

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成21年2月6日
【計算期間】	第6期 (自平成19年11月7日 至 平成20年11月6日)
【ファンド名】	DCインデックスバランス(株式60)
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 ビリー・ウェード・ワイルダー
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	犬伏 貴民
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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

- ・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。
- ・中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行いません。

## ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 追加型投信

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

## 内外

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

## 資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）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

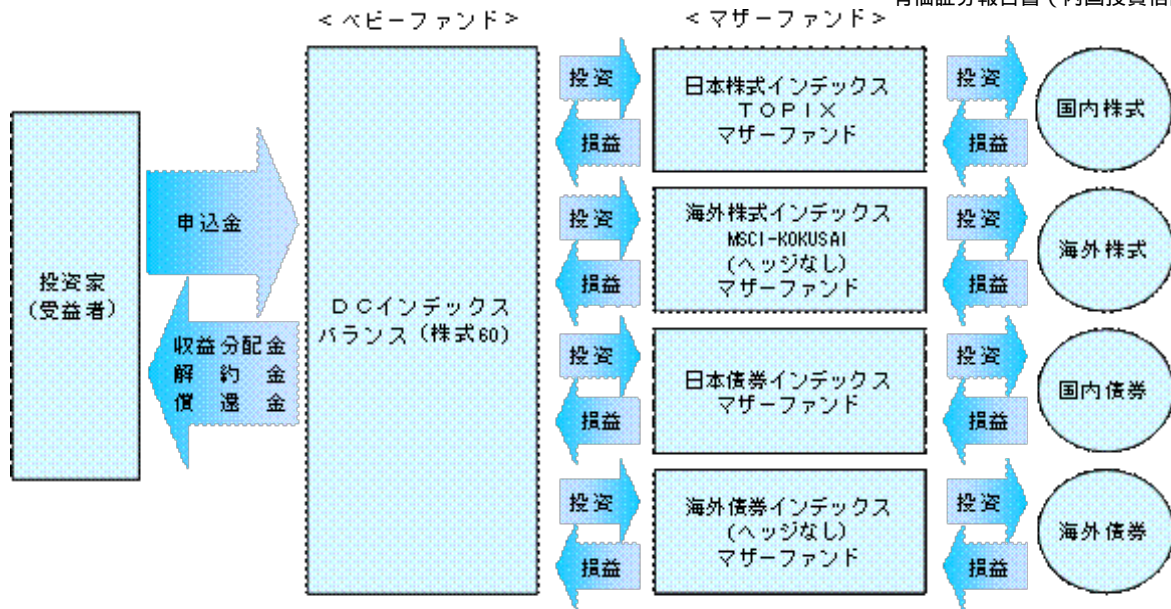
目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。

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

### ファンドの特色

#### 1) 4つの異なる資産に国際分散投資します。

- ・国際分散投資によりリスクの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いません。
- ・主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資するマザーファンド受益証券に投資を行いません（ファミリーファンド方式）。



ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンド受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

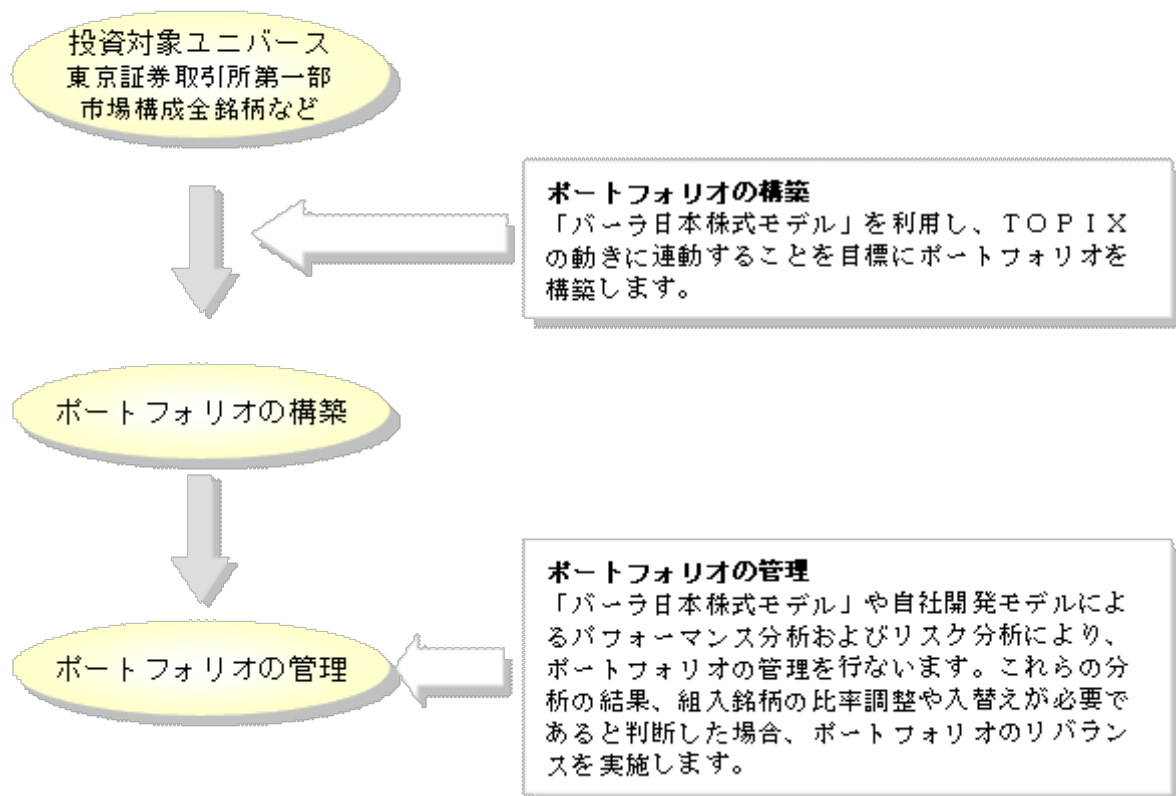
- 2) 株式に60%、債券などに40%投資します。
- 標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%とします。
  - 組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないます。
  - 各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

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%

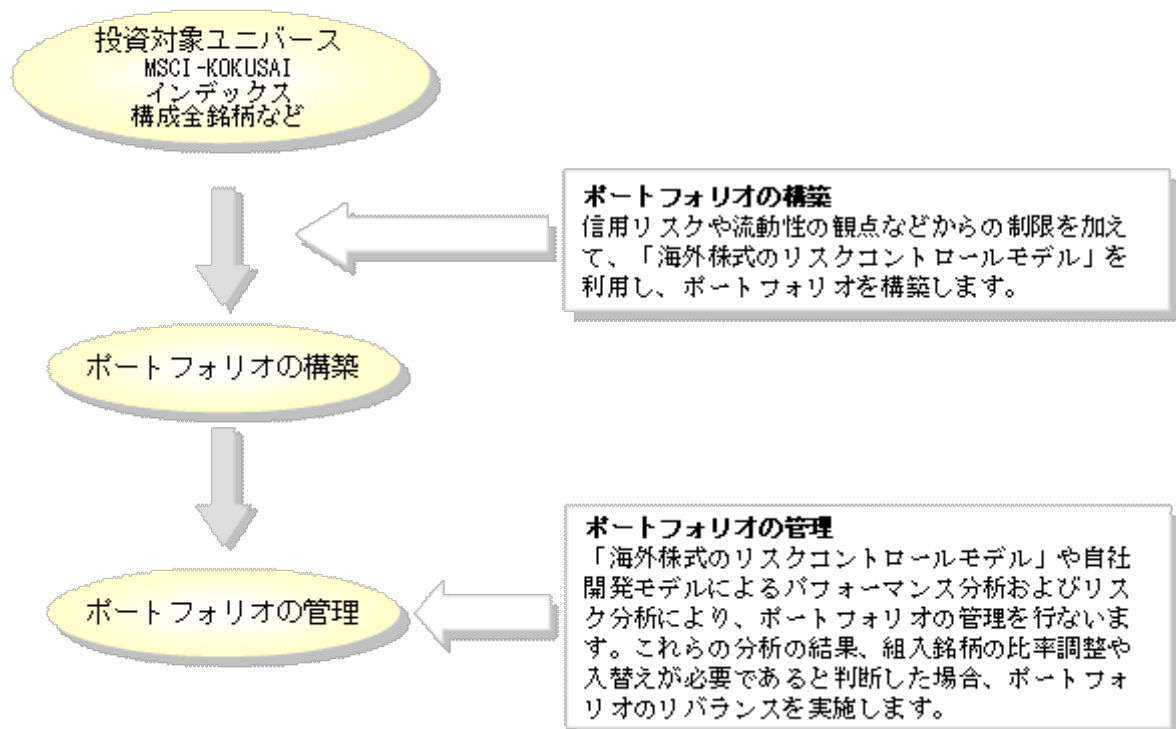
基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

- なお、上記の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。

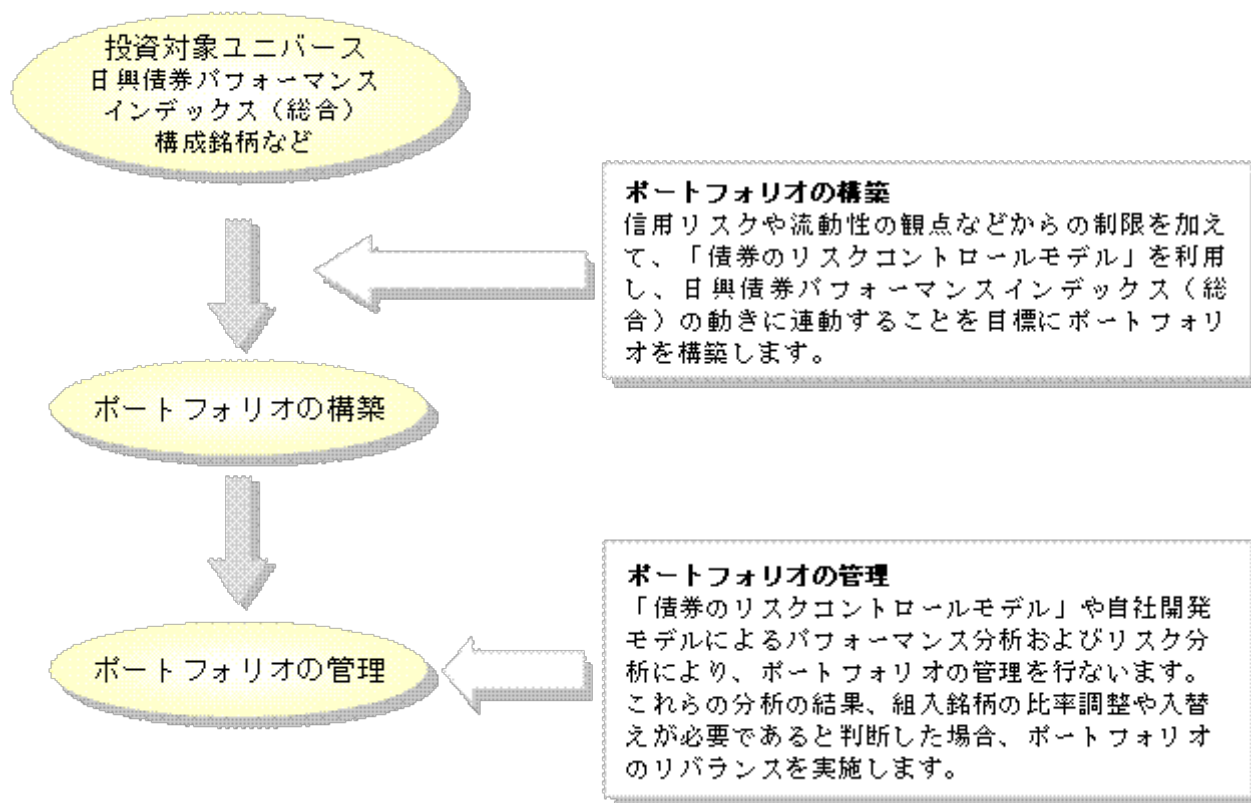
## 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」の運用プロセス



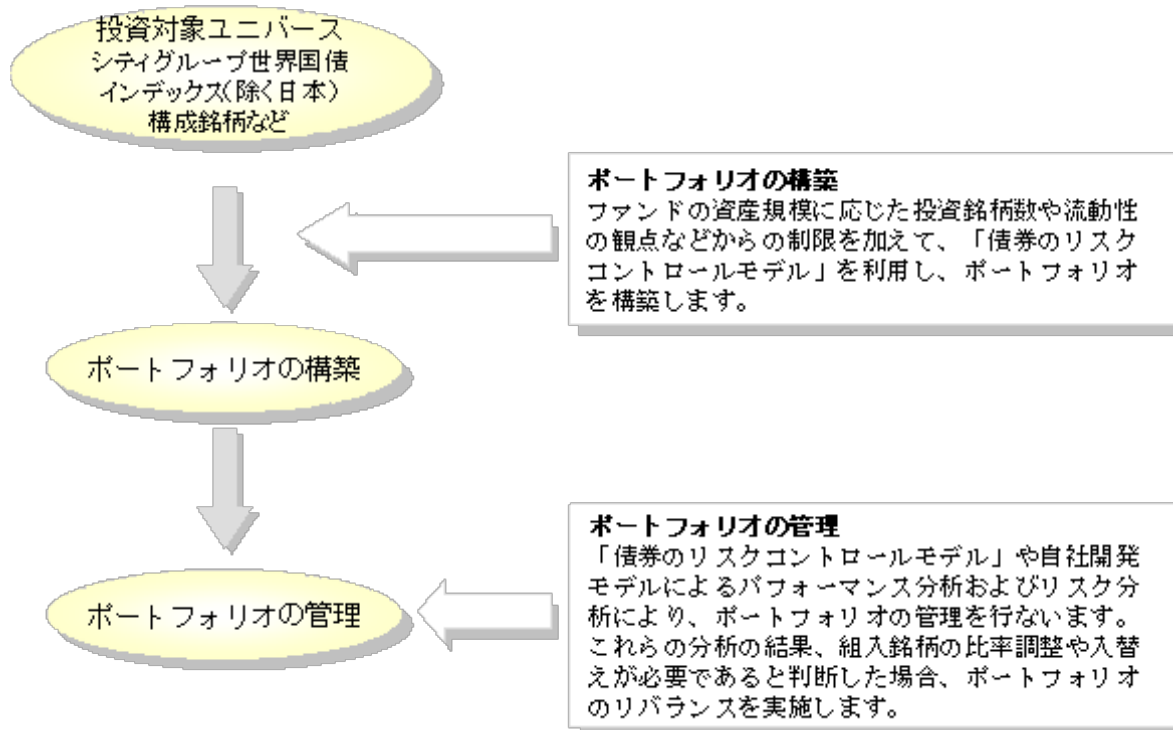
## 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」の運用プロセス



### 「日本債券インデックスマザーファンド」の運用プロセス



### 「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用プロセス



上記は本書提出日現在のプロセスであり、将来変更となる場合があります。

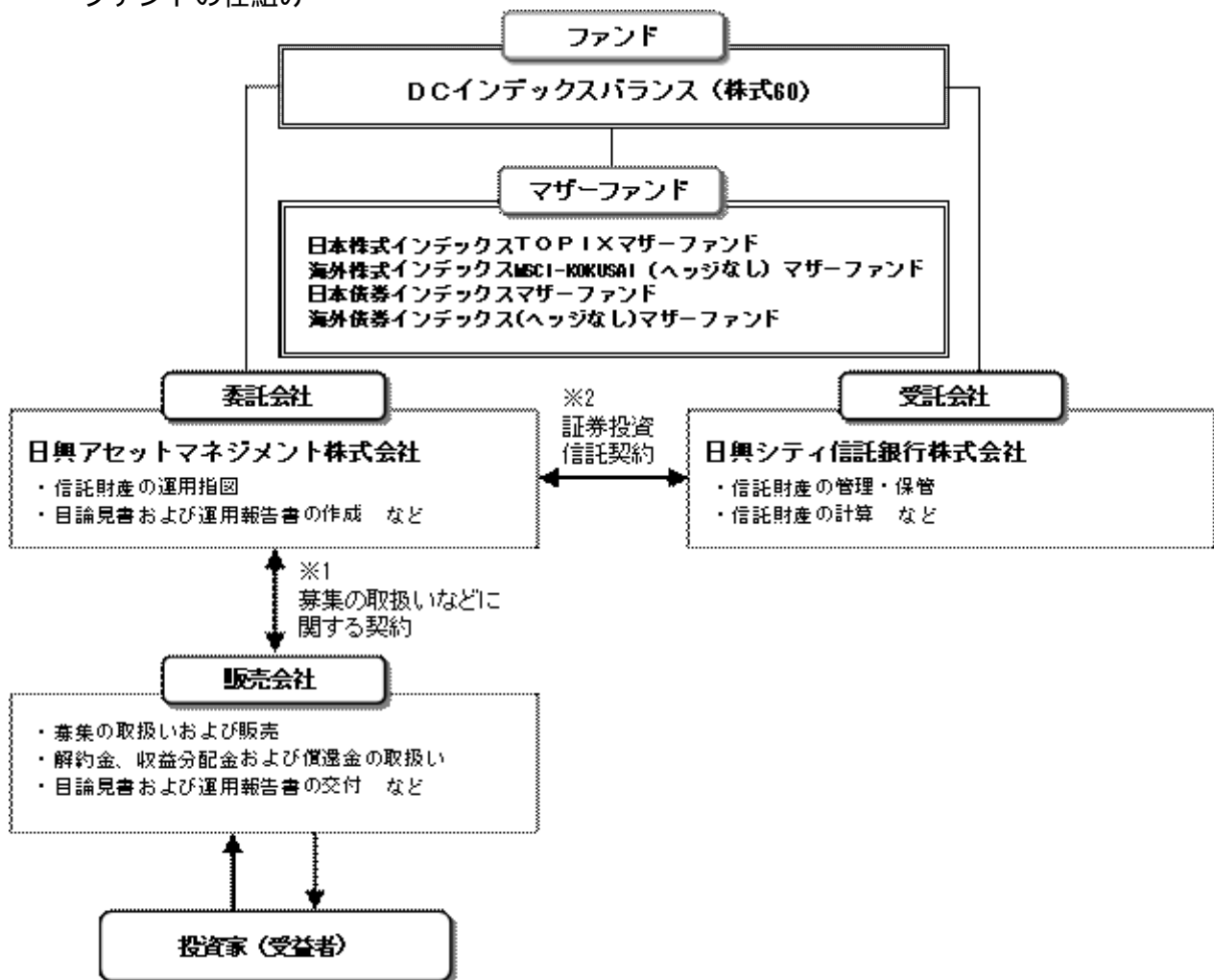
市況動向および資金動向などにより、上記のような運用ができない場合があります。

## 信託金限度額

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

## (2) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（平成20年12月末現在）

## 1) 資本金

16,403百万円

## 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
日興シティホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目3番1号	107,570,100株	58.14%
NAMホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目7番3号	69,170,000株	37.38%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「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】

## &lt;DCインデックスバランス（株式60）&gt;

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「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、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、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、以下同じ。)
- 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、以下同じ。)
- 19) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいい、以下同じ。)
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、以下同じ。)
- 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、以下同じ。)
- 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、以下同じ。))を除きます。には投資しません。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型

新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)~8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)  
または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)  
で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、  
有価証券に係るものに限り、)に限り、)
- 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の  
受益証券に限り、)
- 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、)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)  
の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)

に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)

を除きます。)

には投資しません。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)
- に限ります。)
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

- す。)で投資法人債券に類する証券
- 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
      - 1) 先物取引等
      - 2) スワップ取引
      - 3) 金利先渡取引
      - 4) 有価証券の貸付
      - 5) 公社債の空売
      - 6) 公社債の借入

#### < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

## 投資対象とするマザーファンドの概要

## &lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

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

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

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

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

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

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

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、日興債券パフォーマンスインデックス（総合） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の公社債に投資し、日興債券パフォーマンスインデックス（総合）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行ないません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	日興シティ信託銀行株式会社
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、格付機関からB B B格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。  
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は日興コーディアル証券株式会社に帰属します。また、日興コーディアル証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。



## &lt; 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド &gt;

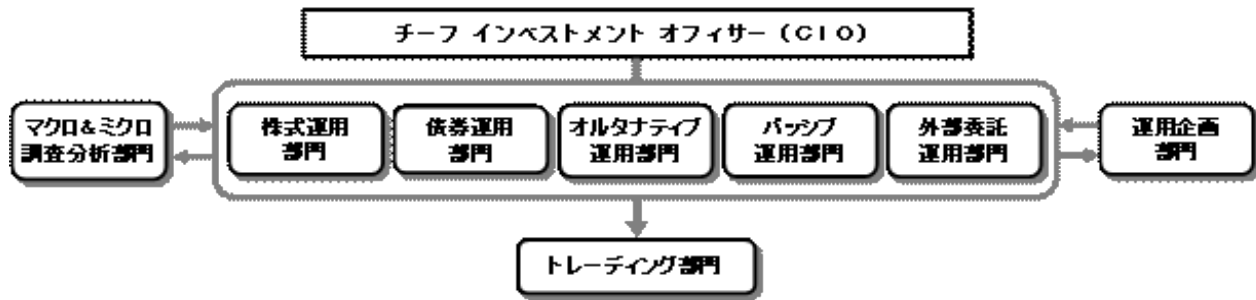
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主として世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取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

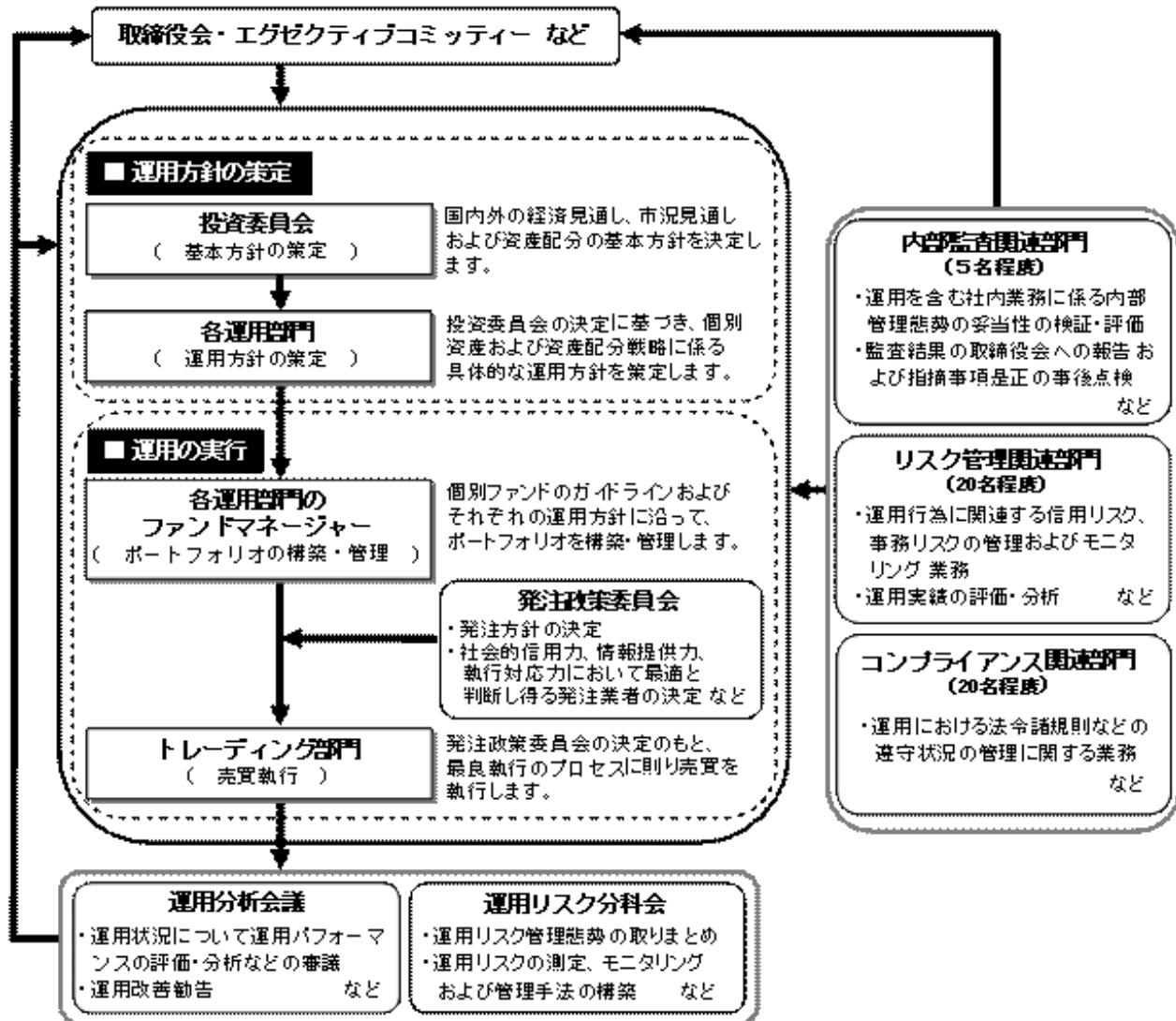
同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## (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。

上記体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

## 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

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

債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

<日本株式インデックストップIXマザーファンド>

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

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

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

#### 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（マザーファンドを含みます。）は、主に株式および債券など値動きのある証券（外貨建証券は為替変動リスクもあります。）を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・当ファンドは、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ありません。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りません。
- ・信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。取得申込者は、ファンドの投資目的およびリスク要因を十分に認識することが求められます。

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、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。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、その価格変動は、残存期間・発行条件などによりばらつきがあります。

##### 流動性リスク

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、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。
- ・一般に公社債および短期金融資産にデフォルト（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は下落（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。

##### 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閉鎖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。また、一時的に取得・換金ができなくなることもあります。

- ・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

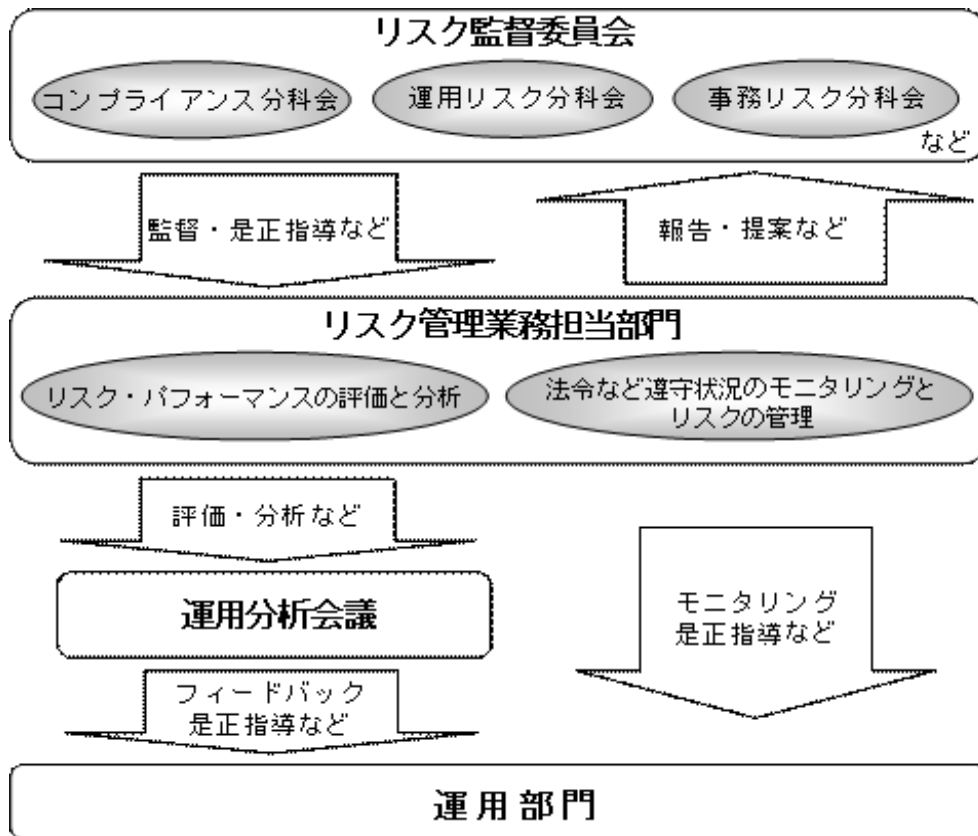
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有証券を大量に売却することがあります。その際に基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・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



## 全体的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスクマネジメント部が事務局を務めるリスク監督委員会、およびその分科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分科会においては、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と分析

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行ないます。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果を運用分析会議に報告し、問題点については運用部門に原因の究明と是正指導を行ないます。

## 法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理

法令・諸規則、信託約款などの遵守状況とリスク管理状況のモニタリングを行ないます。その結果については運用リスク分科会などで報告し運用部門に是正指導を行なうなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は本書提出日現在のものであり、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す。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.336%（税抜0.32%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分は、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.3360%	0.1995%	0.1050%	0.0315%
(0.32%)	(0.19%)	(0.10%)	(0.03%)

括弧内は税抜です。

支払時期

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

## (4)【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

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

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

## (5)【課税上の取扱い】

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

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

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、上記の内容が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下の運用状況は平成20年11月28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】

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,139,920	95.14
日本	1,139,920	95.14
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	58,205	4.86
純資産総額	1,198,125	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

## &lt;親投資信託受益証券&gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 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	895,114,847	0.6597 0.6089	590,473,568 545,035,430	45.49
日本円 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	254,283,434	1.1406 1.1454	290,047,646 291,256,245	24.31
日本円 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	274,060,374	0.7540 0.6771	206,640,865 185,566,279	15.49
日本円 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	80,216,143	1.4737 1.4718	118,218,531 118,062,119	9.85

## ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.14
合計	95.14

## 【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	1口当たりの純資産額(円)		純資産総額(百万円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
設定時(2002年12月10日)	1.0000	1.0000	1	1
第1計算期間末(2003年11月6日)	1.1076	1.1076	17	17
第2計算期間末(2004年11月8日)	1.1864	1.1864	124	124
第3計算期間末(2005年11月7日)	1.4271	1.4271	704	704
第4計算期間末(2006年11月6日)	1.5395	1.5405	1,087	1,087
第5計算期間末(2007年11月6日)	1.5896	1.5906	1,488	1,489
第6計算期間末(2008年11月6日)	1.1336	1.1346	1,250	1,251

	1口当たりの純資産額(円)	純資産総額(百万円)
2007年11月末日	1.5565	1,484
2007年12月末日	1.5427	1,488
2008年1月末日	1.4411	1,410
2008年2月末日	1.4346	1,411
2008年3月末日	1.3701	1,358
2008年4月末日	1.4588	1,481
2008年5月末日	1.4865	1,545
2008年6月末日	1.4339	1,511
2008年7月末日	1.4306	1,529
2008年8月末日	1.4076	1,521
2008年9月末日	1.2754	1,376
2008年10月末日	1.1046	1,210
2008年11月末日	1.0740	1,198

## 【分配の推移】

	1口当たり税込み分配金(円)
第1計算期間(2002年12月10日～2003年11月6日)	0
第2計算期間(2003年11月7日～2004年11月8日)	0
第3計算期間(2004年11月9日～2005年11月7日)	0
第4計算期間(2005年11月8日～2006年11月6日)	0.0010
第5計算期間(2006年11月7日～2007年11月6日)	0.0010
第6計算期間(2007年11月7日～2008年11月6日)	0.0010

