	424.00	1,696,000	
KNT-CTホールディングス	6,000	157.00	942,000	
日本管財	700	1,808.00	1,265,600	

トーカイ	700	2,536.00	1,775,200	
白洋舎	2,000	241.00	482,000	
セコム	17,500	6,010.00	105,175,000	
セントラル警備保障	800	923.00	738,400	
丹青社	2,000	660.00	1,320,000	
メイテック	2,300	2,659.00	6,115,700	
アサツー ディ・ケイ	3,000	2,715.00	8,145,000	
応用地質	1,600	1,639.00	2,622,400	
船井総合研究所	1,700	796.00	1,353,200	
進学会	700	397.00	277,900	
ベネッセホールディングス	5,700	3,710.00	21,147,000	
イオンディライト	1,600	1,951.00	3,121,600	
ナック	900	1,724.00	1,551,600	
ニチイ学館	3,700	967.00	3,577,900	
ダイセキ	2,500	1,942.00	4,855,000	
ステップ	500	836.00	418,000	
合 計	25,928,985		27,322,939,646	

(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。

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

貸借対照表

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	281,267,554	1,580,071,540
コール・ローン	1,343,036,572	488,987,214
株式	60,402,089,915	74,085,402,542
投資証券	1,411,650,431	1,559,674,670
派生商品評価勘定	8,520,325	18,579,319
未収入金	2,790,403	67,917,049
未収配当金	49,839,329	48,663,757
未収利息	2,505	819
差入委託証拠金	206,469,807	293,036,937
流動資産合計	63,705,666,841	78,142,333,847
資産合計	63,705,666,841	78,142,333,847
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	26,307,966	4,130,586
未払金	367,314	7,489,066
未払解約金	105,580,807	147,342,368
流動負債合計	132,256,087	158,962,020
負債合計	132,256,087	158,962,020
純資産の部		
元本等		
元本	66,367,767,459	52,890,133,012
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,794,356,705	25,093,238,815
元本等合計	63,573,410,754	77,983,371,827
純資産合計	63,573,410,754	77,983,371,827
負債純資産合計	63,705,666,841	78,142,333,847

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(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。 (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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
1. 期首	平成23年11月 8日	平成24年11月 7日
期首元本額	76,336,143,090円	66,367,767,459円
期首からの追加設定元本額	4,057,790,394円	1,973,851,590円
期首からの一部解約元本額	14,026,166,025円	15,451,486,037円
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	14,382,859,795円	13,947,374,757円
DCインデックスバランス（株式20）	47,715,270円	37,233,090円
DCインデックスバランス（株式40）	169,279,147円	143,366,618円
DCインデックスバランス（株式60）	310,310,980円	275,730,948円
DCインデックスバランス（株式80）	337,911,175円	324,847,835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	9,394,588,112円	6,385,207,921円
日興五大陸株式ファンド	17,699,222,669円	13,393,010,105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	73,543,353円	56,892,765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）	99,284,577円	24,095,247円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	19,103,703円	13,565,839円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	16,463,831円	9,901,251円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	26,887,266円	15,747,024円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	34,009,527円	19,867,103円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	15,305,278,523円	11,097,092,106円
3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	27,422,152円	- 円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	18,877,336円	15,230,756円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	43,891,787円	34,407,940円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	117,376,888円	100,180,127円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	151,352,446円	136,056,561円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	149,558,064円	141,025,715円
年金積立 インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	7,942,830,858円	6,719,299,304円
計	66,367,767,459円	52,890,133,012円
2. 受益権の総数	66,367,767,459口	52,890,133,012口
3. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	2,794,356,705円	- 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)

金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6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管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
-------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

（平成24年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	278,303,489
投資証券	4,655,956
合計	282,959,445

（平成25年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	102,497,776
投資証券	49,999,817
合計	52,497,959

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（平成24年11月 6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	1,714,548,757	-	1,695,210,190	19,338,567

合計	1,714,548,757	-	1,695,210,190	19,338,567
----	---------------	---	---------------	------------

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,227,527,691	-	2,242,725,701	15,198,010
合計		2,227,527,691	-	2,242,725,701	15,198,010

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成24年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,254,479,464	-	1,256,030,390	1,550,926
	米ドル	816,456,354	-	823,800,410	7,344,056
	ユーロ	438,023,110	-	432,229,980	5,793,130
合計		1,254,479,464	-	1,256,030,390	1,550,926

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,352,405,486	-	1,353,037,700	632,214
	米ドル	1,077,002,500	-	1,078,847,000	1,844,500
	ユーロ	275,402,986	-	274,190,700	1,212,286
	売建	971,234,109	-	972,615,600	1,381,491
	米ドル	591,057,300	-	591,240,000	182,700
	加ドル	98,822,850	-	99,025,500	202,650
	英ポンド	133,771,215	-	134,461,500	690,285
	スイスフラン	77,925,744	-	77,673,600	252,144
	豪ドル	69,657,000	-	70,215,000	558,000
	合計	2,323,639,595	-	2,325,653,300	749,277

(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24年11月 6日現在		平成25年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	0.9579円	1口当たり純資産額	1.4744円
(1万口当たり純資産額)	(9,579円)	(1万口当たり純資産額)	(14,744円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	13,773	92.86	1,278,960.78	
	APACHE CORP	10,994	89.13	979,895.22	
	BAKER HUGHES INC	12,265	57.88	709,898.20	
	CABOT OIL & GAS CORP	11,240	34.92	392,500.80	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	6,471	53.98	349,304.58	
	CHENIERE ENERGY INC	5,580	39.67	221,358.60	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	13,880	28.14	390,583.20	
	CHEVRON CORP	53,111	118.45	6,290,997.95	
	CIMAREX ENERGY CO	2,535	103.87	263,310.45	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	8,000	23.15	185,200.00	
	CONCHO RESOURCES INC	2,935	111.26	326,548.10	
	CONOCOPHILLIPS	31,940	72.57	2,317,885.80	
	CONSOL ENERGY INC	6,858	36.76	252,100.08	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	980	119.20	116,816.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	1,240	187.96	233,070.40	
	DENBURY RESOURCES INC	10,745	19.13	205,551.85	
	DEVON ENERGY CORPORATION	10,621	63.79	677,513.59	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	1,525	59.31	90,447.75	
	ENERGEN CORP	2,310	78.23	180,711.30	
	ENSCO PLC-CL A	5,990	57.07	341,849.30	
	EOG RESOURCES INC	7,576	179.73	1,361,634.48	
	EQT CORP	4,345	84.48	367,065.60	
	EXXON MOBIL CORP	121,931	91.99	11,216,432.69	
	FMC TECHNOLOGIES INC	6,925	50.07	346,734.75	
	HALLIBURTON CO	23,537	53.13	1,250,520.81	
	HELMERICH & PAYNE	2,800	77.78	217,784.00	
	HESS CORP	8,810	80.49	709,116.90	
HOLLYFRONTIER CORP	5,590	46.43	259,543.70		
KINDER MORGAN INC	18,310	35.11	642,864.10		
MARATHON OIL CORP	19,377	35.67	691,177.59		
MARATHON PETROLEUM CORP	9,216	70.72	651,755.52		

MURPHY OIL CORP	5,325	60.36	321,417.00
NABORS INDUSTRIES LTD	7,671	17.82	136,697.22
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,451	80.32	919,744.32
NOBLE CORP	7,632	37.06	282,841.92
NOBLE ENERGY INC	9,962	75.01	747,249.62
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	22,021	96.69	2,129,210.49
OCEANEERING INTL INC	3,070	85.51	262,515.70
PEABODY ENERGY CORP	7,060	20.28	143,176.80
PHILLIPS 66	16,105	64.27	1,035,068.35
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,600	210.36	757,296.00
QEP RESOURCES INC	4,290	33.28	142,771.20
RANGE RESOURCES CORP	4,430	74.93	331,939.90
ROWAN COMPANIES PLC	3,300	36.27	119,691.00
SCHLUMBERGER LTD	36,299	92.39	3,353,664.61
SOUTHWESTERN ENERGY CO	9,595	36.72	352,328.40
SPECTRA ENERGY CORP	18,454	35.21	649,765.34
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	3,820	27.76	106,043.20
TESORO CORP	3,820	47.92	183,054.40
VALERO ENERGY CORP	15,232	41.44	631,214.08
WEATHERFORD INTL LTD	21,119	16.95	357,967.05
WHITING PETROLEUM CORP	3,275	66.80	218,770.00
WILLIAMS COS INC	18,644	35.01	652,726.44
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,675	109.12	619,256.00
AIRGAS INC	2,080	108.26	225,180.80
ALBEMARLE CORP	2,650	66.69	176,728.50
ALCOA INC	30,889	9.78	302,094.42
ASHLAND INC	2,050	87.67	179,723.50
AVERY DENNISON CORP	2,260	46.95	106,107.00
BALL CORP	4,113	49.58	203,922.54
CELANESE CORP-SERIES A	4,510	56.66	255,536.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,470	209.50	307,965.00
CROWN HOLDINGS INC	4,035	43.08	173,827.80
DOW CHEMICAL	33,153	38.72	1,283,684.16
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	25,168	60.30	1,517,630.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,675	77.73	363,387.75

ECOLAB INC	7,350	105.32	774,102.00
FMC CORP	3,270	72.84	238,186.80
FREEMONT-MCMORAN COPPER	28,478	37.19	1,059,096.82
INTERNATIONAL PAPER CO	11,830	43.57	515,433.10
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,494	84.22	210,044.68
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,770	74.30	874,511.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,445	100.18	144,760.10
MEADWESTVACO CORP	4,879	34.18	166,764.22
MONSANTO CO	14,601	103.22	1,507,115.22
MOSAIC CO/THE	7,850	46.05	361,492.50
NEWMONT MINING CORP	13,420	27.35	367,037.00
NUCOR CORP	8,419	53.52	450,584.88
OWENS-ILLINOIS INC	4,955	31.70	157,073.50
PPG INDUSTRIES INC	3,927	183.32	719,897.64
PRAXAIR INC	8,100	125.01	1,012,581.00
ROCK-TENN COMPANY-CL A	1,830	100.69	184,262.70
SEALED AIR CORP	4,356	31.11	135,515.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,587	184.56	477,456.72
SIGMA-ALDRICH	3,575	85.15	304,411.25
VULCAN MATERIALS CO	3,643	56.44	205,610.92
3M CO	17,906	126.12	2,258,304.72
AGCO CORP	2,710	58.47	158,453.70
AMETEK INC	6,343	47.91	303,893.13
BOEING CO	19,692	133.57	2,630,260.44
CATERPILLAR INC	17,866	84.05	1,501,637.30
CUMMINS INC	5,045	131.72	664,527.40
DANAHER CORP	16,219	72.59	1,177,337.21
DEERE & CO	10,020	81.80	819,636.00
DOVER CORP	4,520	91.33	412,811.60
EATON CORP PLC	13,206	70.06	925,212.36
EMERSON ELECTRIC CO	19,590	66.85	1,309,591.50
FASTENAL CO	7,453	49.15	366,314.95
FLOWSERVE CORP	4,335	70.30	304,750.50
FLUOR CORP	4,223	76.21	321,834.83
GENERAL DYNAMICS CORP	8,292	87.10	722,233.20

GENERAL ELECTRIC CO.	284,183	26.42	7,508,114.86
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,486	86.34	1,768,761.24
ILLINOIS TOOL WORKS	11,660	79.15	922,889.00
INGERSOLL-RAND PLC	8,006	67.52	540,565.12
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,330	61.58	205,061.40
JOY GLOBAL INC	3,005	57.44	172,607.20
KBR INC	4,120	34.53	142,263.60
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	2,591	101.05	261,820.55
LOCKHEED MARTIN CORP	7,531	135.47	1,020,224.57
MASCO CORP	10,699	20.78	222,325.22
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,124	109.12	668,250.88
PACCAR INC	9,454	57.25	541,241.50
PALL CORP	2,596	81.88	212,560.48
PARKER HANNIFIN CORP	3,920	115.94	454,484.80
PENTAIR LTD-REGISTERED	5,858	68.16	399,281.28
PRECISION CASTPARTS CORP	3,930	252.27	991,421.10
QUANTA SERVICES INC	6,025	30.27	182,376.75
RAYTHEON COMPANY	8,972	84.49	758,044.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,723	108.79	405,025.17
ROCKWELL COLLINS INC.	3,315	70.66	234,237.90
ROPER INDUSTRIES INC	2,710	124.76	338,099.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,100	37.47	116,157.00
SPX CORP	887	92.91	82,411.17
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,456	78.54	349,974.24
TEXTRON INC	8,346	29.10	242,868.60
TRANSDIGM GROUP INC	1,460	147.72	215,671.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	23,915	107.68	2,575,167.20
WW GRAINGER INC	1,577	268.96	424,149.92
XYLEM INC	4,368	33.75	147,420.00
ADT CORP/THE	4,917	43.15	212,168.55
CINTAS CORP	3,387	54.13	183,338.31
DUN & BRADSTREET CORP	1,162	106.76	124,055.12
EQUIFAX INC	3,584	64.33	230,558.72
IHS INC-CLASS A	1,710	109.83	187,809.30
IRON MOUNTAIN INC	4,684	26.03	121,924.52

MANPOWERGROUP INC	1,937	80.44	155,812.28
NIELSEN HOLDINGS NV	5,645	39.48	222,864.60
REPUBLIC SERVICES INC	7,000	34.13	238,910.00
ROBERT HALF INTL INC	3,425	38.49	131,828.25
STERICYCLE INC	2,285	116.18	265,471.30
TYCO INTERNATIONAL LTD	12,505	36.78	459,933.90
VERISK ANALYTICS INC	4,000	67.80	271,200.00
WASTE MANAGEMENT INC	12,204	43.70	533,314.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,410	60.93	268,701.30
CSX CORP	27,163	26.46	718,732.98
DELTA AIR LINES INC	5,335	27.46	146,499.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,227	43.41	270,314.07
FEDEX CORP	8,068	136.23	1,099,103.64
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	21.30	208,314.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,310	75.05	173,365.50
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	158,000	0.72	114,550.00
KANSAS CITY SOUTHERN	2,910	124.60	362,586.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,930	86.43	771,819.90
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,190	17.87	74,875.30
UNION PACIFIC CORP	12,748	153.21	1,953,121.08
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	35.52	88,622.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19,787	100.30	1,984,636.10
AUTOLIV INC	2,610	90.43	236,022.30
BORGWARNER INC	3,215	102.93	330,919.95
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	7,980	55.01	438,979.80
FORD MOTOR COMPANY	100,065	17.09	1,710,110.85
GENERAL MOTORS CORP	20,745	37.09	769,432.05
HARLEY-DAVIDSON INC	6,549	64.47	422,214.03
JOHNSON CONTROLS INC	18,988	46.36	880,283.68
TESLA MOTORS INC	2,200	176.80	388,960.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	2,955	75.07	221,831.85
COACH INC	7,636	51.77	395,315.72
DR HORTON INC	6,906	18.41	127,139.46
FOSSIL GROUP INC	1,545	134.02	207,060.90
GARMIN LTD	3,575	47.99	171,564.25

HASBRO INC	3,368	52.09	175,439.12
LEGETT & PLATT INC	4,468	29.59	132,208.12
LENNAR CORP-CL A	5,360	34.31	183,901.60
LULULEMON ATHLETICA INC	2,790	69.49	193,877.10
MATTEL INC	10,019	45.04	451,255.76
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	5,100	79.13	403,563.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,738	135.80	236,020.40
NEWELL RUBBERMAID INC	8,160	29.66	242,025.60
NIKE INC -CL B	19,714	77.20	1,521,920.80
POLARIS INDUSTRIES INC	1,580	132.15	208,797.00
PULTE GROUP INC	9,270	17.53	162,503.10
PVH CORP	2,030	124.84	253,425.20
RALPH LAUREN CORP	1,715	171.19	293,590.85
TOLL BROTHERS INC	4,501	32.22	145,022.22
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,140	80.19	171,606.60
VF CORP	2,585	219.75	568,053.75
WHIRLPOOL CORP	2,144	147.85	316,990.40
CARNIVAL CORP	10,117	35.39	358,040.63
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	825	543.05	448,016.25
DARDEN RESTAURANTS INC	2,853	52.96	151,094.88
H&R BLOCK INC	8,610	29.62	255,028.20
INTL GAME TECHNOLOGY	7,626	18.78	143,216.28
LAS VEGAS SANDS CORP	11,800	69.74	822,932.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	6,406	45.85	293,715.10
MCDONALD'S CORP	27,511	97.41	2,679,846.51
MGM RESORTS INTERNATIONAL	9,790	19.15	187,478.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	42.84	210,258.72
STARBUCKS CORP	20,422	81.99	1,674,399.78
STARWOOD HOTELS & RESORTS	5,687	74.68	424,705.16
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	3,950	66.99	264,610.50
WYNN RESORTS LTD	2,370	165.20	391,524.00
YUM! BRANDS INC	12,324	70.23	865,514.52
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	5,725	16.20	92,745.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	15,668	59.90	938,513.20
CHARTER COMMUNICATION-A	1,400	131.06	183,484.00