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間(2002年12月10日～2003年11月6日)	10.76
第2計算期間(2003年11月7日～2004年11月8日)	7.11
第3計算期間(2004年11月9日～2005年11月7日)	20.29
第4計算期間(2005年11月8日～2006年11月6日)	7.95
第5計算期間(2006年11月7日～2007年11月6日)	3.32
第6計算期間(2007年11月7日～2008年11月6日)	28.62

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ちの額。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。

## (参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は平成20年11月28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。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、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。

## (1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	28,150,413	99.03
日本	28,150,413	99.03
有価証券指数等先物取引(買建)	(283,390)	(1.00)
日本	(283,390)	(1.00)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	276,399	0.97
純資産総額	28,426,812	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

&lt; 株式 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	株式 輸送用機器	トヨタ自動車	340,000	2,967 3,000	1,008,617,644 1,020,000,000	3.59
日本円 日本	株式 銀行業	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,437,700	582 521	836,376,864 749,041,700	2.63
日本円 日本	株式 情報・通信業	日本電信電話	1,201	379,647 415,000	455,956,237 498,415,000	1.75
日本円 日本	株式 電気・ガス業	東京電力	166,800	2,738 2,835	456,684,460 472,878,000	1.66
日本円 日本	株式 輸送用機器	ホンダ	226,200	1,843 2,085	416,891,086 471,627,000	1.66
日本円 日本	株式 医薬品	武田薬品工業	100,500	4,247 4,610	426,792,584 463,305,000	1.63
日本円 日本	株式 電気機器	キヤノン	153,400	2,412 2,825	370,014,344 433,355,000	1.52
日本円 日本	株式 その他製品	任天堂	14,000	24,711 29,620	345,949,839 414,680,000	1.46
日本円 日本	株式 情報・通信業	NTTドコモ	2,581	152,472 158,300	393,530,985 408,572,300	1.44
日本円 日本	株式 銀行業	三井住友フィナンシャルグループ	1,102	381,943 345,000	420,901,398 380,190,000	1.34
日本円 日本	株式 銀行業	みずほフィナンシャルグループ	1,470	230,035 248,000	338,151,569 364,560,000	1.28
日本円 日本	株式 陸運業	東日本旅客鉄道	493	684,951 735,000	337,681,012 362,355,000	1.27
日本円 日本	株式 電気機器	パナソニック	282,000	1,268 1,144	357,689,560 322,608,000	1.13
日本円 日本	株式 電気・ガス業	関西電力	109,800	2,332 2,585	255,999,751 283,833,000	1.00
日本円 日本	株式 小売業	セブン&アイ・ホールディングス	104,300	2,451 2,700	255,607,147 281,610,000	0.99
日本円 日本	株式 保険業	東京海上ホールディングス	112,400	2,419 2,315	271,844,627 260,206,000	0.92
日本円 日本	株式 電気機器	ソニー	140,300	1,840 1,843	258,182,380 258,572,900	0.91
日本円 日本	株式 不動産業	三菱地所	182,000	1,689 1,420	307,430,100 258,440,000	0.91
日本円 日本	株式 情報・通信業	KDDI	405	518,226 620,000	209,881,437 251,100,000	0.88
日本円 日本	株式 医薬品	アステラス製薬	62,100	3,587 3,890	222,773,309 241,569,000	0.85
日本円 日本	株式 電気・ガス業	中部電力	89,600	2,336 2,625	209,290,660 235,200,000	0.83
日本円 日本	株式 卸売業	三菱商事	195,100	1,331 1,185	259,713,142 231,193,500	0.81
日本円 日本	株式 食料品	JT	657	261,831 350,000	172,022,732 229,950,000	0.81
日本円 日本	株式 鉄鋼	新日本製鐵	727,000	258 297	187,528,660 215,919,000	0.76
日本円 日本	株式 電気機器	日立製作所	443,000	408 441	180,721,800 195,363,000	0.69
日本円 日本	株式 化学	花王	71,000	2,731 2,730	193,873,440 193,830,000	0.68
日本円 日本	株式 卸売業	三井物産	225,000	780 846	175,496,670 190,350,000	0.67

日本円 日本	株式 証券、商品先物取引業	野村ホールディングス	274,700	900 688	247,366,335 188,993,600	0.66
日本円 日本	株式 機械	三菱重工業	471,000	300 387	141,490,130 182,277,000	0.64
日本円 日本	株式 陸運業	東海旅客鉄道	221	791,753 808,000	174,977,499 178,568,000	0.63

## □ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
株式	99.03
電気機器	11.58
銀行業	10.06
輸送用機器	7.89
電気・ガス業	6.85
情報・通信業	6.56
化学	5.46
医薬品	5.22
陸運業	4.86
小売業	4.08
機械	3.95
卸売業	3.93
食料品	3.74
その他製品	2.57
保険業	2.54
鉄鋼	2.46
不動産業	2.38
建設業	2.18
サービス業	1.79
証券、商品先物取引業	1.37
精密機器	1.21
非鉄金属	0.99
繊維製品	0.96
ガラス・土石製品	0.95
その他金融業	0.87
石油・石炭製品	0.71
ゴム製品	0.70
海運業	0.64
空運業	0.63
金属製品	0.61
パルプ・紙	0.50
鋳業	0.37
倉庫・運輸関連業	0.29
水産・農林業	0.12
合計	99.03

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
< 有価証券指数等先物取引 >

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率 （％）
日本	東証株価指数先物 2008-12	買建	34	280,274,131	283,390,000	1.00
合計			-	280,274,131	283,390,000	1.00

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

以下の運用状況は平成20年11月28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。
- ・有価証券指数等先物取引の金額は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
- ・為替予約取引の金額は、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。

(1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
株式	50,975,059	94.04
アメリカ	29,002,054	53.50
イギリス	5,557,627	10.25
フランス	2,699,519	4.98
ドイツ	2,222,977	4.10
スイス	2,210,670	4.08
カナダ	2,175,133	4.01
オーストラリア	1,364,740	2.52
スペイン	1,143,378	2.11
イタリア	964,581	1.78
オランダ	635,460	1.17
スウェーデン	535,369	0.99
香港	500,728	0.92
フィンランド	381,536	0.70
シンガポール	268,304	0.49
デンマーク	225,450	0.42
ベルギー	183,436	0.34
バミューダ諸島	161,508	0.30
ノルウェー	161,186	0.30
ギリシャ	131,473	0.24
ルクセンブルグ	128,606	0.24
オーストリア	79,830	0.15
アイルランド	78,885	0.15
ポルトガル	72,743	0.13
ジャージー	54,062	0.10
ニュージーランド	24,884	0.05
ケイマン諸島	9,355	0.02
中国	1,553	0.00
投資証券	667,030	1.23
アメリカ	338,548	0.62
オーストラリア	104,990	0.19
カナダ	81,265	0.15
イギリス	56,992	0.11
フランス	55,459	0.10
香港	15,090	0.03
シンガポール	7,584	0.01
オランダ	7,099	0.01
有価証券指数等先物取引(買建)	(2,538,358)	(4.68)
アメリカ	(1,566,349)	(2.89)
ドイツ	(972,008)	(1.79)
為替予約取引(買建)	(1,725,736)	(3.18)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	2,566,077	4.73
純資産総額	54,208,167	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

## &lt; 株式 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	EXXON MOBIL CORPORATION	196,834	6,603 7,728	1,299,731,038 1,521,178,542	2.81
アメリカドル アメリカ	株式 化粧品パーソナルケア	PROCTER & GAMBLE COMPANY	111,473	5,631 6,034	627,758,284 672,662,237	1.24
アメリカドル アメリカ	株式 その他製造	GENERAL ELECTRIC COMPANY	397,058	1,697 1,547	673,705,098 614,166,376	1.13
アメリカドル アメリカ	株式 ソフトウェア	MICROSOFT CORP	311,409	2,094 1,958	652,027,077 609,618,805	1.12
アメリカドル アメリカ	株式 通信	AT&T INC	224,751	2,359 2,712	530,159,892 609,610,252	1.12
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	CHEVRON CORPORATION	78,396	6,118 7,637	479,657,839 598,672,010	1.10
アメリカドル アメリカ	株式 ヘルスケア製品	JOHNSON & JOHNSON	106,609	5,803 5,567	618,689,994 593,504,648	1.09
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	BP PLC	713,898	649 780	463,169,893 556,914,542	1.03
スイスフラン スイス	株式 食品	NESTLE SA	145,145	3,462 3,388	502,515,639 491,688,615	0.91
アメリカドル アメリカ	株式 小売り	WAL-MART STORES INC	89,902	4,910 5,416	441,422,866 486,923,850	0.90
イギリスポンド イギリス	株式 銀行	HSBC HOLDINGS PLC	455,126	1,022 1,038	465,349,771 472,557,052	0.87
ユーロ フランス	株式 石油・ガス	TOTAL SA	80,847	4,450 5,194	359,806,049 419,896,923	0.77
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	JPMORGAN CHASE & CO	139,660	3,372 2,925	470,925,037 408,566,224	0.75
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	51,342	7,830 7,803	401,991,529 400,608,883	0.74
アメリカドル アメリカ	株式 医薬品	PFIZER INC	256,542	1,581 1,535	405,654,230 393,876,064	0.73
スイスフラン スイス	株式 医薬品	NOVARTIS AG-REG SHS	90,210	4,337 4,310	391,216,999 388,818,361	0.72
イギリスポンド イギリス	株式 通信	VODAFONE GROUP PLC	2,015,355	153 185	307,820,537 373,588,775	0.69
アメリカドル アメリカ	株式 銀行	WELLS FARGO & COMPANY	134,349	2,919 2,737	392,110,643 367,742,904	0.68
アメリカドル アメリカ	株式 通信	CISCO SYSTEMS INC	224,055	1,556 1,566	348,629,061 350,847,859	0.65
スイスフラン スイス	株式 医薬品	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,643	13,382 12,962	356,526,941 345,354,799	0.64
アメリカドル アメリカ	株式 飲料	COCA-COLA COMPANY	79,301	3,977 4,336	315,353,649 343,817,828	0.63
イギリスポンド イギリス	株式 石油・ガス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	134,573	2,169 2,550	291,928,664 343,105,921	0.63
アメリカドル アメリカ	株式 通信	VERIZON COMMUNICATIONS INC	108,158	2,399 3,109	259,453,812 336,249,335	0.62
アメリカドル アメリカ	株式 農業	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	78,828	3,869 4,060	305,014,698 320,077,153	0.59
アメリカドル アメリカ	株式 飲料	PEPSICO INC	60,178	4,946 5,248	297,620,911 315,814,878	0.58
ユーロ スペイン	株式 通信	TELEFONICA S.A.	163,018	1,664 1,933	271,338,358 315,166,253	0.58
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	HEWLETT-PACKARD CO	93,570	3,100 3,364	290,109,480 314,766,055	0.58
イギリスポンド イギリス	株式 医薬品	GLAXOSMITHKLINE PLC	198,271	1,659 1,568	328,887,574 310,948,251	0.57
アメリカドル アメリカ	株式 コンピューター	APPLE INC	33,456	9,194 9,076	307,578,168 303,656,693	0.56
アメリカドル アメリカ	株式 石油・ガス	CONOCOPHILLIPS	55,630	4,626 5,222	257,332,973 290,511,898	0.54

## &lt; 投資証券 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	WESTFIELD GROUP	66,875	838 907	56,073,236 60,676,724	0.11
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	8,577	5,170 4,868	44,340,254 41,750,803	0.08
ユーロ フランス	投資証券 -	UNIBAIL-RODAMCO	3,125	13,579 12,767	42,433,888 39,898,250	0.07
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PUBLIC STORAGE	4,879	6,647 6,966	32,430,914 33,986,243	0.06

アメリカドル アメリカ	投資証券 -	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	10,465	2,874 3,001	30,074,769 31,404,538	0.06
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VORNADO REALTY TRUST	5,302	5,383 5,369	28,542,766 28,468,283	0.05
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	BOSTON PROPERTIES INC	4,422	5,851 5,249	25,872,545 23,210,935	0.04
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	LAND SECURITIES GROUP PLC	16,919	1,413 1,365	23,908,028 23,086,618	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	PLUM CREEK TIMBER CO	6,508	2,994 3,504	19,486,407 22,806,682	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HCP INC	9,730	2,606 2,059	25,359,603 20,032,971	0.04
カナダドル カナダ	投資証券 -	PENN WEST ENERGY TRUST	14,333	1,567 1,393	22,461,925 19,966,156	0.04
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,035	6,133 5,886	18,612,783 17,864,676	0.03
カナダドル カナダ	投資証券 -	CANADIAN OIL SANDS TRUST	8,940	2,166 1,989	19,365,346 17,780,972	0.03
香港ドル 香港	投資証券 -	LINK REIT	86,500	153 174	13,214,432 15,090,029	0.03
カナダドル カナダ	投資証券 -	ENERPLUS RESOURCES FUND	6,455	2,206 2,281	14,237,245 14,726,806	0.03
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	BRITISH LAND COMPANY PLC	19,421	814 754	15,814,698 14,643,239	0.03
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	STOCKLAND	54,945	259 264	14,213,986 14,489,986	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HEALTH CARE REIT INC	3,655	3,706 3,760	13,545,418 13,744,461	0.03
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	KIMCO REALTY CORPORATION	8,895	1,767 1,435	15,721,824 12,764,421	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	HOST HOTELS & RESORTS INC	17,388	717 724	12,459,371 12,592,271	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	VENTAS INC	5,525	3,057 2,205	16,891,472 12,182,974	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,135	4,702 5,458	10,039,792 11,653,257	0.02
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	REGENCY CENTERS CORPORATION	2,910	3,141 3,430	9,141,344 9,980,968	0.02
オーストラリアドル オーストラリア	投資証券 -	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	65,850	111 131	7,277,110 8,641,568	0.02
イギリスポンド イギリス	投資証券 -	HAMMERSON PLC	10,610	928 757	9,849,552 8,031,053	0.01
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	UDR INC	5,265	1,639 1,468	8,626,760 7,731,388	0.01
シンガポールドル シンガポール	投資証券 -	CAPITAMALL TRUST	72,000	103 105	7,438,202 7,584,739	0.01
アメリカドル アメリカ	投資証券 -	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,193	1,911 1,782	8,011,984 7,471,175	0.01
ユーロ フランス	投資証券 -	ICADE	1,215	5,580 5,939	6,779,264 7,216,133	0.01
ユーロ オランダ	投資証券 -	CORIO NV	1,700	4,548 4,176	7,731,685 7,099,074	0.01

## □ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
株式	94.04
石油・ガス	11.86
銀行	10.24
通信	6.90
医薬品	6.17
保険	4.20
電力	4.12
小売り	3.90
食品	3.87
コンピューター	2.76
その他製造	2.72
ヘルスケア製品	2.57
ソフトウェア	2.33
化学	2.33
鉱業	2.17
メディア	2.12
飲料	1.96
化粧品パーソナルケア	1.70
農業	1.67
運輸関連	1.56
バイオテクノロジー	1.43
航空宇宙・防衛	1.43
商業サービス	1.31
その他金融	1.22
半導体	1.22
石油・ガス サービス	0.96
インターネット	0.92
エンジニアリング建設	0.79
自動車 製造	0.79
ヘルスケア・サービス	0.68
ガス	0.65
生活用品	0.53
電子機器	0.48
機械 その他	0.46
電気部品・電気機械	0.43
繊維製品	0.42
鉄鋼	0.42
建築資材	0.40
多角産業	0.39
不動産	0.39
パイプライン	0.35
機械 建設・鉱業用	0.24
木材・紙	0.22
金属 加工・鉱業用	0.20
自動車 部品・機器	0.20
環境ビジネス	0.18
宿泊施設	0.18
水道	0.18
流通・卸売業	0.16
レジャー	0.15
貯蓄貸付(S & L)	0.14
投資会社	0.14
包装・容器	0.14
広告	0.12
その他資源	0.11
エンターテインメント	0.11
石炭	0.11

工具・工作機械	0.10
航空	0.10
OA機器	0.09
食品サービス	0.09
住宅建設	0.06
玩具・娯楽	0.05
家具・家電製品	0.03
繊維	0.03
ベンチャーキャピタル	0.02
家庭用品	0.02
造船	0.01
投資証券	1.23
合計	95.27

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## &lt; 有価証券指数等先物取引 &gt;

国・地域	銘柄名	種類	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	S&P 500 FUTURES 2008-12	買建	74	1,571,750,037	1,566,349,638	2.89
ドイツ	DJ STOXX 50 FUTURES 2008-12	買建	370	973,702,923	972,008,648	1.79
合計			-	2,545,452,960	2,538,358,286	4.68

## &lt; 為替予約取引 &gt;

名称	種類	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカドル	買建	1,116,077,496	1,099,416,820	2.03
ユーロ	買建	627,362,662	626,319,360	1.16
合計		1,743,440,158	1,725,736,180	3.18

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は平成20年11月28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

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	23,011,477	69.49
日本	23,011,477	69.49
地方債証券	2,027,349	6.12
日本	2,027,349	6.12
特殊債券	4,045,970	12.22
日本	3,953,989	11.94
韓国	91,981	0.28
社債券	3,883,487	11.73
日本	3,521,613	10.63
アメリカ	267,844	0.81
ドイツ	94,030	0.28
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	146,737	0.44
純資産総額	33,115,020	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

&lt; 国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 219回	1.80000 2010-03-22	596,000,000	101.57 101.58	605,327,400 605,410,840	1.83
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 220回	1.70000 2010-03-22	584,000,000	101.43 101.45	592,378,980 592,468,000	1.79
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 288回	1.70000 2017-09-20	505,000,000	102.41 103.48	517,180,600 522,594,200	1.58
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 240回	1.30000 2012-06-20	501,000,000	101.57 101.79	508,865,700 509,982,930	1.54
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第6 4回	1.50000 2012-06-20	482,000,000	102.35 102.52	493,315,900 494,141,580	1.49
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 285回	1.70000 2017-03-20	408,000,000	102.91 104.09	419,864,640 424,666,800	1.28
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 239回	1.40000 2012-06-20	387,000,000	101.92 102.14	394,445,010 395,274,060	1.19
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 287回	1.90000 2017-06-20	370,000,000	104.38 105.51	386,191,200 390,375,900	1.18
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 282回	1.70000 2016-09-20	353,000,000	103.36 104.76	364,845,300 369,802,800	1.12
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 284回	1.70000 2016-12-20	346,000,000	102.98 104.36	356,317,720 361,078,680	1.09
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第5 7回	1.40000 2011-06-20	330,000,000	101.81 101.80	335,982,930 335,943,300	1.01
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 290回	1.40000 2018-03-20	320,000,000	99.73 100.58	319,140,500 321,849,600	0.97
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(20年)第 88回	2.30000 2026-06-20	300,000,000	102.57 103.49	307,722,000 310,479,000	0.94
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 296回	1.50000 2018-09-20	302,000,000	100.25 100.95	302,758,800 304,862,960	0.92
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 233回	1.40000 2011-06-20	297,000,000	101.81 101.79	302,384,610 302,310,360	0.91
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第6 9回	0.90000 2012-12-20	292,000,000	100.17 100.31	292,504,600 292,913,960	0.88
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第5 2回	0.80000 2010-12-20	263,000,000	100.58 100.37	264,516,600 263,980,990	0.80
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(2年)第2 69回	0.90000 2010-06-15	260,000,000	100.36 100.49	260,938,600 261,281,800	0.79
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第5 8回	1.50000 2011-06-20	255,000,000	102.07 102.05	260,283,600 260,230,050	0.79
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 250回	0.50000 2013-06-20	255,000,000	97.87 98.38	249,568,500 250,874,100	0.76
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 292回	1.70000 2018-03-20	241,000,000	102.23 103.19	246,383,940 248,683,080	0.75
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 293回	1.80000 2018-06-20	238,000,000	103.06 103.94	245,286,200 247,367,680	0.75
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 268回	1.50000 2015-03-20	236,000,000	102.54 103.45	241,992,040 244,142,000	0.74

日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(20年)第 33回	3.80000 2016-09-20	200,000,000	119.43 120.12	238,858,000 240,244,000	0.73
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第4 6回	0.50000 2010-03-20	236,000,000	99.78 99.92	235,480,800 235,801,760	0.71
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 259回	1.50000 2014-03-20	225,000,000	102.83 103.11	231,371,460 231,995,250	0.70
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(2年)第2 65回	0.50000 2010-02-15	226,000,000	99.83 99.92	225,618,160 225,823,720	0.68
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 291回	1.30000 2018-03-20	221,000,000	98.72 99.71	218,168,990 220,359,100	0.67
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(5年)第5 4回	1.10000 2011-03-20	215,000,000	101.05 101.01	217,246,750 217,160,750	0.66
日本円 日本	国債証券 -	利付国庫債券(10年)第 283回	1.80000 2016-09-20	200,000,000	104.18 105.63	208,351,680 211,266,000	0.64

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
国債証券	69.49
地方債証券	6.12
特殊債券	12.22
社債券	11.73
合計	99.56

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は平成20年11月28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。
- ・為替予約取引の金額は、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。

## (1) 投資状況

投資資産の種類	時価(千円)	投資比率(%)
国債証券	634,420,849	98.50
アメリカ	201,341,121	31.26
ドイツ	79,990,005	12.42
イタリア	76,428,037	11.87
フランス	66,890,747	10.38
イギリス	55,534,333	8.62
スペイン	26,052,222	4.04
ベルギー	21,118,403	3.28
オランダ	16,677,453	2.59
ギリシャ	16,315,691	2.53
カナダ	14,434,501	2.24
オーストリア	12,694,931	1.97
ポルトガル	7,767,483	1.21
ポーランド	6,091,639	0.95
デンマーク	5,412,384	0.84
スイス	4,874,900	0.76
スウェーデン	4,794,561	0.74
フィンランド	3,919,070	0.61
アイルランド	3,375,194	0.52
マレーシア	3,356,275	0.52
シンガポール	2,933,132	0.46
オーストラリア	2,464,846	0.38
ノルウェー	1,953,910	0.30
為替予約取引(買建)	(247,934)	(0.04)
為替予約取引(売建)	(181,632)	(0.03)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	9,689,781	1.50
純資産総額	644,110,631	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

## &lt; 国債証券 &gt;

通貨 国・地域	種類 業種	銘柄名	利率(%) 償還期限	数量又は 券面総額	簿価単価(円) 評価単価(円)	簿価額(円) 評価額(円)	投資比率 (%)
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	6.00000 2031-05-01	25,100,000	13,907.80 13,746.29	3,490,858,913 3,450,318,202	0.54
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	8.00000 2021-06-07	16,200,000	19,505.56 20,349.62	3,159,901,302 3,296,639,037	0.51
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	6.50000 2027-11-01	21,400,000	14,588.42 14,557.21	3,121,922,510 3,115,243,111	0.48
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.00000 2012-07-04	23,100,000	13,097.39 13,306.16	3,025,497,056 3,073,722,530	0.48
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	5.00000 2012-02-01	23,350,000	12,769.38 12,780.39	2,981,649,232 2,984,221,234	0.46
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.25000 2014-07-04	22,100,000	12,860.46 13,233.42	2,842,160,742 2,924,586,124	0.45
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.00000 2012-01-04	21,950,000	13,034.15 13,231.54	2,860,996,231 2,904,322,176	0.45
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	4.00000 2015-02-15	27,300,000	10,093.21 10,530.30	2,755,447,401 2,874,771,727	0.45
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	2.62500 2010-05-31	28,000,000	9,740.60 9,803.67	2,727,368,304 2,745,028,376	0.43
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	5.00000 2018-03-07	17,000,000	15,387.28 16,100.50	2,615,837,559 2,737,085,654	0.42
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	8.00000 2021-11-15	20,000,000	12,775.93 13,659.23	2,555,185,194 2,731,846,871	0.42
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.75000 2010-06-07	17,800,000	15,102.21 15,232.30	2,688,192,823 2,711,350,217	0.42
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2013-08-01	21,450,000	12,475.67 12,568.13	2,676,031,933 2,695,864,303	0.42
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	4.12500 2015-05-15	25,000,000	10,040.19 10,572.10	2,510,046,853 2,643,024,529	0.41
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	5.00000 2012-03-07	17,000,000	15,317.76 15,547.05	2,604,019,145 2,642,999,030	0.41
イギリスポンド イギリス	国債証券 -	イギリス国債	4.25000 2011-03-07	17,300,000	14,991.64 15,142.34	2,593,553,396 2,619,624,943	0.41
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	3.50000 2018-02-15	26,000,000	9,430.52 9,988.41	2,451,935,828 2,596,986,070	0.40
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	2.00000 2010-09-30	26,600,000	9,642.08 9,735.00	2,564,792,072 2,589,510,903	0.40
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	2.12500 2010-04-30	26,300,000	9,664.47 9,743.21	2,541,755,761 2,562,465,058	0.40
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.25000 2014-01-04	19,400,000	12,853.34 13,200.50	2,493,547,463 2,560,896,416	0.40
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	3.75000 2015-08-01	21,100,000	12,005.02 12,134.79	2,533,059,934 2,560,441,081	0.40
ユーロ フランス	国債証券 -	フランス国債	5.00000 2016-10-25	18,800,000	13,218.86 13,608.56	2,485,144,962 2,558,410,157	0.40
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	4.50000 2013-01-04	19,400,000	12,915.18 13,165.69	2,505,544,513 2,554,143,344	0.40
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	3.75000 2015-01-04	19,750,000	12,498.90 12,917.94	2,468,531,986 2,551,293,389	0.40
ユーロ ドイツ	国債証券 -	ドイツ国債	5.00000 2011-07-04	19,400,000	12,972.14 13,131.56	2,516,594,205 2,547,521,748	0.40
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	2.75000 2010-07-31	25,850,000	9,778.67 9,853.31	2,527,785,689 2,547,080,290	0.40
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2014-08-01	20,100,000	12,490.28 12,540.78	2,510,546,592 2,520,696,199	0.39
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	1.75000 2010-03-31	26,000,000	9,589.83 9,683.50	2,493,355,150 2,517,710,169	0.39
アメリカドル アメリカ	国債証券 -	アメリカ国債	4.25000 2013-08-15	23,500,000	10,304.17 10,619.87	2,421,479,214 2,495,669,007	0.39
ユーロ イタリア	国債証券 -	イタリア国債	4.25000 2009-11-01	19,960,000	12,443.99 12,501.10	2,483,819,965 2,495,219,614	0.39

## ロ 種類別及び業種別の投資比率

種類別及び業種別	投資比率(%)
国債証券	98.50
合計	98.50

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの



## &lt; 為替予約取引 &gt;

名称	種類	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
ユーロ	買建	218,576,880	219,278,200	0.03
アメリカドル	買建	28,599,900	28,656,000	0.00
合計		247,176,780	247,934,200	0.04
スイスフラン	売建	63,792,225	64,134,350	0.01
オーストラリアドル	売建	61,707,520	62,383,440	0.01
ポーランドズロチ	売建	54,550,832	55,114,290	0.01
合計		180,050,577	181,632,080	0.03

## 第二部【ファンドの詳細情報】

### 第1【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

### 第2【手続等】

#### 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（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

#### 2【換金（解約）手続等】

##### < 解約請求による換金 >

##### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

##### (2) 取扱時間

原則として、午後3時（わが国の金融商品取引所が半休日となる場合は午前11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。

（半休日となる場合は午前9時～正午）

##### (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。

## 第3【管理及び運営】

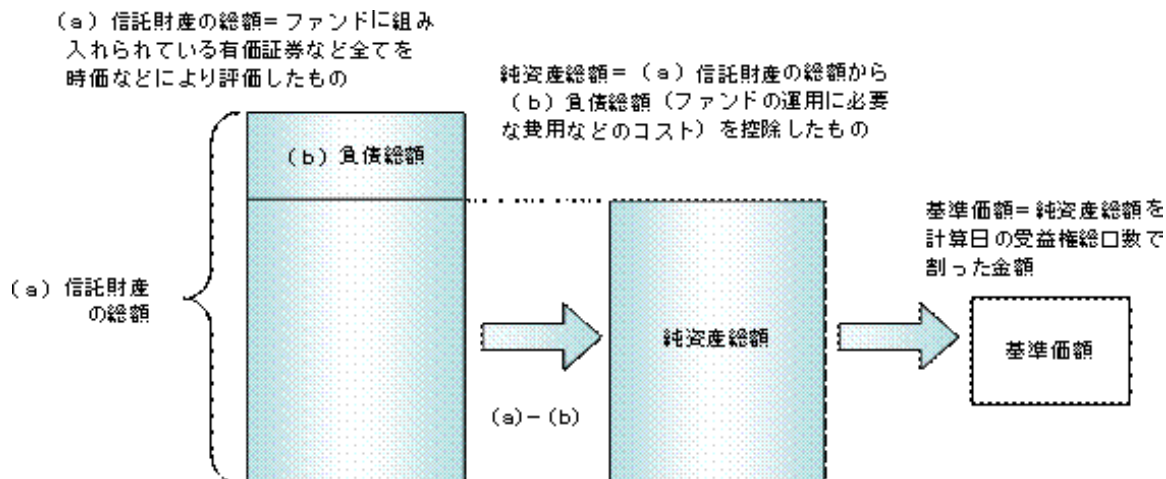
## 1【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

## 基準価額の算出

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

## &lt; 基準価額算出の流れ &gt;



## 有価証券などの評価基準

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

## &lt; 主な資産の評価方法 &gt;

## マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

## 国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場（ジャスダック証券取引所については、同所が発表する基準値段）で評価します。

## 外国株式

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

## 公社債（国内・外国）

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

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

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

c) 価格情報会社の提供する価額

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

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

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（半休日となる場合は午前9時～正午）

## (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。

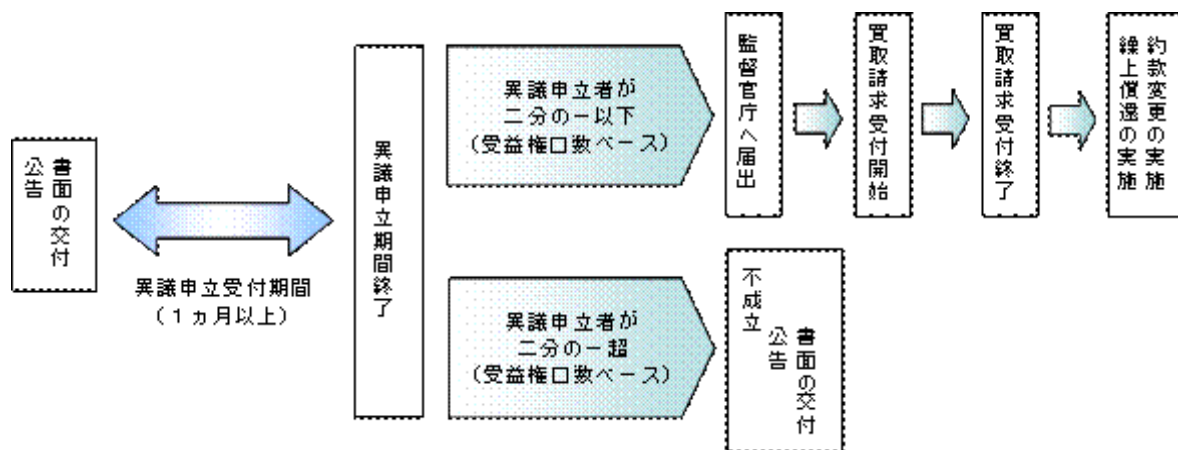
信託約款の変更

- 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わない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

< 繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ >



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

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。

2【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4【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、第5期計算期間(平成18年11月7日から平成19年11月6日まで)については、改正前の「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、第6期計算期間(平成19年11月7日から平成20年11月6日まで)については、改正後の「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5期計算期間(平成18年11月7日から平成19年11月6日まで)及び第6期計算期間(平成19年11月7日から平成20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】

## D C インデックスバランス（株式60）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

科目	期別	第5期	第6期
		平成19年11月6日現在 金額	平成20年11月6日現在 金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		82,638,576	46,983,958
親投資信託受益証券		1,413,221,037	1,189,379,850
未収入金		-	18,572,619
流動資産合計		1,495,859,613	1,254,936,427
資産合計		1,495,859,613	1,254,936,427
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		936,195	1,103,286
未払解約金		4,314,448	641,051
未払受託者報酬		222,199	227,223
未払委託者報酬		2,148,490	2,197,125
その他未払費用		59,202	60,541
流動負債合計		7,680,534	4,229,226
負債合計		7,680,534	4,229,226
純資産の部			
元本等			
元本		936,195,290	1,103,286,894
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		551,983,789	147,420,307
（分配準備積立金）		144,834,407	152,589,760
元本等合計		1,488,179,079	1,250,707,201
純資産合計		1,488,179,079	1,250,707,201
負債純資産合計		1,495,859,613	1,254,936,427



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

科目	期別	第5期	第6期
		自平成18年11月7日 至平成19年11月6日	自平成19年11月7日 至平成20年11月6日
		金額	金額
営業収益			
受取利息		289,294	345,398
有価証券売買等損益		36,245,113	467,780,070
営業収益合計		36,534,407	467,434,672
営業費用			
受託者報酬		411,769	451,557
委託者報酬		3,981,582	4,366,268
その他費用		109,711	120,312
営業費用合計		4,503,062	4,938,137
営業利益又は営業損失( )		32,031,345	472,372,809
経常利益又は経常損失( )		32,031,345	472,372,809
当期純利益又は当期純損失( )		32,031,345	472,372,809
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( )		4,130,824	22,832,925
期首剰余金又は期首欠損金( )		380,947,549	551,983,789
剰余金増加額又は欠損金減少額		183,593,136	116,972,689
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		183,593,136	116,972,689
剰余金減少額又は欠損金増加額		39,521,222	70,893,001
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		39,521,222	70,893,001
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		936,195	1,103,286
期末剰余金又は期末欠損金( )		551,983,789	147,420,307

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期別 項目	第5期	第6期
	自平成18年11月7日 至平成19年11月6日	自平成19年11月7日 至平成20年11月6日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

## (貸借対照表に関する注記)

第5期 平成19年11月6日現在			第6期 平成20年11月6日現在		
1.	期首元本額	706,100,673 円	1.	期首元本額	936,195,290 円
	期中追加設定元本額	302,235,212 円		期中追加設定元本額	291,424,215 円
	期中解約元本額	72,140,595 円		期中解約元本額	124,332,611 円
2.	計算期間末日における 受益権の総数	936,195,290 口	2.	計算期間末日における 受益権の総数	1,103,286,894 口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自平成18年11月7日 至平成19年11月6日			第6期 自平成19年11月7日 至平成20年11月6日		
A	分配金の計算過程 計算期末における費用控除後の配当 等収益	19,606,539 円	A	分配金の計算過程 計算期末における費用控除後の配当 等収益	25,279,201 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	8,293,982 円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後の有価 証券売買等損益	0 円
C	信託約款に定める収益調整金	407,149,382 円	C	信託約款に定める収益調整金	259,313,655 円
D	信託約款に定める分配準備積立金	117,870,081 円	D	信託約款に定める分配準備積立金	128,413,845 円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	552,919,984 円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	413,006,701 円
F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.5906 円 5,906 円	F	分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.3743 円 3,743 円
G	分配金額	936,195 円	G	分配金額	1,103,286 円
H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0010 円 10 円	H	分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0010 円 10 円

## (有価証券に関する注記)

第5期(自平成18年11月7日至平成19年11月6日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,413,221,037	31,313,374
合計	1,413,221,037	31,313,374

第6期(自平成19年11月7日至平成20年11月6日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,189,379,850	393,246,568
合計	1,189,379,850	393,246,568

## (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5期 平成19年11月6日現在		第6期 平成20年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.5896 円	1口当たり純資産額	1.1336 円
(1万口当たり純資産額)	(15,896 円)	(1万口当たり純資産額)	(11,336 円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

## (親投資信託受益証券)

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIX マザーファンド	848,691,332	562,682,353	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	246,010,956	187,681,758	
	日本債券インデックスマザーファンド	274,197,088	312,721,778	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	85,692,741	126,293,961	
合計		1,454,592,117	1,189,379,850	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成20年11月28日現在です。

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,198,676,178	円
負債総額	550,839	円
純資産総額( - )	1,198,125,339	円
発行済数量	1,115,609,841	口
1単位当たり純資産額( / )	1.0740	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	28,624,804,564	円
負債総額	197,991,951	円
純資産総額( - )	28,426,812,613	円
発行済数量	46,689,220,293	口
1単位当たり純資産額( / )	0.6089	円

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

## 純資産額計算書

資産総額	54,618,176,717	円
負債総額	410,009,469	円
純資産総額( - )	54,208,167,248	円
発行済数量	80,057,089,570	口
1単位当たり純資産額( / )	0.6771	円

## (参考)日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	33,238,432,533	円
負債総額	123,411,574	円
純資産総額( - )	33,115,020,959	円
発行済数量	28,910,373,506	口
1単位当たり純資産額( / )	1.1454	円

## (参考)海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	644,537,633,185	円
負債総額	427,002,073	円
純資産総額( - )	644,110,631,112	円
発行済数量	437,647,170,230	口
1単位当たり純資産額( / )	1.4718	円

## 第5【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間(2002年12月10日~2003年11月6日)	16,498,909	1,008,692
第2計算期間(2003年11月7日~2004年11月8日)	92,350,899	2,927,912
第3計算期間(2004年11月9日~2005年11月7日)	403,896,673	15,141,759
第4計算期間(2005年11月8日~2006年11月6日)	273,043,849	60,611,294
第5計算期間(2006年11月7日~2007年11月6日)	302,235,212	72,140,595
第6計算期間(2007年11月7日~2008年11月6日)	291,424,215	124,332,611

(注)第1計算期間の設定数量には、当初設定数量を含みます。

### 第三部【特別情報】

#### 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20年12月末現在	資本金	16,403,045,900円
	発行可能株式総数	220,000,000株
	発行済株式総数	185,012,500株

###### 過去5年間における主な資本金の増減

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

###### (2) 会社の意思決定機構

###### ・株主総会

取締役・監査役などの選任、定款変更などに係る決議などを行ないます。

毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年4月1日から3ヵ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

###### ・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

###### ・監査役会

4名以内の監査役で構成され、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の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することができます。

（平成20年12月末現在）

###### (3) 運用の意思決定プロセス

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用に関するリスク・パフォーマンスの評価と分析および法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理については、運用部門から独立したリスク管理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、精度の高い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20年12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	372	60,949
株式投資信託	291	47,452
単位型	42	892
追加型	249	46,560
公社債投資信託	81	13,496
単位型	64	1,093
追加型	17	12,403
投資法人合計	1	46



### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、第48期事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、旧「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）に基づいて、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正後の財務諸表等規則並びに同規則第2条の規定により、「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。  
また、第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）は、「企業内容等の開示に関する内閣府令等の一部を改正する内閣府令」（平成19年8月15日 内閣府令第65号）附則第9条第2項第1号のただし書きにより、改正後の財務諸表等規則を早期に適用しております。
2. 当社は、第48期事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）の財務諸表については旧証券取引法第193条の2の規定に基づき、また第49期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表については金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あらた監査法人により監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

		第48期 (平成19年3月31日)		第49期 (平成20年3月31日)	
区 分	注記 番号	金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(資産の部)					
流動資産					
1. 現金		0		-	
2. 預金		30,386		-	
3. 現金・預金		-		35,432	
4. 有価証券		-		337	
5. 支払委託金		157		-	
(1) 収益分配金	1	1		-	
(2) 償還金	156			-	
6. 前払費用		236		407	
7. 未収入金		89		7	
8. 未収委託者報酬		10,988		10,138	
9. 未収収益	4	778		712	
10. 立替金		379		190	
11. 繰延税金資産		1,462		1,901	
12. その他		30		30	
流動資産合計	3	44,510	69.9	49,158	76.4
固定資産					
1. 有形固定資産					
(1) 建物	1	55		843	
(2) 器具備品	1	222		548	
有形固定資産合計		278	0.4	1,391	2.2
2. 無形固定資産					
(1) ソフトウェア	2	171		109	
(2) 電話加入権等	2	22		21	
無形固定資産合計		193	0.3	131	0.2
3. 投資その他の資産					
(1) 投資有価証券		10,534		4,274	
(2) 関係会社株式		7,880		8,154	
(3) 関係会社長期貸付金		-		60	
(4) 長期差入保証金		870		1,062	
(5) 繰延税金資産		-		661	
(6) その他		4		2	
(7) 子会社投資損失引当金		576		576	
投資その他の資産合計		18,713	29.4	13,639	21.2
固定資産合計		19,185	30.1	15,162	23.6
資産合計		63,695	100.0	64,321	100.0

区 分	注記 番号	第48期 (平成19年3月31日)		第49期 (平成20年3月31日)	
		金額(百万円)	構成比 (%)	金額(百万円)	構成比 (%)
(負債の部)					
流動負債					
1. 預り金			90		150
2. 未払金			6,222		5,073
(1) 未払収益分配金		9		7	
(2) 未払償還金		1,059		353	
(3) 未払手数料		4,622		4,378	
(4) その他未払金		531		333	
3. 未払費用	4		7,206		6,697
4. 未払法人税等			3,603		5,651
5. 未払消費税等			771		424
6. 賞与引当金			2,406		2,855
7. 役員賞与引当金			265		320
8. その他			-		212
流動負債合計			20,565	32.3	21,384
固定負債					
1. 退職給付引当金			528		624
2. 繰延税金負債			880		-
3. その他			102		102
固定負債合計			1,511	2.4	727
負債合計			22,076	34.7	22,112
(純資産の部)					
株主資本					
1. 資本金			16,223	25.5	16,287
2. 資本剰余金					
(1) 資本準備金		4,092		4,157	
(2) その他資本剰余金		4		4	
資本剰余金合計			4,097	6.4	4,161
3. 利益剰余金					
その他利益剰余金					
繰越利益剰余金		20,616		21,660	
利益剰余金合計			20,616	32.3	21,660
株主資本合計			40,937	64.2	42,109
評価・換算差額等					
その他有価証券評価差額金			682	1.1	99
評価・換算差額等合計			682	1.1	99
純資産合計			41,619	65.3	42,208
負債純資産合計			63,695	100.0	64,321

## (2) 【損益計算書】

区 分	注記 番号	第48期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)		第49期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	
		金額(百万円)	百分比 (%)	金額(百万円)	百分比 (%)
営業収益					
1. 委託者報酬					
2. その他営業収益					
営業収益計		69,882		87,292	
		3,810		3,894	
		73,693	100.0	91,186	100.0
営業費用					
1. 支払手数料					
2. 広告宣伝費		29,319		36,598	
		3,163		4,770	
3. 公告費		27		42	
4. 受益証券発行費					
5. 調査費		78		13	
		14,809		17,679	
調査費	719			868	
委託調査費					
図書費	14,066			16,792	
	24			19	
6. 委託計算費		465		554	
7. 営業雑経費		1,077		1,002	
通信費	200			237	
印刷費					
協会費	581			430	
諸会費					
その他	38			44	
	9			9	
	247			280	
営業費用計		48,941	66.4	60,661	66.5
一般管理費					
1. 給料		6,948		8,005	

役員報酬	1	209			220		
役員賞与引当金繰入額							
給料・手当		265			320		
賞与		4,020			4,578		
賞与引当金繰入額		48			31		
		2,406			2,855		
2. 交際費			51			100	
3. 寄付金							
4. 旅費交通費			35			19	
			353			446	
5. 租税公課			327			341	
6. 不動産賃借料							
7. 退職給付費用			553			1,164	
			273			327	
8. 退職金			67			231	
9. 固定資産減価償却費							
10. 諸経費			292			446	
			3,353			3,806	
一般管理費計			12,257	16.6		14,890	16.3
営業利益			12,493	17.0		15,634	17.2
営業外収益							
1. 受取利息			0			1	
2. 受取配当金							
			273			63	
3. 時効成立分配金・償還金			622			689	
4. その他							
営業外収益計			35			71	
			931	1.2		826	0.9
営業外費用							
1. 支払利息			17			16	
2. 時効成立後支払分配金・償還金							
			116			90	
3. 弁護士報酬等			84			31	
4. その他							
営業外費用計			13			12	
			230	0.3		150	0.2
経常利益			13,194	17.9		16,310	17.9

		第48期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)			第49期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)		
区 分	注記 番号	金額(百万円)		百分比 (%)	金額(百万円)		百分比 (%)
特別利益							
1. 投資有価証券売却益			344			560	
2. 退職給付制度移行益			442			-	
特別利益計			786	1.1		560	0.6
特別損失							
1. 投資有価証券売却損			100			390	
2. 固定資産処分損			-			46	
3. 移転費用			160			110	
4. 関係会社株式評価損			-			2,618	
5. その他			20			7	
特別損失計			281	0.4		3,172	3.5
税引前当期純利益			13,699	18.6		13,697	15.0
法人税、住民税及び事業税		3,506			7,266		
法人税等調整額		133	3,639	4.9	1,581	5,685	6.2
当期純利益			10,060	13.7		8,012	8.8

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第48期（自平成18年4月1日至平成19年3月31日）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金合計
平成18年3月31日残高（百万円）	16,174	4,043	4	4,048
事業年度中の変動額				
新株の発行	48	48		48
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当事業年度中 の変動額（純額）				
事業年度中の変動額合計（百万円）	48	48	-	48
平成19年3月31日残高（百万円）	16,223	4,092	4	4,097

	株主資本		
	利益剰余金		株主資本合計
	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
平成18年3月31日残高（百万円）	11,836	11,836	32,059
事業年度中の変動額			
新株の発行			97
剰余金の配当	1,280	1,280	1,280
当期純利益	10,060	10,060	10,060
株主資本以外の項目の当事業年度中 の変動額（純額）			
事業年度中の変動額合計（百万円）	8,779	8,779	8,877
平成19年3月31日残高（百万円）	20,616	20,616	40,937

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
平成18年3月31日残高（百万円）	450	450	32,059
事業年度中の変動額			
新株の発行			97
剰余金の配当			1,280
当期純利益			10,060
株主資本以外の項目の当事業年度中 の変動額（純額）	231	231	231
事業年度中の変動額合計（百万円）	231	231	9,109
平成19年3月31日残高（百万円）	682	682	41,619

## 第49期（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金合計
平成19年3月31日残高（百万円）	16,223	4,092	4	4,097
事業年度中の変動額				
新株の発行	64	64		64
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当事業年度中 の変動額（純額）				
事業年度中の変動額合計（百万円）	64	64	-	64
平成20年3月31日残高（百万円）	16,287	4,157	4	4,161

	株主資本		
	利益剰余金		株主資本合計
	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
平成19年3月31日残高（百万円）	20,616	20,616	40,937
事業年度中の変動額			
新株の発行			129
剰余金の配当	6,969	6,969	6,969
当期純利益	8,012	8,012	8,012
株主資本以外の項目の当事業年度中 の変動額（純額）			
事業年度中の変動額合計（百万円）	1,043	1,043	1,172
平成20年3月31日残高（百万円）	21,660	21,660	42,109

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
平成19年3月31日残高（百万円）	682	682	41,619
事業年度中の変動額			
新株の発行			129
剰余金の配当			6,969
当期純利益			8,012
株主資本以外の項目の当事業年度中 の変動額（純額）	582	582	582
事業年度中の変動額合計（百万円）	582	582	589
平成20年3月31日残高（百万円）	99	99	42,208



## 重要な会計方針

	第48期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20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</p> <p>総平均法による原価法</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>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</p> <p>総平均法による原価法</p>	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式</p> <p>同左</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>同左</p> <p>時価のないもの</p> <p>同左</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。</p> <p>なお、主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>1年～7年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>1年～20年</td> </tr> </table> <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>	建物	1年～7年	器具備品	1年～20年	<p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法により償却しております。</p> <p>なお、主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>4年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4年～20年</td> </tr> </table> <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>	建物	4年	器具備品	4年～20年
建物	1年～7年									
器具備品	1年～20年									
建物	4年									
器具備品	4年～20年									

	(追加情報)	
	一部の有形固定資産については、平成19年8月末までに予定している事務所移転計画に基づき、使用可能期間を合理的に見積もり、耐用年数を短縮しております。この変更により、一般管理費は92百万円増加し、営業利益、経常利益、税引前当期純利益は同額減少し、当期純利益は55百万円減少しております。	
3. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金  従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。	(1) 賞与引当金  同左
	(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。	(2) 役員賞与引当金  同左

	第48期 (自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)
3. 引当金の計上基準	(3) 退職給付引当金  従業員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。	(3) 退職給付引当金  同左
4. リース取引の処理方法	(4) 子会社投資損失引当金  子会社株式の実質価額の低下による損失に備えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる額を計上しております。	(4) 子会社投資損失引当金  同左
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。  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。	同左  同左

会計処理方法の変更

第48期 (自 平成18年 4 月 1 日 至 平成19年 3 月31日)	第49期 (自 平成19年 4 月 1 日 至 平成20年 3 月31日)
<p>(貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等)</p> <p>当事業年度より、「貸借対照表の純資産の表示に関する会計基準」(企業会計基準第5号平成17年12月9日)及び「貸借対象表の純資産の部の表示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第8号平成17年12月9日)を適用しております。従来の資本の部の合計に相当する金額は41,619百万円であります。なお、財務諸表等規則の改正により、当事業年度における財務諸表の純資産の部については、改正後の財務諸表等規則により作成しております。</p> <p>(ストック・オプション等に関する会計基準等)</p> <p>当事業年度より、「ストック・オプション等に関する会計基準」(企業会計基準第8号平成17年12月27日)及び「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第11号平成18年5月31日)を適用しております。これによる財務諸表に与える影響はありません。</p>	<p>(固定資産の減価償却の方法)</p> <p>法人税法の改正(所得税法等の一部を改正する法律平成19年3月30日法律第6号)及び(法人税法施行令の一部を改正する政令平成19年3月30日政令第83号)に伴い、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得したもののについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。これにより、従来の方法によった場合に比べて、営業利益、経常利益、税金等調整前当期純利益が63百万円、当期純利益が37百万円それぞれ減少しております。</p>

## 表示方法の変更

第48期  (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期  (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
	「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)の別紙様式に基づき、前事業年度において「現金」及び「預金」として掲記されていたものは、当事業年度より「現金・預金」と表示しております。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

第48期(平成19年3月31日)	第49期(平成20年3月31日)
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1. 有形固定資産の減価償却累計額
建物                    107 百万円	建物                    166 百万円
器具備品                206 百万円	器具備品                210 百万円
2. 無形固定資産の減価償却累計額	2.
ソフトウェア                                265 百万円	
電話加入権等(電信電話専用権) 3 百万円	
3. 信託資産	3. 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、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。	その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。

<p>4. 関係会社に対する資産及び負債は次の通りであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 95 百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 427 百万円</p> <p>5. 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務213百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>4. 関係会社に対する資産及び負債は次の通りであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 77 百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 693 百万円</p> <p>5. 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。</p>
--	--

## (損益計算書関係)

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
<p>1. 役員報酬の範囲額</p> <p>取締役 年額 540 百万円以内</p> <p>監査役 年額 80 百万円以内</p>	<p>1.</p>

## (株主資本等変動計算書関係)

第48期（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末 株式数(株)	当事業年度増加株式数 (株)		当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数(株)
		第三者割 当	株式分割		
普通株式(注)	1,829,125	4,900	181,568,475		183,402,500

(注)平成18年10月18日開催の取締役会決議により、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的 となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		前事業 年度末	当事業年 度増加	当事業年 度減少	当事業 年度末	
平成16年度ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション(3)	普通株式	6,960,000	-	440,000	6,520,000	-
平成17年度ストックオプション	普通株式	3,680,000	-	230,000	3,450,000	-
平成18年度ストックオプション	普通株式	-	1,610,000	60,000	1,550,000	-
合計		22,640,000	1,610,000	730,000	23,520,000	-

- (注) 1. 平成16年度ストックオプション(1)のうち、6,000,000株は、権利行使期間の初日が到来しております。
2. 平成16年度ストックオプション(2)のうち、5,320,000株は、権利行使期間の初日が到来しております。
3. 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションは、権利行使期間の初日が到来しておりません。
4. 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションの減少は、新株予約権の失効によるものであります。
5. 平成18年度ストックオプションの増加は、新株予約権の発行によるものであります。
6. 平成18年10月18日開催の取締役会決議により、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。なお、新株予約権の目的となる株式の数は株式分割後の株式数に換算して記載しております。

## 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18年6月20日 定時株主総会	普通株式	1,280	700	平成18年3月31日	平成18年6月21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19年5月23日 取締役会	普通株式	利益剰余金	6,969	38	平成19年3月31日	平成19年6月21日

(注) 当社は、平成18年10月18日開催の取締役会決議により、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。分割後の株式数で計算した平成18年6月20日決議の、1株当たり配当額は7円であります。

第49期（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末	当事業年度	当事業年度	当事業年度末
	株式数(株)	増加株式数(株)	減少株式数(株)	株式数(株)
普通株式	183,402,500	645,000		184,047,500

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加645,000株は、第三者割当による新株の発行による増加であります。

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)			当事業年度末残高 (百万円)
			前事業年度末	当事業年度 増加	当事業年度 減少	



提出会社	平成16年度ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
	平成16年度ストックオプション(3)	普通株式	6,520,000	-	520,000	6,000,000	-
	平成17年度ストックオプション	普通株式	3,450,000	-	310,000	3,140,000	-
	平成18年度ストックオプション	普通株式	1,550,000	-	80,000	1,470,000	-
	平成19年度ストックオプション(1)	普通株式	-	4,250,000	110,000	4,140,000	-
	平成19年度ストックオプション(2)	普通株式	-	30,000	-	30,000	-
合計			23,520,000	4,280,000	1,020,000	26,780,000	-

- (注) 1. 平成16年度ストックオプション(1)及び平成16年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来しております。
2. 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来していません。
3. 平成16年度ストックオプション(3)、平成17年度ストックオプション、平成18年度ストックオプション及び平成19年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。
4. 平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成19年5月23日 取締役会	普通株式	6,969	38	平成19年3月31日	平成19年6月21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20年5月23日 取締役会	普通株式	利益剰余金	2,760	15	平成20年3月31日	平成20年6月10日

## (リース取引関係)

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)																		
<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引</p> <p>(1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <table border="1" data-bbox="188 658 774 958"> <thead> <tr> <th></th> <th>取得価額 相当額</th> <th>減価償却 累計額 相当額</th> <th>期末残高 相当額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>器具備品</td> <td>百万円 12</td> <td>百万円 7</td> <td>百万円 4</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 取得価額相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>(2) 未経過リース料期末残高相当額</p> <table data-bbox="236 1263 687 1447"> <tr> <td>1年内</td> <td>3百万円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td>0百万円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>4百万円</td> </tr> </table> <p>(注) 未経過リース料期末残高相当額は、未経過リース料期末残高が有形固定資産の期末残高等に占める割合が低いため、支払利子込み法により算定しております。</p> <p>(3) 支払リース料及び減価償却費相当額</p> <table data-bbox="236 1823 687 1935"> <tr> <td>支払リース料</td> <td>4百万円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>4百万円</td> </tr> </table>		取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	期末残高 相当額	器具備品	百万円 12	百万円 7	百万円 4	1年内	3百万円	1年超	0百万円	合計	4百万円	支払リース料	4百万円	減価償却費相当額	4百万円	<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引</p> <p>当事業年度中にリース契約が終了し、金額が僅少であるため、注記を省略しております。</p>
	取得価額 相当額	減価償却 累計額 相当額	期末残高 相当額																
器具備品	百万円 12	百万円 7	百万円 4																
1年内	3百万円																		
1年超	0百万円																		
合計	4百万円																		
支払リース料	4百万円																		
減価償却費相当額	4百万円																		

(4) 減価償却費相当額の算定方法			
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。			
2. オペレーティング・リース取引		2. オペレーティング・リース取引	
未経過リース料		未経過リース料	
1年内	1,145百万円	1年内 円	906百万
1年超	2,751百万円	1年超	1,849百万円
合計	3,896百万円	合計	2,755百万円

(有価証券関係)

第48期(自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)

## 1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位：百万円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	7	36	28
	その他	6,508	7,643	1,135
	小計	6,515	7,679	1,164
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	2,602	2,587	14
	小計	2,602	2,587	14
合計		9,117	10,267	1,150

(注) 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 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,827	316	100

## 3 時価評価されていない有価証券

## その他有価証券

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式 その他	167
投資証券	100
合計	267

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない株式20百万円につき、株式の実質価額の低下を考慮し、減損処理を行っております。

## 4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
その他有価証券 その他 投資信託	-	2,667	320	2,793
合計	-	2,667	320	2,793

## 5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	905	992	86
合計	905	992	86

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

## 1 その他有価証券で時価のあるもの

(単位:百万円)

	種類	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	7	27	19
	その他	2,667	3,071	403
	小計	2,675	3,098	423
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他	1,545	1,289	255
	小計	1,545	1,289	255
合計		4,220	4,388	167

(注) 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 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
8,079	560	390

## 3 時価評価されていない有価証券

## その他有価証券

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
非上場株式 その他 投資証券	124
合計	100
	224

(注) 当事業年度において、その他有価証券で時価評価されていない株式7百万円につき、株式の実質価額の低下を考慮し、減損処理を行っております。

## 4 その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
その他有価証券 その他 投資信託	337	1,078	792	1,112
合計	337	1,078	792	1,112

## 5 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
子会社株式	905	787	117
合計	905	787	117

## (持分法損益等)

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,201 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,519

## (退職給付関係)

第48期 (自 平成18年 4月 1日 至 平成19年 3月31日)	第49期 (自 平成19年 4月 1日 至 平成20年 3月31日)																																																				
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定拠出型企業年金制度、キャッシュバランスプラン型企業年金制度、適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <table border="0"> <tr> <td>イ. 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,459</td> </tr> <tr> <td>ロ. 年金資産</td> <td></td> </tr> <tr> <td>ハ. 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">728</td> </tr> <tr> <td>ニ. 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">730</td> </tr> <tr> <td>ホ. 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">202</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right;">528</td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <table border="0"> <tr> <td>イ. 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">70</td> </tr> <tr> <td>ロ. 利息費用</td> <td></td> </tr> <tr> <td>ハ. 期待運用収益</td> <td style="text-align: right;">27</td> </tr> <tr> <td>ニ. 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">4</td> </tr> <tr> <td>ホ. 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">26</td> </tr> <tr> <td>ヘ. 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">152</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right;">273</td> </tr> </table>	イ. 退職給付債務	1,459	ロ. 年金資産		ハ. 未積立退職給付債務	728	ニ. 未認識数理計算上の差異	730	ホ. 退職給付引当金残高	202		528	イ. 勤務費用	70	ロ. 利息費用		ハ. 期待運用収益	27	ニ. 数理計算上の差異の費用処理額	4	ホ. 確定拠出型企業年金への掛金	26	ヘ. 退職給付費用合計	152		273	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <table border="0"> <tr> <td>イ. 退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,502</td> </tr> <tr> <td>ロ. 年金資産</td> <td></td> </tr> <tr> <td>ハ. 未積立退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">688</td> </tr> <tr> <td>ニ. 未認識数理計算上の差異</td> <td style="text-align: right;">813</td> </tr> <tr> <td>ホ. 退職給付引当金残高</td> <td style="text-align: right;">188</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right;">624</td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <p style="text-align: right;">(単位：百万円)</p> <table border="0"> <tr> <td>イ. 勤務費用</td> <td style="text-align: right;">96</td> </tr> <tr> <td>ロ. 利息費用</td> <td></td> </tr> <tr> <td>ハ. 期待運用収益</td> <td style="text-align: right;">29</td> </tr> <tr> <td>ニ. 数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">5</td> </tr> <tr> <td>ホ. 確定拠出型企業年金への掛金</td> <td style="text-align: right;">32</td> </tr> <tr> <td>ヘ. 退職給付費用合計</td> <td style="text-align: right;">174</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right;">327</td> </tr> </table>	イ. 退職給付債務	1,502	ロ. 年金資産		ハ. 未積立退職給付債務	688	ニ. 未認識数理計算上の差異	813	ホ. 退職給付引当金残高	188		624	イ. 勤務費用	96	ロ. 利息費用		ハ. 期待運用収益	29	ニ. 数理計算上の差異の費用処理額	5	ホ. 確定拠出型企業年金への掛金	32	ヘ. 退職給付費用合計	174		327
イ. 退職給付債務	1,459																																																				
ロ. 年金資産																																																					
ハ. 未積立退職給付債務	728																																																				
ニ. 未認識数理計算上の差異	730																																																				
ホ. 退職給付引当金残高	202																																																				
	528																																																				
イ. 勤務費用	70																																																				
ロ. 利息費用																																																					
ハ. 期待運用収益	27																																																				
ニ. 数理計算上の差異の費用処理額	4																																																				
ホ. 確定拠出型企業年金への掛金	26																																																				
ヘ. 退職給付費用合計	152																																																				
	273																																																				
イ. 退職給付債務	1,502																																																				
ロ. 年金資産																																																					
ハ. 未積立退職給付債務	688																																																				
ニ. 未認識数理計算上の差異	813																																																				
ホ. 退職給付引当金残高	188																																																				
	624																																																				
イ. 勤務費用	96																																																				
ロ. 利息費用																																																					
ハ. 期待運用収益	29																																																				
ニ. 数理計算上の差異の費用処理額	5																																																				
ホ. 確定拠出型企業年金への掛金	32																																																				
ヘ. 退職給付費用合計	174																																																				
	327																																																				

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項		4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項	
イ. 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	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		ロ. 割引率	
ハ. 期待運用収益率	2.0%	ハ. 期待運用収益率	2.0%
ニ. 数理計算上の差異の処理年数	0.7%	ニ. 数理計算上の差異の処理年数	0.7%
	10年		10年

## (ストックオプション等関係)

第48期(自平成18年4月1日至平成19年3月31日)

## 1. スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社の取締役 1名	当社の取締役 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式6,070,000株	普通株式6,070,000株
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定条件	平成17年3月24日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年4月24日から平成19年3月24日まで各24日にそれぞれ170,000株の権利が確定	平成17年7月8日に1,990,000株の権利が確定し、その後同年8月8日から平成19年7月8日まで各8日にそれぞれ170,000株の権利が確定
対象勤務期間	平成16年8月31日から 平成19年3月23日まで	平成16年8月31日から 平成19年7月7日まで
権利行使期間	平成16年8月31日から 平成26年3月24日まで	平成16年8月31日から 平成26年7月8日まで
	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 97名	当社の従業員及び 関係会社の取締役・従業員 147名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式7,640,000株	普通株式3,710,000株
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定条件	上場がなされた日または平成18年6月24日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。	上場がなされた日または平成19年6月23日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1ずつ権利確定する。
対象勤務期間	それぞれの付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成18年6月24日から 平成26年6月23日まで	平成19年6月23日から 平成27年6月22日まで
	平成18年度ストックオプション	
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の従業員 115名	当社及び関係会社の従業員 11名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式1,270,000株	普通株式340,000株
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定条件	上場がなされた日または平成21年4月28日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の4分の1ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年4月28日から 平成28年4月27日まで	同左