COMCAST CORP-CLASS A	58,196	47.84	2,784,096.64
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	13,871	46.68	647,498.28
DIRECTV	14,244	63.53	904,921.32
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,930	86.90	341,517.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	2,635	80.69	212,618.15
DISH NETWORK CORP-A	6,029	48.86	294,576.94
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,796	16.74	197,465.04
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,355	76.04	407,194.20
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	4,673	72.16	337,203.68
LIBERTY MEDIA CORP	2,465	152.09	374,901.85
NEWS CORP - CLASS A	11,240	17.69	198,835.60
OMNICOM GROUP	7,317	70.28	514,238.76
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	2,320	80.12	185,878.40
SIRIUS XM RADIO INC	92,570	3.71	343,434.70
THE WALT DISNEY CO.	46,963	68.85	3,233,402.55
TIME WARNER CABLE	8,267	119.97	991,791.99
TIME WARNER INC	25,758	68.23	1,757,468.34
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	12,569	33.87	425,712.03
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	41,332	34.09	1,409,007.88
VIACOM INC-CLASS B	11,998	84.15	1,009,631.70
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,088	99.26	207,254.88
AMAZON.COM INC	9,935	359.17	3,568,353.95
AUTOZONE INC	972	442.06	429,682.32
BED BATH & BEYOND INC	6,062	77.37	469,016.94
BEST BUY CO INC	6,504	44.06	286,566.24
CARMAX INC	5,869	48.74	286,055.06
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,770	54.13	149,940.10
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	9,040	58.11	525,314.40
DOLLAR TREE INC	6,214	58.52	363,643.28
EXPEDIA INC	2,232	59.58	132,982.56
FAMILY DOLLAR STORES	2,623	69.09	181,223.07
GAMESTOP CORP-CLASS A	3,440	56.56	194,566.40
GAP INC/THE	8,356	37.54	313,684.24
GENUINE PARTS CO	4,011	80.21	321,722.31
HOME DEPOT INC	39,940	76.65	3,061,401.00

J.C. PENNEY CO INC	4,661	8.31	38,732.91
KOHL'S CORP	5,202	57.73	300,311.46
L BRANDS INC	6,408	62.89	402,999.12
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	13,920	27.75	386,280.00
LKQ CORP	8,560	32.02	274,091.20
LOWE'S COS INC	29,682	50.18	1,489,442.76
MACY'S INC	10,109	46.14	466,429.26
NETFLIX INC	1,390	341.50	474,685.00
NORDSTROM INC	4,740	60.34	286,011.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,905	124.26	360,975.30
PETSMART INC	2,240	72.32	161,996.80
PRICELINE.COM INC	1,407	1,082.23	1,522,697.61
ROSS STORES INC	6,276	77.58	486,892.08
STAPLES INC	17,384	16.08	279,534.72
TARGET CORP	16,400	64.63	1,059,932.00
TIFFANY & CO	3,360	80.19	269,438.40
TJX COMPANIES INC	19,423	61.29	1,190,435.67
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,600	70.76	254,736.00
TRIPADVISOR INC	3,220	88.07	283,585.40
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	1,770	131.50	232,755.00
URBAN OUTFITTERS INC	3,320	38.94	129,280.80
COSTCO WHOLESALE CORP	11,879	120.13	1,427,024.27
CVS CAREMARK CORP	33,427	63.22	2,113,254.94
KROGER CO	13,275	42.65	566,178.75
SAFEWAY INC	7,013	35.37	248,049.81
SYSCO CORP	17,146	33.31	571,133.26
WAL-MART STORES INC	45,182	77.42	3,497,990.44
WALGREEN CO	24,602	60.30	1,483,500.60
WHOLE FOODS MARKET INC	9,570	63.69	609,513.30
ALTRIA GROUP INC	55,108	37.54	2,068,754.32
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,473	41.98	775,496.54
BEAM INC	4,336	66.99	290,468.64
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,517	73.54	258,640.18
BUNGE LTD	3,647	82.04	299,199.88
CAMPBELL SOUP CO	5,715	42.34	241,973.10

COCA-COLA CO/THE	109,762	39.50	4,335,599.00
COCA-COLA ENTERPRISES	6,670	41.12	274,270.40
CONAGRA FOODS INC	11,730	32.56	381,928.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,990	66.07	263,619.30
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	5,129	47.28	242,499.12
GENERAL MILLS INC	17,379	50.70	881,115.30
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	3,865	62.50	241,562.50
HERSHEY CO/THE	4,165	99.51	414,459.15
HORMEL FOODS CORP	3,770	43.52	164,070.40
JM SMUCKER CO/THE	2,680	110.69	296,649.20
KELLOGG CO	6,618	63.09	417,529.62
KRAFT FOODS GROUP INC	16,931	54.11	916,136.41
LORILLARD INC	10,690	51.85	554,276.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,365	69.11	232,555.15
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	5,811	82.07	476,908.77
MOLSON COORS BREWING CO -B	4,240	54.01	229,002.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	46,085	33.44	1,541,082.40
MONSTER BEVERAGE CORP	3,710	57.52	213,399.20
PEPSICO INC	42,401	84.62	3,587,972.62
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,828	90.13	4,040,347.64
REYNOLDS AMERICAN INC	9,080	51.40	466,712.00
TYSON FOODS INC-CL A	7,806	27.85	217,397.10
AVON PRODUCTS	12,793	17.68	226,180.24
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,225	65.31	275,934.75
CLOROX COMPANY	3,246	90.16	292,659.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	25,510	65.36	1,667,333.60
ENERGIZER HOLDINGS INC	1,571	100.88	158,482.48
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,630	70.75	469,072.50
HERBALIFE LTD	2,430	63.72	154,839.60
KIMBERLY-CLARK CORP	10,363	108.81	1,127,598.03
PROCTER & GAMBLE CO	75,009	81.43	6,107,982.87
ABBOTT LABORATORIES	42,947	37.36	1,604,499.92
AETNA INC	10,619	62.67	665,492.73
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,314	66.87	422,217.18
BAXTER INTERNATIONAL INC	15,039	65.13	979,490.07

BECTON DICKINSON AND CO	5,486	107.01	587,056.86
BOSTON SCIENTIFIC CORP	36,958	12.00	443,496.00
CARDINAL HEALTH INC	9,165	60.56	555,032.40
CAREFUSION CORP	6,075	38.67	234,920.25
CERNER CORP	8,430	55.93	471,489.90
CIGNA CORP	7,940	79.51	631,309.40
COVIDIEN PLC	13,205	64.33	849,477.65
CR BARD INC	2,344	137.21	321,620.24
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	4,638	56.53	262,186.14
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	4,562	47.14	215,052.68
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,050	62.35	190,167.50
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	22,444	63.46	1,424,296.24
HCA HOLDINGS INC	8,215	46.45	381,586.75
HENRY SCHEIN INC	2,170	110.58	239,958.60
HOLOGIC INC	8,758	22.22	194,602.76
HUMANA INC	4,105	93.95	385,664.75
INTUITIVE SURGICAL INC	1,090	374.88	408,619.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,875	102.41	294,428.75
MCKESSON CORP	6,244	158.92	992,296.48
MEDTRONIC INC	27,982	57.10	1,597,772.20
OMNICARE INC	2,710	55.32	149,917.20
PATTERSON COS INC	2,042	42.79	87,377.18
QUEST DIAGNOSTICS	4,826	62.65	302,348.90
RESMED INC	3,370	50.40	169,848.00
ST JUDE MEDICAL INC	7,400	57.53	425,722.00
STRYKER CORP	8,493	74.05	628,906.65
UNITEDHEALTH GROUP INC	28,060	68.72	1,928,283.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,164	72.99	230,940.36
WELLPOINT INC	8,356	87.41	730,397.96
ZIMMER HOLDINGS INC	5,002	88.94	444,877.88
ABBVIE INC	43,447	48.17	2,092,841.99
ACTAVIS PLC	4,655	156.53	728,647.15
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,110	51.21	466,523.10
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	5,580	119.62	667,479.60
ALLERGAN INC	8,405	89.24	750,062.20

AMGEN INC	20,591	115.14	2,370,847.74
BIOGEN IDEC INC	6,497	244.06	1,585,657.82
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,500	62.21	217,735.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	44,941	52.52	2,360,301.32
CELGENE CORP	11,412	150.74	1,720,244.88
ELI LILLY & CO	27,833	50.37	1,401,948.21
FOREST LABORATORIES INC	6,145	46.91	288,261.95
GILEAD SCIENCES INC	41,794	69.54	2,906,354.76
HOSPIRA INC	3,921	40.00	156,840.00
ILLUMINA INC	3,745	95.44	357,422.80
JOHNSON & JOHNSON	76,951	92.81	7,141,822.31
LIFE TECHNOLOGIES CORP	4,476	75.39	337,445.64
MERCK & CO. INC.	82,703	45.36	3,751,408.08
MYLAN INC	9,655	39.86	384,848.30
PERRIGO CO	2,650	142.50	377,625.00
PFIZER INC	179,640	31.24	5,611,953.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,210	302.32	668,127.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9,774	97.09	948,957.66
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6,430	65.40	420,522.00
WATERS CORP	2,276	99.47	226,393.72
ZOETIS INC	12,480	31.69	395,491.20
BB&T CORP	19,388	33.66	652,600.08
CIT GROUP INC	5,695	47.61	271,138.95
COMERICA INC	5,130	43.76	224,488.80
FIFTH THIRD BANCORP	23,509	19.14	449,962.26
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,330	50.22	117,012.60
HUDSON CITY BANCORP INC	14,060	8.90	125,134.00
KEYCORP	26,168	12.56	328,670.08
M & T BANK CORP	3,463	111.43	385,882.09
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	13,774	15.91	219,144.34
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,750	14.23	152,972.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	14,570	73.29	1,067,835.30
REGIONS FINANCIAL CORP	37,184	9.54	354,735.36
SUNTRUST BANKS INC	15,547	33.85	526,265.95
US BANCORP	50,891	37.67	1,917,063.97

WELLS FARGO & CO	138,070	42.63	5,885,924.10
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,540	193.20	297,528.00
AMERICAN EXPRESS CO	27,354	81.90	2,240,292.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,650	101.27	572,175.50
BANK OF AMERICA CORPORATION	295,429	13.93	4,115,325.97
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	31,912	32.35	1,032,353.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	29,400	114.36	3,362,184.00
BLACKROCK INC	3,725	301.85	1,124,391.25
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,075	69.96	1,124,607.00
CITIGROUP INC	83,297	48.38	4,029,908.86
CME GROUP INC	9,000	73.69	663,210.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	13,540	51.92	702,996.80
EATON VANCE CORP	3,790	41.78	158,346.20
FRANKLIN RESOURCES INC	11,455	52.42	600,471.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11,988	161.95	1,941,456.60
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,160	197.97	427,615.20
INVESCO LTD	11,767	32.91	387,251.97
JPMORGAN CHASE & CO	103,730	51.95	5,388,773.50
LEGG MASON INC	3,635	39.05	141,946.75
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	29.11	212,648.55
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	7,142	71.03	507,296.26
MOODY'S CORP	5,927	72.11	427,395.97
MORGAN STANLEY	40,495	28.99	1,173,950.05
NASDAQ OMX GROUP/THE	3,055	35.32	107,902.60
NORTHERN TRUST CORP	6,410	57.14	366,267.40
NYSE EURONEXT	6,790	44.91	304,938.90
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,380	45.51	153,823.80
SCHWAB (CHARLES) CORP	33,014	23.29	768,896.06
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	33.14	143,330.50
SLM CORP	12,552	25.24	316,812.48
STATE STREET CORP	12,427	70.80	879,831.60
T ROWE PRICE GROUP INC	6,755	76.96	519,864.80
TD AMERITRADE HOLDING CORP	5,050	27.50	138,875.00
ACE LTD	9,463	96.61	914,220.43
AFLAC INC	12,482	64.45	804,464.90

ALLEGHANY CORP	400	394.08	157,632.00
ALLSTATE CORP	12,243	52.99	648,756.57
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,285	48.29	1,848,782.65
AON PLC	7,837	78.69	616,693.53
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,985	57.63	229,655.55
ASSURANT INC	2,500	58.70	146,750.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2,995	47.25	141,513.75
CHUBB CORP	6,873	92.83	638,020.59
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3,940	49.67	195,699.80
EVEREST RE GROUP LTD	1,434	152.39	218,527.26
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	27.23	160,139.63
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,832	33.69	398,620.08
LINCOLN NATIONAL CORP	7,733	46.66	360,821.78
LOEWS CORP	9,315	48.12	448,237.80
MARSH & MCLENNAN COS	14,633	45.65	667,996.45
METLIFE INC	25,355	48.07	1,218,814.85
PARTNERRE LTD	1,742	99.61	173,520.62
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,970	47.47	378,335.90
PROGRESSIVE CORP	15,290	26.24	401,209.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,092	81.47	1,066,605.24
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	93.23	139,565.31
TORCHMARK CORP	2,071	72.85	150,872.35
TRAVELERS COS INC/THE	9,984	86.46	863,216.64
UNUM GROUP	7,828	32.58	255,036.24
WILLIS GROUP HOLDING	4,510	44.11	198,936.10
WR BERKLEY CORP	2,573	43.34	111,513.82
XL GROUP PLC	8,070	30.63	247,184.10
CBRE GROUP INC	8,880	22.87	203,085.60
REALOGY HOLDINGS CORP	3,160	43.89	138,692.40
ACCENTURE PLC-CL A	17,768	73.36	1,303,460.48
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,350	16.53	220,675.50
ADOBE SYSTEMS INC	13,049	54.79	714,954.71
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,140	45.21	232,379.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,275	240.03	306,038.25
ANSYS INC	2,800	87.49	244,972.00

AUTODESK INC	6,280	41.71	261,938.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	13,266	75.51	1,001,715.66
CA INC	8,520	31.65	269,658.00
CITRIX SYSTEMS INC	4,968	57.39	285,113.52
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	8,369	89.59	749,778.71
COMPUTER SCIENCES CORP	4,363	50.75	221,422.25
EBAY INC	31,997	51.08	1,634,406.76
ELECTRONIC ARTS INC	9,244	25.56	236,276.64
EQUINIX INC	1,450	161.27	233,841.50
FACEBOOK INC-A	45,560	50.10	2,282,556.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	7,595	48.48	368,205.60
FISERV INC	3,619	104.69	378,873.11
GOOGLE INC-CL A	7,436	1,021.52	7,596,022.72
INTL BUSINESS MACHINES CORP	28,882	177.85	5,136,663.70
INTUIT INC	7,736	71.76	555,135.36
LEIDOS HOLDINGS INC	2,056	46.93	96,488.08
LINKEDIN CORP - A	2,580	224.54	579,313.20
MASTERCARD INC-CLASS A	2,880	736.38	2,120,774.40
MICROSOFT CORP	217,264	36.63	7,959,466.64
NUANCE COMMUNICATIONS INC	6,980	15.66	109,306.80
ORACLE CORP	103,213	33.50	3,457,635.50
PAYCHEX INC	9,402	41.91	394,037.82
RACKSPACE HOSTING INC	3,210	49.94	160,307.40
RED HAT INC	5,810	42.93	249,423.30
SALESFORCE.COM INC	15,720	55.69	875,446.80
SYMANTEC CORP	18,825	22.69	427,139.25
SYNOPSYS INC	4,627	35.86	165,924.22
TERADATA CORP	4,175	42.63	177,980.25
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	29.66	133,647.96
VERISIGN INC	4,810	54.30	261,183.00
VISA INC-CLASS A SHARES	14,155	197.37	2,793,772.35
VMWARE INC	2,405	80.52	193,650.60
WESTERN UNION CO	15,831	17.27	273,401.37
YAHOO! INC	26,955	32.97	888,706.35
AMPHENOL CORP-CL A	4,790	79.80	382,242.00

APPLE COMPUTER INC	25,706	525.62	13,511,587.72
ARROW ELECTRONICS INC	3,110	48.57	151,052.70
AVNET INC	3,460	39.33	136,081.80
CISCO SYSTEMS INC	146,560	23.06	3,379,673.60
CORNING INC	41,608	16.50	686,532.00
EMC CORP/MASS	57,289	23.55	1,349,155.95
F5 NETWORKS INC	2,365	79.74	188,585.10
FLEXTRONICS INTL LTD	14,686	7.80	114,550.80
FLIR SYSTEMS INC	3,195	28.58	91,313.10
HARRIS CORP	3,080	62.17	191,483.60
HEWLETT-PACKARD CO	54,335	25.47	1,383,912.45
JUNIPER NETWORKS INC	13,013	18.56	241,521.28
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,605	62.68	414,001.40
NETAPP INC	9,936	38.51	382,635.36
QUALCOMM INC	47,282	69.00	3,262,694.41
SANDISK CORP	6,413	68.98	442,368.74
SEAGATE TECHNOLOGY	8,564	48.50	415,354.00
TE CONNECTIVITY LTD	11,655	51.76	603,262.80
TRIMBLE NAVIGATION LTD	7,540	31.93	240,752.20
WESTERN DIGITAL CORP	5,865	71.19	417,529.35
XEROX CORP	30,914	10.28	317,795.92
AT&T INC	147,656	35.53	5,246,217.68
CENTURYLINK INC	16,326	33.38	544,961.88
CROWN CASTLE INTL CORP	8,910	76.14	678,407.40
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	30,694	4.48	137,509.12
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	3,630	90.96	330,184.80
SPRINT CORP	28,000	7.19	201,320.00
T-MOBILE US INC	4,362	28.12	122,659.44
VERIZON COMMUNICATIONS INC	78,563	50.10	3,936,006.30
WINDSTREAM HOLDINGS INC	17,485	8.51	148,797.35
AES CORP	17,438	13.96	243,434.48
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	51.99	187,683.90
AMEREN CORPORATION	6,522	36.19	236,031.18
AMERICAN ELECTRIC POWER	12,988	46.57	604,851.16
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,095	43.26	177,149.70

CALPINE CORP	9,640	19.69	189,811.60
CENTERPOINT ENERGY INC	11,092	24.26	269,091.92
CMS ENERGY CORP	7,820	27.45	214,659.00
CONSOLIDATED EDISON INC	8,536	58.35	498,075.60
DOMINION RESOURCES INC/VA	15,867	64.57	1,024,532.19
DTE ENERGY COMPANY	4,478	69.76	312,385.28
DUKE ENERGY CORP	19,356	72.45	1,402,342.20
EDISON INTERNATIONAL	8,219	49.26	404,867.94
ENTERGY CORP	5,187	64.01	332,019.87
EXELON CORP	24,586	28.25	694,554.50
FIRSTENERGY CORP	11,925	37.14	442,894.50
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	58.51	141,594.20
MDU RESOURCES GROUP INC	5,280	30.27	159,825.60
NEXTERA ENERGY INC	12,085	87.26	1,054,537.10
NISOURCE INC	8,025	31.58	253,429.50
NORTHEAST UTILITIES	8,390	42.46	356,239.40
NRG ENERGY INC	9,360	28.30	264,888.00
OGE ENERGY CORP	5,180	36.96	191,452.80
ONEOK INC	5,160	56.06	289,269.60
P G & E CORP	11,831	42.01	497,020.31
PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.17	137,870.64
PINNACLE WEST CAPITAL	3,569	55.63	198,543.47
PPL CORPORATION	15,848	30.40	481,779.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	13,568	33.64	456,427.52
SCANA CORP	3,443	47.33	162,957.19
SEMPRA ENERGY	6,547	90.48	592,372.56
SOUTHERN CO	24,655	41.10	1,013,320.50
WISCONSIN ENERGY CORP	5,774	42.11	243,143.14
XCEL ENERGY INC	14,404	28.72	413,682.88
ALTERA CORPORATION	9,206	32.97	303,521.82
ANALOG DEVICES INC	8,741	49.79	435,214.39
APPLIED MATERIALS INC	32,603	17.77	579,355.31
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	6,260	45.03	281,887.80
BROADCOM CORP-CL A	15,346	26.46	406,131.89
CREE INC	3,160	60.18	190,168.80

	INTEL CORP	135,892	24.03	3,265,484.76
	KLA-TENCOR CORPORATION	4,819	63.97	308,271.43
	LAM RESEARCH CORP	4,167	54.15	225,643.05
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	5,594	40.94	229,018.36
	LSI CORP	11,795	8.25	97,308.75
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	12,624	13.03	164,490.72
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,570	29.19	220,968.30
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,124	42.66	218,589.84
	MICRON TECHNOLOGY INC	28,947	17.68	511,782.96
	NVIDIA CORP	15,155	14.80	224,294.00
	TEXAS INSTRUMENTS INC	30,342	41.90	1,271,329.80
	XILINX INC	7,715	45.02	347,329.30
米ドル小計		8,422,406		443,136,644.24 (43,671,116,289)
加ドル	ALTAGAS LTD	3,050	38.59	117,699.50
	ARC RESOURCES LTD	7,925	28.76	227,923.00
	ATHABASCA OIL CORP	8,020	6.29	50,445.80
	BAYTEX ENERGY CORP	3,375	42.44	143,235.00
	BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	11.70	58,324.50
	CAMECO CORP	10,492	19.48	204,384.16
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	29,304	32.42	950,035.68
	CANADIAN OIL SANDS LTD	14,490	20.28	293,857.20
	CENOVUS ENERGY INC	19,883	30.53	607,027.99
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	10,045	40.25	404,311.25
	ENBRIDGE INC	21,045	45.80	963,861.00
	ENCANA CORP	20,718	19.21	397,992.78
	ENERPLUS CORP	6,630	18.05	119,671.50
	HUSKY ENERGY INC	9,069	29.66	268,986.54
	IMPERIAL OIL LTD	8,212	45.22	371,346.64
	KEYERA CORP	2,060	61.98	127,678.80
	MEG ENERGY CORP	4,510	31.30	141,163.00
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	21.40	200,946.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,085	34.26	276,992.10
	PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	6.77	86,520.60
	PENN WEST PETROLEUM LTD	15,493	11.63	180,183.59

PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	3,680	31.10	114,448.00
SUNCOR ENERGY INC	41,155	36.69	1,509,976.95
TALISMAN ENERGY INC	30,152	12.82	386,548.64
TOURMALINE OIL CORP	4,005	39.55	158,397.75
TRANSCANADA CORP	18,973	46.98	891,351.54
VERMILION ENERGY INC	3,000	57.59	172,770.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,325	30.36	161,667.00
AGRIUM INC	3,765	91.32	343,819.80
BARRICK GOLD CORP	27,474	19.16	526,401.84
ELDORADO GOLD CORP	20,510	7.01	143,775.10
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,260	19.84	342,438.40
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	45.42	204,162.90
GOLDCORP INC	21,277	25.97	552,563.69
KINROSS GOLD CORP	34,515	5.18	178,787.70
NEW GOLD INC	16,160	5.93	95,828.80
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	23,017	33.83	778,665.11
SILVER WHEATON CORP	8,645	23.32	201,601.40
TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,345	28.71	469,264.95
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	13,419	5.02	67,363.38
YAMANA GOLD INC	19,626	10.06	197,437.56
BOMBARDIER INC 'B'	34,746	4.53	157,399.38
CAE INC	6,315	12.13	76,600.95
FINNING INTERNATIONAL INC	4,625	23.91	110,583.75
SNC-LAVALIN GROUP INC	4,385	46.31	203,069.35
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,644	115.36	1,343,251.84
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,925	152.65	751,801.25
MAGNA INTERNATIONAL INC	6,089	88.98	541,799.22
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,070	50.15	153,960.50
TIM HORTONS INC	4,585	62.73	287,617.05
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	10,695	24.74	264,594.30
THOMSON REUTERS CORP	10,274	39.76	408,494.24
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,040	96.62	197,104.80
DOLLARAMA INC	1,660	89.78	149,034.80
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	3,810	71.00	270,510.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	79.91	79,910.00

LOBLAW COMPANIES LTD	2,709	47.56	128,840.04
METRO INC	3,090	67.66	209,069.40
SHOPPERS DRUG MART INC	5,365	60.88	326,621.20
WESTON (GEORGE) LTD	1,572	84.85	133,384.20
SAPUTO INC	3,520	51.25	180,400.00
CATAMARAN CORP	5,730	51.84	297,043.20
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	8,534	114.67	978,593.78
BANK OF MONTREAL	17,651	72.90	1,286,757.90
BANK OF NOVA SCOTIA	32,719	63.62	2,081,582.78
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,005	88.66	975,703.30
NATIONAL BANK OF CANADA	4,550	90.86	413,413.00
ROYAL BANK OF CANADA	39,469	70.08	2,765,987.52
TORONTO-DOMINION BANK	25,100	95.69	2,401,819.00
CI FINANCIAL CORP	3,410	34.34	117,099.40
IGM FINANCIAL INC	2,535	50.01	126,775.35
ONEX CORPORATION	1,905	55.54	105,803.70
GREAT-WEST LIFECO INC	7,724	32.17	248,481.08
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	2,905	47.15	136,970.75
INTACT FINANCIAL CORP	3,045	64.55	196,554.75
MANULIFE FINANCIAL CORP	48,731	18.67	909,807.77
POWER CORP OF CANADA	10,160	30.73	312,216.80
POWER FINANCIAL CORP	7,645	34.23	261,688.35
SUN LIFE FINANCIAL INC	15,704	35.32	554,665.28
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,782	41.78	659,371.96
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	19.85	171,980.40
CGI GROUP INC - CL A	5,870	35.31	207,269.70
OPEN TEXT CORPORATION	1,535	85.32	130,966.20
BLACKBERRY LTD	13,928	6.98	97,217.44
BCE INC	7,240	45.42	328,840.80
BELL ALIANT INC	1,680	26.46	44,452.80
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,405	46.88	487,786.40
TELUS CORP	5,976	36.31	216,988.56
ATCO LTD -CLASS I	1,920	48.39	92,908.80
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,590	38.28	99,145.20
FORTIS INC	4,785	32.43	155,177.55

	TRANSALTA CORP	7,950	14.17	112,651.50	
加ドル小計		1,025,325		36,639,624.43 (3,455,849,376)	
ユーロ	CGG	4,720	16.50	77,903.60	
	ENI SPA	69,716	18.30	1,275,802.80	
	FUGRO NV-CVA	1,660	45.96	76,293.60	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	12.54	116,810.10	
	NESTE OIL OYJ	3,590	15.16	54,424.40	
	OMV AG	3,490	36.51	127,437.35	
	REPSOL SA	23,631	19.59	463,049.44	
	SAIPEM SPA	7,220	18.23	131,620.60	
	TECHNIP SA	3,008	77.23	232,307.84	
	TENARIS SA	14,025	17.59	246,699.75	
	TOTAL SA	58,747	44.31	2,603,373.30	
	VOPAK	1,890	44.93	84,917.70	
	AIR LIQUIDE	8,676	99.99	867,513.24	
	AKZO NOBEL NV	6,468	53.45	345,714.60	
	ARCELORMITTAL	30,061	12.01	361,182.91	
	ARKEMA	2,005	81.33	163,066.65	
	BASF SE	25,135	75.83	1,905,987.05	
	CRH PLC	20,670	18.36	379,501.20	
	FUCHS PETROLUB SE-PRF	860	61.65	53,019.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	3,965	58.34	231,318.10	
	IMERYS SA	910	59.12	53,799.20	
	K+S AG	5,420	20.82	112,844.40	
	KONINKLIJKE DSM NV	4,382	57.28	251,000.96	
	LAFARGE SA	5,258	53.50	281,303.00	
	LANXESS AG	2,765	52.75	145,853.75	
	LINDE AG	5,105	141.80	723,889.00	
	SOLVAY ET CIE SA -A	1,711	115.95	198,390.45	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	12,085	7.11	85,984.77	
	THYSSENKRUPP AG	9,395	19.00	178,505.00	
	UMICORE	3,460	35.29	122,120.70	
	UPM-KYMMENE OYJ	12,618	12.39	156,337.02	
	VOESTALPINE AG	2,509	35.74	89,671.66	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4,176	24.25	101,288.88
ALSTOM	5,800	27.09	157,122.00
ANDRITZ AG	1,980	45.23	89,565.30
BOSKALIS WESTMINSTER	1,695	35.75	60,604.72
BOUYGUES SA	4,210	28.24	118,890.40
BRENTAG AG	1,465	120.90	177,118.50
CNH INDUSTRIAL NV	24,730	8.31	205,506.30
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	10,846	38.96	422,560.16
EADS NV	15,928	52.66	838,768.48
FERROVIAL SA	12,315	14.04	172,902.60
FINMECCANICA SPA	9,630	5.45	52,531.65
GEA GROUP AG	5,040	32.36	163,119.60
HOCHTIEF AG	1,045	67.40	70,433.00
KONE OYJ-B	4,497	65.65	295,228.05
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25,861	25.97	671,739.47
LEGRAND SA	7,428	41.81	310,564.68
MAN SE	1,054	88.86	93,658.44
METSO OYJ	3,260	29.19	95,159.40
OCI NV	2,300	29.75	68,436.50
OSRAM LICHT AG	2,332	38.40	89,548.80
PRYSMIAN SPA	5,635	17.63	99,345.05
REXEL SA	4,200	18.41	77,343.00
SAFRAN SA	6,190	46.91	290,403.85
SCHNEIDER ELECTRIC SA	14,458	61.68	891,769.44
SIEMENS AG-REG	21,696	92.41	2,004,927.36
THALES SA	2,345	45.40	106,463.00
VALLOUREC	3,345	44.16	147,731.92
VINCI SA	12,830	47.37	607,757.10
WARTSILA OYJ	4,810	32.50	156,325.00
ZARDOYA OTIS SA	5,219	12.68	66,176.92
ZODIAC AEROSPACE	910	116.60	106,106.00
BUREAU VERITAS SA	7,080	22.10	156,503.40
EDENRED	6,096	24.82	151,333.20
RANDSTAD HOLDING NV	2,865	44.90	128,638.50
SOCIETE BIC SA	735	92.01	67,627.35

ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	10,531	15.40	162,177.40
ADP	970	77.97	75,630.90
ATLANTIA SPA	9,360	16.00	149,760.00
DEUTCHE LUFTHANSA	5,680	14.32	81,366.00
DEUTSCHE POST AG	25,023	24.66	617,067.18
FRAPORT AG	980	55.63	54,517.40
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	17,530	7.15	125,497.27
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	4.11	130,567.75
RYANAIR HOLDINGS PLC	2,835	5.58	15,824.97
TNT EXPRESS NV	9,060	6.66	60,384.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,285	81.20	753,942.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	1,650	61.99	102,283.50
CONTINENTAL AG	3,055	136.05	415,632.75
DAIMLER AG	26,272	59.35	1,559,243.20
FIAT SPA	26,775	5.66	151,680.37
MICHELIN (CGDE)-B	4,749	76.37	362,681.13
NOKIAN RENKAAT OYJ	2,915	37.75	110,041.25
PIRELLI & C.	5,506	10.25	56,436.50
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	4,080	69.60	283,968.00
RENAULT SA	5,127	59.85	306,850.95
VOLKSWAGEN AG	771	181.90	140,244.90
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,953	190.90	754,627.70
ADIDAS AG	5,881	83.62	491,769.22
CHRISTIAN DIOR	1,420	139.50	198,090.00
HUGO BOSS AG -ORD	900	96.00	86,400.00
KERING	2,037	165.30	336,716.10
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	38.84	154,427.84
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,069	139.65	987,185.85
ACCOR SA	3,686	32.79	120,882.37
SODEXO	2,850	71.66	204,231.00
AXEL SPRINGER AG	995	43.42	43,207.87
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	23.85	90,510.75
JC DECAUX SA .	1,910	29.19	55,762.45
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	700	93.20	65,240.00
LAGARDERE S.C.A.	2,980	26.38	78,627.30

PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	2,855	34.85	99,496.75
PUBLICIS GROUPE	4,725	63.93	302,069.25
REED ELSEVIER NV	20,248	15.01	303,922.48
SES	9,570	21.62	206,951.25
TELENET GROUP HOLDING NV	1,440	40.40	58,176.00
WOLTERS KLUWER	7,557	19.89	150,308.73
INDITEX	6,055	118.55	717,820.25
CARREFOUR SA	16,343	26.98	441,015.85
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,344	84.00	112,896.00
COLRUYT SA	2,035	41.51	84,472.85
DELHAIZE GROUP	2,426	47.12	114,325.25
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	16,598	6.60	109,546.80
JERONIMO MARTINS	7,685	14.40	110,664.00
KESKO OYJ-B SHS	1,610	25.17	40,523.70
KONINKLIJKE AHOLD NV	29,474	14.06	414,404.44
METRO AG	3,260	34.94	113,920.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	22,111	75.77	1,675,350.47
DANONE	15,684	53.42	837,839.28
HEINEKEN HOLDING NV	2,595	46.68	121,147.57
HEINEKEN NV	6,333	50.28	318,423.24
KERRY GROUP PLC-A	4,610	46.58	214,756.85
PERNOD-RICARD SA	6,076	86.75	527,093.00
REMY COINTREAU	780	71.54	55,801.20
SUEDZUCKER AG	2,400	23.87	57,300.00
UNILEVER NV-CVA	44,455	29.39	1,306,532.45
BEIERSDORF AG	2,655	73.44	194,983.20
HENKEL AG & CO KGAA	3,880	68.85	267,138.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,983	81.12	404,220.96
L'OREAL	6,676	123.65	825,487.40
CELESIO AG	2,150	23.03	49,514.50
ESSILOR INTERNATIONAL	5,685	76.02	432,173.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,463	49.15	317,656.45
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,495	96.85	338,490.75
BAYER AG	22,640	92.71	2,098,954.40
ELAN CORP PLC	11,000	12.57	138,325.00

GRIFOLS SA	4,680	30.96	144,916.20
MERCK KGAA	1,745	122.80	214,286.00
ORION OYJ-CLASS B	2,590	19.81	51,307.90
QIAGEN N.V.	7,635	17.05	130,214.92
SANOFI	32,696	77.92	2,547,672.32
UCB SA	2,798	49.00	137,102.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.23	35,329.15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	154,213	8.44	1,301,557.72
BANCO DE SABADELL SA	84,048	1.84	155,320.70
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	0.98	20,848.97
BANCO POPULAR ESPANOL	29,339	4.08	119,761.79
BANCO SANTANDER SA	305,857	6.43	1,966,660.51
BANK OF IRELAND	558,550	0.26	145,781.55
BANKIA SA	65,000	1.03	67,340.00
BNP PARIBAS	27,332	53.23	1,454,882.36
CAIXABANK S.A	26,440	3.77	99,758.12
COMMERZBANK AG	26,244	9.30	244,147.93
CREDIT AGRICOLE SA	29,942	8.75	262,112.26
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	26.46	188,377.87
INTESA SANPAOLO	320,463	1.79	573,628.77
KBC GROEP NV	6,119	39.10	239,252.90
NATIXIS	27,130	3.90	105,807.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	1,470	27.57	40,527.90
SOCIETE GENERALE	19,199	40.35	774,679.65
UBI BANCA SCPA	28,684	5.02	143,993.68
UNICREDIT SPA	120,043	5.46	656,034.99
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,825	34.45	958,710.37
DEUTSCHE BOERSE AG	5,320	54.77	291,376.40
EURAZEO	1,159	56.10	65,019.90
EXOR SPA	1,714	28.77	49,311.78
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,882	65.35	122,988.70
ING GROEP NV-CVA	104,765	9.27	971,800.14
MEDIOBANCA SPA	16,140	6.52	105,232.80
POHJOLA BANK PLC	3,875	13.98	54,172.50
WENDEL	1,050	102.80	107,940.00