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



(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況  
 ストックオプション(新株予約権)の数

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定前(株)		
期首	2,040,000	2,720,000
付与	0	0
失効	0	0
権利確定	2,040,000	2,040,000
権利未確定残	0	680,000
権利確定後(株)		
期首	3,960,000	3,280,000
権利確定	2,040,000	2,040,000
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	5,320,000
	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定前(株)		
期首	6,960,000	3,680,000
付与	0	0
失効	440,000	230,000
権利確定	0	0
権利未確定残	6,520,000	3,450,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		
	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	0	0
付与	1,270,000	340,000
失効	50,000	10,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,220,000	330,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

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

## 単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利行使価格(円)(注)1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注)2、3		
	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利行使価格(円)(注)1	15,823(分割後159)	17,666(分割後177)
付与日における公正な評価単価(円) (注)2、3		
	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利行使価格(円)(注)1	19,981(分割後200)	同左
付与日における公正な評価単価(円) (注)2、3		

(注)1. 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。

- 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち、平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 平成18年度ストックオプションのうち、平成18年7月18日付与ストックオプションについては、公正な評価単価に代え、本源的価値(当社株式評価額と行使価格との差額)の見積もりによっております。

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

## 1. ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

対象勤務期間	それぞれの付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成18年6月24日から 平成26年6月23日まで	平成19年6月23日から 平成27年6月22日まで
	平成18年度ストックオプション	
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の従業員115名	当社及び関係会社の従業員11名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)1	普通株式1,270,000株	普通株式340,000株
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定条件	上場がなされた日または平成21年4月28日のいずれか遅い日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から3年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の4分の1ずつ権利確定する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から3年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成21年4月28日から 平成28年4月27日まで	同左

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

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

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

	平成16年度ストックオプション (1)	平成16年度ストックオプション (2)
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利確定前(株)		
期首		680,000
付与		0
失効		0
権利確定		680,000
権利未確定残		0
権利確定後(株)		
期首	6,000,000	5,320,000
権利確定	0	680,000
権利行使	0	0
失効	0	0
権利未行使残	6,000,000	6,000,000
	平成16年度ストックオプション (3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利確定前(株)		
期首	6,520,000	3,450,000
付与	0	0
失効	520,000	310,000
権利確定	0	0
権利未確定残	6,000,000	3,140,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		
	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利確定前(株)		
期首	1,220,000	330,000
付与	0	0
失効	80,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,140,000	330,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

	平成19年度ストックオプション ( 1 )	平成19年度ストックオプション ( 2 )
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利確定前(株)		
期首	0	0
付与	4,250,000	30,000
失効	110,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	4,140,000	30,000
権利確定後(株)		
期首		
権利確定		
権利行使		
失効		
権利未行使残		

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

## 単価情報

	平成16年度ストックオプション(1)	平成16年度ストックオプション(2)
付与日	平成16年8月31日	平成16年8月31日
権利行使価格(円) (注)1	15,823(分割後159)	同左
付与日における公正な評価単価(円)(注)2、3		
	平成16年度ストックオプション(3)	平成17年度ストックオプション
付与日	平成17年1月11日、平成17年1月28日 平成17年5月24日、平成17年6月22日	平成18年2月14日
権利行使価格(円) (注)1	15,823(分割後159)	17,666(分割後177)
付与日における公正な評価単価(円)(注)2、3		
	平成18年度ストックオプション	
付与日	平成18年4月28日	平成18年7月18日
権利行使価格(円) (注)1	19,981(分割後200)	同左
付与日における公正な評価単価(円)(注)2、3		0
	平成19年度ストックオプション(1)	平成19年度ストックオプション(2)
付与日	平成19年7月27日	平成20年3月31日
権利行使価格(円) (注)1	450	同左
付与日における公正な評価単価(円)(注)2、3	0	0

(注)1. 株式数に換算して記載しております。なお当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。

- 平成16年度ストックオプション(1)(2)(3)、平成17年度ストックオプション及び平成18年度ストックオプションのうち平成18年4月28日付与ストックオプションについては、会社法の施行日前に付与されたストックオプションであるため、記載しておりません。
- 平成18年度ストックオプションのうち平成18年7月18日付与ストックオプション、平成19年度ストックオプション(1)及び平成19年度ストックオプション(2)については、公正な評価単価に代え、本源的価値(DCF法による評価額と行使価格との差額)の見積もりによっております。



## (税効果会計関係)

第48期(平成19年3月31日)		第49期(平成20年3月31日)	
1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	(単位:百万円)		(単位:百万円)
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	979	賞与引当金繰入超過額	1,161
未払事業税	285	未払事業税	551
その他	197	その他	188
	<u>1,462</u>		<u>1,901</u>
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
退職給付引当金超過額	214	退職給付引当金超過額	254
子会社投資損失引当金	234	子会社投資損失引当金	234
その他	154	その他	240
	<u>603</u>		<u>729</u>
繰延税金資産合計	<u>2,065</u>	繰延税金資産合計	<u>2,630</u>
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)	
その他有価証券評価差額金	467	その他有価証券評価差額金	68
法人税法上の子会社株式譲渡損	1,016	繰延税金負債合計	68
繰延税金負債合計	<u>1,484</u>		
繰延税金資産の純額	<u>581</u>	繰延税金資産の純額	<u>2,562</u>

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率 (調整)	40.6%
評価性引当額の影響等	14.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>26.6%</u>

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率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百分の五以下であるため注記を省略しております。

## ( 関連当事者情報 )

第48期(自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)

## ( 1 ) 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	日興コーポリアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1)	16,595	未払手数料	3,166

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第49期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

## ( 追加情報 )

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」(平成18年10月17日 企業会計基準委員会 企業会計基準第11号)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(平成18年10月17日 企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第13号)を早期に適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に加えて、親会社又は重要な関連会社に関する注記が開示対象に追加されております。

## 1. 関連当事者との取引

## ( 1 ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社を持つ会社	日興コーポリアル証券株式会社	東京都千代田区	100,000	証券業	なし	投資信託受益証券の募集販売	信託約款に定める受益者に対する収益分配金及び償還金の支払委託に係る代行手数料の支払(注1)	19,162	未払手数料	2,977

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

シティグループ・インク(ニューヨーク証券取引所等に上場)  
 シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社  
 株式会社日興コーディアルグループ

(注)平成20年5月1日、シティグループ・ジャパン・ホールディングス株式会社と株式会社日興コーディアルグループは合併し、日興シティホールディングス株式会社に名称変更しております。

## (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(ロンドン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下の通りであります。なお、下記数値は平成19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	8,817百万円
負債合計	2,727百万円
純資産合計	6,090百万円
営業収益	13,173百万円
税引前当期純利益	5,719百万円
当期純利益	4,873百万円

## (1 株当たり情報)

第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
1株当たり純資産額 226円92銭 1株当たり当期純利益 54円89銭	1株当たり純資産額 229円33銭 1株当たり当期純利益 43円54銭
<p>当社は、平成18年11月6日付けで、普通株式1株を100株とする株式分割を行っております。当該株式分割が平成17年4月1日に行われたと仮定した場合の前事業年度における1株当たり情報は、以下の通りであります。</p> <p>1株当たり純資産額 177円73銭 1株当たり当期純利益 22円97銭</p> <p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>	<p>なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、新株予約権の残高はありますが、非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。</p>

(注) 1株当たり当期純利益の算定上の基礎

	第48期 (自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)	第49期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,060	8,012
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)	10,060	8,012
普通株式の期中平均株式数(千株)	183,272	184,023
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3)6,520,000株、平成17年度ストックオプション3,450,000株、平成18年度ストックオプション1,550,000株。	平成16年度ストックオプション(1)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(2)6,000,000株、平成16年度ストックオプション(3)6,000,000株、平成17年度ストックオプション3,140,000株、平成18年度ストックオプション1,470,000株、平成19年度ストックオプション(1)4,140,000株、平成19年度ストックオプション(2)30,000株。

(重要な後発事象)

第48期(自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日)

## 1. 新株発行に対する払込

当社は、平成18年4月27日開催の臨時株主総会及び平成19年3月28日開催の取締役会にて、645,000株の第三者割当による当社普通株式の発行を決議いたしました。決済金額は期日に払込まれております。

割当先	日興アセットマネジメント社員持株会
発行価額	1株につき金200円
資本組入額	100円
払込期日	平成19年4月13日

## 2. 株式の取得

当社は、平成19年4月20日をもって中国の融通(ロンドン)基金管理有限公司株式の40%を取得いたしました。

主旨及び目的	事業の拡大
株式取得先	同社既存大株主からの譲受
会社名	融通(ロンドン)基金管理有限公司
事業内容	アセットマネジメント業

## 規模

平成18年12月31日現在

営業収益	1,959百万円
営業利益	356百万円
当期純利益	300百万円
総資産	2,379百万円
純資産	2,281百万円

## 3. 投資有価証券の繰上償還

当社が投資有価証券として保有しているPF日興・ピムコ・海外短期債券ファンド(適格機関投資家転売制限付)(2,585百万円 当事業年度末現在)が平成19年8月6日に繰上償還されることを、平成19年5月29日に金融庁に届出ております。

## 4. 新株予約権(ストックオプション)の発行

当社は、平成19年6月28日開催の第48期定時株主総会において、ストックオプションとして発行する新株予約権の募集事項の決定を当社取締役会に委任する決議をいたしました。

対象者	当社及び関係会社の取締役・従業員
新株予約権の数	430個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 4,300,000株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金450円
新株予約権の行使期間	募集事項を決定する取締役会決議日から2年を経過した日の翌日より8年以内。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が、募集事項を決定する取締役会決議日から5年を経過した日までに当社が株式公開しない場合には、当社は当該新株予約権を取得することができる。

第49期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

## 1. 新株発行に対する払込

当社は、平成20年6月9日開催の定時株主総会及び同日開催の取締役会にて、965,000株の第三者割当による当社普通株式の発行を決議いたしました。決済金額は期日に払込まれております。

割当先	日興アセットマネジメント社員持株会
発行価額	1株につき金239円
資本組入額	1株につき金119円50銭
払込期日	平成20年6月23日

1. 当社の中間財務諸表は、改正後の「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という。)並びに同規則第38条及び第57条に基づき、改正後の「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
  
2. 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第50期中間会計期間(平成20年4月1日から平成20年9月30日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。



## 中間財務諸表等

## ( 1 ) 中間貸借対照表

( 単位 : 百万円 )

第50期中間会計期間末

( 平成20年 9 月30日現在 )

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金	30,012	
有価証券	924	
未収委託者報酬	8,318	
未収収益	1,266	
その他	2	1,328

---

流動資産合計	41,851	
--------	--------	--

---

## 固定資産

有形固定資産	1	1,035
無形固定資産	113	
投資その他の資産		
投資有価証券	1,792	
関係会社株式	8,154	
長期差入保証金	1,037	
繰延税金資産	1,021	
その他	60	

子会社投資損失引当	576	
-----------	-----	--

金

---

投資その他の資産合計	11,490	
------------	--------	--

---

固定資産合計	12,640	
--------	--------	--

---

資産合計	54,491	
------	--------	--

---

(単位：百万円)

## 第50期中間会計期間末

(平成20年9月30日現在)

負債の部	
流動負債	
未払金	4,598
未払費用	6,024
未払法人税等	405
未払消費税等	77
賞与引当金	893
役員賞与引当金	135
その他	98
流動負債合計	12,233
固定負債	
退職給付引当金	654
その他	102
固定負債合計	757
負債合計	12,990
純資産の部	
株主資本	
資本金	16,403
資本剰余金	
資本準備金	4,272
その他資本剰余金	4
資本剰余金合計	4,277
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	20,901
利益剰余金合計	20,901
株主資本合計	41,581
評価・換算差額等	
金  金	
金	
その他有価証券評価差額	80
評価・換算差額等合計	80
純資産合計	41,500
負債純資産合計	54,491

## ( 2 ) 中間損益計算書

( 単位 : 百万円 )

## 第50期中間会計期間

( 自 平成20年 4 月 1 日

至 平成20年 9 月30日)

営業収益		
委託者報酬	34,178	
その他営業収益	1,588	
営業収益合計	35,766	
営業費用及び一般管理費	1	32,320
営業利益	3,446	
営業外収益	2	394
営業外費用	3	71
経常利益	3,769	
特別利益	4	38
特別損失	5	361
税引前中間純利益	3,447	
法人税、住民税及び事業 税	390	
法人税等調整額	1,055	
中間純利益	2,002	

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:百万円)

## 第50期中間会計期間

(自 平成20年4月1日

至 平成20年9月30日)

株主資本	
資本金	
前期末残高	16,287
当中間期変動額	
新株の発行	115
当中間期変動額合計	115
当中間期末残高	16,403
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	4,157
当中間期変動額	
新株の発行	115
当中間期変動額合計	115
当中間期末残高	4,272
その他資本剰余金	
前期末残高	4
当中間期末残高	4
資本剰余金合計	
前期末残高	4,161
当中間期変動額	
新株の発行	115
当中間期変動額合計	115
当中間期末残高	4,277
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
前期末残高	21,660
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,760
中間純利益	2,002
当中間期変動額合計	758
当中間期末残高	20,901
利益剰余金合計	
前期末残高	21,660
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,760
中間純利益	2,002
当中間期変動額合計	758
当中間期末残高	20,901
株主資本合計	
前期末残高	42,109
当中間期変動額	

新株の発行	230
剰余金の配当	2,760
中間純利益	<u>2,002</u>
当中間期変動額合計	<u>528</u>
当中間期末残高	<u>41,581</u>
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	99
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>180</u>
当中間期変動額合計	<u>180</u>
当中間期末残高	<u>80</u>
評価・換算差額等合計	
前期末残高	99
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>180</u>
当中間期変動額合計	<u>180</u>
当中間期末残高	<u>80</u>
純資産合計	
前期末残高	42,208
当中間期変動額	
新株の発行	230
剰余金の配当	2,760
中間純利益	2,002
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	<u>180</u>
当中間期変動額合計	<u>708</u>
当中間期末残高	<u>41,500</u>

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第50期中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>其他有価証券 時価のあるもの 中間決算末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、 売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。但し、ソフトウェア (自社利用分)については、社内における利用可 能期間(5年)に基づく定額法によっておりま す。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支 給見込額に基づき、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、支給 見込額に基づき、当中間会計期間負担額を計上し ております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末 における退職給付債務及び年金資産の見込額に 基づき、当中間会計期間末において発生してい ると認められる額を計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時に おける従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年 数(10年)で按分した額をそれぞれ発生翌事 業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 子会社投資損失引当金 子会社株式の実質価額の低下による損失に備 えて、純資産価額等を勘案して必要と認められる 額を計上しております。</p>
4 その他中間財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理について 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式に よっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期 間の費用として処理しております。</p>

## 中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項の変更

## 第50期中間会計期間

(自 平成20年 4月 1日

至 平成20年 9月30日)

該当事項はありません。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

## 第50期中間会計期間末

(平成20年 9月30日現在)

1. 有形固定資産の減価償却累計額  
752 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、日興シティ信託銀行株式会社に信託しております。
3. 保証債務  
当社は、Nikko Asset Management Europe Limited がロンドンウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務107百万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50期中間会計期間

(自 平成20年 4月 1日

至 平成20年 9月30日)

- |                 |         |
|-----------------|---------|
| 1 減価償却実施額       |         |
| 有形固定資産          | 375 百万円 |
| 無形固定資産          | 29 百万円  |
| 2 営業外収益のうち主要なもの |         |
| 受取利息            | 1 百万円   |
| 受取配当金           | 6 百万円   |
| 時効成立分配金・償還金     | 98 百万円  |
| 有価証券売却益         | 156 百万円 |
| 有価証券償還益         | 42 百万円  |
| 3 営業外費用のうち主要なもの |         |
| 支払利息            | 7 百万円   |
| 時効成立後支払分配金・償還金  | 24 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       | 38 百万円  |
| 5 特別損失のうち主要なもの  |         |
| 投資有価証券売却損       | 111 百万円 |
| 投資有価証券評価損       | 249 百万円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第50期中間会計期間（自平成20年4月1日至平成20年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末	当中間会計期間	当中間会計期間	当中間会計期間
	株式数(株)	増加株式数 (株)	減少株式数 (株)	末 株式数(株)
普通株式(注)	184,047,500	965,000		185,012,500

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計 期間末残高 (百万円)
		前事業年度末	当中間会 計	当中間会 計	当中間会 計	
			期間増加	期間減少	期間末	
平成16年度ストックオプション(1)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション(2)	普通株式	6,000,000	-	-	6,000,000	-
平成16年度ストックオプション(3)	普通株式	6,000,000	-	270,000	5,730,000	-
平成17年度ストックオプション	普通株式	3,140,000	-	150,000	2,990,000	-
平成18年度ストックオプション	普通株式	1,470,000	-	40,000	1,430,000	-
平成19年度ストックオプション(1)	普通株式	4,140,000	-	60,000	4,080,000	-
平成19年度ストックオプション(2)	普通株式	30,000	-	-	30,000	-
合計		26,780,000	-	520,000	26,260,000	-

(注) 1. 平成16年度ストックオプション(1)のうち、6,000,000株は、権利行使期間の初日が到来しております。

2. 平成16年度ストックオプション(2)のうち、6,000,000株は、権利行使期間の初日が到来しております。

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額



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

(2) 基準日が当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50期中間会計期間	
(自 平成20年 4月 1日	
至 平成20年 9月30日)	
1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 該当事項はありません。	
2. オペレーティング・リース取引	
未経過リース料	
1年内	906 百万円
1年超	1,394 百万円
合計	2,300 百万円

## (有価証券関係)

第50期中間会計期間末（平成20年 9月30日現在）

## 1 その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価 (百万円)	中間貸借対照表 計上額(百万円)	差額 (百万円)
株式	7	20	13
その他	2,624	2,474	149
合 計	2,631	2,495	136

(注) 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。当中間会計期末においてはその他投資有価証券について、249百万円の減損処理を行っております。

## 2 子会社株式及び関連会社株式で時価のあるもの

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
子会社株式	905	655	249
合 計	905	655	249

## 3 時価評価されていない主な有価証券の内容

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
子会社株式	3,780
関連会社株式	2,892
その他有価証券	
非上場株式	121
その他	100

## (持分法損益等)

第50期中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位:百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	2,892
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	5,046
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	665

## (ストックオプション等関係)

第50期中間会計期間(自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第50期中間会計期間	
(自 平成20年4月1日	
至 平成20年9月30日)	
1株当たり純資産額	224円31銭
1株当たり中間純利益	10円84銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、新株予約権の残高はありますが、非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので希薄化効果を算定できないため、記載しておりません。</p>	

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	第50期中間会計期間 (自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)
中間純利益 (百万円)	2,002
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-
普通株式に係る中間純利益 (百万円)	2,002
普通株式の期中平均株式数 (千株)	184,569
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成16年度ストックオプション(1) 6,000,000株 平成16年度ストックオプション(2) 6,000,000株 平成16年度ストックオプション(3) 5,730,000株 平成17年度ストックオプション 2,990,000株 平成18年度ストックオプション 1,430,000株 平成19年度ストックオプション(1) 4,080,000株 平成19年度ストックオプション(2) 30,000株

## (重要な後発事象)

第50期中間会計期間(自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成20年9月末現在)	事業の内容
日興シティ信託銀行株式会社	20,000百万円	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20年9月末現在)	事業の内容
損保ジャパンDC証券株式会社	11,500百万円	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。
株式会社みずほコーポレート銀行	1,070,965百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
住友信託銀行株式会社	287,537百万円	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	200,000百万円 (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	40,000百万円 (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

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成20年2月6日	有価証券報告書
平成20年2月6日	有価証券届出書
平成20年8月6日	半期報告書
平成20年8月6日	有価証券届出書の訂正届出書

（参考）

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

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

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### （1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成19年11月6日現在	平成20年11月6日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		201,898,019	255,480,659
株式		40,575,448,000	29,517,119,890
派生商品評価勘定		2,553,431	19,633,151
未収入金		-	839,448,741
未収配当金		221,614,160	316,827,696
差入委託証拠金		4,790,700	-
流動資産合計		41,006,304,310	30,948,510,137
資産合計		41,006,304,310	30,948,510,137
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,457,107	31,519,244
前受金		520,000	21,805,000
未払金		103,074,130	41,041,039
未払解約金		55,847,722	109,931,733
流動負債合計		161,898,959	204,297,016
負債合計		161,898,959	204,297,016
純資産の部			
元本等			
元本		36,305,326,892	46,368,777,336
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,539,078,459	15,624,564,215
元本等合計		40,844,405,351	30,744,213,121
純資産合計		40,844,405,351	30,744,213,121
負債純資産合計		41,006,304,310	30,948,510,137

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>	<p>デリバティブ取引 同左</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日に、当該金額を計上しております。ただし、平成19年6月30日以前については、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額の90%を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>	<p>受取配当金の計上基準 -</p>



## (貸借対照表に関する注記)

平成19年11月6日現在		平成20年11月6日現在	
1. 期首	平成18年11月7日	1. 期首	平成19年11月7日
期首元本額	7,906,584,859 円	期首元本額	36,305,326,892 円
期首からの追加設定元本額	29,793,831,663 円	期首からの追加設定元本額	21,517,588,795 円
期首からの解約元本額	1,395,089,630 円	期首からの解約元本額	11,454,138,351 円
平成19年11月6日現在の元本の内訳		平成20年11月6日現在の元本の内訳	
DCインデックスバラン ス(株式20)	72,755,610 円	DCインデックスバラン ス(株式20)	130,094,957 円
DCインデックスバラン ス(株式40)	284,206,858 円	DCインデックスバラン ス(株式40)	456,892,914 円
DCインデックスバラン ス(株式60)	586,276,838 円	DCインデックスバラン ス(株式60)	848,691,332 円
DCインデックスバラン ス(株式80)	714,785,307 円	DCインデックスバラン ス(株式80)	925,513,079 円
インデックスファンド日 本株式(DC専用)	616,371,057 円	インデックスファンド日本 株式(DC専用)	839,582,725 円
世界の財産3分法ファン ド(不動産・債券・株 式)毎月分配型	24,093,596,166 円	世界の財産3分法ファン ド(不動産・債券・株式)毎 月分配型	24,790,349,074 円
グローバルコレクション (債券/株式/不動産・資 源・食料等)隔月分配 型	25,234,466 円	グローバルコレクション (債券/株式/不動産・資 源・食料等)隔月分配型	26,559,699 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)	2,507,469 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	8,036,872 円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式80)	165,782,518 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)	120,433,651 円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式60)	122,241,579 円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式80)	172,559,272 円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式40)	213,648,945 円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式60)	158,589,479 円
アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式20)	314,154,581 円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式40)	291,004,311 円
国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	5,295,049,193 円	アセット・ナビゲーショ ン・ファンド(株式20)	452,039,218 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)	1,102,926,023 円	国際分散型ファンド40(適 格機関投資家向け)	13,503,919,078 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)	58,451,536 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)	166,834,000 円
3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	650,269,990 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)	144,434,133 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド (株式20)	164,011,850 円	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	540,110,396 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド (株式40)	450,516,355 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド(株 式20)	281,815,031 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド (株式60)	657,546,926 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド(株 式40)	719,873,459 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド (株式80)	714,993,625 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド(株 式60)	908,197,928 円
(合計)	36,305,326,892 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーショ ン・ファンド(株 式80)	883,246,728 円

2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	36,305,326,892	□	(合計)	46,368,777,336	円
3.	担保資産			2.	本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	46,368,777,336
	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通りであります。			3.	元本の欠損	
	株式	6,913,000	円		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,624,564,215円であります。	
				4.	担保資産	
					デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。	
					株式	152,045,000
					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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	40,575,448,000	4,818,182
合計	40,575,448,000	4,818,182

対象期間（自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	29,517,119,890	5,159,203,089
合計	29,517,119,890	5,159,203,089

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引および金利先渡取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左

取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左
--------------	---	----

## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位：円)

区分	種類	平成19年11月6日現在			
		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	267,655,000	-	267,835,000	180,000
合計		267,655,000	-	267,835,000	180,000

(単位：円)

区分	種類	平成20年11月6日現在			
		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	434,510,000	-	422,765,000	11,745,000
合計		434,510,000	-	422,765,000	11,745,000

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成19年11月6日現在		平成20年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.1250 円	1口当たり純資産額	0.6630 円
(1万口当たり純資産額)	(11,250 円)	(1万口当たり純資産額)	(6,630 円)

[次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:株,円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
1301	極洋	12,000	204	2,448,000
1332	日本水産	32,900	238	7,830,200
1334	マルハニチロホールディングス	52,000	154	8,008,000
1352	ハウスイ	2,000	90	180,000
1377	サカタのタネ	5,200	1,528	7,945,600
1379	ホクト	2,600	2,405	6,253,000
1414	ショーボンドホールディングス	2,800	1,794	5,023,200
1514	住石ホールディングス	7,900	117	924,300
1515	日鉄鉱業	7,000	299	2,093,000
1518	三井松島産業	9,000	169	1,521,000
1605	国際石油開発帝石	130	599,000	77,870,000
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	611	1,833,000
1662	石油資源開発	4,100	4,170	17,097,000
1712	ダイセキ環境ソリューション	2	189,700	379,400
1719	ハザマ	11,900	87	1,035,300
1720	東急建設	10,130	236	2,390,680
1721	コムシスホールディングス	14,000	690	9,660,000
1722	ミサワホーム	3,400	298	1,013,200
1762	高松コンストラクショングループ	2,200	1,439	3,165,800
1766	東建コーポレーション	960	2,235	2,145,600
1780	ヤマウラ	1,500	111	166,500
1786	オリエンタル白石	2,600	140	364,000
1801	大成建設	126,000	226	28,476,000
1802	大林組	80,000	469	37,520,000
1803	清水建設	81,000	467	37,827,000
1808	長谷工コーポレーション	143,500	95	13,632,500
1810	松井建設	3,000	267	801,000
1812	鹿島	117,000	269	31,473,000
1813	不動テトラ	20,200	52	1,050,400
1814	大未建設	10,000	31	310,000
1815	鉄建	14,000	104	1,456,000
1816	安藤建設	9,000	142	1,278,000
1819	太平工業	3,000	294	882,000
1820	西松建設	33,000	201	6,633,000
1821	三井住友建設	15,100	67	1,011,700
1822	大豊建設	8,000	59	472,000
1824	前田建設工業	17,000	249	4,233,000
1826	佐田建設	11,000	37	407,000
1827	ナカノフドー建設	2,500	149	372,500
1833	奥村組	27,000	398	10,746,000
1834	大和小田急建設	1,500	167	250,500
1835	東鉄工業	3,000	580	1,740,000
1852	浅沼組	8,000	62	496,000
1860	戸田建設	31,000	349	10,819,000
1861	熊谷組	17,000	47	799,000
1865	青木あすなろ建設	2,000	455	910,000
1866	北野建設	6,000	201	1,206,000
1867	植木組	4,000	92	368,000
1868	三井ホーム	4,000	440	1,760,000
1870	矢作建設工業	3,000	384	1,152,000

1871	ピーエス三菱	1,800	174	313,200	
1872	アゼル	7,000	18	126,000	
1878	大東建託	12,700	4,030	51,181,000	
1879	新日本建設	3,900	84	327,600	
1881	N I P P Oコーポレーション	6,000	567	3,402,000	
1882	東亜道路工業	6,000	99	594,000	
1883	前田道路	8,000	731	5,848,000	
1884	日本道路	9,000	110	990,000	
1885	東亜建設工業	25,000	126	3,150,000	
1888	若築建設	16,000	43	688,000	
1889	あおみ建設	18,000	30	540,000	
1890	東洋建設	37,000	39	1,443,000	
1893	五洋建設	33,000	106	3,498,000	
1895	大成ロテック	5,000	136	680,000	
1896	大林道路	4,000	133	532,000	
1899	福田組	4,000	193	772,000	
1907	東北ミサワホーム	1,400	115	161,000	
1911	住友林業	19,600	601	11,779,600	
1914	日本基礎技術	3,700	242	895,400	
1916	日成ビルド工業	9,000	58	522,000	
1919	エス・パイ・エル	15,000	43	645,000	
1921	巴コーポレーション	3,900	154	600,600	
1924	パナホーム	11,000	541	5,951,000	
1925	大和ハウス工業	71,000	794	56,374,000	
1926	ライト工業	6,000	173	1,038,000	
1928	積水ハウス	80,000	890	71,200,000	
1929	日特建設	8,000	34	272,000	
1930	北陸電気工事	2,000	330	660,000	
1932	コミュニチュア	2,000	550	1,100,000	
1934	ユアテック	5,000	440	2,200,000	
1937	西部電気工業	2,000	398	796,000	
1939	四電工	3,000	490	1,470,000	
1941	中電工	4,100	1,519	6,227,900	
1942	関電工	13,000	551	7,163,000	
1943	大明	4,000	750	3,000,000	
1944	きんでん	17,000	858	14,586,000	
1945	東京エネシス	3,000	567	1,701,000	
1946	トーエネック	4,000	460	1,840,000	
1949	住友電設	2,300	559	1,285,700	
1950	日本電設工業	6,000	852	5,112,000	
1951	協和エクシオ	10,000	962	9,620,000	
1952	新日本空調	2,200	785	1,727,000	
1954	日本工営	9,000	217	1,953,000	
1955	東電通	4,000	165	660,000	
1956	日本電話施設	5,000	266	1,330,000	
1959	九電工	5,000	747	3,735,000	
1961	三機工業	7,000	685	4,795,000	
1963	日揮	29,000	1,115	32,335,000	
1964	中外炉工業	10,000	273	2,730,000	
1967	ヤマト	3,000	237	711,000	
1968	太平電業	4,000	835	3,340,000	
1969	高砂熱学工業	8,000	941	7,528,000	
1970	日立プラントテクノロジー	8,000	256	2,048,000	
1972	三晃金属工業	3,000	238	714,000	
1973	N E C ネットエスアイ	2,400	1,210	2,904,000	
1975	朝日工業社	3,000	317	951,000	
1978	アタカ大機	2,000	190	380,000	
1979	大気社	4,100	1,364	5,592,400	
1980	ダイダン	4,000	415	1,660,000	