AEGON NV	53,099	5.75	305,531.64
AGEAS	7,014	31.16	218,556.24
ALLIANZ SE-REG	12,448	123.35	1,535,460.80
ASSICURAZIONI GENERALI	31,968	17.20	549,849.60
AXA	48,832	17.98	878,243.52
CNP ASSURANCES	3,530	13.03	46,013.55
DELTA LLOYD NV	3,600	15.64	56,304.00
HANNOVER RUECK SE-REG	1,845	59.82	110,367.90
MAPFRE SA	26,034	2.90	75,628.77
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,816	153.55	739,496.80
SAMPO OYJ-A SHS	11,829	34.59	409,165.11
SCOR SE	4,142	25.63	106,180.17
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	39.31	55,427.10
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	25,580	3.26	83,518.70
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	26.79	269,507.40
ATOS	1,650	63.30	104,445.00
CAP GEMINI SA	4,079	47.20	192,549.19
DASSAULT SYSTEMES SA	1,765	86.39	152,478.35
SAP AG-COMMON	25,272	57.60	1,455,667.20
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,570	28.45	101,566.50
GEMALTO	2,370	79.82	189,173.40
NOKIA OYJ	102,676	5.77	592,953.90
BELGACOM SA	3,780	20.43	77,225.40
DEUTSCHE TELEKOM AG	78,616	11.71	920,986.44
ELISA OYJ	4,205	18.26	76,783.30
ILIAD SA	730	166.80	121,764.00
KONINKLIJKE KPN NV	80,906	2.39	193,688.96
ORANGE S.A.	52,084	9.75	507,819.00
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	15,833	3.34	52,993.05
TELECOM ITALIA SPA	277,303	0.72	202,153.88
TELECOM ITALIA-RSP	189,867	0.57	109,553.25
TELEFONICA SA	112,718	12.80	1,442,790.40
TELEKOM AUSTRIA AG	6,570	6.06	39,833.91

	VIVENDI	33,550	18.66	626,210.75
	ZIGGO NV	4,030	32.08	129,282.40
	ACCIONA SA	566	45.60	25,812.43
	E.ON SE	48,869	13.60	664,618.40
	EDF	6,885	26.17	180,180.45
	ENAGAS	4,190	19.61	82,165.90
	ENEL GREEN POWER SPA	43,650	1.73	75,820.05
	ENEL SPA	180,354	3.14	567,393.68
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,221	2.71	133,388.91
	FORTUM OYJ	12,255	16.61	203,555.55
	GAS NATURAL SDG SA	10,732	17.83	191,405.22
	GDF SUEZ	37,654	18.32	690,009.55
	IBERDROLA SA	129,702	4.68	607,005.36
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,040	46.25	140,615.20
	RWE AG	14,235	27.67	393,953.62
	RWE AG-NON VTG PFD	1,060	25.30	26,823.30
	SNAM SPA	47,520	3.76	178,865.28
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	8,549	12.82	109,598.18
	TERNA SPA	43,127	3.67	158,621.10
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,184	12.27	112,733.60
	VERBUND AG	2,370	17.70	41,960.85
	ASML HOLDING NV	9,782	67.15	656,861.30
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	29,335	7.19	210,918.65
	STMICROELECTRONICS NV	16,783	5.69	95,545.61
ユーロ小計		5,376,209		77,280,898.17 (10,262,130,467)
英債券	AMEC PLC	8,850	12.07	106,819.50
	BG GROUP PLC	93,174	12.79	1,191,695.46
	BP PLC	521,378	4.88	2,544,585.32
	PETROFAC LTD	6,995	14.40	100,728.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	104,298	20.87	2,176,699.26
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	69,914	21.76	1,521,328.64
	TULLOW OIL PLC	25,600	9.41	241,024.00
	ANGLO AMERICAN PLC	38,484	15.36	591,114.24
	ANTOFAGASTA PLC	11,360	8.89	100,990.40

BHP BILLITON PLC	58,131	19.70	1,145,180.70
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,900	24.13	94,107.00
FRESNILLO PLC	5,160	10.02	51,703.20
GLENCORE XSTRATA PLC	290,583	3.41	993,212.69
JOHNSON MATTHEY PLC	5,517	30.20	166,613.40
RANDGOLD RESOURCES LTD	2,250	46.13	103,792.50
REXAM PLC	22,222	5.20	115,665.51
RIO TINTO PLC	34,985	33.30	1,165,175.42
VEDANTA RESOURCES PLC	2,850	10.96	31,236.00
BAE SYSTEMS PLC ORD	88,785	4.53	402,462.40
BUNZL PLC	10,376	13.73	142,462.48
COBHAM PLC	34,695	2.84	98,533.80
IMI PLC	9,210	15.33	141,189.30
INVENSYS PLC	21,664	5.00	108,428.32
MEGGITT PLC	20,865	4.93	102,968.77
MELROSE INDUSTRIES PLC	40,000	3.16	126,640.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -PRF C	4,548,970	0.00	4,548.97
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	52,895	11.46	606,176.70
SMITHS GROUP PLC	11,363	14.18	161,127.34
TRAVIS PERKINS PLC	6,600	18.22	120,252.00
WEIR GROUP PLC/THE	5,660	21.88	123,840.80
WOLSELEY PLC	7,414	33.03	244,884.42
AGGREKO PLC	8,361	15.66	130,933.26
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	12.78	124,924.50
CAPITA PLC	18,349	9.80	179,820.20
EXPERIAN PLC	27,408	12.63	346,163.04
G4S PLC	42,539	2.49	106,219.88
INTERTEK GROUP PLC	4,815	32.36	155,813.40
SERCO GROUP PLC	14,965	5.42	81,110.30
EASYJET PLC	3,840	12.03	46,195.20
GKN PLC	44,825	3.64	163,476.77
BURBERRY GROUP PLC	13,234	15.00	198,510.00
PERSIMMON PLC	8,190	12.15	99,508.50
CARNIVAL PLC	5,300	22.55	119,515.00
COMPASS GROUP PLC	50,618	8.98	454,802.73

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,369	18.06	151,144.14
TUI TRAVEL PLC	14,295	3.75	53,620.54
WHITBREAD PLC	5,510	34.59	190,590.90
WILLIAM HILL PLC	23,300	3.89	90,846.70
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	28,404	9.33	265,009.32
ITV PLC	103,355	1.91	197,408.05
PEARSON PLC	23,069	12.92	298,051.48
REED ELSEVIER PLC	32,106	8.76	281,248.56
WPP PLC	34,754	13.47	468,136.38
KINGFISHER PLC	62,157	3.73	232,094.23
MARKS & SPENCER GROUP PLC	47,910	5.09	243,861.90
NEXT PLC	4,477	55.10	246,682.70
SAINSBURY (J) PLC	34,011	3.95	134,581.52
TESCO PLC	221,604	3.63	804,422.52
WM MORRISON SUPERMARKETS	59,995	2.80	168,105.99
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,125	22.08	223,560.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	52,707	34.34	1,809,958.38
COCA-COLA HBC AG-CDI	5,000	17.62	88,100.00
DIAGEO PLC	69,022	19.93	1,375,608.46
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	26,552	23.82	632,468.64
SABMILLER PLC	26,441	32.40	856,688.40
TATE & LYLE PLC	12,180	7.80	95,004.00
UNILEVER PLC	35,037	25.35	888,187.95
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17,625	48.13	848,291.25
SMITH & NEPHEW PLC	26,646	8.02	213,834.15
ASTRAZENECA PLC	34,383	32.91	1,131,716.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	135,281	16.65	2,252,428.65
SHIRE PLC	15,145	28.58	432,844.10
BARCLAYS PLC	418,691	2.49	1,042,540.59
HSBC HOLDINGS PLC	511,141	6.98	3,567,764.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,269,826	0.75	954,401.22
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,230	3.26	186,569.80
STANDARD CHARTERED PLC	66,649	14.99	999,401.75
3I GROUP PLC	29,809	3.71	110,651.00
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	22,730	4.36	99,239.18

	HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,720	11.74	67,152.80
	ICAP PLC	18,640	3.80	70,999.76
	INVESTEC PLC	13,185	4.30	56,748.24
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	16.11	65,535.48
	SCHRODERS PLC	2,231	25.75	57,448.25
	ADMIRAL GROUP PLC	4,925	12.68	62,449.00
	AVIVA PLC	79,430	4.42	351,080.60
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,560	2.26	44,244.72
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	168,571	2.13	359,224.80
	OLD MUTUAL PLC	143,879	1.99	287,182.48
	PRUDENTIAL PLC	69,742	12.70	885,723.40
	RESOLUTION LTD	37,353	3.51	131,407.85
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	89,957	1.21	108,847.97
	STANDARD LIFE PLC	70,055	3.51	245,893.05
	SAGE GROUP PLC/THE	27,620	3.39	93,825.14
	BT GROUP PLC	220,352	3.76	829,184.57
	INMARSAT PLC	10,010	7.20	72,072.00
	VODAFONE GROUP PLC	1,339,465	2.28	3,057,328.86
	CENTRICA PLC	141,755	3.58	507,482.90
	NATIONAL GRID PLC	102,105	7.88	804,587.40
	SEVERN TRENT PLC	6,283	17.96	112,842.68
	SSE PLC	26,377	14.00	369,278.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,525	6.91	128,007.75
	ARM HOLDINGS PLC	37,080	9.75	361,715.40
英債券小計		12,618,791		47,797,505.49 (7,561,565,368)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	9,705	43.72	424,302.60
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	240	328.00	78,720.00
	GIVAUDAN-REG	213	1,291.00	274,983.00
	HOLCIM LTD-REG	6,583	67.90	446,985.70
	SIKA AG-BR	67	2,873.00	192,491.00
	SYNGENTA AG-REG	2,598	367.00	953,466.00
	ABB LTD-REG	59,945	22.89	1,372,141.05
	GEBERIT AG-REG	1,125	268.70	302,287.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	129.20	100,776.00

SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,090	129.10	140,719.00		
SULZER AG-REG	520	142.60	74,152.00		
ADECCO SA-REG	3,557	66.10	235,117.70		
SGS SA-REG	133	2,108.00	280,364.00		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,550	112.60	174,530.00		
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	14,259	92.60	1,320,383.40		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	830	573.00	475,590.00		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	930	99.75	92,767.50		
ARYZTA AG	2,630	66.90	175,947.00		
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	25	3,875.00	96,875.00		
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	3	46,255.00	138,765.00		
NESTLE SA-REG	88,273	65.25	5,759,813.25		
SONOVA HOLDING AG-REG	1,510	114.30	172,593.00		
ACTELION LTD-REG	2,560	72.15	184,704.00		
LONZA GROUP AG-REG	1,650	81.70	134,805.00		
NOVARTIS AG-REG	62,943	70.30	4,424,892.90		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,228	250.80	4,822,382.40		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	40,818	25.98	1,060,451.64		
JULIUS BAER GROUP LTD	6,780	42.16	285,844.80		
PARGESA HOLDING SA-BR	975	71.40	69,615.00		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	500	223.50	111,750.00		
UBS AG-REG	99,692	16.54	1,648,905.68		
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	106.60	148,174.00		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	178.50	151,725.00		
SWISS RE AG	9,779	79.25	774,985.75		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,011	249.30	999,942.30		
SWISS PRIME SITE-REG	1,370	69.05	94,598.50		
SWISSCOM AG-REG	634	459.20	291,132.80		
スイスフラン小計	449,746		28,487,679.47 (3,073,250,861)		
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,180	134.00	828,120.00	
	BOLIDEN AB	7,620	93.95	715,899.00	
	ALFA LAVAL AB	7,470	146.20	1,092,114.00	
	ASSA ABLOY AB-B	9,660	316.80	3,060,288.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	17,995	179.40	3,228,303.00	

	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,280	160.40	1,809,312.00	
	SANDVIK AB	30,250	86.45	2,615,112.50	
	SCANIA AB-B SHS	8,560	128.00	1,095,680.00	
	SKANSKA AB-B SHS	10,520	125.50	1,320,260.00	
	SKF AB-B SHS	10,209	173.40	1,770,240.60	
	VOLVO AB-B SHARES	40,370	82.05	3,312,358.50	
	SECURITAS AB-B SHS	7,249	73.50	532,801.50	
	ELECTROLUX AB - B	6,765	160.70	1,087,135.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	8,480	38.97	330,465.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	26,248	272.60	7,155,204.80	
	SWEDISH MATCH AB	6,530	210.10	1,371,953.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	15,365	183.70	2,822,550.50	
	ELEKTA AB-B SHS	10,440	93.40	975,096.00	
	GETINGE AB-B SHS	5,730	201.80	1,156,314.00	
	NORDEA BANK AB	76,178	81.75	6,227,551.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	44,630	78.15	3,487,834.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	13,930	298.00	4,151,140.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	24,570	167.90	4,125,303.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,630	115.30	303,239.00	
	INVESTOR AB-B SHS	11,795	207.90	2,452,180.50	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	242.50	1,628,387.50	
	RATOS AB-B SHS	4,110	56.00	230,160.00	
	ERICSSON LM-B SHS	83,635	77.65	6,494,257.75	
	HEXAGON AB-B SHS	6,960	193.10	1,343,976.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,370	606.50	830,905.00	
	TELE2 AB-B SHS	8,705	78.50	683,342.50	
	TELIASONERA AB	65,210	53.55	3,491,995.50	
	スウェーデンクローナ小計	597,359		71,729,481.25	(1,084,549,756)
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	4,430	83.05	367,911.50	
	SEADRILL LTD	9,735	273.40	2,661,549.00	
	STATOIL ASA	30,684	141.30	4,335,649.20	
	SUBSEA 7 SA	7,505	126.70	950,883.50	
	NORSK HYDRO A S	20,410	26.95	550,049.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,560	263.90	1,203,384.00	

	ORKLA ASA	19,380	47.00	910,860.00	
	DNB ASA	28,595	105.40	3,013,913.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	4,200	111.20	467,040.00	
	TELENOR ASA	19,875	145.50	2,891,812.50	
ノルウェークローネ小計		149,374		17,353,052.20	(285,631,239)
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	13	49,920.00	648,960.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - B	33	52,950.00	1,747,350.00	
	DSV A/S	5,060	159.40	806,564.00	
	CARLSBERG AS-B	2,940	551.50	1,621,410.00	
	COLOPLAST-B	3,385	352.50	1,193,212.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	600	518.50	311,100.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	10,945	921.50	10,085,817.50	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,645	215.80	1,218,191.00	
	DANSKE BANK A/S	18,375	125.50	2,306,062.50	
	TRYG A/S	615	507.00	311,805.00	
	TDC A/S	14,545	49.49	719,832.05	
デンマーククローネ小計		62,156		20,970,304.55	(373,271,420)
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	4,575	18.61	85,140.75	
	ORIGIN ENERGY LTD	30,980	14.67	454,476.60	
	SANTOS LTD	28,415	15.17	431,055.55	
	WHITEHAVEN COAL LTD	15,000	1.59	23,850.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,488	39.35	727,502.80	
	WORLEYPARSONS LTD	4,340	21.56	93,570.40	
	ALUMINA LTD	68,742	1.06	73,210.23	
	AMCOR LIMITED	35,520	10.79	383,260.80	
	BHP BILLITON LTD	88,006	37.85	3,331,027.10	
	BORAL LTD	17,115	4.93	84,376.95	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	46,275	5.53	255,900.75	
	ILUKA RESOURCES LTD	12,115	10.27	124,421.05	
	INCITEC PIVOT LTD	53,090	2.66	141,219.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	13,935	10.85	151,194.75	
	NEWCREST MINING LTD	20,969	10.22	214,303.18	
ORICA LIMITED	10,785	20.72	223,465.20		

RIO TINTO LTD	11,838	64.70	765,918.60
LEIGHTON HOLDINGS LTD	3,517	17.63	62,004.71
ALS LTD	8,301	9.85	81,764.85
BRAMBLES LTD	45,708	9.28	424,170.24
SEEK LTD	8,040	13.00	104,520.00
ASCIANO LTD	24,833	5.76	143,038.08
AURIZON HOLDINGS LTD	59,950	4.79	287,160.50
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.25	42,977.47
SYDNEY AIRPORT	5,340	4.02	21,466.80
TOLL HOLDINGS LTD	16,805	5.71	95,956.55
TRANSURBAN GROUP	35,045	6.93	242,861.85
CROWN RESORTS LTD	10,705	16.77	179,522.85
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	17,212	2.64	45,439.68
FLIGHT CENTRE LTD	1,640	51.75	84,870.00
TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	3.57	85,597.89
TATTS GROUP LTD	42,460	3.18	135,022.80
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	15,840	3.38	53,539.20
METCASH LTD	18,890	3.30	62,337.00
WESFARMERS LTD	27,930	43.06	1,202,665.80
WOOLWORTHS LTD	34,062	34.60	1,178,545.20
COCA-COLA AMATIL LTD	15,150	12.29	186,193.50
TREASURY WINE ESTATES LTD	21,730	4.68	101,696.40
COCHLEAR LTD	1,277	57.51	73,440.27
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,935	38.40	112,704.00
SONIC HEALTHCARE LTD	9,830	16.02	157,476.60
CSL LTD	13,392	68.05	911,325.60
AUST AND NZ BANKING GROUP	74,939	33.79	2,532,188.81
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	10,478	10.86	113,791.08
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	44,087	77.00	3,394,699.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	64,023	35.80	2,292,023.40
WESTPAC BANKING CORP	85,031	34.35	2,920,814.85
ASX LTD	4,995	36.50	182,317.50
MACQUARIE GROUP LTD	8,026	53.50	429,391.00
AMP LTD	86,217	4.71	406,082.07
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	59,878	6.13	367,052.14

	QBE INSURANCE GROUP LTD	31,820	14.69	467,435.80	
	SUNCORP GROUP LTD	33,060	13.30	439,698.00	
	COMPUTERSHARE LTD	11,490	10.76	123,632.40	
	TELSTRA CORPORATION LTD	122,744	5.14	630,904.16	
	AGL ENERGY LTD	16,671	15.41	256,900.11	
	SP AUSNET	49,750	1.25	62,187.50	
豪ドル小計		1,682,211		28,259,309.77 (2,646,201,766)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	23,390	9.73	227,584.70	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	30,950	3.52	108,944.00	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	12,790	3.90	49,881.00	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	55,837	2.33	130,100.21	
	CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.20	49,036.00	
ニュージーランドドル小計		132,397		565,545.91 (46,612,293)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	16,000	25.55	408,800.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	57,823	95.85	5,542,334.55	
	NWS HOLDINGS LTD	48,500	12.06	584,910.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	15.14	560,180.00	
	MTR CORP	39,500	29.70	1,173,150.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	41.50	249,000.00	
	LI & FUNG LTD	182,000	10.84	1,972,880.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	21.25	520,625.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	57,000	57.70	3,288,900.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	28,000	26.60	744,800.00	
	SANDS CHINA LTD	68,600	54.25	3,721,550.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	14.22	682,560.00	
	SJM HOLDINGS LTD	57,000	25.50	1,453,500.00	
	WYNN MACAU LTD	44,600	29.65	1,322,390.00	
	BANK OF EAST ASIA	36,440	33.30	1,213,452.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	109,000	24.95	2,719,550.00	
	HANG SENG BANK LTD	21,400	127.60	2,730,640.00	
	FIRST PACIFIC CO	74,250	8.73	648,202.50	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	31,400	125.10	3,928,140.00	
	AIA GROUP LTD	328,600	38.75	12,733,250.00	

	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	36,682	121.80	4,467,867.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	25.80	1,470,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	30,168	45.95	1,386,219.60	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	15,000	35.10	526,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	16,950	33.15	561,892.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	101,000	10.72	1,082,720.00	
	SINO LAND CO	63,050	10.82	682,201.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,480	102.00	4,638,960.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,017	89.25	1,608,017.25	
	SWIRE PROPERTIES LTD	39,400	21.05	829,370.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,800	64.15	2,809,770.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	29,600	38.15	1,129,240.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	19,000	31.00	589,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	67,000	7.05	472,350.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	53.65	804,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	48,000	62.05	2,978,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	154,438	18.16	2,804,594.08	
	POWER ASSETS HOLDINGS	37,500	63.15	2,368,125.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	67.75	440,375.00	
香港ドル小計		2,159,198		77,849,766.08	(989,470,526)
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	43,660	10.79	471,091.40	
	NOBLE GROUP LTD	141,854	1.04	148,237.43	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	32,000	5.29	169,280.00	
	SEBACORP MARINE LTD	27,000	4.50	121,500.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	33,000	4.18	137,940.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	42,010	1.17	49,361.75	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	46,000	1.91	87,860.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	15,800	10.47	165,426.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	172,000	1.53	263,160.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	45,050	4.22	190,111.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	36.68	73,360.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	1.48	69,560.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.58	127,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,000	3.45	182,850.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	47,215	16.86	796,044.90	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	67,240	10.47	704,002.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	34,700	20.80	721,760.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	28,000	7.40	207,200.00	
	CAPITALAND LTD	71,000	3.09	219,390.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	29,880	2.03	60,656.40	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,000	10.20	132,600.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	3.08	184,800.00	
	KEPPEL LAND LTD	18,000	3.72	66,960.00	
	UOL GROUP LTD	12,250	6.39	78,277.50	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	220,280	3.76	828,252.80	
シンガポールドル小計		1,521,939		6,257,281.98 (495,827,024)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	9,770	29.90	292,123.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	78	1,815.00	141,570.00	
	TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	22,840	130.80	2,987,472.00	
	BANK HAPOLIM BM	27,725	18.91	524,279.75	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,355	13.32	391,008.60	
	NICE SYSTEMS LTD	1,825	138.00	251,850.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,880	6.25	430,568.88	
イスラエルシュケル小計		160,473		5,018,872.23 (139,926,157)	
合 計		34,357,584		74,085,402,542 (74,085,402,542)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	11,760	255,544.80	
		AMERICAN TOWER CORP	11,209	881,027.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	24,910	286,465.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	430,900.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,117	420,551.55	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	134,134.00
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,735	178,943.85
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	112,681.25
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	8,890	467,258.40
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,825	195,421.00
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	11,315	236,144.05
		HCP INC	12,455	508,039.45
		HEALTH CARE REIT INC	8,180	514,113.00
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,749	410,186.14
		KIMCO REALTY CORPORATION	11,985	255,999.60
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	112,628.34
		PLUM CREEK TIMBER CO	4,548	204,750.96
		PROLOGIS INC	13,432	536,071.12
		PUBLIC STORAGE	3,959	654,145.57
		RAYONIER INC	3,507	161,812.98
		REALTY INCOME CORP	5,400	223,830.00
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	141,848.85
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	8,474	1,315,249.54
		SL GREEN REALTY CORP	2,650	248,411.00
		THE MACERICH COMPANY	4,370	257,174.50
		UDR INC	7,800	189,072.00
		VENTAS INC	8,095	517,999.05
		VORNADO REALTY TRUST	4,671	422,865.63
		WEYERHAEUSER CO	16,116	475,422.00
米ドル合計			233,620	10,748,691.03 (1,059,283,501)
加ドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	4,000	86,480.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	85,243.60
加ドル合計			7,380	171,723.60 (16,196,969)
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,998	64,315.62
		FONCIERE DES REGIONS	595	38,002.65
		GECINA SA	740	72,164.80
		ICADE	685	46,203.25
		KLEPIERRE	2,445	80,685.00

		UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,680	516,838.00	
ユーロ合計			9,143	818,209.32	(108,650,015)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	27,311	166,733.65	
		HAMMERSON PLC	15,295	79,686.95	
		INTU PROPERTIES PLC	19,860	66,610.44	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	22,899	222,578.28	
		SEGRO PLC	20,223	65,138.28	
英ポンド合計			105,588	600,747.60	(95,038,270)
豪ドル	投資証券	APA GROUP	19,805	118,631.95	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	67,010	138,040.60	
		DEXUS PROPERTY GROUP	110,925	118,135.12	
		FEDERATION CENTRES	45,000	112,050.00	
		GOODMAN GROUP	43,442	217,644.42	
		GPT GROUP	47,615	178,556.25	
		LEND LEASE GROUP	17,037	190,814.40	
		MIRVAC GROUP	108,455	190,880.80	
		STOCKLAND	55,310	223,452.40	
		WESTFIELD GROUP	55,295	601,609.60	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	86,505	265,570.35	
豪ドル合計			656,399	2,355,385.89	(220,558,334)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	59,500	2,311,575.00	
香港ドル合計			59,500	2,311,575.00	(29,380,118)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	62,000	145,080.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	67,000	98,155.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	142,523.00	
シンガポールドル合計			200,800	385,758.00	(30,567,463)
合計				1,559,674,670	(1,559,674,670)

(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 568銘柄	97.6%		57.7%
	投資証券 29銘柄		2.4%	1.4%
加ドル	株式 92銘柄	99.5%		4.6%
	投資証券 2銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	99.0%		13.6%
	投資証券 6銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 103銘柄	98.8%		10.0%
	投資証券 5銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		4.1%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.5%
豪ドル	株式 57銘柄	92.3%		3.5%
	投資証券 11銘柄		7.7%	0.3%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	97.1%		1.3%
	投資証券 1銘柄		2.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 25銘柄	94.2%		0.7%
	投資証券 3銘柄		5.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.0%		0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）		
	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	50,549,312	20,903,095
国債証券	24,503,490,680	27,143,528,160
地方債証券	1,997,149,000	2,316,085,000
特殊債券	2,801,754,000	2,476,553,000
社債券	2,162,558,000	2,278,648,000
未収入金	-	137,754,700
未収利息	101,814,933	105,563,980
前払費用	1,683,852	1,993,040
流動資産合計	31,618,999,777	34,481,028,975
資産合計	31,618,999,777	34,481,028,975
負債の部		
流動負債		
未払金	-	104,968,000
未払解約金	24,935,817	45,726,278
流動負債合計	24,935,817	150,694,278
負債合計	24,935,817	150,694,278
純資産の部		
元本等		
元本	25,160,170,820	26,748,043,185
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,433,893,140	7,582,291,512
元本等合計	31,594,063,960	34,330,334,697
純資産合計	31,594,063,960	34,330,334,697
負債純資産合計	31,618,999,777	34,481,028,975

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
1.	期首	平成23年11月 8日	平成24年11月 7日
	期首元本額	26,055,168,581円	25,160,170,820円
	期首からの追加設定元本額	1,781,986,498円	4,333,512,979円
	期首からの一部解約元本額	2,676,984,259円	2,745,640,614円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	469,336,238円	551,331,180円
	DCインデックスバランス（株式40）	575,452,114円	727,438,960円
	DCインデックスバランス（株式60）	391,874,057円	514,807,475円
	DCインデックスバランス（株式80）	64,081,958円	92,747,038円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	1,112,147,360円	1,169,515,432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	7,126,691,792円	7,301,021,244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	8,264,158円	8,143,932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）	99,397,477円	56,145,692円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	7,216,652円	7,755,850円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	41,547,332円	37,660,144円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	184,615,776円	162,191,397円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	676,571,702円	592,012,952円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	6,942,590,807円	7,401,918,468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）	114,584,462円	103,067,299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）	196,874,248円	200,848,757円
	3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	21,261,988円	- 円
	グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	28,156,286円	33,295,646円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	878,970,026円	1,021,270,981円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	812,394,357円	1,001,385,092円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	386,232,513円	519,933,222円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	56,485,704円	79,324,896円
	年金積立 インデックスファンド日本債券	4,820,491,989円	5,002,290,178円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	144,931,824円	163,937,350円
	計	25,160,170,820円	26,748,043,185円
2.	受益権の総数	25,160,170,820口	26,748,043,185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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6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管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成24年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	6,801,610
地方債証券	1,054,000
特殊債証券	690,000
社債証券	20,086,000
合計	28,631,610

(平成25年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	16,897,020
地方債証券	317,000
特殊債証券	371,000
社債証券	1,168,000
合計	18,753,020

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年11月 6日現在		平成25年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.2557円	1口当たり純資産額	1.2835円
(1万口当たり純資産額)	(12,557円)	(1万口当たり純資産額)	(12,835円)

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3 2 3 回利付国債（2年）	210,000,000	210,033,600	
	第3 2 4 回利付国債（2年）	100,000,000	100,017,000	
	第3 2 9 回利付国債（2年）	100,000,000	100,175,000	
	第3 3 2 回利付国債（2年）	150,000,000	150,013,500	
	第8 7 回利付国債（5年）	460,000,000	462,125,200	
	第8 8 回利付国債（5年）	140,000,000	140,789,600	
	第8 9 回利付国債（5年）	330,000,000	331,673,100	
	第9 0 回利付国債（5年）	50,000,000	50,173,000	
	第9 1 回利付国債（5年）	50,000,000	50,284,000	
	第9 2 回利付国債（5年）	15,000,000	15,057,150	
	第9 3 回利付国債（5年）	445,000,000	448,755,800	
	第9 4 回利付国債（5年）	70,000,000	70,738,500	
	第9 5 回利付国債（5年）	220,000,000	222,565,200	
	第9 6 回利付国債（5年）	150,000,000	151,395,000	
	第9 7 回利付国債（5年）	350,000,000	352,597,000	
	第9 8 回利付国債（5年）	55,000,000	55,265,100	
	第9 9 回利付国債（5年）	200,000,000	201,570,000	
	第1 0 0 回利付国債（5年）	110,000,000	110,548,900	
	第1 0 1 回利付国債（5年）	170,000,000	171,422,900	
	第1 0 2 回利付国債（5年）	280,000,000	281,430,800	
	第1 0 4 回利付国債（5年）	50,000,000	50,100,000	
	第1 0 5 回利付国債（5年）	100,000,000	100,179,000	
	第1 0 6 回利付国債（5年）	340,000,000	340,455,600	
	第1 0 7 回利付国債（5年）	210,000,000	210,256,200	
	第1 0 9 回利付国債（5年）	100,000,000	99,653,000	
	第1 1 1 回利付国債（5年）	40,000,000	40,380,800	
第1 1 2 回利付国債（5年）	160,000,000	161,536,000		
第1 1 4 回利付国債（5年）	90,000,000	90,432,900		
第1 回利付国債（40年）	25,000,000	29,664,500		

第2回利付国債(40年)	165,000,000	187,146,300	
第3回利付国債(40年)	20,000,000	22,680,200	
第4回利付国債(40年)	75,000,000	85,124,250	
第5回利付国債(40年)	20,000,000	21,568,400	
第6回利付国債(40年)	50,000,000	52,419,500	
第265回利付国債(10年)	50,000,000	50,788,000	
第266回利付国債(10年)	58,000,000	58,849,120	
第268回利付国債(10年)	361,000,000	367,945,640	
第269回利付国債(10年)	90,000,000	91,486,800	
第270回利付国債(10年)	88,000,000	89,715,120	
第271回利付国債(10年)	146,000,000	148,610,480	
第272回利付国債(10年)	178,000,000	182,325,400	
第273回利付国債(10年)	111,000,000	113,903,760	
第274回利付国債(10年)	73,000,000	75,164,450	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	36,111,600	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	83,194,400	
第279回利付国債(10年)	30,000,000	31,339,200	
第280回利付国債(10年)	156,000,000	163,255,560	
第281回利付国債(10年)	182,000,000	190,939,840	
第282回利付国債(10年)	24,000,000	25,082,880	
第283回利付国債(10年)	25,000,000	26,199,250	
第284回利付国債(10年)	462,000,000	484,499,400	
第285回利付国債(10年)	261,000,000	274,621,590	
第286回利付国債(10年)	186,000,000	197,029,800	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	37,201,150	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,064,880	
第289回利付国債(10年)	199,000,000	209,815,650	
第290回利付国債(10年)	406,000,000	427,526,120	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	300,974,030	
第292回利付国債(10年)	241,000,000	256,908,410	
第293回利付国債(10年)	96,000,000	103,092,480	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,217,600	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,781,950	
第296回利付国債(10年)	126,000,000	133,956,900	
第297回利付国債(10年)	148,000,000	156,991,000	

第298回利付国債(10年)	221,000,000	233,307,490	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	793,342,500	
第300回利付国債(10年)	86,000,000	91,881,540	
第301回利付国債(10年)	223,000,000	238,761,640	
第302回利付国債(10年)	14,000,000	14,911,820	
第303回利付国債(10年)	581,000,000	619,979,290	
第305回利付国債(10年)	673,000,000	714,914,440	
第306回利付国債(10年)	233,000,000	249,230,780	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	148,982,400	
第309回利付国債(10年)	34,000,000	35,728,900	
第310回利付国債(10年)	88,000,000	91,896,640	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	95,869,980	
第312回利付国債(10年)	205,000,000	216,719,850	
第313回利付国債(10年)	420,000,000	447,027,000	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	89,857,750	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	36,742,300	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	173,212,050	
第318回利付国債(10年)	205,000,000	213,564,900	
第319回利付国債(10年)	180,000,000	188,937,000	
第320回利付国債(10年)	100,000,000	104,183,000	
第321回利付国債(10年)	215,000,000	223,896,700	
第322回利付国債(10年)	200,000,000	206,668,000	
第323回利付国債(10年)	45,000,000	46,447,650	
第324回利付国債(10年)	75,000,000	76,762,500	
第325回利付国債(10年)	270,000,000	276,056,100	
第326回利付国債(10年)	30,000,000	30,364,200	
第327回利付国債(10年)	140,000,000	142,913,400	
第328回利付国債(10年)	275,000,000	275,486,750	
第329回利付国債(10年)	210,000,000	213,914,400	
第330回利付国債(10年)	160,000,000	162,828,800	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	239,439,200	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	189,295,380	
第18回利付国債(30年)	50,000,000	56,608,500	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	64,450,100	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	185,215,500	

第26回利付国債(30年)	30,000,000	34,640,700
第27回利付国債(30年)	59,000,000	69,429,430
第28回利付国債(30年)	14,000,000	16,497,740
第29回利付国債(30年)	276,000,000	320,405,640
第30回利付国債(30年)	127,000,000	144,999,710
第31回利付国債(30年)	60,000,000	67,324,800
第32回利付国債(30年)	40,000,000	45,742,800
第33回利付国債(30年)	50,000,000	53,960,500
第34回利付国債(30年)	165,000,000	185,427,000
第35回利付国債(30年)	120,000,000	129,500,400
第36回利付国債(30年)	310,000,000	334,514,800
第37回利付国債(30年)	70,000,000	73,927,000
第38回利付国債(30年)	50,000,000	51,636,500
第39回利付国債(30年)	75,000,000	79,202,250
第40回利付国債(30年)	40,000,000	41,282,800
第29回利付国債(20年)	110,000,000	118,432,600
第31回利付国債(20年)	40,000,000	43,207,600
第33回利付国債(20年)	200,000,000	221,050,000
第34回利付国債(20年)	85,000,000	94,539,550
第37回利付国債(20年)	63,000,000	70,129,080
第39回利付国債(20年)	86,000,000	95,047,200
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,846,530
第42回利付国債(20年)	178,000,000	200,607,780
第43回利付国債(20年)	73,000,000	84,280,690
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,112,460
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,637,390
第48回利付国債(20年)	99,000,000	113,702,490
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,979,650
第50回利付国債(20年)	237,000,000	262,626,810
第51回利付国債(20年)	39,000,000	43,547,400
第54回利付国債(20年)	15,000,000	17,061,750
第55回利付国債(20年)	66,000,000	74,126,580
第57回利付国債(20年)	137,000,000	152,901,590
第58回利付国債(20年)	135,000,000	150,916,500
第59回利付国債(20年)	33,000,000	36,341,250