1982	日比谷総合設備	4,000	791	3,164,000	
1983	東芝プラントシステム	5,000	792	3,960,000	
2001	日本製粉	18,000	447	8,046,000	
2002	日清製粉グループ本社	26,000	1,052	27,352,000	
2003	日東富士製粉	2,000	283	566,000	
2004	昭和産業	13,000	276	3,588,000	
2009	鳥越製粉	2,500	789	1,972,500	
2051	日本農産工業	7,000	187	1,309,000	
2052	協同飼料	10,000	110	1,100,000	
2053	中部飼料	3,000	530	1,590,000	
2056	日本配合飼料	8,000	104	832,000	
2059	ユニ・チャーム ペットケア	1,600	3,120	4,992,000	
2107	東洋精糖	5,000	111	555,000	
2108	日本甜菜製糖	16,000	213	3,408,000	
2109	三井製糖	11,000	358	3,938,000	
2127	日本M&Aセンター	4	364,000	1,456,000	
2131	アコーディア・ゴルフ	66	68,200	4,501,200	
2168	パソナグループ	26	67,600	1,757,600	
2181	テンプホールディングス	3,100	610	1,891,000	
2201	森永製菓	30,000	197	5,910,000	
2202	明治製菓	43,000	405	17,415,000	
2204	中村屋	7,000	492	3,444,000	
2206	江崎グリコ	10,000	987	9,870,000	
2207	名糖産業	1,200	1,975	2,370,000	
2211	不二家	15,000	124	1,860,000	
2212	山崎製パン	19,000	1,331	25,289,000	
2215	第一屋製パン	4,000	102	408,000	
2217	モロゾフ	4,000	308	1,232,000	
2261	明治乳業	34,000	454	15,436,000	
2262	雪印乳業	31,500	371	11,686,500	
2264	森永乳業	24,000	331	7,944,000	
2267	ヤクルト本社	15,300	2,430	37,179,000	
2281	プリマハム	16,000	193	3,088,000	
2282	日本ハム	22,000	1,283	28,226,000	
2284	伊藤ハム	18,000	328	5,904,000	
2286	林兼産業	9,000	80	720,000	
2288	丸大食品	12,000	247	2,964,000	
2290	米久	3,000	1,107	3,321,000	
2292	S F O O D S	1,500	735	1,102,500	
2301	学情	1,100	399	438,900	
2305	スタジオアリス	1,200	1,178	1,413,600	
2309	シミック	40	25,180	1,007,200	
2317	システムプロ	17	41,700	708,900	
2322	N E C フィールディング	2,100	1,036	2,175,600	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,700	1,175	1,997,500	
2331	総合警備保障	8,900	1,026	9,131,400	
2353	日本駐車場開発	272	3,590	976,480	
2359	コア	1,000	576	576,000	
2371	カカクコム	21	312,000	6,552,000	
2372	アイロムホールディングス	59	4,780	282,020	
2378	ルネサンス	1,400	402	562,800	
2392	セキュアード・キャピタル・ジャパン	9	50,600	455,400	
2395	新日本科学	1,000	1,121	1,121,000	
2413	ソネット・エムスリー	12	310,000	3,720,000	
2432	ディー・エヌ・エー	35	237,100	8,298,500	
2433	博報堂D Yホールディングス	3,690	4,850	17,896,500	
2450	一休	20	40,900	818,000	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	39,200	156,800	

2462	ジェイコム	3	147,900	443,700	
2466	パシフィックゴルフグループイン ターナショナルホールディングス	65	48,300	3,139,500	
2501	サッポロホールディングス	40,000	549	21,960,000	
2502	アサヒビール	53,500	1,652	88,382,000	
2503	キリンホールディングス	117,000	1,121	131,157,000	
2531	宝ホールディングス	24,000	469	11,256,000	
2533	オエノンホールディングス	8,000	262	2,096,000	
2536	メルシャン	9,000	217	1,953,000	
2540	養命酒製造	2,000	910	1,820,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	3,800	936	3,556,800	
2578	四国コカ・コーラボトリング	1,300	808	1,050,400	
2579	コカ・コーラウエストホールディン グス	8,800	2,020	17,776,000	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	6	643,000	3,858,000	
2590	ダイトードリンコ	1,300	2,505	3,256,500	
2593	伊藤園	7,900	1,617	12,774,300	
2594	キーコーヒー	2,300	1,580	3,634,000	
2597	ユニカフェ	700	1,197	837,900	
2599	ジャパンフーズ	400	800	320,000	
2602	日清オイリオグループ	12,000	490	5,880,000	
2607	不二製油	7,600	1,201	9,127,600	
2613	J・オイルミルズ	11,000	407	4,477,000	
2651	ローソン	7,900	5,160	40,764,000	
2657	インターニックス	1,000	283	283,000	
2659	サンエー	1,000	2,970	2,970,000	
2660	キリン堂	1,000	455	455,000	
2662	ダイユーエイト	400	649	259,600	
2664	カワチ薬品	1,800	1,511	2,719,800	
2670	エービーシー・マート	2,700	2,990	8,073,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,100	361	397,100	
2676	高千穂交易	1,100	1,070	1,177,000	
2678	アスクル	2,400	1,600	3,840,000	
2681	ゲオ	46	67,800	3,118,800	
2685	ポイント	2,260	4,870	11,006,200	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	129	258,000	
2692	伊藤忠食品	600	3,220	1,932,000	
2695	くらコーポレーション	7	135,500	948,500	
2698	キャンドゥ	11	82,100	903,100	
2715	高千穂電気	1,600	848	1,356,800	
2726	パル	650	691	449,150	
2729	JALUX	700	1,360	952,000	
2730	エディオン	10,000	696	6,960,000	
2734	サーラコーポレーション	2,500	529	1,322,500	
2737	トーマンデバイス	300	1,051	315,300	
2738	パルス	14	120,000	1,680,000	
2753	あみやき亭	5	135,000	675,000	
2768	双日	156,100	165	25,756,500	
2784	アルフレッサ ホールディングス	5,000	4,200	21,000,000	
2792	ハニーズ	1,990	710	1,412,900	
2794	クリエイトエス・ディー	900	1,540	1,386,000	
2801	キッコーマン	25,000	947	23,675,000	
2802	味の素	77,000	902	69,454,000	
2809	キュービー	14,700	1,129	16,596,300	
2810	ハウス食品	10,500	1,529	16,054,500	
2811	カゴメ	11,000	1,622	17,842,000	
2812	焼津水産化学工業	1,500	1,034	1,551,000	
2815	アリアケジャパン	2,300	1,668	3,836,400	
2871	ニチレイ	32,000	405	12,960,000	

2874	ヨコレイ	6,000	665	3,990,000	
2875	東洋水産	11,000	2,615	28,765,000	
2897	日清食品ホールディングス	9,100	2,970	27,027,000	
2899	永谷園	2,000	840	1,680,000	
2908	フジッコ	3,000	1,234	3,702,000	
2910	ロック・フィールド	1,300	1,163	1,511,900	
2914	J T	633	352,000	222,816,000	
2918	わらべや日洋	1,500	1,343	2,014,500	
2922	なとり	1,200	765	918,000	
3001	片倉工業	3,100	935	2,898,500	
3002	グンゼ	20,000	338	6,760,000	
3003	昭栄	4,200	1,052	4,418,400	
3004	神栄	3,000	150	450,000	
3009	川島織物セルコン	10,000	63	630,000	
3022	山下医科器械	200	1,090	218,000	
3023	ラサ商事	1,100	418	459,800	
3028	アルペン	1,900	1,882	3,575,800	
3048	ビックカメラ	69	30,200	2,083,800	
3050	D C M Japanホールディングス	12,600	756	9,525,600	
3076	あい ホールディングス	6,300	289	1,820,700	
3086	J.フロント リテイリング	64,000	405	25,920,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,600	1,664	5,990,400	
3088	マツモトキヨシホールディングス	4,700	1,998	9,390,600	
3098	ココカラファイン ホールディングス	1,400	1,125	1,575,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	46,000	883	40,618,000	
3101	東洋紡	88,000	138	12,144,000	
3103	ユニチカ	60,000	68	4,080,000	
3104	富士紡ホールディングス	11,000	92	1,012,000	
3105	日清紡	19,000	636	12,084,000	
3106	クラボウ	27,000	136	3,672,000	
3107	ダイワボウ	17,000	248	4,216,000	
3109	シキボウ	17,000	98	1,666,000	
3110	日東紡	26,000	165	4,290,000	
3116	トヨタ紡織	8,900	917	8,161,300	
3201	日本毛織	9,000	728	6,552,000	
3202	大東紡織	4,000	59	236,000	
3204	トーア紡コーポレーション	10,000	67	670,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,600	1,114	4,010,400	
3216	御幸ホールディングス	3,000	204	612,000	
3225	東京建物不動産販売	1,100	324	356,400	
3231	野村不動産ホールディングス	7,100	2,020	14,342,000	
3302	帝国繊維	3,000	343	1,029,000	
3313	ブックオフコーポレーション	1,400	695	973,000	
3315	三井鉱山	16,500	197	3,250,500	
3321	ミタチ産業	500	493	246,500	
3332	J F E 商事ホールディングス	17,000	295	5,015,000	
3333	あさひ	400	1,688	675,200	
3337	サークルKサンクス	6,100	1,792	10,931,200	
3341	日本調剤	450	1,327	597,150	
3349	コスモス薬品	1,100	1,153	1,268,300	
3360	グリーンホスピタルサプライ	24	39,450	946,800	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	100,400	2,935	294,674,000	
3391	ツルハホールディングス	1,700	2,665	4,530,500	
3395	サンマルクホールディングス	800	2,635	2,108,000	
3396	フェリシモ	700	2,085	1,459,500	
3401	帝人	109,000	260	28,340,000	
3402	東レ	177,000	477	84,429,000	
3404	三菱レイヨン	66,000	218	14,388,000	
3405	クラレ	39,500	784	30,968,000	



3407	旭化成	167,000	407	67,969,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	93	744,000	
3421	稲葉製作所	1,300	1,114	1,448,200	
3431	宮地エンジニアリンググループ	8,000	58	464,000	
3432	三協・立山ホールディングス	33,000	96	3,168,000	
3433	トーカロ	1,600	1,119	1,790,400	
3434	アルファCo	900	598	538,200	
3436	SUMCO	14,300	1,100	15,730,000	
3501	住江織物	7,000	151	1,057,000	
3512	日本フェルト	1,500	428	642,000	
3513	イチカワ	2,000	283	566,000	
3514	日本バイリーン	4,000	434	1,736,000	
3524	日東製網	3,000	81	243,000	
3526	芦森工業	6,000	118	708,000	
3529	アツギ	25,000	109	2,725,000	
3551	ダイニック	5,000	131	655,000	
3553	共和レザー	1,600	479	766,400	
3569	セーレン	6,700	502	3,363,400	
3577	東海染工	4,000	80	320,000	
3580	小松精練	4,000	386	1,544,000	
3591	ワコールホールディングス	16,000	1,131	18,096,000	
3593	ホギメディカル	1,300	5,180	6,734,000	
3605	サンエー・インターナショナル	1,100	1,047	1,151,700	
3606	レナウン	4,500	173	778,500	
3607	クラウドディア	300	1,011	303,300	
3626	ITホールディングス	8,200	1,160	9,512,000	
3708	特種東海ホールディングス	18,000	261	4,698,000	
3715	ドワンゴ	13	108,000	1,404,000	
3724	ベリサーブ	1	119,900	119,900	
3730	マクロミル	10	102,300	1,023,000	
3738	ティーガイア	20	91,000	1,820,000	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	4	78,200	312,800	
3774	インターネットイニシアティブ	15	113,500	1,702,500	
3789	ソネットエンタテインメント	14	207,000	2,898,000	
3817	SRAホールディングス	1,200	739	886,800	
3820	JBISホールディングス	2,900	382	1,107,800	
3834	朝日ネット	2,000	234	468,000	
3861	王子製紙	110,000	407	44,770,000	
3864	三菱製紙	38,000	141	5,358,000	
3865	北越製紙	15,500	375	5,812,500	
3877	中越パルプ工業	10,000	173	1,730,000	
3878	巴川製紙所	4,000	147	588,000	
3880	大王製紙	11,000	837	9,207,000	
3882	紀州製紙	9,000	104	936,000	
3893	日本製紙グループ本社	124	300,000	37,200,000	
3941	レンゴー	21,000	520	10,920,000	
3946	トーモク	9,000	170	1,530,000	
3950	ザ・パック	1,700	1,207	2,051,900	
4003	コープケミカル	4,000	199	796,000	
4004	昭和電工	138,000	156	21,528,000	
4005	住友化学	197,000	321	63,237,000	
4007	日本化成	5,000	127	635,000	
4008	住友精化	5,000	269	1,345,000	
4021	日産化学工業	19,000	784	14,896,000	
4022	ラサ工業	11,000	146	1,606,000	
4023	クレハ	18,000	467	8,406,000	
4027	テイカ	5,000	226	1,130,000	
4028	石原産業	41,000	88	3,608,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	313	626,000	

4041	日本曹達	16,000	257	4,112,000	
4042	東ソー	71,000	197	13,987,000	
4043	トクヤマ	33,000	518	17,094,000	
4044	セントラル硝子	27,000	313	8,451,000	
4045	東亜合成	29,000	220	6,380,000	
4046	ダイソー	11,000	272	2,992,000	
4047	関東電化工業	6,000	266	1,596,000	
4061	電気化学工業	56,000	207	11,592,000	
4062	イビデン	17,900	1,830	32,757,000	
4063	信越化学工業	44,400	4,620	205,128,000	
4064	日本カーバイド工業	6,000	81	486,000	
4078	堺化学工業	9,000	258	2,322,000	
4088	エア・ウォーター	19,000	959	18,221,000	
4091	大陽日酸	42,000	738	30,996,000	
4092	日本化学工業	9,000	193	1,737,000	
4095	日本パーカライジング	6,000	1,209	7,254,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	524	2,096,000	
4099	四国化成工業	4,000	363	1,452,000	
4100	戸田工業	4,000	227	908,000	
4109	ステラ ケミファ	1,300	1,302	1,692,600	
4112	保土谷化学工業	7,000	166	1,162,000	
4114	日本触媒	18,000	557	10,026,000	
4116	大日精化工業	9,000	262	2,358,000	
4118	カネカ	33,000	472	15,576,000	
4151	協和発酵キリン	37,000	820	30,340,000	
4182	三菱ガス化学	46,000	398	18,308,000	
4183	三井化学	82,000	373	30,586,000	
4185	J S R	24,300	1,173	28,503,900	
4186	東京応化工業	5,300	1,457	7,722,100	
4188	三菱ケミカルホールディングス	155,000	409	63,395,000	
4201	日本合成化学工業	7,000	228	1,596,000	
4202	ダイセル化学工業	35,000	398	13,930,000	
4203	住友ベークライト	27,000	383	10,341,000	
4204	積水化学工業	60,000	576	34,560,000	
4205	日本ゼオン	23,000	295	6,785,000	
4206	アイカ工業	8,300	980	8,134,000	
4208	宇部興産	112,000	211	23,632,000	
4212	積水樹脂	4,000	678	2,712,000	
4215	タキロン	6,000	282	1,692,000	
4216	旭有機材工業	9,000	279	2,511,000	
4217	日立化成工業	11,500	1,041	11,971,500	
4218	ニチバン	3,000	325	975,000	
4220	リケンテクノス	5,000	203	1,015,000	
4221	大倉工業	6,000	233	1,398,000	
4228	積水化成成品工業	7,000	277	1,939,000	
4229	群栄化学工業	7,000	202	1,414,000	
4231	タイガースポリマー	1,300	430	559,000	
4271	日本カーリット	2,100	372	781,200	
4272	日本化薬	20,000	444	8,880,000	
4282	イーピーエス	7	411,000	2,877,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステムズ	500	1,907	953,500	
4295	フェイス	104	4,350	452,400	
4301	アミューズ	600	1,083	649,800	
4307	野村総合研究所	12,400	1,777	22,034,800	
4310	ドリームインキュベータ	8	66,700	533,600	
4312	サイバネットシステム	21	36,000	756,000	
4319	T A C	1,300	311	404,300	
4321	ケネディクス	71	16,430	1,166,530	

4324	電通	264	161,700	42,688,800	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	72	4,190	301,680	
4337	ぴあ	600	1,102	661,200	
4340	シンプレクス・テクノロジー	42	32,100	1,348,200	
4343	イオンファンタジー	900	689	620,100	
4344	ソースネクスト	2	59,500	119,000	
4362	日本精化	2,200	419	921,800	
4401	A D E K A	11,500	663	7,624,500	
4403	日油	24,000	282	6,768,000	
4404	ミヨシ油脂	9,000	128	1,152,000	
4410	ハリマ化成	2,000	430	860,000	
4452	花王	68,000	2,975	202,300,000	
4461	第一工業製薬	5,000	165	825,000	
4471	三洋化成工業	8,000	497	3,976,000	
4502	武田薬品工業	96,700	4,810	465,127,000	代用有価証券 5,000株
4503	アステラス製薬	59,800	3,990	238,602,000	
4506	大日本住友製薬	19,000	765	14,535,000	
4507	塩野義製薬	39,000	1,766	68,874,000	
4508	田辺三菱製薬	27,000	1,079	29,133,000	
4512	わかもと製薬	3,000	337	1,011,000	
4514	あすか製薬	3,000	803	2,409,000	

[次へ](#)

(単位:株、円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
4516	日本新薬	7,000	1,052	7,364,000
4519	中外製薬	35,400	1,424	50,409,600
4521	科研製薬	11,000	844	9,284,000
4523	エーザイ	32,800	3,210	105,288,000
4527	ロート製薬	12,000	1,140	13,680,000
4528	小野薬品工業	13,400	4,750	63,650,000
4530	久光製薬	8,300	4,030	33,449,000
4531	有機合成薬品工業	2,000	473	946,000
4534	持田製薬	11,000	1,019	11,209,000
4535	大正製薬	25,000	1,842	46,050,000
4536	参天製薬	8,300	2,850	23,655,000
4537	エスエス製薬	7,000	574	4,018,000
4538	扶桑薬品工業	9,000	280	2,520,000
4539	日本ケミファ	4,000	317	1,268,000
4540	ツムラ	7,800	2,710	21,138,000
4543	テルモ	18,400	4,210	77,464,000
4544	みらかホールディングス	5,300	1,730	9,169,000
4547	キッセイ薬品工業	5,000	2,230	11,150,000
4548	生化学工業	5,100	923	4,707,300
4549	栄研化学	1,700	605	1,028,500
4550	日水製薬	1,100	723	795,300
4551	鳥居薬品	1,600	1,399	2,238,400
4553	東和薬品	1,100	3,270	3,597,000
4555	沢井製薬	1,700	4,190	7,123,000
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,046	4,184,000
4568	第一三共	78,500	1,835	144,047,500
4569	キョーリン	7,000	1,084	7,588,000
4611	大日本塗料	15,000	103	1,545,000
4612	日本ペイント	29,000	371	10,759,000
4613	関西ペイント	30,000	519	15,570,000
4614	トウペ	2,000	82	164,000
4617	中国塗料	8,000	526	4,208,000
4619	日本特殊塗料	2,000	362	724,000
4620	藤倉化成	3,100	522	1,618,200
4626	太陽インキ製造	2,000	1,701	3,402,000
4631	D I C	88,000	160	14,080,000
4633	サカタインクス	6,000	258	1,548,000
4634	東洋インキ製造	26,000	274	7,124,000
4641	アルプス技研	1,200	896	1,075,200
4651	サニックス	3,900	132	514,800
4653	ダイオーズ	500	388	194,000
4658	日本空調サービス	600	603	361,800
4661	オリエンタルランド	7,500	7,280	54,600,000
4665	ダスキン	8,000	1,602	12,816,000
4666	パーク24	15,200	442	6,718,400
4668	明光ネットワークジャパン	2,500	414	1,035,000
4671	ファルコバイオシステムズ	1,500	720	1,080,000
4674	クレスコ	400	911	364,400
4676	フジ・メディア・ホールディングス	262	130,400	34,164,800
4678	秀英予備校	600	330	198,000
4679	田谷	400	644	257,600
4680	ラウンドワン	40	52,300	2,092,000
4681	リゾートトラスト	4,500	998	4,491,000
4684	オービック	790	13,460	10,633,400

4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	600	701	420,600	
4689	ヤフー	1,876	34,750	65,191,000	
4694	ピー・エム・エル	1,400	1,860	2,604,000	
4696	ワタベウェディング	800	959	767,200	
4704	トレンドマイクロ	12,000	2,655	31,860,000	
4708	もしもしホットライン	1,950	1,965	3,831,750	
4711	東急コミュニティー	700	1,396	977,200	
4714	リソー教育	270	3,600	972,000	
4716	日本オラクル	4,000	4,680	18,720,000	
4719	アルファシステムズ	700	2,055	1,438,500	
4722	フューチャーアーキテクト	30	48,550	1,456,500	
4724	シチエ	700	460	322,000	
4725	シーエーシー	1,400	820	1,148,000	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	506	303,600	
4728	トーセ	600	745	447,000	
4732	ユー・エス・エス	3,620	6,500	23,530,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	800	4,380	3,504,000	
4738	日立ビジネスソリューション	800	525	420,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	3,100	2,435	7,548,500	
4743	アイティフォー	2,800	260	728,000	
4745	東京個別指導学院	2,100	138	289,800	
4746	東計電算	500	1,220	610,000	
4756	カルチュア・コンビニエンス・クラブ	12,200	583	7,112,600	
4762	エックスネット	3	86,200	258,600	
4767	テー・オー・ダブリュー	500	510	255,000	
4768	大塚商会	2,000	5,010	10,020,000	
4775	総合メディカル	600	2,880	1,728,000	
4776	サイボウズ	37	19,600	725,200	
4779	ソフトブレーン	37	2,520	93,240	
4799	アグレックス	500	753	376,500	
4801	セントラルスポーツ	700	877	613,900	
4812	I S I D	1,800	602	1,083,600	
4825	ウェザーニューズ	800	1,236	988,800	
4826	C I J	2,500	342	855,000	
4848	フルキャストホールディングス	22	8,300	182,600	
4901	富士フイルムホールディングス	65,100	2,350	152,985,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	67,000	727	48,709,000	
4911	資生堂	46,000	1,997	91,862,000	
4912	ライオン	31,000	603	18,693,000	
4914	高砂香料工業	9,000	476	4,284,000	
4917	マンダム	2,700	2,695	7,276,500	
4919	ミルボン	1,100	2,360	2,596,000	
4921	ファンケル	5,000	1,225	6,125,000	
4922	コーセー	4,300	2,880	12,384,000	
4924	ドクターシーラボ	18	168,000	3,024,000	
4951	エステー	1,900	1,201	2,281,900	
4956	コニシ	2,100	790	1,659,000	
4958	長谷川香料	3,100	1,387	4,299,700	
4967	小林製薬	3,700	3,280	12,136,000	
4968	荒川化学工業	2,200	1,001	2,202,200	
4971	メック	1,800	484	871,200	
4973	日本高純度化学	7	206,700	1,446,900	
4975	荏原ユージライト	300	1,705	511,500	
4985	アース製薬	2,100	2,700	5,670,000	
4989	イハラケミカル工業	5,000	264	1,320,000	
4992	北興化学工業	3,000	303	909,000	
4994	大成ラミック	800	2,190	1,752,000	

4996	クミアイ化学工業	7,000	297	2,079,000	
4997	日本農業	6,000	576	3,456,000	
5001	新日本石油	185,000	390	72,150,000	
5002	昭和シェル石油	20,900	769	16,072,100	
5007	コスモ石油	74,000	224	16,576,000	
5009	富士興産	10,000	76	760,000	
5011	ニチレキ	3,000	250	750,000	
5012	東燃ゼネラル石油	40,000	868	34,720,000	
5013	ユシロ化学工業	1,300	1,551	2,016,300	
5015	ビービー・カストロール	900	225	202,500	
5016	新日鉱ホールディングス	110,000	293	32,230,000	
5017	AOCホールディングス	6,200	577	3,577,400	
5019	出光興産	3,200	6,050	19,360,000	
5101	横浜ゴム	32,000	498	15,936,000	
5105	東洋ゴム工業	27,000	246	6,642,000	
5108	ブリヂストン	83,600	1,655	138,358,000	
5110	住友ゴム工業	22,900	797	18,251,300	
5121	藤倉ゴム工業	1,700	331	562,700	
5122	オカモト	11,000	336	3,696,000	
5142	アキレス	22,000	130	2,860,000	
5185	フコク	1,300	595	773,500	
5186	ニッタ	2,400	1,339	3,213,600	
5187	クリエートメディック	800	796	636,800	
5191	東海ゴム工業	4,900	893	4,375,700	
5192	三ツ星ベルト	8,000	408	3,264,000	
5195	バンドー化学	10,000	253	2,530,000	
5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	149	894,000	
5201	旭硝子	131,000	600	78,600,000	
5202	日本板硝子	85,000	369	31,365,000	
5204	石塚硝子	4,000	148	592,000	
5208	有沢製作所	3,600	345	1,242,000	
5210	日本山村硝子	12,000	206	2,472,000	
5214	日本電気硝子	43,000	649	27,907,000	
5218	オハラ	1,200	981	1,177,200	
5232	住友大阪セメント	51,000	151	7,701,000	
5233	太平洋セメント	105,000	116	12,180,000	
5234	デイ・シイ	2,200	230	506,000	
5261	リゾートソリューション	2,000	211	422,000	
5262	日本ヒューム	2,000	259	518,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	92	368,000	
5301	東海カーボン	23,000	585	13,455,000	
5302	日本カーボン	13,000	277	3,601,000	
5310	東洋炭素	1,100	4,780	5,258,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	14,000	293	4,102,000	
5332	TOTO	41,000	634	25,994,000	
5333	日本ガイシ	32,000	1,147	36,704,000	
5334	日本特殊陶業	24,000	897	21,528,000	
5337	ダントーホールディングス	4,000	93	372,000	
5344	MARUWA	800	1,031	824,800	
5345	日本セラテック	5	46,000	230,000	
5351	品川白煉瓦	7,000	199	1,393,000	
5352	黒崎播磨	7,000	166	1,162,000	
5363	TYK	3,000	210	630,000	
5367	ニッカトー	1,000	463	463,000	
5384	フジインコーポレーテッド	2,700	1,106	2,986,200	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	65	390,000	
5393	ニチアス	13,000	222	2,886,000	
5401	新日本製鐵	700,000	331	231,700,000	
5405	住友金属工業	456,000	259	118,104,000	

5406	神戸製鋼所	370,000	161	59,570,000	
5407	日新製鋼	102,000	135	13,770,000	
5408	中山製鋼所	15,000	264	3,960,000	
5410	合同製鐵	16,000	276	4,416,000	
5411	J F Eホールディングス	68,100	2,645	180,124,500	
5423	東京製鐵	11,000	821	9,031,000	
5440	共英製鋼	2,100	1,230	2,583,000	
5444	大和工業	6,300	2,340	14,742,000	
5445	東京鐵鋼	5,000	246	1,230,000	
5449	大阪製鐵	1,700	1,154	1,961,800	
5451	淀川製鋼所	20,000	452	9,040,000	
5453	東洋鋼鈑	6,000	305	1,830,000	
5457	住友鋼管	1,800	664	1,195,200	
5463	丸一鋼管	7,400	2,265	16,761,000	
5464	モリ工業	5,000	200	1,000,000	
5471	大同特殊鋼	41,000	338	13,858,000	
5476	日本高周波鋼業	11,000	96	1,056,000	
5479	日本金属工業	18,000	129	2,322,000	
5480	日本冶金工業	14,500	267	3,871,500	
5481	山陽特殊製鋼	13,000	298	3,874,000	
5482	愛知製鋼	14,000	376	5,264,000	
5486	日立金属	17,000	735	12,495,000	
5491	日本金属	7,000	142	994,000	
5541	大平洋金属	19,000	430	8,170,000	
5563	日本電工	10,000	466	4,660,000	
5602	栗本鐵工所	12,000	80	960,000	
5606	旭テック	8,000	39	312,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	122	366,000	
5631	日本製鋼所	38,000	900	34,200,000	
5632	三菱製鋼	16,000	256	4,096,000	
5658	日亜鋼業	4,000	264	1,056,000	
5659	日本精線	2,000	247	494,000	
5701	日本軽金属	65,000	98	6,370,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	175	700,000	
5706	三井金属	77,000	189	14,553,000	
5707	東邦亜鉛	14,000	205	2,870,000	
5711	三菱マテリアル	162,000	235	38,070,000	
5713	住友金属鉱山	69,000	756	52,164,000	
5714	D O W Aホールディングス	34,000	300	10,200,000	
5715	古河機械金属	45,000	98	4,410,000	
5721	エス・サイエンス	129,000	6	774,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,600	2,460	6,396,000	
5727	東邦チタニウム	4,300	1,114	4,790,200	
5738	住友軽金属工業	38,000	86	3,268,000	
5741	古河スカイ	12,000	217	2,604,000	
5801	古河電気工業	84,000	314	26,376,000	
5802	住友電気工業	87,900	809	71,111,100	
5803	フジクラ	40,000	277	11,080,000	
5804	三菱電線工業	17,000	94	1,598,000	
5805	昭和電線ホールディングス	32,000	87	2,784,000	
5809	タツタ電線	6,000	249	1,494,000	
5812	日立電線	21,000	210	4,410,000	
5815	沖電線	3,000	144	432,000	
5819	カナレ電気	300	1,010	303,000	
5821	平河ヒューテック	800	1,285	1,028,000	
5851	リョービ	16,000	214	3,424,000	
5855	アサヒプリテック	3,700	1,255	4,643,500	
5901	東洋製罐	20,500	1,249	25,604,500	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	238	1,428,000	

5909	コロナ	1,200	951	1,141,200	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	667	3,335,000	
5913	松尾橋梁	4,000	71	284,000	
5915	駒井鉄工	4,000	143	572,000	
5929	三和ホールディングス	27,000	346	9,342,000	
5930	文化シャッター	7,000	381	2,667,000	
5931	川田工業	7,000	99	693,000	
5936	東洋シャッター	600	622	373,200	
5938	住生活グループ	32,200	1,293	41,634,600	
5942	日本フィルコン	1,900	494	938,600	
5943	ノーリツ	4,400	1,005	4,422,000	
5946	長府製作所	2,800	2,095	5,866,000	
5947	リンナイ	5,200	3,750	19,500,000	
5949	ユニプレス	3,500	817	2,859,500	
5951	ダイニチ工業	1,500	588	882,000	
5957	日東精工	4,000	298	1,192,000	
5958	三洋工業	4,000	148	592,000	
5959	岡部	5,200	410	2,132,000	
5963	日立ツール	1,500	879	1,318,500	
5974	中国工業	4,000	99	396,000	
5975	東ブレ	5,500	822	4,521,000	
5976	ネツレン	3,900	647	2,523,300	
5981	東京製綱	19,000	179	3,401,000	
5988	パイオラックス	1,100	1,528	1,680,800	
5991	ニッパツ	17,000	410	6,970,000	
5992	中央発條	4,000	337	1,348,000	
5998	アドバネクス	5,000	93	465,000	
6005	三浦工業	4,000	2,165	8,660,000	
6013	タクマ	11,000	219	2,409,000	
6101	ツガミ	8,000	200	1,600,000	
6103	オークマ	16,000	487	7,792,000	
6104	東芝機械	15,000	314	4,710,000	
6113	アマダ	42,000	469	19,698,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,900	366	2,525,400	
6135	牧野フライス製作所	12,000	283	3,396,000	
6136	O S G	11,000	723	7,953,000	
6138	ダイジェット工業	3,000	183	549,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	7,000	538	3,766,000	
6141	森精機製作所	11,500	857	9,855,500	
6146	ディスコ	2,400	2,545	6,108,000	
6151	日東工器	1,600	1,869	2,990,400	
6201	豊田自動織機	20,600	2,365	48,719,000	
6203	豊和工業	15,000	64	960,000	
6205	O K K	9,000	109	981,000	
6208	石川製作所	6,000	52	312,000	
6210	東洋機械金属	1,700	199	338,300	
6213	オーエム製作所	2,000	448	896,000	
6217	津田駒工業	7,000	103	721,000	
6218	エンシュウ	7,000	85	595,000	
6222	島精機製作所	3,200	1,736	5,555,200	
6242	日本スピンドル製造	4,000	162	648,000	
6247	日阪製作所	3,000	1,133	3,399,000	
6262	ペガサスミシン製造	2,300	194	446,200	
6268	ナブテスコ	11,000	685	7,535,000	
6269	三井海洋開発	1,800	1,610	2,898,000	
6272	レオン自動機	3,000	257	771,000	
6273	S M C	7,900	9,200	72,680,000	
6274	新川	2,400	1,131	2,714,400	
6277	ホソカワミクロン	4,000	392	1,568,000	