第60回利付国債(20年)	545,000,000	585,716,950	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	28,019,250	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	34,475,100	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	60,595,020	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	157,430,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	37,890,620	
第67回利付国債(20年)	84,000,000	94,559,640	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	43,931,040	
第70回利付国債(20年)	49,000,000	57,743,070	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	48,253,800	
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,819,220	
第74回利付国債(20年)	78,000,000	89,770,200	
第76回利付国債(20年)	151,000,000	170,608,860	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	353,175,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	181,688,520	
第91回利付国債(20年)	260,000,000	306,027,800	
第92回利付国債(20年)	110,000,000	126,672,700	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	57,533,500	
第95回利付国債(20年)	32,000,000	37,592,640	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	112,602,980	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	52,243,650	
第98回利付国債(20年)	44,000,000	50,508,480	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	134,162,730	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	34,761,000	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	78,242,340	
第102回利付国債(20年)	106,000,000	125,561,240	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,880,780	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	37,748,700	
第105回利付国債(20年)	127,000,000	145,079,720	
第106回利付国債(20年)	122,000,000	141,038,100	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	91,254,400	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	149,052,220	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	118,794,610	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	111,537,720	
第111回利付国債(20年)	90,000,000	103,536,000	

	第113回利付国債(20年)	170,000,000	192,703,500
	第114回利付国債(20年)	52,000,000	58,795,880
	第116回利付国債(20年)	185,000,000	211,603,000
	第117回利付国債(20年)	30,000,000	33,877,800
	第118回利付国債(20年)	70,000,000	77,864,500
	第119回利付国債(20年)	50,000,000	54,118,000
	第120回利付国債(20年)	70,000,000	73,674,300
	第121回利付国債(20年)	22,000,000	24,075,700
	第122回利付国債(20年)	80,000,000	86,308,800
	第123回利付国債(20年)	55,000,000	61,678,100
	第124回利付国債(20年)	50,000,000	55,326,000
	第125回利付国債(20年)	50,000,000	56,735,500
	第126回利付国債(20年)	25,000,000	27,576,250
	第128回利付国債(20年)	35,000,000	37,982,350
	第129回利付国債(20年)	115,000,000	122,976,400
	第130回利付国債(20年)	80,000,000	85,365,600
	第131回利付国債(20年)	25,000,000	26,259,250
	第132回利付国債(20年)	90,000,000	94,310,100
	第133回利付国債(20年)	30,000,000	31,918,500
	第134回利付国債(20年)	30,000,000	31,845,600
	第135回利付国債(20年)	30,000,000	31,360,200
	第136回利付国債(20年)	210,000,000	216,134,100
	第137回利付国債(20年)	140,000,000	145,985,000
	第138回利付国債(20年)	50,000,000	50,514,500
	第140回利付国債(20年)	280,000,000	291,230,800
	第141回利付国債(20年)	215,000,000	223,210,850
	第142回利付国債(20年)	25,000,000	26,368,750
	第143回利付国債(20年)	115,000,000	117,164,300
	第144回利付国債(20年)	40,000,000	40,090,000
	第145回利付国債(20年)	125,000,000	129,180,000
	第146回利付国債(20年)	95,000,000	97,982,050
	国債証券 合計	25,460,000,000	27,143,528,160
地方債証券	第636回東京都公募公債	100,000,000	104,917,000
	第682回東京都公募公債	100,000,000	106,169,000
	第708回東京都公募公債	100,000,000	102,670,000

	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,464,000	
	平成24年度第2回京都府公募公債	200,000,000	205,584,000	
	平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	106,087,000	
	平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	105,566,000	
	平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,134,000	
	平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,363,000	
	平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,003,000	
	平成24年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	101,668,000	
	平成23年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,516,000	
	平成24年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	100,776,000	
	平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	101,961,000	
	第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,429,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,040,000	
	平成24年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	101,770,000	
	第4回京都市公募公債(20年)	100,000,000	118,840,000	
	平成23年度第14回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	104,440,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	105,081,000	
	平成23年度第2回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	103,607,000	
	地方債証券 合計	2,200,000,000	2,316,085,000	
特殊債券	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,885,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,171,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,400,000	
	第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,917,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,907,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,985,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,610,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	101,446,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	101,569,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	101,910,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	101,929,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,473,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	104,847,000	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,915,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,280,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	104,263,000	

	第 8 回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	203,422,000	
	第 5 回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	203,150,000	
	い第 7 1 4 号農林債	100,000,000	100,754,000	
	い第 7 2 2 号農林債	100,000,000	100,607,000	
	い第 7 4 5 号農林債	100,000,000	100,358,000	
	第 2 6 7 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,755,000	
特殊債券 合計		2,400,000,000	2,476,553,000	
社債券	第 3 2 4 回東京交通債券	100,000,000	110,170,000	
	第 5 回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	101,201,000	
	第 6 回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	101,525,000	
	第 8 回帝人株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,425,000	
	第 2 8 回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,095,000	
	第 3 2 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	102,759,000	
	第 1 2 回武田薬品工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,571,000	
	第 2 回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,696,000	
	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	100,523,000	
	第 1 5 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	102,693,000	
	第 1 5 回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,028,000	
	第 1 1 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	102,508,000	
	第 1 8 回株式会社ニコン無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,606,000	
	第 2 6 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	105,002,000	
	第 6 5 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	105,011,000	
	第 1 6 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	108,803,000	
	第 2 5 回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	112,249,000	

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	102,385,000	
第523回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	95,792,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	109,377,000	
第257回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,304,000	
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,925,000	
社債券 合計	2,200,000,000	2,278,648,000	
合計	32,260,000,000	34,214,814,160	

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。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	860,739,435	285,318,523
コール・ローン	322,247,687	96,159,517
国債証券	221,310,863,018	219,287,892,695
派生商品評価勘定	1,793,931	1,283,738
未収入金	1,966,816,289	2,765,670,244
未収利息	2,881,732,327	2,862,780,547
前払費用	75,983,345	72,711,311
流動資産合計	227,420,176,032	225,371,816,575
資産合計	227,420,176,032	225,371,816,575
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	95,600	2,961,258
未払金	1,971,515,582	2,314,600,113
未払解約金	526,259,541	277,247,296
流動負債合計	2,497,870,723	2,594,808,667
負債合計	2,497,870,723	2,594,808,667
純資産の部		
元本等		
元本	148,279,610,523	116,345,973,411

平成24年11月 6日現在

平成25年11月 6日現在

剰余金	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
剰余金又は欠損金()	76,642,694,786	106,431,034,497
元本等合計	224,922,305,309	222,777,007,908
純資産合計	224,922,305,309	222,777,007,908
負債純資産合計	227,420,176,032	225,371,816,575

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
1. 期首	平成23年11月 8日	平成24年11月 7日
期首元本額	323,217,716,090円	148,279,610,523円
期首からの追加設定元本額	1,567,028,133円	2,772,383,801円
期首からの一部解約元本額	176,505,133,700円	34,706,020,913円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	10,234,301,415円	10,205,661,248円
DCインデックスバランス(株式20)	60,145,982円	56,597,935円
DCインデックスバランス(株式40)	106,307,320円	107,928,273円
DCインデックスバランス(株式60)	130,268,089円	137,934,008円
DCインデックスバランス(株式80)	106,148,931円	123,944,252円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	40,478,376,343円	35,926,482,795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	5,949,204,827円	4,874,615,227円
日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	74,208,410,714円	50,499,604,192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	46,355,094円	42,551,474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）	1,357,843,576円	1,254,566,473円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	8,880,873円	22,001,531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）	70,238,120円	30,677,238円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,987,878円	5,173,164円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	6,894,436円	5,037,923円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	17,025,128円	12,039,475円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	43,099,350円	30,379,477円
世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,091,320,470円	903,337,358円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,929,505,788円	1,669,941,958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）	133,108,111円	95,668,549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）	186,693,392円	152,197,488円
3資産バランスファンド（適格機関投資家向け）	17,680,881円	- 円
グローバルバランスファンド35（適格機関投資家向け）	53,421,274円	50,784,130円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	55,647,610円	52,296,099円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	74,372,569円	74,470,138円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	63,885,689円	69,230,600円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	47,204,663円	53,117,165円
年金積立 インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）	11,571,522,574円	9,666,500,092円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	225,759,426円	223,235,149円
計	148,279,610,523円	116,345,973,411円
2. 受益権の総数	148,279,610,523口	116,345,973,411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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成23年11月 8日 至 平成24年11月 6日	自 平成24年11月 7日 至 平成25年11月 6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管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月 6日現在	平成25年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成24年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	905,578,592
合計	905,578,592

(平成25年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	659,289,679
合計	659,289,679

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(平成24年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	728,693,721	-	726,995,390	1,698,331
	米ドル	80,189,100	-	80,210,000	20,900
	加ドル	97,445,900	-	97,485,500	39,600
	ユーロ	535,167,100	-	533,416,000	1,751,100
	ノルウェークローネ	15,891,621	-	15,883,890	7,731
合計		728,693,721	-	726,995,390	1,698,331

(平成25年11月 6日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	422,337,131	-	422,774,930	437,799
	加ドル	75,302,000	-	75,448,000	146,000
	メキシコペソ	10,816,670	-	10,755,640	61,030
	英ポンド	228,557,142	-	229,691,880	1,134,738
	スウェーデンクローナ	9,871,019	-	9,851,720	19,299
	ノルウェークローネ	5,461,301	-	5,444,950	16,351
	デンマーククローネ	28,004,793	-	27,910,400	94,393
	ポーランドズロチ	37,540,621	-	37,377,940	162,681
	南アフリカランド	26,783,585	-	26,294,400	489,185

	売建	818,342,581	-	820,457,900	2,115,319
	米ドル	776,471,150	-	778,466,000	1,994,850
	シンガポールドル	41,871,431	-	41,991,900	120,469
	合計	1,240,679,712	-	1,243,232,830	1,677,520

(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24年11月 6日現在		平成25年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.5169円	1口当たり純資産額	1.9148円
(1万口当たり純資産額)	(15,169円)	(1万口当たり純資産額)	(19,148円)

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-2.375%-14/10/31	8,500,000.00	8,685,937.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	27,700,000.00	28,857,773.43	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000.00	10,923,195.31	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	25,500,000.00	26,217,187.50	

US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	14,700,000.00	15,075,539.06
US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000.00	3,421,406.25
US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	32,700,000.00	34,281,351.56
US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	2,300,000.00	2,365,406.25
US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	13,000,000.00	13,413,359.37
US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	26,000,000.00	26,879,531.25
US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000.00	24,473,367.18
US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	9,500,000.00	9,779,804.68
US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	22,200,000.00	23,769,609.37
US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	22,200,000.00	24,083,531.25
US TREASURY N/B-2.125%-15/12/31	4,300,000.00	4,464,273.43
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	22,500,000.00	24,605,859.37
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	23,700,000.00	26,488,453.12
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000.00	10,537,031.25
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	16,500,000.00	17,678,203.12
US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	10,000,000.00	10,725,000.00
US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	4,200,000.00	4,510,078.12
US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	8,000,000.00	8,958,125.00
US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	4,000,000.00	4,273,125.00
US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	5,200,000.00	5,562,375.00
US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	6,900,000.00	7,409,414.06
US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	6,000,000.00	6,715,781.25
US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	9,700,000.00	11,695,320.31
US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,000,000.00	1,063,281.25
US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	8,700,000.00	9,394,640.62
US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	9,000,000.00	9,688,359.37
US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	9,250,000.00	10,410,585.93
US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000.00	5,795,296.87
US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	8,800,000.00	9,518,437.50
US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000.00	7,549,609.37
US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	12,500,000.00	14,086,914.06
US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000.00	10,201,250.00
US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	8,800,000.00	9,384,375.00
US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	4,000,000.00	4,229,687.50
US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	18,700,000.00	21,355,984.37
US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	17,900,000.00	20,165,468.75
US TREASURY N/B-2.75%-17/12/31	18,000,000.00	19,216,406.24
US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	15,700,000.00	17,244,242.18
US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	7,550,000.00	8,438,304.68
US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,400,000.00	19,604,906.25
US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	15,200,000.00	16,946,812.50
US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000.00	6,895,703.12

		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	5,600,000.00	5,960,500.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	4,400,000.00	4,767,125.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	3,000,000.00	3,326,015.62	
		US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000.00	12,245,625.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	13,800,000.00	15,125,015.62	
		US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	16,300,000.00	18,081,539.06	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	8,000,000.00	8,806,250.00	
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000.00	11,426,882.81	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000.00	2,083,750.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	2,500,000.00	2,597,070.31	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	17,800,000.00	19,646,750.00	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000.00	17,100,937.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	9,300,000.00	8,842,265.62	
		US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	8,500,000.00	7,856,523.43	
		US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	5,500,000.00	5,421,796.87	
		US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000.00	3,713,976.56	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	3,100,000.00	4,157,875.00	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	3,800,000.00	5,237,468.75	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	3,500,000.00	4,430,507.81	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	2,900,000.00	3,555,898.43	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	3,500,000.00	3,929,570.31	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	3,900,000.00	4,459,710.93	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	6,300,000.00	6,931,968.75	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	8,000,000.00	9,148,750.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	7,000,000.00	7,852,031.25	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	8,800,000.00	10,243,750.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	9,600,000.00	10,758,000.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	4,900,000.00	5,053,125.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	8,200,000.00	8,997,578.12	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,600,000.00	1,898,500.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	7,200,000.00	8,059,500.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	5,600,000.00	5,632,375.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,000,000.00	1,769,375.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	9,000,000.00	7,538,203.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	6,200,000.00	6,051,781.25	
		米ドル合計	802,450,000.00	879,748,296.67 (86,699,194,636)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	2,200,000.00	2,222,924.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/02/01	3,900,000.00	3,898,323.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,100,000.00	2,146,305.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	4,650,000.00	4,896,496.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-15/11/01	1,100,000.00	1,097,415.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,350,000.00	2,438,712.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	4,900,000.00	5,245,646.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-16/06/01	1,200,000.00	1,224,132.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	5,100,000.00	5,547,831.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/03/01	2,500,000.00	2,453,150.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	2,220,000.00	2,464,777.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-18/09/01	650,000.00	633,425.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	2,600,000.00	2,847,078.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	2,070,000.00	2,247,295.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,650,000.00	1,765,434.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	1,850,000.00	1,897,637.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	2,000,000.00	1,825,800.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	420,000.00	414,678.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	700,000.00	1,114,610.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	1,700,000.00	2,309,331.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	1,950,000.00	2,735,382.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	2,300,000.00	3,043,084.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	2,460,000.00	2,868,975.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	2,150,000.00	2,320,473.50	
加ドル合計			54,720,000.00	59,658,916.30	(5,627,028,985)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	30,300,000.00	32,245,562.69	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-15/12/17	32,100,000.00	34,738,965.07	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.25%- 16/06/16	3,700,000.00	3,882,451.77	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%- 16/12/15	27,400,000.00	29,617,950.81	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 17/12/14	18,500,000.00	20,457,666.85	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	34,800,000.00	39,441,911.10	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	4,000,000.00	4,551,242.32	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	37,300,000.00	48,931,003.49	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	4,000,000.00	4,344,197.28	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	28,700,000.00	33,079,592.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	6,100,000.00	6,488,178.92	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	11,900,000.00	15,399,087.06	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	21,300,000.00	24,045,560.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	5,200,000.00	5,428,509.16	
メキシコペソ合計			265,300,000.00	302,651,878.88	(2,269,889,091)

ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	1,150,000.00	1,201,646.61
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	1,800,000.00	1,992,534.66
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	1,720,000.00	1,831,679.77
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000.00	1,582,024.65
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	2,840,000.00	3,057,412.22
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	2,430,000.00	2,692,926.72
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	250,000.00	273,561.45
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	2,400,000.00	2,820,762.96
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	3,130,000.00	3,526,772.88
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	2,050,000.00	2,331,221.87
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	2,900,000.00	3,271,910.79
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	2,270,000.00	2,637,327.31
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	2,050,000.00	2,337,044.48
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-22/09/28	1,500,000.00	1,735,273.80
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,450,000.00	1,698,284.08
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	2,940,000.00	3,793,597.24
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	850,000.00	933,421.04
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	3,420,000.00	4,266,896.99
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	2,230,000.00	2,530,687.84
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	850,000.00	874,213.95
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	4,800,000.00	4,916,520.00
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	5,200,000.00	5,418,212.28
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000.00	1,333,046.00
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-15/07/30	4,620,000.00	4,821,661.15
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	6,000,000.00	6,188,932.20
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-16/04/30	4,700,000.00	4,865,555.62
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-16/10/31	4,700,000.00	4,998,774.77
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	2,550,000.00	2,682,280.23
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	3,750,000.00	4,168,216.87
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,900,000.00	2,047,707.71
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	3,700,000.00	3,939,303.79
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	3,200,000.00	3,459,493.12
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	3,000,000.00	3,190,099.80		
	3,000,000.00	3,118,835.70		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.85%- 20/10/31	2,800,000.00	3,039,001.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	3,800,000.00	4,275,123.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	1,100,000.00	1,255,510.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	2,000,000.00	2,208,014.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%- 23/10/31	1,250,000.00	1,279,582.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	3,100,000.00	3,267,595.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,500,000.00	1,546,426.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,700,000.00	1,947,241.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	3,550,000.00	4,073,596.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	3,070,000.00	3,447,061.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	2,900,000.00	2,600,378.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	2,300,000.00	2,276,594.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	2,100,000.00	2,012,820.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	400,000.00	406,455.60	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-15/02/27	4,500,000.00	4,639,489.65	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-15/04/10	8,000,000.00	8,240,286.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 15/01/04	4,700,000.00	4,898,167.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 15/07/04	5,000,000.00	5,256,112.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 16/01/04	3,850,000.00	4,127,245.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%- 16/06/20	8,200,000.00	9,423,688.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 16/07/04	5,760,000.00	6,332,279.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 17/01/04	5,750,000.00	6,373,025.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 17/07/04	6,650,000.00	7,581,368.41	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 18/01/04	6,900,000.00	7,899,092.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 18/07/04	5,600,000.00	6,537,997.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%- 19/01/04	2,300,000.00	2,652,629.10	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%- 19/07/04	4,200,000.00	4,819,330.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 20/01/04	4,300,000.00	4,893,888.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	5,900,000.00	6,640,325.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 21/07/04	9,050,000.00	10,364,252.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	200,000.00	213,916.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 22/01/04	2,000,000.00	2,093,470.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%- 22/07/04	300,000.00	306,165.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/02/15	500,000.00	493,790.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 23/05/15	1,000,000.00	982,348.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	1,950,000.00	2,767,006.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	1,800,000.00	2,718,459.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	2,200,000.00	3,097,850.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	2,130,000.00	2,777,953.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	1,840,000.00	2,783,961.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	2,650,000.00	3,768,513.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	4,900,000.00	6,597,075.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	3,900,000.00	4,820,791.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	3,550,000.00	4,614,591.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	3,600,000.00	5,048,307.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	1,500,000.00	1,684,718.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,450,000.00	1,403,877.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 15/02/01	8,100,000.00	8,429,589.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/04/15	1,000,000.00	1,026,829.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/06/15	1,600,000.00	1,644,125.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 15/07/15	2,450,000.00	2,579,222.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 15/08/01	11,100,000.00	11,555,680.53	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 15/11/01	700,000.00	721,742.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/04/15	4,000,000.00	4,198,001.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 16/08/01	9,000,000.00	9,457,258.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 17/02/01	8,600,000.00	9,091,518.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 17/08/01	8,000,000.00	8,800,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/02/01	4,200,000.00	4,522,027.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 18/06/01	1,000,000.00	1,034,178.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 18/08/01	4,200,000.00	4,528,342.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/02/01	4,300,000.00	4,572,981.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 19/03/01	4,350,000.00	4,672,698.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 19/09/01	4,790,000.00	5,085,257.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 20/02/01	4,100,000.00	4,383,198.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%- 20/03/01	3,300,000.00	3,481,131.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	4,650,000.00	4,846,640.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	5,100,000.00	5,191,369.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 21/09/01	5,400,000.00	5,817,614.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	2,400,000.00	2,613,714.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/09/01	1,000,000.00	1,118,751.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	500,000.00	558,962.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	500,000.00	520,965.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	1,000,000.00	1,068,354.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	5,410,000.00	7,589,237.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,000,000.00	1,030,547.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	3,400,000.00	3,638,443.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	3,800,000.00	4,880,702.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	5,600,000.00	6,774,270.72	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	4,700,000.00	5,053,723.88
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	5,700,000.00	6,594,519.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	4,650,000.00	5,255,381.17
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	2,300,000.00	2,391,634.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	3,200,000.00	2,908,799.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	4,500,000.00	4,607,847.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	3,200,000.00	3,257,545.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	1,000,000.00	977,251.00
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	860,000.00	917,952.04
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,080,000.00	1,119,015.21
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	1,420,000.00	1,592,593.04
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	1,150,000.00	1,354,875.83
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	1,470,000.00	1,655,571.77
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,050,000.00	1,191,178.48
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	100,000.00	96,034.95
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	1,780,000.00	2,096,518.53
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	400,000.00	410,675.68
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	440,000.00	426,628.13
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	6,150,000.00	6,443,573.94
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	6,760,000.00	7,119,609.01
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	10,300,000.00	11,024,132.23
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	6,710,000.00	7,602,570.23
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	8,900,000.00	9,851,475.86
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	6,250,000.00	7,100,283.75
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	5,650,000.00	6,419,084.21
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-18/05/25	4,600,000.00	4,611,432.84
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	2,300,000.00	2,657,652.07
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	7,700,000.00	8,954,199.87
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	1,050,000.00	1,483,431.60
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	4,700,000.00	5,357,645.62
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	6,400,000.00	7,218,213.12
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	2,300,000.00	2,443,537.25
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	8,070,000.00	9,237,485.28
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	5,500,000.00	6,087,040.85
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	4,350,000.00	4,706,191.92
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-22/10/25	900,000.00	912,024.45
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	4,000,000.00	6,174,511.20

FRANCE (GOVT OF)-1.75%-23/05/25	1,400,000.00	1,343,818.70
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	4,150,000.00	4,865,956.75
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	3,800,000.00	5,143,090.24
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	4,600,000.00	5,006,900.82
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	1,000,000.00	993,047.10
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	3,070,000.00	4,064,947.09
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	4,200,000.00	5,835,005.82
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	3,650,000.00	4,557,605.35
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	3,250,000.00	3,663,429.90
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	5,090,000.00	6,194,437.87
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	2,500,000.00	2,811,597.50
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,550,000.00	1,748,801.76
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	1,200,000.00	1,232,721.48
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	2,100,000.00	2,161,395.60
FRENCH TREASURY NOTE-2.25%-16/02/25	2,100,000.00	2,190,956.67
IRISH TREASURY-4.5%-15/02/18	520,000.00	547,395.68
IRISH TREASURY-4.6%-16/04/18	1,570,000.00	1,697,497.03
IRISH TREASURY-5.5%-17/10/18	950,000.00	1,071,123.10
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	1,500,000.00	1,642,165.50
IRISH TREASURY-4.4%-19/06/18	1,150,000.00	1,248,400.90
IRISH TREASURY-5.9%-19/10/18	1,000,000.00	1,159,622.00
IRISH TREASURY-4.5%-20/04/18	1,900,000.00	2,047,390.60
IRISH TREASURY-5.0%-20/10/18	1,300,000.00	1,438,618.61
IRISH TREASURY-3.9%-23/03/20	780,000.00	801,738.60
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	1,770,000.00	2,000,556.30
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	4,400,000.00	4,535,164.04
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	3,600,000.00	3,783,634.92
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	4,100,000.00	4,494,038.29
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	4,750,000.00	5,412,351.87
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-18/01/15	220,000.00	223,999.16
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	3,420,000.00	3,900,340.71
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	2,600,000.00	3,003,080.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	2,550,000.00	2,886,755.29
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	2,100,000.00	2,339,518.02
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	500,000.00	514,546.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	2,400,000.00	2,761,214.16
NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	1,500,000.00	2,197,164.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	2,070,000.00	2,804,710.06
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	500,000.00	482,575.65
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	2,930,000.00	3,544,155.24
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,780,000.00	3,296,940.72
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	2,250,000.00	2,374,285.95

		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	1,870,000.00	2,060,363.38
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	1,650,000.00	1,792,196.67
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	1,550,000.00	1,761,966.84
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	1,520,000.00	1,761,210.01
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	300,000.00	302,095.41
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	2,400,000.00	2,803,900.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.95%-19/06/18	220,000.00	229,467.96
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	1,980,000.00	2,290,101.85
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	2,210,000.00	2,504,332.66
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	1,100,000.00	1,255,604.13
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	1,400,000.00	1,569,606.78
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	280,000.00	271,271.53
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	1,200,000.00	1,515,837.48
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	1,200,000.00	1,722,179.52
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	1,910,000.00	2,326,758.18
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	650,000.00	680,571.58
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	580,000.00	706,770.25
ユーロ合計			636,780,000.00	713,347,868.53 (94,725,463,462)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.75%-15/01/22	1,200,000.00	1,233,402.12
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	2,730,000.00	2,943,747.26
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	4,900,000.00	5,665,535.33
		UK TREASURY-2.0%-16/01/22	400,000.00	411,920.00
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	6,740,000.00	7,349,695.68
		UK TREASURY-1.75%-17/01/22	2,200,000.00	2,254,005.82
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	4,100,000.00	5,252,709.67
		UK TREASURY-1.0%-17/09/07	1,000,000.00	991,900.00
		UK TREASURY-5.0%-18/03/07	3,250,000.00	3,747,536.32
		UK TREASURY-1.25%-18/07/22	2,000,000.00	1,973,510.60
		UK TREASURY-4.5%-19/03/07	3,650,000.00	4,172,324.85
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	2,150,000.00	2,378,852.66
		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	4,750,000.00	5,545,587.95
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	1,600,000.00	1,771,429.28
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	3,450,000.00	4,833,925.41
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	2,300,000.00	2,537,345.05
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	3,000,000.00	3,362,464.80
		UK TREASURY-1.75%-22/09/07	500,000.00	468,180.00
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	900,000.00	863,546.85
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	2,590,000.00	3,127,338.49
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	1,950,000.00	2,204,040.73
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	1,710,000.00	2,301,160.68
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	2,500,000.00	2,991,031.75

		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	3,150,000.00	3,557,657.25	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	4,050,000.00	4,721,531.71	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	1,900,000.00	2,146,599.28	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,550,000.00	1,890,590.49	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	1,950,000.00	2,207,662.66	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	3,650,000.00	4,132,189.09	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	3,150,000.00	3,725,697.78	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,220,000.00	1,150,275.90	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	3,450,000.00	3,936,936.45	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	3,100,000.00	3,566,917.66	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	500,000.00	523,712.30	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	4,920,000.00	5,742,918.70	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000.00	1,900,665.62	
英ポンド合計			93,860,000.00	107,584,546.19	(17,019,875,207)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	1,610,000.00	1,705,473.00	
		SWITZERLAND-4.25%-17/06/05	1,780,000.00	2,044,862.22	
		SWITZERLAND-2.25%-20/07/06	400,000.00	443,519.60	
		SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	2,740,000.00	3,477,065.48	
スイスフラン合計			6,530,000.00	7,670,920.30	(827,538,881)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	10,180,000.00	10,791,461.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	8,500,000.00	8,885,976.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	10,700,000.00	11,577,624.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	13,000,000.00	14,634,958.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	8,300,000.00	9,912,275.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	11,000,000.00	12,100,539.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	3,850,000.00	3,557,107.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	9,200,000.00	9,927,582.00	
スウェーデンクローナ合計			74,730,000.00	81,387,524.30	(1,230,579,367)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	11,750,000.00	12,342,200.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	8,950,000.00	9,642,783.70	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	8,250,000.00	9,197,083.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	8,950,000.00	9,669,580.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	4,900,000.00	4,578,074.90	
ノルウェークローネ合計			42,800,000.00	45,429,722.10	(747,773,225)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	16,500,000.00	17,792,824.50	
		KINGDOM OF DENMARK-2.5%-16/11/15	600,000.00	639,522.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	15,500,000.00	17,634,396.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	27,000,000.00	31,714,173.00	

		KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	500,000.00	557,826.50
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	5,900,000.00	5,750,954.20
		KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	5,350,000.00	8,144,540.40
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	18,050,000.00	24,632,871.10
デンマーククローネ合計			89,400,000.00	106,867,108.20 (1,902,234,525)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	5,750,000.00	5,974,825.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	4,500,000.00	4,787,100.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	6,000,000.00	6,271,800.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-16/10/25	2,800,000.00	2,924,040.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-17/04/25	2,100,000.00	2,196,390.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	9,200,000.00	9,807,200.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-18/04/25	900,000.00	907,290.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-18/07/25	1,900,000.00	1,808,705.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	5,000,000.00	5,438,000.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	4,000,000.00	4,295,000.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-21/10/25	3,200,000.00	3,537,440.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	4,300,000.00	4,768,915.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,700,000.00	1,657,330.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	1,950,000.00	2,200,380.00
ポーランドズロチ合計			53,300,000.00	56,574,415.00 (1,795,671,932)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	3,080,000.00	3,235,829.52
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-15/10/21	1,240,000.00	1,286,001.52
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	2,950,000.00	3,082,331.10
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	3,720,000.00	4,052,300.16
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-17/07/21	1,400,000.00	1,449,980.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	2,600,000.00	2,820,812.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	2,670,000.00	2,896,402.65
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	2,850,000.00	2,977,908.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	2,630,000.00	2,950,173.57
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	2,550,000.00	2,876,774.85
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	2,810,000.00	3,127,476.61
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	1,900,000.00	1,677,624.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	911,714.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,420,000.00	1,473,275.56
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,050,000.00	900,681.60		
豪ドル合計			33,870,000.00	35,719,285.94 (3,344,753,935)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	1,570,000.00	1,636,097.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.125%-16/04/01	500,000.00	509,450.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	900,000.00	985,140.00

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	670,000.00	712,645.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-18/04/01	100,000.00	99,160.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	770,000.00	880,995.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	700,000.00	744,695.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	1,150,000.00	1,256,835.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	580,000.00	627,386.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	800,000.00	840,880.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	760,000.00	824,448.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	500,000.00	495,275.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	130,000.00	137,171.58	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	580,000.00	555,379.00	
シンガポールドル合計			9,710,000.00	10,305,557.58	(816,612,382)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	2,200,000.00	2,220,980.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	1,650,000.00	1,673,582.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	850,000.00	877,126.88	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.197%-15/10/15	1,000,000.00	1,003,444.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.172%-16/07/15	1,400,000.00	1,400,596.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	3,400,000.00	3,503,120.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	1,900,000.00	1,930,108.46	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	3,400,000.00	3,477,775.13	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	4,100,000.00	4,248,075.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	2,300,000.00	2,561,037.18	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	3,800,000.00	3,961,343.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	3,000,000.00	3,096,196.62	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.418%-22/08/15	450,000.00	441,520.24	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	1,150,000.00	1,134,133.45	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,500,000.00	2,604,651.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	450,000.00	442,883.34	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,300,000.00	1,234,426.73	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	750,000.00	844,344.80	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.127%-32/04/15	950,000.00	949,849.90			
マレーシアアリンギット合計			36,550,000.00	37,605,196.32	(1,162,376,618)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-14/12/21	2,600,000.00	2,704,948.22	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-17/09/15	14,500,000.00	15,231,259.65	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-18/12/21	10,000,000.00	10,426,256.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.25%-20/01/15	15,000,000.00	14,943,414.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.75%-21/03/31	10,000,000.00	9,584,845.00	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	28,300,000.00	33,640,974.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	6,850,000.00	5,774,624.66	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	8,600,000.00	6,369,979.58	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	2,800,000.00	2,645,266.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	12,700,000.00	9,389,918.99	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	6,000,000.00	5,719,361.40	
南アフリカランド合計		117,350,000.00	116,430,848.00 (1,118,900,449)	
合計			219,287,892,695 (219,287,892,695)	

(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 81銘柄	100.0%	39.5%
加ドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.6%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 208銘柄	100.0%	43.2%
英ポンド	国債証券 36銘柄	100.0%	7.8%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
豪ドル	国債証券 15銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 19銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2013年11月29日現在です。

【DCインデックスバランス(株式60)】

【純資産額計算書】

資産総額	2,749,384,945円
負債総額	20,609,638円
純資産総額(-)	2,728,775,307円
発行済口数	1,656,382,919口
1口当たり純資産額(/)	1.6474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	28,561,268,429円
負債総額	125,870,623円
純資産総額(-)	28,435,397,806円
発行済口数	27,774,348,379口
1口当たり純資産額(/)	1.0238円

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	80,992,922,839円
負債総額	688,558,368円
純資産総額(-)	80,304,364,471円
発行済口数	51,387,718,854口
1口当たり純資産額(/)	1.5627円

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	34,491,633,049円
負債総額	135,006,662円
純資産総額（ - ）	34,356,626,387円
発行済口数	26,721,015,255口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2858円

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	228,817,135,593円
負債総額	946,688,186円
純資産総額（ - ）	227,870,447,407円
発行済口数	113,659,925,981口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0048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25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（平成25年11月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、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

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後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。

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成25年11月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成25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	464	95,929
株式投資信託	404	73,974
単体型	45	935
追加型	359	73,038
公社債投資信託	60	21,955
単体型	44	445
追加型	16	21,509
投資法人合計	1	84

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
 なお、当社の監査法人は次のとおり、交代しております。
 第53期事業年度 あらた監査法人
 第54期事業年度 有限責任 あずさ監査法人

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第53期 (平成24年3月31日)		第54期 (平成25年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,352	3	15,820
前払費用		332	3	380
未収入金		1		4
未収委託者報酬		5,872		7,472
未収収益	3	543	3	342
関係会社短期貸付金		33		606
立替金		1,094		335
繰延税金資産		1,084		869
その他	2	30	2	30
流動資産合計		26,345		25,862
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	66	1	48
器具備品	1	137	1	124
有形固定資産合計		203		172
無形固定資産				
ソフトウェア		72		70
無形固定資産合計		72		70
投資その他の資産				

投資有価証券	3,002	7,170
関係会社株式	24,320	22,935
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	774	706
繰延税金資産	723	500
投資その他の資産合計	28,880	31,373
固定資産合計	29,156	31,616
資産合計	55,502	57,478

(単位：百万円)

	第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	194	305
未払金	3,086	3,862
未払収益分配金	7	6
未払償還金	129	115
未払手数料	3 2,486	3 3,195
その他未払金	462	545
未払費用	3 2,807	3 3,282
未払法人税等	1,295	589
未払消費税等	4 281	4 123
賞与引当金	2,039	1,770
役員賞与引当金	105	80
流動負債合計	9,809	10,012
固定負債		
退職給付引当金	907	1,001
その他	55	55
固定負債合計	963	1,057
負債合計	10,773	11,070
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
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	22,172	23,530
利益剰余金合計	22,172	23,530
自己株式	68	68
株主資本合計	44,687	46,045
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	42	362
評価・換算差額等合計	42	362

純資産合計	44,729	46,408
負債純資産合計	55,502	57,478

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	56,698	52,848
その他営業収益	2,025	1,922
営業収益合計	58,724	54,771
営業費用		
支払手数料	29,251	26,955
広告宣伝費	673	649
公告費	3	7
調査費	11,397	10,797
調査費	719	691
委託調査費	10,660	10,089
図書費	18	17
委託計算費	348	406
営業雑経費	577	530
通信費	206	188
印刷費	247	214
協会費	43	46
諸会費	9	16
その他	70	64
営業費用計	42,252	39,347
一般管理費		
給料	6,991	6,759
役員報酬	237	256
役員賞与引当金繰入額	105	80
給料・手当	4,508	4,565
賞与	101	87
賞与引当金繰入額	2,039	1,770
交際費	74	100
寄付金	111	66
旅費交通費	328	313
租税公課	145	188
不動産賃借料	749	753
退職給付費用	307	312
退職金	8	83
固定資産減価償却費	143	124
諸経費	3,110	3,061
一般管理費計	11,971	11,764
営業利益	4,500	3,659