6278	ユニオンツール	1,500	2,230	3,345,000	
6282	オイレス工業	3,100	1,185	3,673,500	
6287	サトー	2,800	1,123	3,144,400	
6291	日本エアータック	800	389	311,200	
6293	日精樹脂工業	2,100	259	543,900	
6298	ワイエイシイ	1,200	464	556,800	
6301	コマツ	118,500	1,175	139,237,500	
6302	住友重機械工業	67,000	340	22,780,000	
6305	日立建機	13,600	1,181	16,061,600	
6306	日工	4,000	228	912,000	
6309	巴工業	1,000	925	925,000	
6310	井関農機	27,000	167	4,509,000	
6313	共立	6,000	158	948,000	
6315	T O W A	2,400	261	626,400	
6316	丸山製作所	6,000	152	912,000	
6317	北川鉄工所	12,000	133	1,596,000	
6319	シンニッタ	2,300	415	954,500	
6326	クボタ	122,000	489	59,658,000	
6328	荏原実業	600	1,000	600,000	
6330	東洋エンジニアリング	17,000	295	5,015,000	
6331	三菱化工機	8,000	210	1,680,000	
6332	月島機械	4,000	732	2,928,000	
6333	帝国電機製作所	1,000	1,239	1,239,000	
6335	東京機械製作所	8,000	215	1,720,000	
6339	新東工業	5,400	641	3,461,400	
6340	澁谷工業	1,500	791	1,186,500	
6345	アイチコーポレーション	4,400	371	1,632,400	
6349	小森コーポレーション	7,600	1,088	8,268,800	
6351	鶴見製作所	2,000	686	1,372,000	
6355	住友精密工業	5,000	383	1,915,000	
6358	酒井重工業	5,000	145	725,000	
6361	荏原	57,000	210	11,970,000	
6362	石井鐵工所	4,000	130	520,000	
6363	西島製作所	2,400	1,336	3,206,400	
6366	千代田化工建設	23,000	541	12,443,000	
6367	ダイキン工業	27,800	2,270	63,106,000	
6368	オルガノ	4,000	615	2,460,000	
6369	トーヨーカネツ	17,000	122	2,074,000	
6370	栗田工業	14,700	2,650	38,955,000	
6371	椿本チエイン	14,000	283	3,962,000	
6373	大同工業	5,000	176	880,000	
6374	T C M	7,000	130	910,000	
6375	日本コンベヤ	9,000	74	666,000	
6376	日機装	8,000	522	4,176,000	
6378	木村化工機	2,500	675	1,687,500	
6379	新興プランテック	4,800	804	3,859,200	
6381	アネスト岩田	5,000	347	1,735,000	
6383	ダイフク	10,500	556	5,838,000	
6390	加藤製作所	6,000	244	1,464,000	
6393	油研工業	5,000	184	920,000	
6395	タダノ	12,000	448	5,376,000	
6406	フジテック	7,000	314	2,198,000	
6407	C K D	7,100	337	2,392,700	
6409	キトー	6	84,200	505,200	
6412	平和	6,900	668	4,609,200	
6413	理想科学工業	2,100	890	1,869,000	
6417	S A N K Y O	6,900	4,690	32,361,000	
6418	日本金銭機械	2,800	803	2,248,400	
6419	マースエンジニアリング	1,200	2,225	2,670,000	

6420	福島工業	800	757	605,600	
6421	キヤノンファインテック	2,300	952	2,189,600	
6428	オーイズミ	900	211	189,900	
6430	ダイコク電機	1,100	1,082	1,190,200	
6436	アマノ	7,700	672	5,174,400	
6440	J U K I	13,000	140	1,820,000	
6444	サンデン	15,000	295	4,425,000	
6445	蛇の目ミシン工業	25,000	48	1,200,000	
6448	ブラザー工業	30,700	729	22,380,300	
6454	マックス	4,000	977	3,908,000	
6455	モリタホールディングス	4,000	393	1,572,000	
6457	グローリー	8,100	1,501	12,158,100	
6459	大和冷機工業	4,000	276	1,104,000	
6460	セガサミーホールディングス	29,100	961	27,965,100	
6461	日本ピストンリング	10,000	108	1,080,000	
6462	リケン	12,000	267	3,204,000	
6463	T P R	3,100	448	1,388,800	
6470	大豊工業	2,000	605	1,210,000	
6471	日本精工	52,000	428	22,256,000	
6472	N T N	45,000	362	16,290,000	
6473	ジェイテクト	25,400	820	20,828,000	
6474	不二越	26,000	216	5,616,000	
6479	ミネベア	38,000	314	11,932,000	
6480	日本トムソン	8,000	460	3,680,000	
6481	T H K	15,900	1,421	22,593,900	
6482	ユーシン精機	1,100	1,228	1,350,800	
6485	前澤給装工業	1,000	1,215	1,215,000	
6486	イーグル工業	3,000	337	1,011,000	
6489	前澤工業	2,100	210	441,000	
6490	日本ピラー工業	3,000	359	1,077,000	
6498	キット	11,000	357	3,927,000	
6501	日立製作所	426,000	485	206,610,000	
6502	東芝	384,000	368	141,312,000	
6503	三菱電機	238,000	615	146,370,000	
6504	富士電機ホールディングス	59,000	138	8,142,000	
6505	東洋電機製造	5,000	455	2,275,000	
6506	安川電機	28,000	454	12,712,000	
6507	神鋼電機	16,000	253	4,048,000	
6508	明電舎	23,000	154	3,542,000	
6513	オリジン電気	4,000	371	1,484,000	
6517	デンヨー	2,600	632	1,643,200	
6581	日立工機	8,800	760	6,688,000	
6584	三桜工業	3,200	489	1,564,800	
6586	マキタ	15,900	2,030	32,277,000	

[次へ](#)

(単位:株、円)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
6588	東芝テック	18,000	303	5,454,000	
6590	芝浦メカトロニクス	4,000	396	1,584,000	
6592	マブチモーター	4,000	4,030	16,120,000	
6594	日本電産	12,600	5,180	65,268,000	
6621	高岳製作所	10,000	116	1,160,000	
6622	ダイヘン	13,000	240	3,120,000	
6632	JVC・ケンウッド・ホールディングス	94,800	53	5,024,400	
6641	日新電機	5,000	364	1,820,000	
6644	大崎電気工業	4,000	475	1,900,000	
6645	オムロン	30,300	1,411	42,753,300	
6651	日東工業	3,800	877	3,332,600	
6652	I D E C	3,300	1,002	3,306,600	
6665	エルピーダメモリ	11,300	630	7,119,000	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	41,000	323	13,243,000	
6675	サクサホールディングス	7,000	130	910,000	
6676	メルコホールディングス	1,500	1,050	1,575,000	
6678	テクノメディカ	2	217,000	434,000	
6701	N E C	257,000	300	77,100,000	
6702	富士通	262,000	431	112,922,000	
6703	O K I	81,000	77	6,237,000	
6704	岩崎通信機	11,000	92	1,012,000	
6706	電気興業	7,000	629	4,403,000	
6707	サンケン電気	15,000	381	5,715,000	
6708	エプソントヨコム	9,000	193	1,737,000	
6715	ナカヨ通信機	3,000	146	438,000	
6718	アイホン	1,800	1,632	2,937,600	
6723	N E C エレクトロニクス	4,900	1,261	6,178,900	
6724	セイコーエプソン	18,600	1,476	27,453,600	
6727	ワコム	50	100,200	5,010,000	
6728	アルバック	4,100	1,934	7,929,400	
6731	ピクセラ	1,000	156	156,000	
6737	ナナオ	2,200	1,627	3,579,400	
6741	日本信号	6,400	470	3,008,000	
6742	京三製作所	6,000	336	2,016,000	
6744	能美防災	3,000	863	2,589,000	
6745	ホーチキ	2,000	664	1,328,000	
6749	マスプロ電工	1,900	843	1,601,700	
6751	日本無線	10,000	175	1,750,000	
6752	パナソニック	272,000	1,589	432,208,000	
6753	シャープ	123,000	730	89,790,000	
6754	アンリツ	12,000	231	2,772,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	204	1,224,000	
6756	日立国際電気	7,000	478	3,346,000	
6758	ソニー	135,100	2,295	310,054,500	
6759	N E C トーキン	8,000	284	2,272,000	
6762	T D K	13,300	3,140	41,762,000	
6763	帝国通信工業	6,000	228	1,368,000	
6764	三洋電機	252,000	204	51,408,000	
6767	ミツミ電機	9,000	1,301	11,709,000	
6768	タムラ製作所	8,000	225	1,800,000	
6770	アルプス電気	21,600	483	10,432,800	
6771	池上通信機	8,000	91	728,000	
6773	パイオニア	19,900	322	6,407,800	
6779	日本電波工業	2,000	1,239	2,478,000	

6788	日本トリム	350	2,275	796,250	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,000	1,250	1,250,000	
6791	コロムビアミュージックエンタテインメント	18,000	32	576,000	
6794	フォスター電機	2,500	1,026	2,565,000	
6796	クラリオン	11,000	75	825,000	
6798	S M K	8,000	257	2,056,000	
6800	ヨコオ	2,200	516	1,135,200	
6801	東光	12,000	99	1,188,000	
6803	ティアック	12,000	46	552,000	
6804	ホシデン	6,300	1,212	7,635,600	
6806	ヒロセ電機	4,400	8,350	36,740,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	404	2,424,000	
6809	T O A	3,000	413	1,239,000	
6810	日立マクセル	5,500	793	4,361,500	
6815	ユニデン	7,000	304	2,128,000	
6816	アルパイン	5,500	813	4,471,500	
6817	スミダ コーポレーション	1,700	583	991,100	
6818	島田理化工業	1,400	122	170,800	
6820	アイコム	1,400	2,020	2,828,000	
6839	船井電機	2,300	1,344	3,091,200	
6841	横河電機	27,600	481	13,275,600	
6844	新電元工業	9,000	206	1,854,000	
6845	山武	6,500	1,826	11,869,000	
6849	日本光電	5,100	1,576	8,037,600	
6850	チノー	5,000	218	1,090,000	
6853	共和電業	3,000	305	915,000	
6855	日本電子材料	1,000	446	446,000	
6856	堀場製作所	3,700	1,700	6,290,000	
6857	アドバンテスト	17,400	1,369	23,820,600	
6858	小野測器	3,000	405	1,215,000	
6859	エスベック	2,500	662	1,655,000	
6860	S U N X	2,200	338	743,600	
6861	キーエンス	4,800	18,250	87,600,000	
6866	H I O K I	1,200	1,750	2,100,000	
6869	シスメックス	4,900	3,130	15,337,000	
6875	メガチップス	2,300	1,279	2,941,700	
6877	O B A R A	1,700	603	1,025,100	
6883	日本電産コパル電子	2,600	541	1,406,600	
6885	ミヤチテクノス	1,200	752	902,400	
6900	東京電波	800	669	535,200	
6901	澤藤電機	2,000	204	408,000	
6902	デンソー	55,900	2,065	115,433,500	
6905	コーセル	3,400	792	2,692,800	
6910	日立メディコ	2,000	788	1,576,000	
6911	新日本無線	2,000	175	350,000	
6914	オブテックス	1,800	916	1,648,800	
6915	千代田インテグレ	1,600	1,215	1,944,000	
6921	東光電気	2,000	206	412,000	
6923	スタンレー電気	17,900	1,360	24,344,000	
6924	岩崎電気	9,000	122	1,098,000	
6925	ウシオ電機	14,400	1,399	20,145,600	
6926	岡谷電機産業	1,400	244	341,600	
6927	フェニックス電機	2,200	163	358,600	
6929	日本セラミック	1,900	1,092	2,074,800	
6934	新神戸電機	2,000	615	1,230,000	
6935	日本デジタル研究所	2,400	924	2,217,600	
6937	古河電池	2,000	790	1,580,000	
6938	双信電機	1,300	327	425,100	

6941	山一電機	2,100	187	392,700	
6947	図研	1,800	695	1,251,000	
6951	日本電子	9,000	284	2,556,000	
6952	カシオ計算機	24,300	693	16,839,900	
6954	ファナック	24,600	6,590	162,114,000	
6955	F D K	11,000	104	1,144,000	
6958	日本C M K	5,000	326	1,630,000	
6961	エンプラス	1,500	927	1,390,500	
6963	ローム	13,200	4,370	57,684,000	
6965	浜松ホトニクス	9,300	2,150	19,995,000	
6966	三井ハイテック	3,400	536	1,822,400	
6967	新光電気工業	7,500	679	5,092,500	
6971	京セラ	22,700	5,530	125,531,000	
6973	協栄産業	3,000	225	675,000	
6974	日本インター	2,800	152	425,600	
6976	太陽誘電	12,000	481	5,772,000	
6981	村田製作所	28,500	3,230	92,055,000	
6985	ユーシン	3,000	509	1,527,000	
6986	双葉電子工業	4,500	1,525	6,862,500	
6988	日東電工	23,400	1,934	45,255,600	
6989	北陸電気工業	12,000	156	1,872,000	
6991	パナソニック電工	42,000	875	36,750,000	
6995	東海理化	6,700	1,028	6,887,600	
6996	ニチコン	8,000	586	4,688,000	
6997	日本ケミコン	13,000	230	2,990,000	
6999	K O A	3,800	540	2,052,000	
7003	三井造船	92,000	142	13,064,000	
7004	日立造船	113,500	88	9,988,000	
7007	佐世保重工業	15,000	158	2,370,000	
7011	三菱重工業	454,000	370	167,980,000	
7012	川崎重工業	211,000	185	39,035,000	
7013	I H I	174,000	128	22,272,000	
7102	日本車輛製造	12,000	213	2,556,000	
7105	ニチユ	3,000	220	660,000	
7122	近畿車輛	4,000	347	1,388,000	
7201	日産自動車	321,800	455	146,419,000	
7202	いすゞ自動車	121,000	161	19,481,000	
7203	トヨタ自動車	327,300	3,810	1,247,013,000	代用有価証券 9,000株
7205	日野自動車	36,000	249	8,964,000	
7211	三菱自動車	569,000	159	90,471,000	
7212	エフテック	900	765	688,500	
7220	武蔵精密工業	2,500	1,146	2,865,000	
7221	トヨタ車体	5,600	1,581	8,853,600	
7222	日産車体	9,000	632	5,688,000	
7223	関東自動車工業	3,900	1,250	4,875,000	
7224	新明和工業	11,000	252	2,772,000	
7226	極東開発工業	5,100	432	2,203,200	
7230	日信工業	4,600	985	4,531,000	
7231	トピー工業	23,000	201	4,623,000	
7236	ティラド	8,000	192	1,536,000	
7238	曙ブレーキ工業	7,000	554	3,878,000	
7239	タチエス	3,300	537	1,772,100	
7240	N O K	13,700	888	12,165,600	
7241	フタバ産業	5,500	624	3,432,000	
7242	K Y B	18,000	218	3,924,000	
7243	シロキ工業	5,000	224	1,120,000	
7244	市光工業	6,000	174	1,044,000	
7245	大同メタル工業	4,000	250	1,000,000	

7246	プレス工業	10,000	211	2,110,000	
7248	カルソニックカンセイ	15,000	200	3,000,000	
7250	太平洋工業	5,000	330	1,650,000	
7251	ケーヒン	5,900	893	5,268,700	
7256	河西工業	4,000	232	928,000	
7259	アイシン精機	23,300	1,781	41,497,300	
7260	富士機工	3,000	108	324,000	
7261	マツダ	101,000	215	21,715,000	
7262	ダイハツ工業	27,000	822	22,194,000	
7263	愛知機械工業	7,000	205	1,435,000	
7266	今仙電機製作所	1,800	883	1,589,400	
7267	ホンダ	217,700	2,475	538,807,500	代用有価証券 11,000株
7269	スズキ	51,500	1,468	75,602,000	
7270	富士重工業	87,000	334	29,058,000	
7272	ヤマハ発動機	29,500	1,010	29,795,000	
7274	ショーワ	5,400	465	2,511,000	
7276	小糸製作所	13,000	826	10,738,000	
7277	T B K	3,000	208	624,000	
7278	エクセディ	3,100	1,473	4,566,300	
7280	ミツバ	5,000	496	2,480,000	
7282	豊田合成	7,200	1,379	9,928,800	
7283	愛三工業	3,100	636	1,971,600	
7294	ヨロズ	1,700	884	1,502,800	
7296	エフ・シー・シー	3,800	1,226	4,658,800	
7305	新家工業	6,000	160	960,000	
7309	シマノ	9,900	3,670	36,333,000	
7312	タカタ	4,500	838	3,771,000	
7313	テイ・エス テック	4,100	847	3,472,700	
7414	小野建	2,000	970	1,940,000	
7416	はるやま商事	1,200	413	495,600	
7420	佐島電機	2,000	490	980,000	
7421	カップ・クリエイト	1,450	2,295	3,327,750	
7427	エコートレーディング	500	648	324,000	
7433	伯東	1,500	624	936,000	
7442	中山福	1,600	516	825,600	
7445	ライトオン	2,100	1,346	2,826,600	
7447	ナガイレーベン	1,400	1,904	2,665,600	
7448	ジーンズメイト	700	506	354,200	
7451	菱食	2,400	2,100	5,040,000	
7453	良品計画	2,700	4,930	13,311,000	
7455	三城	3,500	1,005	3,517,500	
7456	松田産業	1,800	1,024	1,843,200	
7459	メディセオ・パルタックホールディングス	27,100	1,040	28,184,000	
7463	アドヴァン	1,700	480	816,000	
7466	S P K	600	1,115	669,000	
7476	アズワン	1,600	2,170	3,472,000	
7480	スズデン	800	601	480,800	
7482	シモジマ	1,700	984	1,672,800	
7483	ドウシシャ	1,300	1,040	1,352,000	
7494	コナカ	3,200	313	1,001,600	
7504	高速	1,500	580	870,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	300	1,376	412,800	
7508	G - 7ホールディングス	800	389	311,200	
7512	イオン北海道	1,600	291	465,600	
7513	コジマ	3,400	409	1,390,600	
7516	コーナン商事	2,900	1,080	3,132,000	
7517	黒田電気	3,600	842	3,031,200	

7518	ネットワークシステムズ	61	164,000	10,004,000	
7520	エコス	900	584	525,600	
7522	ワタミ	3,300	1,788	5,900,400	
7524	マルシェ	600	609	365,400	
7532	ドン・キホーテ	5,700	2,025	11,542,500	
7537	丸文	2,000	378	756,000	
7541	メガネトップ	1,100	683	751,300	
7545	西松屋チェーン	6,600	1,007	6,646,200	
7550	ゼンショー	8,500	426	3,621,000	
7552	ハビネット	700	1,317	921,900	
7554	幸楽苑	1,600	1,091	1,745,600	
7558	トーマンエレクトロニクス	800	1,149	919,200	
7560	ユニマットライフ	1,000	675	675,000	
7561	ハークスレイ	700	784	548,800	
7581	サイゼリヤ	2,900	1,498	4,344,200	
7591	エクセル	1,100	740	814,000	
7594	マルカキカイ	800	795	636,000	
7595	アルゴグラフィックス	1,000	1,186	1,186,000	
7599	ガリバーインターナショナル	590	1,687	995,330	
7600	日本エム・ディ・エム	2,200	182	400,400	
7601	ポブラ	700	444	310,800	
7606	ユナイテッドアローズ	3,400	759	2,580,600	
7607	進和	1,400	1,550	2,170,000	
7608	エスケイジャパン	600	159	95,400	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	495	544,500	
7611	ハイデイ日高	1,100	744	818,400	
7613	シークス	1,600	315	504,000	
7615	京都きもの友禅	16	64,600	1,033,600	
7616	コロワイド	5,500	509	2,799,500	
7619	田中商事	800	345	276,000	
7628	オーハシテクニカ	1,700	723	1,229,100	
7630	壺番屋	900	2,150	1,935,000	
7631	マクニカ	1,000	1,153	1,153,000	
7637	白銅	800	742	593,600	
7640	トップカルチャー	800	286	228,800	
7649	スギホールディングス	4,000	2,335	9,340,000	
7701	島津製作所	28,000	708	19,824,000	
7702	JMS	4,000	302	1,208,000	
7704	アロカ	1,600	734	1,174,400	
7714	モリテックス	1,500	630	945,000	
7715	長野計器	1,500	929	1,393,500	
7718	スター精密	5,200	1,052	5,470,400	
7721	東京計器	9,000	136	1,224,000	
7723	愛知時計電機	3,000	237	711,000	
7728	日本電産トーソク	800	787	629,600	
7729	東京精密	4,800	1,006	4,828,800	
7731	ニコン	44,000	1,334	58,696,000	
7732	トプコン	5,900	475	2,802,500	
7733	オリンパス	28,000	1,777	49,756,000	
7734	理研計器	2,100	531	1,115,100	
7735	大日本スクリーン製造	28,000	216	6,048,000	
7739	キヤノン電子	2,300	1,405	3,231,500	
7740	タムロン	2,200	921	2,026,200	
7741	H O Y A	58,500	1,640	95,940,000	
7744	ノーリツ鋼機	2,300	703	1,616,900	
7745	エー・アンド・デイ	2,100	290	609,000	
7751	キヤノン	147,700	3,470	512,519,000	
7752	リコー	82,000	1,033	84,706,000	
7756	日本電産コバル	2,500	943	2,357,500	

7757	日本電産サンキョー	8,000	466	3,728,000	
7762	シチズンホールディングス	33,100	563	18,635,300	
7769	リズム時計工業	12,000	103	1,236,000	
7825	S R I スポーツ	16	86,100	1,377,600	
7832	パンダイナムコホールディングス	27,700	887	24,569,900	
7838	共立印刷	2,300	170	391,000	
7840	フランスベッドホールディングス	17,000	111	1,887,000	
7846	パイロットコーポレーション	24	210,000	5,040,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,700	813	3,821,100	
7862	トッパン・フォームズ	5,500	1,089	5,989,500	
7864	フジシールインターナショナル	2,800	1,288	3,606,400	
7867	タカラトミー	7,600	609	4,628,400	
7868	廣済堂	2,200	268	589,600	
7873	アーク	7,600	144	1,094,400	
7874	スルガ	700	939	657,300	
7882	アロン化成	2,000	335	670,000	
7885	タカノ	1,000	456	456,000	
7893	プロネクサス	3,100	688	2,132,800	
7897	ホクシン	2,000	148	296,000	
7898	ウッドワン	5,000	409	2,045,000	
7905	大建工業	11,000	190	2,090,000	
7908	K I M O T O	2,200	322	708,400	
7909	シーアイ化成	2,000	254	508,000	
7911	凸版印刷	77,000	722	55,594,000	
7912	大日本印刷	78,000	1,110	86,580,000	
7913	図書印刷	5,000	259	1,295,000	
7914	共同印刷	9,000	218	1,962,000	
7915	日本写真印刷	3,900	5,630	21,957,000	
7916	光村印刷	3,000	325	975,000	
7917	藤森工業	1,800	687	1,236,600	
7921	宝印刷	1,200	846	1,015,200	
7925	前澤化成工業	1,900	909	1,727,100	
7935	コンビ	1,500	488	732,000	
7936	アシックス	25,000	663	16,575,000	
7937	ツツミ	1,000	1,750	1,750,000	
7942	J S P	1,700	644	1,094,800	
7943	ニチハ	3,000	521	1,563,000	
7944	ローランド	1,800	1,108	1,994,400	
7947	エフピコ	1,300	3,660	4,758,000	
7949	小松ウオール工業	1,000	1,035	1,035,000	
7951	ヤマハ	20,300	924	18,757,200	
7952	河合楽器製作所	10,000	93	930,000	
7955	クリナップ	2,700	342	923,400	
7956	ピジョン	1,600	3,000	4,800,000	
7958	天馬	2,000	1,312	2,624,000	
7960	パラマウントベッド	2,500	1,301	3,252,500	
7961	兼松日産農林	4,000	61	244,000	
7962	キングジム	2,100	844	1,772,400	
7966	リンテック	4,900	1,256	6,154,400	
7968	田崎真珠	4,000	93	372,000	
7970	信越ポリマー	5,200	450	2,340,000	
7971	東リ	7,000	186	1,302,000	
7972	イトーキ	5,400	312	1,684,800	
7974	任天堂	13,400	33,350	446,890,000	
7976	三菱鉛筆	2,400	1,171	2,810,400	
7981	タカラスタンダード	12,000	559	6,708,000	
7984	コクヨ	13,200	700	9,240,000	
7987	ナカバヤシ	6,000	159	954,000	



7988	ニフコ	5,500	1,547	8,508,500	
7990	ダイワ精工	13,000	145	1,885,000	
7993	サンウエーブ工業	3,000	132	396,000	
7994	岡村製作所	11,000	515	5,665,000	
7995	日本バルカー工業	10,000	265	2,650,000	
7999	MUTOHホールディングス	3,000	213	639,000	
8001	伊藤忠商事	188,000	530	99,640,000	
8002	丸紅	220,000	392	86,240,000	
8005	ムトウ	2,900	513	1,487,700	
8007	高島	5,000	113	565,000	
8008	F & A アクアホールディングス	2,200	739	1,625,800	
8011	三陽商会	13,000	503	6,539,000	
8012	長瀬産業	13,000	874	11,362,000	
8013	ナイガイ	8,000	34	272,000	
8014	蝶理	16,000	100	1,600,000	
8015	豊田通商	25,200	1,003	25,275,600	
8016	オンワードホールディングス	18,000	723	13,014,000	
8018	三共生興	4,300	155	666,500	
8020	兼松	54,000	92	4,968,000	
8022	ミズノ	13,000	412	5,356,000	
8024	シルバーオックス	3,000	61	183,000	
8025	ツカモトコーポレーション	4,000	67	268,000	
8028	ファミリーマート	7,700	4,120	31,724,000	
8029	ルック	4,000	91	364,000	
8031	三井物産	217,000	1,034	224,378,000	
8032	日本紙パルプ商事	13,000	326	4,238,000	
8035	東京エレクトロン	18,600	3,420	63,612,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	8,700	1,685	14,659,500	
8037	カメイ	3,000	426	1,278,000	
8038	東都水産	4,000	130	520,000	
8042	日本マタイ	4,000	142	568,000	
8043	スターゼン	8,000	225	1,800,000	
8050	セイコーホールディングス	9,000	268	2,412,000	
8051	山善	9,700	316	3,065,200	
8052	橋本興業	3,000	227	681,000	
8053	住友商事	148,400	950	140,980,000	
8056	日本ユニシス	6,100	977	5,959,700	
8057	内田洋行	6,000	401	2,406,000	
8058	三菱商事	187,800	1,598	300,104,400	
8059	第一実業	6,000	257	1,542,000	
8060	キヤノンマーケティングジャパン	9,600	1,502	14,419,200	
8061	西華産業	11,000	187	2,057,000	
8065	佐藤商事	2,300	660	1,518,000	
8068	菱洋エレクトロ	2,500	829	2,072,500	
8070	東京産業	2,500	260	650,000	
8074	ユアサ商事	27,000	96	2,592,000	
8075	神鋼商事	6,000	180	1,080,000	
8078	阪和興業	25,000	306	7,650,000	
8081	カナデン	3,000	426	1,278,000	
8084	菱電商事	4,000	507	2,028,000	
8086	ニプロ	6,000	1,558	9,348,000	
8087	フルサト工業	1,600	907	1,451,200	
8088	岩谷産業	28,000	212	5,936,000	
8089	すてきナイスグループ	10,000	157	1,570,000	
8090	昭光通商	9,000	121	1,089,000	
8091	ニチモウ	4,000	123	492,000	
8092	富士通ビジネスシステム	1,500	1,274	1,911,000	
8093	極東貿易	3,000	144	432,000	
8095	イワキ	3,000	167	501,000	

8096	兼松エレクトロニクス	1,600	755	1,208,000	
8097	三愛石油	6,000	364	2,184,000	
8098	稲畑産業	6,700	360	2,412,000	
8101	G S Iクレオス	7,000	117	819,000	
8103	明和産業	2,000	138	276,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	152	912,000	
8112	東京スタイル	9,000	836	7,524,000	
8113	ユニ・チャーム	5,400	7,170	38,718,000	
8114	デサント	7,000	396	2,772,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,800	428	770,400	
8129	東邦薬品	5,600	1,018	5,700,800	
8130	サンゲツ	4,300	2,020	8,686,000	
8131	ミツウロコ	4,100	634	2,599,400	
8132	シナネン	6,000	424	2,544,000	
8133	伊藤忠エネクス	6,500	493	3,204,500	
8134	T O K A I	6,000	480	2,880,000	
8136	サンリオ	7,000	845	5,915,000	
8137	サンワテクノス	1,200	537	644,400	
8140	リョーサン	4,100	1,916	7,855,600	
8141	新光商事	2,500	677	1,692,500	
8142	トーホー	5,000	327	1,635,000	
8150	三信電気	3,000	892	2,676,000	
8151	東陽テクニカ	2,800	1,189	3,329,200	
8153	モスフードサービス	3,600	1,287	4,633,200	
8154	加賀電子	2,700	1,105	2,983,500	
8155	三益半導体工業	2,300	1,049	2,412,700	
8158	ソーダニッカ	2,000	296	592,000	
8159	立花エレテック	1,700	720	1,224,000	
8160	木曽路	2,900	1,936	5,614,400	
8165	千趣会	4,500	715	3,217,500	
8166	タカキュー	2,000	133	266,000	
8168	ケーヨー	5,200	564	2,932,800	
8170	アデランスホールディングス	3,000	889	2,667,000	
8173	上新電機	6,000	955	5,730,000	
8174	日本瓦斯	2,700	1,065	2,875,500	
8175	ベスト電器	8,000	322	2,576,000	
8178	マルエツ	5,000	503	2,515,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,200	1,042	4,376,400	
8181	東天紅	2,000	128	256,000	
8182	いなげや	3,000	902	2,706,000	
8184	島忠	6,100	2,305	14,060,500	
8185	チヨダ	3,600	1,330	4,788,000	
8193	鈴丹	600	198	118,800	
8194	ライフコーポレーション	1,600	1,821	2,913,600	
8196	カスミ	5,000	517	2,585,000	
8200	リンガーハット	1,900	1,089	2,069,100	
8201	さが美	2,000	146	292,000	
8203	M r M a x	2,800	361	1,010,800	
8207	テンアライド	1,700	319	542,300	
8214	A O K Iホールディングス	2,700	1,050	2,835,000	
8217	オークワ	3,000	1,423	4,269,000	
8218	コメリ	3,500	2,450	8,575,000	
8219	青山商事	6,400	1,419	9,081,600	
8227	しまむら	2,600	7,350	19,110,000	
8229	C F Sコーポレーション	3,000	656	1,968,000	
8233	高島屋	34,000	747	25,398,000	
8236	丸善	13,000	66	858,000	
8237	松屋	5,100	2,090	10,659,000	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	16,000	702	11,232,000	

8245	丸栄	4,000	258	1,032,000	
8248	ニッセンホールディングス	6,000	416	2,496,000	
8251	パルコ	7,200	978	7,041,600	
8252	丸井グループ	32,800	586	19,220,800	
8253	クレディセゾン	21,600	1,092	23,587,200	
8255	原信ナルスホールディングス	1,500	1,081	1,621,500	

[次へ](#)

(単位:株、円)