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		

受取利息		15		12
受取配当金	1	757	1	601
有価証券償還益		19		-
時効成立分配金・償還金		35		4
為替差益		-		64
その他		18		16
営業外収益合計		846		699
営業外費用				
支払利息		10		19
有価証券償還損		-		1
時効成立後支払分配金・償還金		77		15
支払源泉所得税		74		55
為替差損		35		-
弁護士報酬等		180		-
その他		4		2
営業外費用合計		381		93
経常利益		4,965		4,265
特別利益				
投資有価証券売却益		1		226
関係会社株式売却益		-		239
特別利益合計		1		465
特別損失				
投資有価証券売却損		0		84
固定資産処分損		6		3
役員退職一時金		369		75
特別損失合計		376		163
税引前当期純利益		4,590		4,568
法人税、住民税及び事業税		1,795		1,480
法人税等調整額		224		260
法人税等合計		2,020		1,740
当期純利益		2,570		2,827

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日)	第54期 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月 31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	-
当期変動額		

自己株式の処分	4	-
当期変動額合計	4	-
当期末残高	-	-
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,220
当期変動額		
自己株式の処分	4	-
当期変動額合計	4	-
当期末残高	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	21,703	22,172
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の処分	599	-
当期変動額合計	468	1,358
当期末残高	22,172	23,530
利益剰余金合計		
当期首残高	21,703	22,172
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の処分	599	-
当期変動額合計	468	1,358
当期末残高	22,172	23,530

(単位：百万円)

	第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月 31日)
自己株式		
当期首残高	68	68
当期変動額		
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,700	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	68	68
株主資本合計		
当期首残高	44,224	44,687
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
自己株式の取得	8,700	-
自己株式の処分	8,095	-
当期変動額合計	463	1,358
当期末残高	44,687	46,045
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	42
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	21	320
当期末残高	42	362
評価・換算差額等合計		
当期首残高	63	42
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	21	320
当期末残高	42	362
純資産合計		
当期首残高	44,287	44,729
当期変動額		
剰余金の配当	1,502	1,468
当期純利益	2,570	2,827
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期変動額 (純額)	21	320
当期変動額合計	441	1,678
当期末残高	44,729	46,408

重要な会計方針

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>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 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</p> <p>定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 4年～5年 器具備品 4年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p>

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>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。</p> <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>
---------------------------	--

会計方針の変更

<p>第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)</p>
<p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。</p>

未適用の会計基準等

1. 「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）
- (1) 概要
当該会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、主に 未認識数理計算上の差異及び未認識過去勤務費用の処理方法を変更し、開示項目を拡充するほか、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を改正するものであります。
- (2) 適用予定日
当社は については、平成25年4月1日に開始する事業年度の年度末に係る財務諸表から適用し、については、平成26年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。
- (3) 当該会計基準等の適用による影響
当該会計基準等の適用による影響は、現在評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)								
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,012百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">590百万円</td> </tr> </table>	建物	1,012百万円	器具備品	590百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,054百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">618百万円</td> </tr> </table>	建物	1,054百万円	器具備品	618百万円
建物	1,012百万円								
器具備品	590百万円								
建物	1,054百万円								
器具備品	618百万円								
<p>2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>								

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 5,802百万円</p> <p>未収収益 217百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 42百万円</p> <p>未払費用 259百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務110百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソンタワー アソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,818百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 58百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 143百万円</p> <p>未払費用 297百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務87百万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243百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

(損益計算書関係)

第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 743百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 552百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第53期（自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	19,328,100	-	112,200	19,215,900	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,702,800	-	26,400	1,676,400	-

平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	-	2,955,200	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	6,101,700	9,900	6,091,800	-
合計		23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)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。第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成23年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであり、減少は新株予約権の失効によるものであります。
- 4 平成21年度ストックオプション(1)9,837,300株、平成21年度ストックオプション(2)871,200株、平成22年度ストックオプション(1)1,155,000株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

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

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

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高 (百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-

平成21年度 ストックオプション（2）	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度 ストックオプション（1）	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション（1）	普通株式	6,091,800	-	161,700	5,930,100	-
合計		32,249,300	-	2,448,600	29,800,700	-

- (注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
- 2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)13,625,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当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25年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

(リース取引関係)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	740百万円	1年内	750百万円
1年超	1,548百万円	1年超	807百万円
合計	2,288百万円	合計	1,558百万円

(金融商品関係)

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等によ

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	17,352	17,352	-
(2) 未収委託者報酬	5,872	5,872	-
(3) 未収収益	543	543	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	2,854	2,854	-
(5) 関係会社株式 関連会社株式	1,404	1,615	210
(6) 未払金	(3,086)	(3,086)	-
(7) 未払費用	(2,807)	(2,807)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,023百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,352	-	-	-
未収委託者報酬	5,872	-	-	-
未収収益	543	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	362	479	439
合計	23,768	362	479	439

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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、バリュエーション・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25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	15,820	15,820	-
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	-
(3) 未収収益	342	342	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	7,091	7,091	-
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	-
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	-

()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、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

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

これらは短期間で決済され、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79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,042百万円）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、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表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	15,820	-	-	-
未収委託者報酬	7,472	-	-	-
未収収益	342	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

(有価証券関係)

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
関連会社株式	1,404	1,615	210
合計	1,404	1,615	210

(注)

時価を把握することが極めて困難と認められる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
子会社株式	20,023
関連会社株式	2,892

これらについては、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「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの	株式	35	7	28
	その他	1,177	999	177
	小計	1,212	1,006	206
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	その他	1,642	1,784	141
	小計	1,642	1,784	141
	合計	2,854	2,790	64

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	112	1	0
合計	112	1	0

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式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、子会社株式及び関連会社株式の時価を記載しておりません。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額は次のとおりです。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

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	その他	6,366	5,708	658
	小計	6,366	5,708	658
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	724	821	96
	小計	724	821	96
合計		7,091	6,529	561

(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 79百万円）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	43	35	67
投資信託	1,099	190	17
合計	1,143	226	84

(持分法損益等)

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 4,407	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,069
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159

（退職給付関係）

第53期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)																																																
<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td>985</td></tr> <tr><td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>985</td></tr> <tr><td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>77</td></tr> <tr><td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>907</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 勤務費用</td><td>97</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>27</td></tr> <tr><td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>168</td></tr> <tr><td>ホ 退職給付費用合計</td><td>307</td></tr> </table> <p>4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <table> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td>1.4%</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	985	ロ 未積立退職給付債務	985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.4%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年	<p>1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバ ランスプラン型退職金制度を設けております。</p> <p>2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 退職給付債務</td><td>1,101</td></tr> <tr><td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>1,101</td></tr> <tr><td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>99</td></tr> <tr><td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>1,001</td></tr> </table> <p>3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円)</p> <table> <tr><td>イ 勤務費用</td><td>102</td></tr> <tr><td>ロ 利息費用</td><td>13</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>24</td></tr> <tr><td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>171</td></tr> <tr><td>ホ 退職給付費用合計</td><td>312</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> <tr><td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr><td>ロ 割引率</td><td>0.9%</td></tr> <tr><td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	1,101	ロ 未積立退職給付債務	1,101	ハ 未認識数理計算上の差異	99	ニ 退職給付引当金残高	1,001	イ 勤務費用	102	ロ 利息費用	13	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171	ホ 退職給付費用合計	312	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	0.9%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	985																																																
ロ 未積立退職給付債務	985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.4%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	1,101																																																
ロ 未積立退職給付債務	1,101																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	99																																																
ニ 退職給付引当金残高	1,001																																																
イ 勤務費用	102																																																
ロ 利息費用	13																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171																																																
ホ 退職給付費用合計	312																																																
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	0.9%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																

（ストックオプション等関係）

第53期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24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)ストックオプション(新株予約権)の内容

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

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,328,100	1,702,800
付与	0	0
失効	112,200	26,400
権利確定	0	0
権利未確定残	19,215,900	1,676,400
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

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

権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円

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

第54期(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) スtock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	19,215,900	1,676,400
付与	0	0
失効	2,237,400	49,500
権利確定	0	0
権利未確定残	16,978,500	1,626,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
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) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

2 ス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

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

(税効果会計関係)

第53期 (平成24年 3 月31日)	第54期 (平成25年 3 月31日)
------------------------	------------------------

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)																																																																						
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">775</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">309</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,084</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">52</td> </tr> <tr> <td>関係会社株式評価損</td> <td style="text-align: right;">205</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">329</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">190</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">28</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">806</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right;">1,890</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">61</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,829</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">22</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">22</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,807</td> </tr> </table> <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">40.6%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">2.5%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">5.6%</td> </tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td> <td style="text-align: right;">3.8%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">2.7%</td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">44.0%</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	775	その他	309	小計	1,084	投資有価証券評価損	52	関係会社株式評価損	205	退職給付引当金超過額	329	固定資産減価償却超過額	190	その他	28	小計	806		1,890	評価性引当金	61	繰延税金資産合計	1,829	その他有価証券評価差額金	22	繰延税金負債合計	22		1,807	法定実効税率 (調整)	40.6%	交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%	海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.0%	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <p>繰延税金資産(流動)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">672</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">196</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">869</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">投資有価証券評価損</td> <td style="text-align: right;">149</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金超過額</td> <td style="text-align: right;">361</td> </tr> <tr> <td>固定資産減価償却超過額</td> <td style="text-align: right;">174</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">75</td> </tr> <tr> <td>小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">760</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産小計</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right;">1,630</td> </tr> <tr> <td>評価性引当金</td> <td style="text-align: right;">61</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,568</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債(固定)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">199</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">199</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,369</td> </tr> </table> <p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	賞与引当金繰入超過額	672	その他	196	小計	869	投資有価証券評価損	149	退職給付引当金超過額	361	固定資産減価償却超過額	174	その他	75	小計	760		1,630	評価性引当金	61	繰延税金資産合計	1,568	その他有価証券評価差額金	199	繰延税金負債合計	199		1,369
賞与引当金繰入超過額	775																																																																						
その他	309																																																																						
小計	1,084																																																																						
投資有価証券評価損	52																																																																						
関係会社株式評価損	205																																																																						
退職給付引当金超過額	329																																																																						
固定資産減価償却超過額	190																																																																						
その他	28																																																																						
小計	806																																																																						
	1,890																																																																						
評価性引当金	61																																																																						
繰延税金資産合計	1,829																																																																						
その他有価証券評価差額金	22																																																																						
繰延税金負債合計	22																																																																						
	1,807																																																																						
法定実効税率 (調整)	40.6%																																																																						
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%																																																																						
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%																																																																						
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%																																																																						
海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%																																																																						
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.0%																																																																						
賞与引当金繰入超過額	672																																																																						
その他	196																																																																						
小計	869																																																																						
投資有価証券評価損	149																																																																						
退職給付引当金超過額	361																																																																						
固定資産減価償却超過額	174																																																																						
その他	75																																																																						
小計	760																																																																						
	1,630																																																																						
評価性引当金	61																																																																						
繰延税金資産合計	1,568																																																																						
その他有価証券評価差額金	199																																																																						
繰延税金負債合計	199																																																																						
	1,369																																																																						

第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
----------------------	----------------------

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

（関連当事者情報）

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有) 割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社 (注)3	大阪市中央区	342,037	信託 銀行業	(被所有) 直接 91.34 (注)2	投資信託 受益証券の 募集販売	自己株式の 取得(注)1	8,700	-	-

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 当社株式14,283,400株を1株につき609.10円で取得したものであります。
- 2 議決権等の被所有割合は、自己株式（109,600株）を控除して計算しております。
- 3 住友信託銀行株式会社は、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社及び中央三井アセット信託銀行株式会社を吸収合併し、三井住友信託銀行株式会社に社名を変更しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (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)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセット マネジメント業	直接 100.00	-	増資の引受 (注)1	8,095	-	-
							株式売買代金相当額の引受(注)2	8,095	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成23年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	9,309百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	8,206百万円

営業収益	7,961百万円
税引前当期純利益	2,868百万円
当期純利益	2,181百万円

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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

重要な該当事項はありません。

(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)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD8,000)	関係会社短期貸付	606 (千SGD8,000)
							貸付利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD76)	未収収益	5 (千SGD76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成24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	10,930百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	9,826百万円

営業収益	7,917百万円
税引前当期純利益	2,801百万円
当期純利益	2,091百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

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

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

関連情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

項目	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	227円16銭	235円69銭
1株当たり当期純利益金額	13円09銭	14円35銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(百万円)	2,570	2,827
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	2,570	2,827
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,278	196,903

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2) 1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 6,091,800株	平成21年度ストックオプション(1) 16,978,500株、平成21年度ストックオプション(2) 1,626,900株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,930,100株
--	---	---

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第53期 (平成24年3月31日)	第54期 (平成25年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	44,729	46,408
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	44,729	46,408
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

- 1 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第55期中間会計期間(平成25年4月1日から平成25年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,689
未収委託者報酬		6,483
未収収益		570
関係会社短期貸付金		850
繰延税金資産		526
その他	2	786
流動資産合計		25,905
固定資産		
有形固定資産	1	192
無形固定資産		81
投資その他の資産		
投資有価証券		7,723
関係会社株式		22,935

関係会社長期貸付金	60
長期差入保証金	686
繰延税金資産	552
投資その他の資産合計	31,958
固定資産合計	32,233
資産合計	58,138

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(平成25年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		3,260
未払費用		3,331
未払法人税等		1,288
未払消費税等	3	266
賞与引当金		881
役員賞与引当金		170
その他		303
流動負債合計		9,501

固定負債

退職給付引当金		1,032
その他		55
固定負債合計		1,088

負債合計

10,590

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		24,690
利益剰余金合計		24,690

自己株式 68

株主資本合計 47,206

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金 342

評価・換算差額等合計 342

純資産合計 47,548

負債純資産合計 58,138

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(自 平成25年 4月 1日
至 平成25年 9月30日)

営業収益		
委託者報酬		32,440
その他営業収益		1,179
営業収益合計		33,620
営業費用及び一般管理費	1	30,198
営業利益		3,421
営業外収益	2	822
営業外費用	3	89
経常利益		4,155
特別利益	4	56
特別損失	5	35
税引前中間純利益		4,175
法人税、住民税及び事業税		1,333
法人税等調整額		302
中間純利益		2,540

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(自 平成25年 4月 1日
至 平成25年 9月30日)

株主資本		
資本金		
当期首残高		17,363
当中間期末残高		17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高		5,220
当中間期末残高		5,220
資本剰余金合計		
当期首残高		5,220
当中間期末残高		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高		23,530
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,380
中間純利益		2,540
当中間期変動額合計		1,160
当中間期末残高		24,690
利益剰余金合計		
当期首残高		23,530
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,380
中間純利益		2,540
当中間期変動額合計		1,160
当中間期末残高		24,690

(単位：百万円)

第55期中間会計期間
(自 平成25年 4月 1日
至 平成25年 9月30日)

自己株式	
当期首残高	68
当中間期末残高	68
株主資本合計	
当期首残高	46,045
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,380
中間純利益	2,540
当中間期変動額合計	1,160
当中間期末残高	47,206
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	362
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)	19
当中間期変動額合計	19
当中間期末残高	342
評価・換算差額等合計	
当期首残高	362
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)	19
当中間期変動額合計	19
当中間期末残高	342
純資産合計	
当期首残高	46,408
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,380
中間純利益	2,540
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	19
当中間期変動額合計	1,140
当中間期末残高	47,548

重要な会計方針

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	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>その他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理することとしております。</p>
4 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第55期中間会計期間 (平成25年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,700百万円
2	信託資産 その他流動資産のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
4	保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務78百万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202百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	34百万円
無形固定資産	11百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	11百万円
受取配当金	804百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	9百万円
時効成立後支払分配金・償還金	21百万円
支払源泉所得税	57百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	56百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
割増退職金	34百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	16,978,500	-	1,059,300	15,919,200	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	42,900	1,584,000	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,930,100	-	468,600	5,461,500	-
合計		29,800,700	-	1,570,800	28,229,900	-

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

- 2 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。
- 3 平成21年度ストックオプション(1)13,830,300株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	744百万円
1年超	437百万円
合計	1,182百万円

(金融商品関係)

第55期中間会計期間(平成25年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金及び預金	16,689	16,689	-
(2) 未収委託者報酬	6,483	6,483	-
(3) 未収収益	570	570	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	7,643	7,643	-
(5) 未払金	(3,260)	(3,260)	-
(6) 未払費用	(3,331)	(3,331)	-

()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

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 未払費用

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

- 2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額79百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
- 3 子会社株式（中間貸借対照表計上額20,042百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

(有価証券関係)

第55期中間会計期間(平成25年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	6,524	5,871	652
	小計	6,524	5,871	652
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,119	1,241	122
	小計	1,119	1,241	122
合計		7,643	7,113	530

(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 79百万円）については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、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55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,073百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	6,686百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	635百万円

(ストックオプション等関係)

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

関連情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第55期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1株当たり純資産額	241円48銭
1株当たり中間純利益金額	12円90銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

中間純利益（百万円）	2,540
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）	2,540
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 15,919,200株、平成21年度ストックオプション(2) 1,584,000株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権 2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,461,500株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第55期中間会計期間 (平成25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）	47,548
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	47,548
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積り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25年9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25年9月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	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。
日本生命保険相互会社	250,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
富国生命保険相互会社	35,000百万円 (基金の総額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

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

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成25年9月末現在)

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成25年12月11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	鶴 田	光 夫
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DCインデックスバランス（株式60）の平成24年11月7日から平成25年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の平成25年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2.財務諸表の範囲には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25年6月14日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
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24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成25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。

その他の事項

会社の平成24年3月31日をもって終了した前事業年度の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成24年6月15日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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。