	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
8258	オーエムシーカード	8,900	156	1,388,400	
8260	井筒屋	14,000	54	756,000	
8263	ダイエー	11,650	510	5,941,500	
8266	イズミヤ	8,000	575	4,600,000	
8267	イオン	101,300	922	93,398,600	
8270	ユニー	19,000	793	15,067,000	
8273	イズミ	6,800	1,381	9,390,800	
8274	東武ストア	3,000	332	996,000	
8276	平和堂	5,100	1,505	7,675,500	
8278	フジ	2,800	1,673	4,684,400	
8279	ヤオコー	1,400	2,690	3,766,000	
8281	ゼビオ	2,600	1,716	4,461,600	
8282	ケーズホールディングス	4,400	1,726	7,594,400	
8289	オリンピック	1,700	694	1,179,800	
8291	東日カーライフグループ	4,000	49	196,000	
8303	新生銀行	147,000	159	23,373,000	
8304	あおぞら銀行	91,000	91	8,281,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,383,700	650	899,405,000	
8308	りそなホールディングス	812	120,900	98,170,800	
8309	中央三井トラスト・ホールディングス	128,000	358	45,824,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,061	427,000	453,047,000	
8324	第四銀行	35,000	433	15,155,000	
8325	北越銀行	28,000	210	5,880,000	
8327	西日本シティ銀行	82,000	210	17,220,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	38	435,000	16,530,000	
8331	千葉銀行	99,000	501	49,599,000	
8332	横浜銀行	173,000	504	87,192,000	
8333	常陽銀行	98,000	477	46,746,000	
8334	群馬銀行	59,000	523	30,857,000	
8336	武蔵野銀行	3,800	3,020	11,476,000	
8337	千葉興業銀行	4,800	1,135	5,448,000	
8338	関東つくば銀行	7,100	434	3,081,400	
8339	東京都民銀行	4,700	1,348	6,335,600	
8341	七十七銀行	42,000	474	19,908,000	
8342	青森銀行	16,000	432	6,912,000	
8343	秋田銀行	17,000	428	7,276,000	
8344	山形銀行	15,000	609	9,135,000	
8345	岩手銀行	1,700	6,430	10,931,000	
8346	東邦銀行	20,000	438	8,760,000	
8347	荘内銀行	12,000	190	2,280,000	
8349	東北銀行	13,000	152	1,976,000	
8350	みちのく銀行	13,000	200	2,600,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	109,000	339	36,951,000	
8355	静岡銀行	79,000	916	72,364,000	
8356	十六銀行	32,000	411	13,152,000	
8358	スルガ銀行	29,000	1,076	31,204,000	
8359	八十二銀行	48,000	502	24,096,000	
8360	山梨中央銀行	17,000	563	9,571,000	
8361	大垣共立銀行	29,000	502	14,558,000	
8362	福井銀行	22,000	340	7,480,000	
8363	北國銀行	29,000	397	11,513,000	
8364	清水銀行	900	3,940	3,546,000	
8366	滋賀銀行	23,000	583	13,409,000	
8367	南都銀行	25,000	543	13,575,000	

8368	百五銀行	25,000	623	15,575,000	
8369	京都銀行	43,000	1,085	46,655,000	
8374	三重銀行	11,000	399	4,389,000	
8375	池田銀行	2,300	3,970	9,131,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	176,000	204	35,904,000	
8379	広島銀行	74,000	354	26,196,000	
8381	山陰合同銀行	15,000	760	11,400,000	
8382	中国銀行	21,000	1,418	29,778,000	
8383	鳥取銀行	8,000	284	2,272,000	
8385	伊予銀行	29,000	1,148	33,292,000	
8386	百十四銀行	29,000	542	15,718,000	
8387	四国銀行	18,000	444	7,992,000	
8388	阿波銀行	22,000	633	13,926,000	
8390	鹿児島銀行	18,000	704	12,672,000	
8392	大分銀行	14,000	592	8,288,000	
8393	宮崎銀行	13,000	323	4,199,000	
8394	肥後銀行	20,000	574	11,480,000	
8395	佐賀銀行	15,000	325	4,875,000	
8396	十八銀行	16,000	302	4,832,000	
8397	沖縄銀行	2,100	3,320	6,972,000	
8399	琉球銀行	5,300	838	4,441,400	
8403	住友信託銀行	238,000	491	116,858,000	
8404	みずほ信託銀行	238,000	117	27,846,000	
8409	八千代銀行	15	253,000	3,795,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	1,415	272,100	385,021,500	
8415	紀陽ホールディングス	99,000	158	15,642,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	23,000	1,067	24,541,000	
8423	フィデック	10	14,310	143,100	
8424	芙蓉総合リース	2,600	1,675	4,355,000	
8425	興銀リース	3,500	1,267	4,434,500	
8439	センチュリー・リーシング・システム	3,300	846	2,791,800	
8473	SBIホールディングス	1,988	14,100	28,030,800	
8511	日本証券金融	9,600	426	4,089,600	
8512	大証金	2,900	226	655,400	
8515	アイフル	13,250	455	6,028,750	
8518	日本アジア投資	11,000	87	957,000	
8519	ポケットカード	2,400	248	595,200	
8521	長野銀行	9,000	218	1,962,000	
8522	名古屋銀行	24,000	600	14,400,000	
8527	愛知銀行	900	7,230	6,507,000	
8529	第三銀行	15,000	353	5,295,000	
8530	中京銀行	12,000	330	3,960,000	
8536	東日本銀行	13,000	292	3,796,000	
8541	愛媛銀行	16,000	319	5,104,000	
8542	トマト銀行	10,000	205	2,050,000	
8543	みなと銀行	26,000	118	3,068,000	
8544	京葉銀行	23,000	462	10,626,000	
8545	関西アーバン銀行	27,000	133	3,591,000	
8550	栃木銀行	14,000	603	8,442,000	
8551	北日本銀行	800	2,600	2,080,000	
8556	香川銀行	10,000	519	5,190,000	
8558	東和銀行	22,000	77	1,694,000	
8561	徳島銀行	7,000	452	3,164,000	
8562	福島銀行	31,000	68	2,108,000	
8563	大東銀行	17,000	61	1,037,000	
8564	武富士	15,980	794	12,688,120	
8566	リコーリース	1,700	1,546	2,628,200	
8568	シンキ	3,600	65	234,000	

8570	イオンクレジットサービス	11,200	1,030	11,536,000	
8571	N I Sグループ	15,600	45	702,000	
8572	アコム	11,360	3,900	44,304,000	
8574	プロミス	11,750	1,936	22,748,000	
8579	東京リース	3,000	567	1,701,000	
8584	ジャックス	15,000	169	2,535,000	
8586	日立キャピタル	5,900	909	5,363,100	
8588	セントラルファイナンス	10,000	144	1,440,000	
8591	オリックス	12,400	10,300	127,720,000	
8593	三菱UFJリース	6,380	2,610	16,651,800	
8595	ジャフコ	3,800	3,020	11,476,000	
8597	S F C G	580	1,644	953,520	
8601	大和証券グループ本社	167,000	580	96,860,000	
8604	野村ホールディングス	264,400	948	250,651,200	
8606	新光証券	64,000	225	14,400,000	
8607	みずほインベスターズ証券	58,000	77	4,466,000	
8609	岡三証券グループ	22,000	435	9,570,000	
8613	丸三証券	8,300	478	3,967,400	
8614	東洋証券	9,000	188	1,692,000	
8616	東海東京証券	29,000	289	8,381,000	
8617	光世証券	6,000	97	582,000	
8622	水戸証券	8,000	331	2,648,000	
8624	いちよし証券	5,900	753	4,442,700	
8628	松井証券	19,200	633	12,153,600	
8692	だいこう証券ビジネス	1,100	748	822,800	
8698	マネックスグループ	130	35,250	4,582,500	
8703	カブドットコム証券	54	106,900	5,772,600	
8706	極東証券	3,100	436	1,351,600	
8707	岩井証券	2,600	885	2,301,000	
8725	三井住友海上グループホールディングス	60,000	2,970	178,200,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	89	317,000	28,213,000	
8742	小林洋行	700	238	166,600	
8754	日本興亜損害保険	97,000	643	62,371,000	
8755	損保ジャパン	117,000	757	88,569,000	
8759	ニッセイ同和損害保険	28,000	467	13,076,000	
8761	あいおい損害保険	66,000	450	29,700,000	
8763	富士火災海上保険	26,000	200	5,200,000	
8766	東京海上ホールディングス	108,200	3,250	351,650,000	
8772	アサックス	3	68,000	204,000	
8793	N E C リース	900	906	815,400	
8795	T & Dホールディングス	33,100	4,220	139,682,000	
8801	三井不動産	112,000	1,766	197,792,000	
8802	三菱地所	175,000	1,821	318,675,000	
8803	平和不動産	17,500	249	4,357,500	
8804	東京建物	38,000	418	15,884,000	
8806	ダイビル	6,500	820	5,330,000	
8809	サンケイビル	3,800	445	1,691,000	
8815	東急不動産	51,000	282	14,382,000	
8818	京阪神不動産	3,000	405	1,215,000	
8830	住友不動産	64,000	1,657	106,048,000	
8833	東宝不動産	2,700	581	1,568,700	
8834	藤和不動産	8,500	59	501,500	
8835	太平洋興発	8,000	52	416,000	
8838	有楽土地	2,000	107	214,000	
8840	大京	27,000	90	2,430,000	
8841	テーオーシー	9,500	326	3,097,000	
8842	東京楽天地	5,000	396	1,980,000	
8848	レオパレス 2 1	17,700	866	15,328,200	

8860	フジ住宅	2,900	240	696,000	
8864	空港施設	2,600	577	1,500,200	
8869	明和地所	1,200	436	523,200	
8870	住友不動産販売	1,130	2,500	2,825,000	
8871	ゴールドクレスト	1,980	1,749	3,463,020	
8874	ジョイント・コーポレーション	3,400	169	574,600	
8875	東栄住宅	1,900	115	218,500	
8877	日本エスリード	900	556	500,400	
8878	日本綜合地所	3,900	216	842,400	
8879	東急リパブル	2,700	463	1,250,100	
8880	飯田産業	1,000	280	280,000	
8881	日神不動産	1,500	225	337,500	
8888	クリード	18	18,010	324,180	
8895	アーネストワン	4,200	157	659,400	
8897	タカラレーベン	1,300	233	302,900	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	83,100	831,000	
8905	イオンモール	11,500	2,500	28,750,000	
8907	フージャースコーポレーション	21	9,510	199,710	
8915	タクトホーム	12	31,350	376,200	
8918	ランド	8	12,200	97,600	
8924	リサ・パートナーズ	35	28,000	980,000	
8933	N T T都市開発	156	112,500	17,550,000	
8934	サンフロンティア不動産	24	39,300	943,200	
8939	大和システム	1,200	232	278,400	
8944	ランドビジネス	17	12,400	210,800	
8993	アトリウム	2,800	247	691,600	
9001	東武鉄道	109,000	508	55,372,000	
9003	相模鉄道	33,000	395	13,035,000	
9005	東京急行電鉄	140,000	383	53,620,000	
9006	京浜急行電鉄	64,000	796	50,944,000	
9007	小田急電鉄	82,000	721	59,122,000	
9008	京王電鉄	66,000	507	33,462,000	
9009	京成電鉄	41,000	467	19,147,000	
9010	富士急行	7,000	416	2,912,000	
9020	東日本旅客鉄道	475	712,000	338,200,000	
9021	西日本旅客鉄道	237	417,000	98,829,000	
9022	東海旅客鉄道	213	838,000	178,494,000	
9030	アートコーポレーション	500	941	470,500	
9031	西日本鉄道	33,000	373	12,309,000	
9037	ハマキョウレックス	800	1,902	1,521,600	
9039	サカイ引越センター	500	1,967	983,500	
9041	近畿日本鉄道	230,000	390	89,700,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	171,000	467	79,857,000	
9044	南海電気鉄道	53,000	432	22,896,000	
9045	京阪電気鉄道	57,000	469	26,733,000	
9047	名糖運輸	1,100	766	842,600	
9048	名古屋鉄道	89,000	304	27,056,000	
9062	日本通運	109,000	390	42,510,000	
9064	ヤマトホールディングス	51,000	1,147	58,497,000	
9065	山九	31,000	340	10,540,000	
9066	日新	10,000	281	2,810,000	
9067	丸運	1,900	260	494,000	
9068	丸全昭和運輸	8,000	326	2,608,000	
9069	センコー	9,000	394	3,546,000	
9070	トナミホールディングス	6,000	247	1,482,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,000	926	6,482,000	
9074	日本石油輸送	3,000	178	534,000	
9075	福山通運	20,000	417	8,340,000	
9076	セイノーホールディングス	20,000	517	10,340,000	

9081	神奈川中央交通	3,000	498	1,494,000	
9086	日立物流	5,300	1,265	6,704,500	
9101	日本郵船	136,000	480	65,280,000	
9104	商船三井	133,000	496	65,968,000	
9107	川崎汽船	61,000	378	23,058,000	
9110	新和海運	10,000	231	2,310,000	
9113	乾汽船	3,000	726	2,178,000	
9115	明治海運	2,300	344	791,200	
9119	飯野海運	12,300	495	6,088,500	
9123	太平洋海運	5,000	92	460,000	
9130	共栄タンカー	2,000	218	436,000	
9132	第一中央汽船	17,000	264	4,488,000	
9202	全日本空輸	262,000	359	94,058,000	
9205	日本航空	368,000	217	79,856,000	
9232	パスコ	3,000	115	345,000	
9234	国際航業ホールディングス	2,000	207	414,000	
9301	三菱倉庫	18,000	891	16,038,000	
9302	三井倉庫	11,000	429	4,719,000	
9303	住友倉庫	20,000	358	7,160,000	
9304	澁澤倉庫	8,000	515	4,120,000	
9305	ヤマタネ	14,000	104	1,456,000	
9306	東陽倉庫	4,000	201	804,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	357	1,785,000	
9312	ケイヒン	5,000	129	645,000	
9324	安田倉庫	1,800	780	1,404,000	
9351	東洋埠頭	7,000	159	1,113,000	
9358	宇徳	1,900	309	587,100	
9364	上組	30,000	685	20,550,000	
9366	サンリツ	700	621	434,700	
9368	キムラユニティー	600	819	491,400	
9369	キューソー流通システム	700	962	673,400	
9370	郵船航空サービス	2,000	1,171	2,342,000	
9375	近鉄エクスプレス	2,300	1,407	3,236,100	
9380	東海運	1,600	291	465,600	
9382	バンテック・グループ・ホールディングス	12	151,300	1,815,600	
9401	T B S	15,100	1,793	27,074,300	
9404	日本テレビ放送網	2,410	9,760	23,521,600	
9409	テレビ朝日	64	127,800	8,179,200	
9411	テレビ東京	1,000	4,170	4,170,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	191	35,750	6,828,250	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	5	142,300	711,500	
9427	イー・アクセス	112	45,000	5,040,000	
9430	N E C モバイルリング	900	1,311	1,179,900	
9432	日本電信電話	1,156	432,000	499,392,000	代用有価証券 100株
9433	K D D I	390	606,000	236,340,000	
9435	光通信	3,200	1,677	5,366,400	
9437	N T T ドコモ	2,484	160,300	398,185,200	
9449	G M O インターネット	4,800	295	1,416,000	
9470	学習研究社	8,000	181	1,448,000	
9474	ゼンリン	3,600	872	3,139,200	
9475	昭文社	1,400	421	589,400	
9477	角川グループホールディングス	2,100	1,733	3,639,300	
9479	インプレスホールディングス	21	12,830	269,430	
9501	東京電力	160,500	2,910	467,055,000	代用有価証券 8,000株
9502	中部電力	86,300	2,560	220,928,000	
9503	関西電力	105,700	2,425	256,322,500	



9504	中国電力	38,200	2,430	92,826,000	
9505	北陸電力	26,200	2,665	69,823,000	
9506	東北電力	63,600	2,330	148,188,000	
9507	四国電力	26,900	2,925	78,682,500	
9508	九州電力	56,300	2,280	128,364,000	
9509	北海道電力	23,800	2,350	55,930,000	
9511	沖縄電力	1,800	6,130	11,034,000	
9513	J - P O W E R	18,500	3,000	55,500,000	
9531	東京ガス	323,000	435	140,505,000	
9532	大阪ガス	273,000	360	98,280,000	
9533	東邦ガス	67,000	574	38,458,000	
9534	北海道ガス	5,000	270	1,350,000	
9536	西部ガス	29,000	250	7,250,000	
9543	静岡ガス	8,000	430	3,440,000	
9600	アイネット	1,200	494	592,800	
9601	松竹	14,000	593	8,302,000	
9602	東宝	17,900	1,981	35,459,900	
9603	エイチ・アイ・エス	2,400	1,391	3,338,400	
9605	東映	11,000	430	4,730,000	
9607	葵プロモーション	1,500	433	649,500	
9609	ベンチャー・リンク	13,200	22	290,400	
9613	N T T データ	155	359,000	55,645,000	
9616	共立メンテナンス	1,100	1,246	1,370,600	
9619	イチネンホールディングス	2,600	469	1,219,400	
9621	建設技術研究所	1,500	604	906,000	
9628	燦ホールディングス	600	1,876	1,125,600	
9632	スバル興業	2,000	286	572,000	
9633	東京テアトル	10,000	192	1,920,000	
9650	テクモ	1,900	801	1,521,900	
9654	コーエー	2,200	1,037	2,281,400	
9665	吉本興業	4,000	1,032	4,128,000	
9667	ホリプロ	900	885	796,500	
9671	よみうりランド	6,000	267	1,602,000	
9672	東京都競馬	18,000	147	2,646,000	
9675	常盤興産	9,000	159	1,431,000	
9678	カナモト	3,000	336	1,008,000	
9681	東京ドーム	20,000	328	6,560,000	
9682	D T S	2,400	886	2,126,400	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,400	2,800	17,920,000	
9692	シーイーシー	1,500	757	1,135,500	
9694	日立ソフトウェアエンジニアリング	3,600	1,418	5,104,800	
9697	カプコン	5,300	2,055	10,891,500	
9706	日本空港ビルデング	6,100	1,221	7,448,100	
9715	トランスコスモス	3,500	728	2,548,000	
9716	乃村工藝社	5,000	330	1,650,000	
9717	ジャステック	1,300	566	735,800	
9719	住商情報システム	2,600	1,554	4,040,400	
9722	藤田観光	8,000	634	5,072,000	
9726	K N T	8,000	190	1,520,000	
9728	日本管財	1,000	1,763	1,763,000	
9731	白洋舎	3,000	268	804,000	
9735	セコム	25,800	3,840	99,072,000	
9737	C S K ホールディングス	7,600	864	6,566,400	
9739	N S W	1,000	333	333,000	
9740	C S P	1,200	788	945,600	
9741	日立情報システムズ	2,000	1,794	3,588,000	
9742	アイネス	3,000	491	1,473,000	
9743	丹青社	3,000	245	735,000	

9744	メイテック	4,500	2,350	10,575,000	
9746	T K C	2,400	1,754	4,209,600	
9747	アサツー ディ・ケイ	5,300	2,425	12,852,500	
9749	富士ソフト	3,100	1,869	5,793,900	
9750	ソラン	2,600	515	1,339,000	
9755	応用地質	3,000	1,118	3,354,000	
9757	船井総合研究所	3,400	494	1,679,600	
9759	日本システムディベロップメント	4,400	779	3,427,600	
9760	進学会	1,300	327	425,100	
9763	丸紅建材リース	3,000	133	399,000	
9766	コナミ	11,400	1,900	21,660,000	
9783	ベネッセコーポレーション	9,300	4,250	39,525,000	
9787	イオンディライト	2,000	2,275	4,550,000	
9788	ナック	700	720	504,000	
9790	福井コンピュータ	600	414	248,400	
9792	ニチイ学館	3,200	896	2,867,200	
9793	ダイセキ	3,900	2,310	9,009,000	
9828	元気寿司	800	1,222	977,600	
9830	トラスコ中山	2,900	1,290	3,741,000	
9831	ヤマダ電機	12,200	5,840	71,248,000	
9832	オートバックスセブン	4,000	2,325	9,300,000	
9842	アークランドサカモト	1,800	996	1,792,800	
9843	ニトリ	5,450	6,280	34,226,000	
9844	ユーエスシー	1,000	1,020	1,020,000	
9854	愛眼	2,000	609	1,218,000	
9861	吉野家ホールディングス	58	94,800	5,498,400	
9865	日商エレクトロニクス	1,100	565	621,500	
9869	加藤産業	3,600	1,160	4,176,000	
9882	イエローハット	2,600	455	1,183,000	
9883	富士エレクトロニクス	1,400	736	1,030,400	
9887	松屋フーズ	1,200	1,217	1,460,400	
9889	J B C Cホールディングス	2,100	697	1,463,700	
9896	J Kホールディングス	2,000	582	1,164,000	
9897	ユニダックス	1,500	400	600,000	
9900	サガミチェーン	3,000	956	2,868,000	
9902	日伝	1,000	2,630	2,630,000	
9912	ダイワボウ情報システム	1,500	2,355	3,532,500	
9916	バイタルネット	3,300	467	1,541,100	
9930	北沢産業	2,000	161	322,000	
9932	杉本商事	1,400	1,013	1,418,200	
9934	因幡電機産業	2,400	2,490	5,976,000	
9937	セシール	2,700	107	288,900	
9938	住金物産	13,000	216	2,808,000	
9945	プレナス	3,200	1,396	4,467,200	
9946	ミニストップ	1,800	1,778	3,200,400	
9947	イメージホールディングス	800	391	312,800	
9948	アークス	3,000	1,401	4,203,000	
9956	パロー	5,000	807	4,035,000	
9962	ミスミグループ本社	8,400	1,706	14,330,400	
9963	江守商事	500	784	392,000	
9972	アルテック	1,100	205	225,500	
9979	大庄	1,500	1,253	1,879,500	
9982	タキヒヨー	5,000	398	1,990,000	
9983	ファーストリテイリング	5,900	9,800	57,820,000	
9984	ソフトバンク	102,600	1,313	134,713,800	
9987	スズケン	8,900	2,300	20,470,000	
9989	サンドラッグ	4,800	1,785	8,568,000	
9991	ジェコス	1,700	445	756,500	
9993	ヤマザワ	700	1,329	930,300	

9994	やまや	500	457	228,500	
9997	ベルーナ	3,150	292	919,800	
	合計	34,301,813		29,517,119,890	

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成19年11月6日現在	平成20年11月6日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		468,945,373	104,730,454
コール・ローン		2,299,507,439	1,039,342,003
株式		77,052,763,187	56,438,041,069
投資証券		1,277,891,225	783,651,095
派生商品評価勘定		10,490,981	44,497,161
未収入金		62,842,400	11,249,651
未収配当金		65,826,970	75,081,116
差入委託証拠金		313,786,224	513,390,481
流動資産合計		81,552,053,799	59,009,983,030
資産合計		81,552,053,799	59,009,983,030
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		84,532,309	2,740,784
未払金		-	45,215,055
未払解約金		25,395,048	15,539,980
流動負債合計		109,927,357	63,495,819
負債合計		109,927,357	63,495,819
純資産の部			
元本等			
元本		55,320,249,983	77,264,216,726
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		26,121,876,459	18,317,729,515
元本等合計		81,442,126,442	58,946,487,211
純資産合計		81,442,126,442	58,946,487,211
負債純資産合計		81,552,053,799	59,009,983,030

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間	自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		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。 (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）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。 (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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 (3) 時価が入手できなかった有価証券 同左
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。	(1)デリバティブ取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準		受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金の計上基準 同左
4. 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。	外貨建取引等の処理基準 同左

## (貸借対照表に関する注記)

平成19年11月6日現在		平成20年11月6日現在	
1. 期首	平成18年11月7日	1. 期首	平成19年11月7日
期首元本額	14,570,513,819 円	期首元本額	55,320,249,983 円
期首からの追加設定元本額	42,555,042,909 円	期首からの追加設定元本額	27,666,801,227 円
期首からの解約元本額	1,805,306,745 円	期首からの解約元本額	5,722,834,484 円
平成19年11月6日現在の元本の内訳		平成20年11月6日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	6,109,166,077 円	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	7,142,605,516 円
DCインデックスバランス(株式20)	18,552,994 円	DCインデックスバランス(株式20)	37,688,828 円
DCインデックスバランス(株式40)	72,872,555 円	DCインデックスバランス(株式40)	132,372,615 円
DCインデックスバランス(株式60)	149,835,165 円	DCインデックスバランス(株式60)	246,010,956 円
DCインデックスバランス(株式80)	181,956,057 円	DCインデックスバランス(株式80)	271,481,971 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	18,544,708,646 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	22,160,674,990 円
日興五大陸株式ファンド	19,361,847,754 円	日興五大陸株式ファンド	21,178,843,984 円
グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	19,395,814 円	グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	24,175,570 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)	3,130,544 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	53,527,169 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	21,128,910 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)	170,659,533 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	15,542,847 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	25,673,909 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	27,443,718 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	22,975,865 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	40,355,808 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	42,156,191 円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	6,789,368,194 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	67,393,206 円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	493,221,977 円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	19,302,827,078 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	20,891,466 円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	483,220,143 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	57,752,991 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	41,484,219 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	83,948,806 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	104,286,164 円
年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	91,485,230 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	131,581,247 円
年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	3,217,644,430 円	年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	130,466,902 円
(合計)	55,320,249,983 円	年金積立インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	5,494,110,670 円

2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	55,320,249,983 □	(合計)	77,264,216,726 円
2. 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数			77,264,216,726 □
3. 元本の欠損			
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は18,317,729,515円であります。			

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	77,052,763,187	659,907,302
投資証券	1,277,891,225	49,229,732
合計	78,330,654,412	709,137,034

対象期間（自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	56,438,041,069	5,547,502,533
投資証券	783,651,095	81,396,765
合計	57,221,692,164	5,628,899,298

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の状況に関する事項

	自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左

取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左
--------------	---	----



## 取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(単位：円)

区分	種類	平成19年11月6日現在			
		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	3,245,505,884	-	3,169,537,086	75,968,798
	合計	3,245,505,884	-	3,169,537,086	75,968,798

(単位：円)

区分	種類	平成20年11月6日現在			
		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	730,975,281	-	770,551,840	39,576,559
	合計	730,975,281	-	770,551,840	39,576,559

(注) 時価の算定方法

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

(通貨関連)

(単位：円)

区分	種類	平成19年11月6日現在			
		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	2,514,427,610	-	2,516,355,080	1,927,470
	アメリカドル	1,399,191,491	-	1,393,725,780	5,465,711
	ユーロ	1,115,236,119	-	1,122,629,300	7,393,181
	合計	2,514,427,610	-	2,516,355,080	1,927,470

(単位：円)

区分	種類	平成20年11月6日現在			
		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	928,904,492	-	929,036,790	132,298
	アメリカドル	565,171,200	-	565,228,800	57,600
	ユーロ	363,733,292	-	363,807,990	74,698
	買建	1,093,976,225	-	1,072,184,760	21,791,465
	アメリカドル	680,398,079	-	675,294,030	5,104,049
	ユーロ	413,578,146	-	396,890,730	16,687,416
	合計	2,022,880,717	-	2,001,221,550	21,923,763

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年11月6日現在	平成20年11月6日現在
1口当たり純資産額	1.4722 円	1口当たり純資産額 0.7629 円
(1万口当たり純資産額)	(14,722 円)	(1万口当たり純資産額) (7,629 円)

[次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

外国株式(アメリカドル)

(単位:株、アメリカドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
00105510	AFLAC INC	18,012	45.47000	819,005.64	
00108410	AGCO CORP	3,240	29.79000	96,519.60	
00130H10	AES CORPORATION	25,938	7.24000	187,791.12	
00154710	AK STEEL HOLDING CORP	3,810	12.49000	47,586.90	
00282410	ABBOTT LABORATORIES	57,672	55.18000	3,182,340.96	
00289620	ABERCROMBIE&FITCH CO-CL A	2,781	26.78000	74,475.18	
00493020	ACTIVISION BLIZZARD INC	22,650	10.98000	248,697.00	
00724F10	ADOBE SYSTEMS INC	20,249	27.22000	551,177.78	
00751Y10	ADVANCE AUTO PARTS, INC.	3,483	29.32000	102,121.56	
00790310	ADVANCED MICRO DEVICES INC	19,226	3.55000	68,252.30	
00811710	AETNA INC	18,643	23.92000	445,940.56	
00819010	AFFILIATED COMPUTER SERVICES INC-A	3,238	42.97000	139,136.86	
00846U10	AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,220	23.26000	307,497.20	
00915810	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,900	57.92000	457,568.00	
00971T10	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,830	14.45000	84,243.50	
01381710	ALCOA INC	29,514	11.80000	348,265.20	
01736110	ALLEGHENY ENERGY INC	6,620	29.23000	193,502.60	
01741R10	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	3,010	25.09000	75,520.90	
01849010	ALLERGAN INC	11,880	38.83000	461,300.40	
01858110	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,830	51.15000	144,754.50	
01880210	ALLIANT ENERGY CORP	4,465	29.15000	130,154.75	
01903Q10	ALLIED CAPITAL CORPORATION	6,690	7.34000	49,104.60	
02000210	ALLSTATE CORP	19,558	27.78000	543,321.24	
02076X10	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	2,300	29.41000	67,643.00	
02144110	ALTERA CORPORATION	10,931	16.84000	184,078.04	
02313510	AMAZON.COM INC	11,920	51.98000	619,601.60	
02355110	HESS CORP	11,105	58.96000	654,750.80	
02360810	AMEREN CORPORATION	7,507	32.27000	242,250.89	
02364J10	TIME WARNER INC	133,725	10.15000	1,357,308.75	
02493710	AMERICAN CAPITAL LTD	6,980	14.39000	100,442.20	
02553710	AMERICAN ELECTRIC POWER	15,123	31.76000	480,306.48	
02553E10	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	5,982	10.17000	60,836.94	
02581610	AMERICAN EXPRESS CO	38,959	27.83000	1,084,228.97	
02660910	WYETH	49,827	32.47000	1,617,882.69	
02687410	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	79,417	2.06000	163,599.02	
02991220	AMERICAN TOWER CORP	15,439	31.02000	478,917.78	
03073E10	AMERISOURCEBERGEN CORP	6,357	30.92000	196,558.44	
03076C10	AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,520	21.75000	185,310.00	
03116210	AMGEN INC	40,686	59.42000	2,417,562.12	
03209510	AMPHENOL CORPORATION-CL A	6,785	29.32000	198,936.20	
03251110	ANADARKO PETROLEUM CORP	17,853	35.13000	627,175.89	
03265410	ANALOG DEVICES INC	10,966	20.92000	229,408.72	
03522910	ANHEUSER-BUSCH COMPANIES INC	26,648	64.00000	1,705,472.00	
03674B10	WELLPOINT INC	20,086	38.51000	773,511.86	
03738910	AON CORP	10,357	41.49000	429,711.93	
03741110	APACHE CORP	12,464	80.42000	1,002,354.88	
03760410	APOLLO GROUP INC-CL A	5,248	66.94000	351,301.12	
03783310	APPLE INC	32,946	103.30000	3,403,321.80	
03822210	APPLIED MATERIALS INC	50,853	12.46000	633,628.38	

03836W10	AQUA AMERICA INC	5,165	18.04000	93,176.60	
03938010	ARCH COAL INC	5,690	20.62000	117,327.80	
03948310	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,133	23.71000	524,773.43	
04273510	ARROW ELECTRONICS INC	4,110	17.42000	71,596.20	
04548710	ASSOCIATED BANC-CORP	5,414	20.78000	112,502.92	
04621X10	ASSURANT INC	3,990	25.40000	101,346.00	
05276910	AUTODESK INC	8,640	21.00000	181,440.00	
05301510	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	19,366	34.66000	671,225.56	
05333210	AUTOZONE INC	1,697	118.01000	200,262.97	
05361110	AVERY DENNISON CORP	3,315	34.54000	114,500.10	
05380710	AVNET INC	5,790	16.98000	98,314.20	
05430310	AVON PRODUCTS INC	16,393	25.72000	421,627.96	
05493710	BB&T CORPORATION	20,843	33.55000	699,282.65	
05548210	BJ SERVICES CO	10,013	12.59000	126,063.67	
05592110	BMC SOFTWARE INC	7,584	26.81000	203,327.04	
05722410	BAKER HUGHES INC	11,636	34.52000	401,674.72	
05849810	BALL CORP	4,129	36.72000	151,616.88	
06405710	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	42,747	31.10000	1,329,431.70	
06605F10	BANK OF AMERICA CORP	182,500	21.75000	3,969,375.00	
06738310	C.R. BARD INC	4,054	86.83000	352,008.82	
06830610	BARR PHARMACEUTICALS INC	4,035	62.32000	251,461.20	
07181310	BAXTER INTERNATIONAL INC	23,444	60.25000	1,412,501.00	
07581110	BECKMAN COULTER INC	2,433	51.66000	125,688.78	
07588710	BECTON DICKINSON & CO	9,471	70.00000	662,970.00	
07589610	BED BATH & BEYOND INC	9,692	24.12000	233,771.04	
07785310	VERIZON COMMUNICATIONS INC	106,528	30.84000	3,285,323.52	
08442310	W.R. BERKLEY CORPORATION	6,018	26.25000	157,972.50	
08467020	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	368	3,890.00000	1,431,520.00	
08651610	BEST BUY CO INC	13,359	26.60000	355,349.40	
09062X10	BIOGEN IDEC INC	11,112	44.84000	498,262.08	
09179710	BLACK & DECKER CORP	1,960	48.32000	94,707.20	
09367110	H&R BLOCK INC	12,960	18.38000	238,204.80	
09702310	BOEING CO	26,677	49.55000	1,321,845.35	
09972410	BORGWARNER INC	4,165	23.05000	96,003.25	
10113710	BOSTON SCIENTIFIC CORP	51,963	8.77000	455,715.51	
11012210	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	73,979	20.75000	1,535,064.25	
11132010	BROADCOM CORP-CL A	16,981	17.06000	289,695.86	
1150G111	ACCENTURE LTD-CL A	22,348	31.37000	701,056.76	
11563720	BROWN-FORMAN CORP -CL B	2,250	46.91000	105,547.50	
12189T10	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION	12,891	86.49000	1,114,942.59	
12485720	CBS CORP	18,688	9.10000	170,060.80	
12497T10	CB RICHARD ELLIS GROUP INC	6,460	6.29000	40,633.40	
12526910	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,790	59.48000	106,469.20	
12541W20	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,605	52.09000	344,054.45	
12550910	CIGNA CORP	10,525	17.15000	180,503.75	
12640810	CSX CORP	15,336	44.51000	682,605.36	
12665010	CVS CAREMARK CORP	53,417	30.69000	1,639,367.73	
12686C10	CABLEVISION SYSTEM CORPORATION	9,160	16.93000	155,078.80	
12709710	CABOT OIL & GAS CORP	3,315	27.00000	89,505.00	
12738710	CADENCE DESIGN SYS INC	8,885	4.34000	38,560.90	
13442910	CAMPBELL SOUP CO	8,925	38.30000	341,827.50	
14040H10	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,245	38.23000	544,586.35	
14149Y10	CARDINAL HEALTH INC	13,705	39.33000	539,017.65	
14313010	CARMAX INC	7,314	9.35000	68,385.90	
14365810	CARNIVAL CORP	16,112	23.46000	377,987.52	
14912310	CATERPILLAR INC	23,186	40.40000	936,714.40	
15087010	CELANESE CORP	5,020	14.19000	71,233.80	
15102010	CELGENE CORPORATION	16,622	63.18000	1,050,177.96	

15231210	CENTEX CORP	4,586	11.57000	53,060.02	
15670810	CEPHALON INC	2,645	73.45000	194,275.25	
15688010	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	7,785	16.18000	125,961.30	
15986410	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	3,120	33.90000	105,768.00	
16161A10	JPMORGAN CHASE & CO	136,915	39.22000	5,369,806.30	
16516710	CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	19,630	24.83000	487,412.90	
16675110	CHEVRON CORPORATION	76,881	74.88000	5,756,849.28	
16776010	CME GROUP INC	2,301	282.05000	648,997.05	
17123210	CHUBB CORP	13,768	48.14000	662,791.52	
17179810	CIMAREX ENERGY CO	3,405	35.19000	119,821.95	
17206210	CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	5,695	26.49000	150,860.55	
17275R10	CISCO SYSTEMS INC	219,720	17.39000	3,820,930.80	
17290810	CINTAS CORP	5,682	23.16000	131,595.12	
17296710	CITIGROUP INC	194,418	12.63000	2,455,499.34	
17737610	CITRIX SYSTEMS INC	7,163	24.61000	176,281.43	
18589610	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	3,010	30.46000	91,684.60	
18905410	CLOROX COMPANY	5,311	60.67000	322,218.37	
18975410	COACH INC	13,066	19.48000	254,525.68	
19121610	COCA-COLA COMPANY	77,781	44.73000	3,479,144.13	
19121910	COCA-COLA ENTERPRISES	11,030	10.18000	112,285.40	
19244610	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	11,154	20.17000	224,976.18	
19416210	COLGATE-PALMOLIVE CO	18,975	63.71000	1,208,897.25	
20030010	COMCAST CORP-CL A	72,286	16.90000	1,221,633.40	
20030020	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	34,426	16.48000	567,340.48	
20034010	COMERICA INC	5,345	27.14000	145,063.30	
20491210	CA INC	15,740	16.95000	266,793.00	
20536310	COMPUTER SCIENCES CORP	5,238	31.06000	162,692.28	
20588710	CONAGRA FOODS INC	18,065	17.45000	315,234.25	
20854P10	CONSOL ENERGY INC	7,078	31.52000	223,098.56	
20911110	CONSOLIDATED EDISON INC	10,306	43.55000	448,826.30	
21036P10	CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,000	12.70000	88,900.00	
21037110	CONSTELLATION ENERGY GROUP INC	6,970	23.55000	164,143.50	
21664010	CAMERON INTERNATIONAL CORP	7,556	25.33000	191,393.48	
21666910	COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	7,098	29.32000	208,113.36	
21935010	CORNING INC	60,373	11.09000	669,536.57	
22160Q10	COSTCO WHOLESALE CORP	16,189	53.71000	869,511.19	
22281610	COVANCE INC	2,480	54.85000	136,028.00	
22286210	COVENTRY HEALTH CARE INC	5,235	14.15000	74,075.25	
22822710	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	10,670	20.75000	221,402.50	
23102110	CUMMINS INC	7,420	26.81000	198,930.20	
23331A10	DR HORTON INC	9,306	6.81000	63,373.86	
23332610	DST SYSTEMS INC	1,724	40.04000	69,028.96	
23333110	DTE ENERGY COMPANY	6,353	36.92000	234,552.76	
23585110	DANAHER CORP	9,482	59.40000	563,230.80	
23719410	DARDEN RESTAURANTS INC	4,633	20.96000	97,107.68	
23918K10	DAVITA INC	4,319	50.35000	217,461.65	
23975310	TARGET CORP	27,995	37.75000	1,056,811.25	
24237010	DEAN FOODS CO	5,572	17.03000	94,891.16	
24419910	DEERE & CO	16,315	39.53000	644,931.95	
24702510	DELL INC	68,521	12.77000	875,013.17	
24791620	DENBURY RESOURCES INC	8,590	12.56000	107,890.40	
24903010	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	6,312	29.24000	184,562.88	
25179M10	DEVON ENERGY CORPORATION	15,841	79.76000	1,263,478.16	
25271C10	DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC	2,525	86.71000	218,942.75	
25468710	THE WALT DISNEY CO.	67,638	24.23000	1,638,868.74	
25468Y10	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	4,615	13.73000	63,363.95	
25470910	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,240	12.07000	183,946.80	

25470F30	DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	4,615	13.26000	61,194.90	
25747010	DOMINION RESOURCES INC/VA	21,777	35.23000	767,203.71	
25755910	DOMTAR CORP	18,700	2.37000	44,319.00	
25786710	RR DONNELLEY & SONS CO	7,645	16.48000	125,989.60	
26000310	DOVER CORP	7,370	31.70000	233,629.00	
26054310	DOW CHEMICAL COMPANY	34,808	25.56000	889,692.48	
26138E10	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	8,804	22.49000	198,001.96	
26353410	E. I. DU PONT DE NEMOURS AND COMPANY	33,658	30.86000	1,038,685.88	
26439910	DUKE ENERGY CORP	47,418	15.62000	740,669.16	
26483E10	DUN & BRADSTREET CORPORATION	2,132	73.34000	156,360.88	
26817G10	DYNEGY INC	16,930	3.05000	51,636.50	
26864810	EMC CORP	77,804	11.01000	856,622.04	
26874Q10	ENSCO INTERNATIONAL INC	5,530	37.31000	206,324.30	
27743210	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2,615	40.60000	106,169.00	
27746110	EASTMAN KODAK CO	10,577	9.34000	98,789.18	
27805810	EATON CORP	5,643	48.65000	274,531.95	
27864210	EBAY INC	42,407	14.72000	624,231.04	
27876210	DISH NETWORK CORP-A	8,249	15.76000	130,004.24	
27886510	ECOLAB INC	7,080	36.91000	261,322.80	
28102010	EDISON INTERNATIONAL	11,134	35.10000	390,803.40	
28390510	EL PASO CORP	25,995	9.52000	247,472.40	
28551210	ELECTRONIC ARTS INC	11,594	22.37000	259,357.78	
29078E10	EMBARQ CORP	5,982	32.66000	195,372.12	
29101110	EMERSON ELECTRIC CO	29,180	34.18000	997,372.40	
29266R10	ENERGIZER HOLDINGS INC	1,911	45.12000	86,224.32	
29356210	EOG RESOURCES INC	9,486	81.81000	776,049.66	
29364G10	ENTERGY CORP	7,242	78.93000	571,611.06	
29442910	EQUIFAX INC	4,959	26.30000	130,421.70	
29454910	EQUITABLE RESOURCES INC	4,360	32.24000	140,566.40	
30161N10	EXELON CORPORATION	24,514	53.83000	1,319,588.62	
30212P10	EXPEDIA INC	6,900	8.51000	58,719.00	
30213010	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	8,152	34.70000	282,874.40	
30218210	EXPRESS SCRIPTS INC	8,256	61.78000	510,055.68	
30225X10	EXTERRAN HOLDINGS INC	2,105	22.77000	47,930.85	
30231G10	EXXON MOBIL CORPORATION	195,704	73.69000	14,421,427.76	
30249U10	FMC TECHNOLOGIES INC	4,950	37.35000	184,882.50	
30257110	FPL GROUP INC	14,605	45.98000	671,537.90	
30700010	FAMILY DOLLAR STORES	5,308	25.32000	134,398.56	
31190010	FASTENAL COMPANY	4,974	36.92000	183,640.08	
31304N10	FEDEX CORP	11,103	63.92000	709,703.76	
31410H10	MACY'S INC	14,229	10.85000	154,384.65	
31620R10	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL, INC.	7,616	8.50000	64,736.00	
31677310	FIFTH THIRD BANCORP	18,929	11.07000	209,544.03	
31852230	FIRST AMERICAN CORP	3,035	20.38000	61,853.30	
33643310	FIRST SOLAR INC	1,445	152.09000	219,770.05	
33735810	WACHOVIA CORP	83,308	5.98000	498,181.84	
33773810	FISERV INC	6,424	34.18000	219,572.32	
33793210	FIRSTENERGY CORP	11,538	53.34000	615,436.92	
34354P10	FLOWSERVE CORP	2,295	56.48000	129,621.60	
34386110	FLUOR CORP	6,838	37.75000	258,134.50	
34537010	FORD MOTOR CO	30,000	2.09000	62,700.00	
34555010	FOREST CITY ENTERPRISES INC	2,420	11.07000	26,789.40	
34583810	FOREST LABORATORIES INC	11,915	23.05000	274,640.75	
34609170	FOREST OIL CORP	2,905	24.90000	72,334.50	
34963110	FORTUNE BRANDS INC	5,261	38.06000	200,233.66	
35461310	FRANKLIN RESOURCES INC	6,225	66.94000	416,701.50	
35671D85	FREEMPORT-MCMORAN COPPER-B	14,429	30.06000	433,735.74	
36467W10	GAMESTOP CORP	6,025	25.28000	152,312.00	

36473010	GANNETT CO	7,180	11.87000	85,226.60	
36476010	GAP INC	19,716	12.84000	253,153.44	
36871010	GENENTECH INC	17,672	83.91000	1,482,857.52	
36955010	GENERAL DYNAMICS CORP	12,407	62.11000	770,598.77	
36960410	GENERAL ELECTRIC COMPANY	388,758	19.93000	7,747,946.94	
37033410	GENERAL MILLS INC	12,802	65.76000	841,859.52	
37044210	GENERAL MOTORS CORP	3,500	5.56000	19,460.00	
37246010	GENUINE PARTS CO	6,571	38.39000	252,260.69	
37247D10	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	13,515	5.18000	70,007.70	
37291710	GENZYME CORP - GENL DIVISION	10,304	70.90000	730,553.60	
37555810	GILEAD SCIENCES INC	34,472	45.02000	1,551,929.44	
38141G10	GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,613	87.43000	1,277,614.59	
38238810	GOODRICH CORP	4,860	36.93000	179,479.80	
38255010	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	9,190	8.91000	81,882.90	
38259P50	GOOGLE INC-CL A	8,916	342.24000	3,051,411.84	
38480210	WW GRAINGER INC	2,317	76.14000	176,416.38	
40621610	HALLIBURTON CO	33,042	19.22000	635,067.24	
41131010	HANSEN NATURAL CORP	2,320	24.29000	56,352.80	
41282210	HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	22.71000	201,982.74	
41387510	HARRIS CORP	5,305	36.82000	195,330.10	
41586410	HARSCO CORP	3,365	23.86000	80,288.90	
41651510	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	11,257	17.15000	193,057.55	
41805610	HASBRO INC	4,903	28.10000	137,774.30	
42222G10	HEALTH NET INC	3,941	11.47000	45,203.27	
42307410	HJ HEINZ CO	12,250	43.27000	530,057.50	
42345210	HELMERICH & PAYNE INC	3,500	33.19000	116,165.00	
42786610	HERSHEY COMPANY	5,765	36.65000	211,287.25	
42823610	HEWLETT-PACKARD CO	91,735	36.25000	3,325,393.75	
43644010	HOLOGIC INC	9,128	13.12000	119,759.36	
43707610	HOME DEPOT INC	63,160	22.15000	1,398,994.00	
43850610	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,121	30.99000	809,489.79	
44106010	HOSPIRA INC	5,936	30.60000	181,641.60	
44368310	HUDSON CITY BANCORP INC	18,525	18.01000	333,635.25	
44441810	THE DIRECTV GROUP INC	26,156	20.80000	544,044.80	
44485910	HUMANA INC	6,600	36.01000	237,666.00	
44615010	HUNTINGTON BANCSHARES INC	13,195	10.04000	132,477.80	
44701110	HUNTSMAN CORP	4,975	8.49000	42,237.75	
44993410	IMS HEALTH INC	6,945	14.47000	100,494.15	
45091110	ITT CORPORATION	6,343	45.04000	285,688.72	
45230810	ILLINOIS TOOL WORKS	15,535	33.46000	519,801.10	
45686610	INGERSOLL-RAND CO-CL A	11,376	17.91000	203,744.16	
45814010	INTEL CORP	214,062	15.06000	3,223,773.72	
45865V10	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,090	81.90000	171,171.00	
45920010	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	51,067	89.94000	4,592,965.98	
45950610	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	3,189	31.17000	99,401.13	
45990210	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY	11,686	13.38000	156,358.68	
46014610	INTERNATIONAL PAPER CO	14,895	16.18000	241,001.10	
46069010	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	20,306	5.14000	104,372.84	
46069S10	INTERSIL CORP -CL A	4,455	12.67000	56,444.85	
46120210	INTUIT INC	11,761	25.32000	297,788.52	
46120E60	INTUITIVE SURGICAL INC	1,430	186.72000	267,009.60	
46284610	IRON MOUNTAIN INC	6,947	23.90000	166,033.30	
46981410	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,770	35.52000	169,430.40	
47816010	JOHNSON & JOHNSON	104,699	59.85000	6,266,235.15	
47836610	JOHNSON CONTROLS INC	22,583	18.72000	422,753.76	
48116510	JOY GLOBAL INC	3,735	28.39000	106,036.65	
48203R10	JUNIPER NETWORKS INC	19,408	17.21000	334,011.68	

48242W10	KBR INC	6,205	15.65000	97,108.25	
48248010	KLA-TENCOR CORPORATION	5,839	22.77000	132,954.03	
48783610	KELLOGG CO	10,153	50.33000	511,000.49	
49326710	KEYCORP	17,878	12.54000	224,190.12	
49436810	KIMBERLY-CLARK CORP	15,638	59.11000	924,362.18	
50025510	KOHL'S CORP	11,187	33.33000	372,862.71	
50075N10	KRAFT FOODS INC-A	54,385	29.23000	1,589,673.55	
50104410	KROGER CO	24,000	26.70000	640,800.00	
50216110	LSI CORP	21,495	3.96000	85,120.20	
50242410	L-3 COMMUNICATIONS	4,431	79.36000	351,644.16	
50540R40	LABORATORY CORPORATION OF AMERICAN HOLDINGS	4,320	62.10000	268,272.00	
51280710	LAM RESEARCH CORPORATION	4,857	23.03000	111,856.71	
51281510	LAMAR ADVERTISING COMPANY-CL A	2,705	15.32000	41,440.60	
51783410	LAS VEGAS SANDS CORP	3,405	11.66000	39,702.30	
51843910	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,275	34.20000	146,205.00	
52466010	LEGGETT & PLATT INC	5,413	16.79000	90,884.27	
52490110	LEGG MASON INC	4,715	19.45000	91,706.75	
52605710	LENNAR CORP-CL A	4,416	8.56000	37,800.96	
52728810	LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	27.86000	203,517.30	
52977110	LEXMARK INTERNATIONAL INC	3,305	26.70000	88,243.50	
53055530	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	5,543	15.77000	87,413.11	
53071910	LIBERTY GLOBAL INC-A	6,058	16.11000	97,594.38	
53071M10	LIBERTY MEDIA HOLDING CORP-INTERACTIVE A	20,745	4.63000	96,049.35	
53071M50	LIBERTY MEDIA CORP - ENTERTAINMENT	17,526	16.00000	280,416.00	
53245710	ELI LILLY & CO	38,238	33.76000	1,290,914.88	
53271610	LIMITED BRANDS	10,423	11.51000	119,968.73	
53418710	LINCOLN NATIONAL CORP	9,838	20.47000	201,383.86	
53567810	LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,034	22.28000	178,997.52	
53983010	LOCKHEED MARTIN CORP	12,866	84.39000	1,085,761.74	
54042410	LOEWS CORP	12,955	32.05000	415,207.75	
54414710	LORILLARD INC	6,400	60.39000	386,496.00	
54866110	LOWE'S COS INC	54,634	20.51000	1,120,543.34	
55261F10	M & T BANK CORP	2,573	78.25000	201,337.25	
55269010	MDU RESOURCES GROUP INC	5,945	18.61000	110,636.45	

[次へ](#)



(単位:株、円)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
55271510	MEMC ELECTRONIC MATERIALS INC	8,695	19.83000	172,421.85	
55295310	MGM MIRAGE	3,995	15.99000	63,880.05	
56357110	MANITOWOC CO INC/THE	3,985	9.40000	37,459.00	
56418H10	MANPOWER INC	2,612	31.36000	81,912.32	
57174810	MARSH & MCLENNAN COMPANIES INC	19,603	26.06000	510,854.18	
57183410	MARSHALL & ILSLEY CORP	9,132	17.07000	155,883.24	
57190310	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,701	19.78000	191,885.78	
57328410	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	1,430	85.09000	121,678.70	
57459910	MASCO CORP	13,969	9.59000	133,962.71	
57636Q10	MASTERCARD INC-A	2,665	155.87000	415,393.55	
57708110	MATTEL INC	12,524	14.98000	187,609.52	
57978020	MCCORMIK & CO-NON VGT SHRS	4,730	32.26000	152,589.80	
58003710	MCDERMOTT INTERNATIONAL INC	7,755	15.56000	120,667.80	
58013510	MCDONALD'S CORPORATION	42,361	56.00000	2,372,216.00	
58064510	MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,642	26.28000	305,951.76	
58155Q10	MCKESSON CORPORATION	10,729	37.52000	402,552.08	
58333410	MEADWESTVACO CORP	5,859	14.21000	83,256.39	
58405U10	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	19,402	41.47000	804,600.94	
58505510	MEDTRONIC INC	41,967	39.14000	1,642,588.38	
58933110	MERCK & CO. INC.	80,218	28.72000	2,303,860.96	
59018810	MERRILL LYNCH & CO INC	58,214	17.62000	1,025,730.68	
59156R10	METLIFE INC	29,155	35.75000	1,042,291.25	
59170810	METROPCS COMMUNICATIONS INC	7,425	14.02000	104,098.50	
59491810	MICROSOFT CORP	310,459	22.08000	6,854,934.72	
59501710	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,564	23.08000	151,497.12	
59511210	MICRON TECHNOLOGY INC	29,277	4.80000	140,529.60	
60107310	MILLIPORE CORP	2,230	53.94000	120,286.20	
60405910	3M CO	25,001	64.52000	1,613,064.52	
60467510	MIRANT CORP	8,230	16.36000	134,642.80	
60819010	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,823	42.33000	77,167.59	
60871R20	MOLSON COORS BREWING COMPANY-B	4,480	41.78000	187,174.40	
61166W10	MONSANTO CO	20,506	87.71000	1,798,581.26	
61536910	MOODY'S CORPORATION	7,742	23.15000	179,227.30	
61744644	MORGAN STANLEY	37,555	17.06000	640,688.30	
61945A10	MOSAIC CO/THE	5,940	38.36000	227,858.40	
62007610	MOTOROLA INC	87,340	4.80000	419,232.00	
62671710	MURPHY OIL CORPORATION	6,630	49.85000	330,505.50	
62913F20	NII HOLDINGS INC	6,562	22.38000	146,857.56	
62937750	NRG ENERGY INC	8,695	24.00000	208,680.00	
62940M10	VIRGIN MEDIA INC	9,840	6.24000	61,401.60	
62949W10	NYSE EURONEXT	4,645	27.62000	128,294.90	
62956810	NABORS INDUSTRIES LTD	9,561	16.75000	160,146.75	
63110310	NASDAQ STOCK MARKET INC	4,855	32.41000	157,350.55	
63540510	NATIONAL CITY CORP	12,000	2.54000	30,480.00	
63707110	NATIONAL-OILWELL VARCO INC	15,751	29.92000	471,269.92	
63764010	NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	8,530	13.80000	117,714.00	
63861210	NATIONWIDE FINANCIAL SERVICES	1,815	47.60000	86,394.00	
64093810	MCAFEE INC	6,335	31.45000	199,235.75	
64120L10	NETAPP INC	12,586	13.28000	167,142.08	
64944510	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	11,799	14.01000	165,303.99	
65119210	NEWELL RUBBERMAID INC	9,710	14.33000	139,144.30	
65129010	NEWFIELD EXPLORATION COMPANY	4,570	24.27000	110,913.90	
65163910	NEWMONT MINING CORP	16,445	27.81000	457,335.45	
65248770	NEWS CORP INC-CL B WHEN ISS	12,694	9.93000	126,051.42	
65248780	NEWS CORP-CL A	70,072	9.79000	686,004.88	

65410610	NIKE INC -CL B	14,037	52.78000	740,872.86	
65473P10	NISOURCE INC	10,140	13.25000	134,355.00	
65489410	NOBLE ENERGY INC	6,371	51.50000	328,106.50	
65504210	NOBLE CORP	9,732	31.01000	301,789.32	
65566410	NORDSTROM INC	6,435	16.01000	103,024.35	
65584410	NORFOLK SOUTHERN CORP	14,250	57.07000	813,247.50	
66577210	XCEL ENERGY INC	15,834	17.73000	280,736.82	
66585910	NORTHERN TRUST CORP	7,635	52.28000	399,157.80	
66680710	NORTHROP GRUMMAN CORP	11,714	46.68000	546,809.52	
67034610	NUCOR CORP	11,949	35.50000	424,189.50	
67066G10	NVIDIA CORP	18,290	8.51000	155,647.90	
67459910	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,671	53.94000	1,654,393.74	
67622010	OFFICE DEPOT INC	8,290	2.89000	23,958.10	
68022310	OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP	8,198	8.81000	72,224.38	
68191910	OMNICOM GROUP INC	12,402	29.74000	368,835.48	
68389X10	ORACLE CORP	154,015	17.82000	2,744,547.30	
69076840	OWENS-ILLINOIS INC	6,475	22.95000	148,601.25	
69331C10	P G & E CORP	13,646	36.30000	495,349.80	
69347510	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,185	68.34000	901,062.90	
69349910	PPL CORPORATION	14,163	30.00000	424,890.00	
69350610	PPG INDUSTRIES INC	6,162	48.22000	297,131.64	
69371810	PACCAR INTERNATIONAL INC	12,529	29.42000	368,603.18	
69525710	PACTIV CORPORATION	5,804	25.42000	147,537.68	
69642930	PALL CORP	4,541	26.43000	120,018.63	
70109410	PARKER HANNIFIN CORP	6,150	38.39000	236,098.50	
70341210	PATTERSON COS INC	4,587	23.13000	106,097.31	
70348110	PATTERSON-UTI ENERGY INC	5,197	12.64000	65,690.08	
70432610	PAYCHEX INC	11,752	27.88000	327,645.76	
70454910	PEABODY ENERGY CORPORATION	9,990	32.32000	322,876.80	
70816010	J.C. PENNEY CO INC (HOLDING CO)	7,661	22.23000	170,304.03	
70963110	PENTAIR INC	3,434	27.12000	93,130.08	
71019810	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	13,935	17.08000	238,009.80	
71340910	PEPSI BOTTLING GROUP INC	4,510	23.13000	104,316.30	
71344810	PEPSICO INC	59,273	57.01000	3,379,153.73	
71404110	APPLIED BIOSYSTEMS INC	6,925	30.69000	212,528.25	
71649510	PETROHAWK ENERGY CORP	9,625	17.49000	168,341.25	
71676810	PETSMART INC	4,270	17.83000	76,134.10	
71708110	PFIZER INC	251,562	17.00000	4,276,554.00	
71815410	ALTRIA GROUP INC	78,268	18.24000	1,427,608.32	
71817210	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	78,828	44.02000	3,470,008.56	
71850710	CONOCOPHILLIPS	54,760	53.46000	2,927,469.60	
72348410	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	4,079	30.24000	123,348.96	
72378710	PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	4,320	24.79000	107,092.80	
72447910	PITNEY BOWES INC	7,308	25.55000	186,719.40	
72650510	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	3,735	26.51000	99,014.85	
73157210	POLO RALPH LAUREN CORP	2,045	48.00000	98,160.00	
73767910	PEPCO HOLDINGS INC	7,507	17.57000	131,897.99	
74005P10	PRAXAIR INC	11,760	63.21000	743,349.60	
74018910	PRECISION CASTPARTS CORP	5,280	60.73000	320,654.40	
74147710	T ROWE PRICE GROUP INC	9,570	38.00000	363,660.00	
74153Q10	PRIDE INTERNATIONAL INC	5,675	18.95000	107,541.25	
74251V10	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,505	25.54000	242,757.70	
74271810	PROCTER & GAMBLE COMPANY	113,078	63.81000	7,215,507.18	
74326310	PROGRESS ENERGY INC	9,318	39.11000	364,426.98	
74331510	PROGRESSIVE CORP	23,685	13.29000	314,773.65	

74432010	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	16,332	39.01000	637,111.32	
74457310	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	19,278	27.63000	532,651.14	
74586710	PULTE HOMES INC	7,409	10.66000	78,979.94	
74752510	QUALCOMM INC	60,492	35.17000	2,127,503.64	
74834L10	QUEST DIAGNOSTICS INC	6,586	46.27000	304,734.22	
74835610	QUESTAR CORPORATION	6,755	33.16000	223,995.80	
74912110	QWEST COMMUNICATIONS INTERNATIONAL INC	60,828	3.30000	200,732.40	
75281A10	RANGE RESOURCES CORP	6,045	40.32000	243,734.40	
75511140	RAYTHEON COMPANY	15,717	49.69000	780,977.73	
75894010	REGIONS FINANCIAL CORP	25,154	11.49000	289,019.46	
75952B10	RELIANT ENERGY INC	11,890	5.74000	68,248.60	
75952J10	CENTERPOINT ENERGY INC	12,352	12.12000	149,706.24	
76075910	REPUBLIC SERVICES INC	7,459	24.11000	179,836.49	
76182K10	REYNOLDS AMERICAN INC	6,310	47.07000	297,011.70	
77032310	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	5,425	18.79000	101,935.75	
77390310	ROCKWELL AUTOMATION INC	5,303	27.71000	146,946.13	
77434110	ROCKWELL COLLINS INC.	5,835	36.36000	212,160.60	
77537110	ROHM AND HAAS CO	4,670	70.25000	328,067.50	
77669610	ROPER INDUSTRIES INC	3,055	43.43000	132,678.65	
77829610	ROSS STORES INC	4,893	29.99000	146,741.07	
77938210	ROWAN COMPANIES INC	3,895	20.89000	81,366.55	
78387G10	AT&T INC	220,781	27.15000	5,994,204.15	
78411710	SEI INVESTMENTS CO	4,885	16.93000	82,703.05	
78463510	SPX CORP	1,872	39.34000	73,644.48	
78651420	SAFEWAY INC	16,043	21.60000	346,528.80	
79084910	ST JUDE MEDICAL INC	13,130	36.78000	482,921.40	
79286010	TRAVELERS COS INC/THE	22,684	40.43000	917,114.12	
79466L30	SALESFORCE.COM INC	4,030	29.80000	120,094.00	
80004C10	SANDISK CORPORATION	7,848	10.14000	79,578.72	
80311110	SARA LEE CORP	26,673	10.20000	272,064.60	
80589M10	SCANA CORP	4,378	33.88000	148,326.64	
80640710	HENRY SCHEIN INC	3,500	41.63000	145,705.00	
80660510	SCHERING-PLOUGH CORP	61,750	15.00000	926,250.00	
80685710	SCHLUMBERGER LTD	44,587	50.24000	2,240,050.88	
80851310	CHARLES SCHWAB CORP	37,159	19.42000	721,627.78	
81106510	SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,345	27.01000	90,348.45	
81211K10	SEALED AIR CORP	5,646	16.80000	94,852.80	
81235010	SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,491	54.93000	136,830.63	
81685110	SEMPRA ENERGY	9,047	43.47000	393,273.09	
82434810	SHERWIN-WILLIAMS CO	3,772	55.63000	209,836.36	
82655210	SIGMA ALDRICH CORP	5,120	42.55000	217,856.00	
83211010	SMITH INTERNATIONAL INC	7,936	33.81000	268,316.16	
84258710	SOUTHERN CO	28,670	34.62000	992,555.40	
84474110	SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	6,100	11.72000	71,492.00	
84546710	SOUTHWESTERN ENERGY CO	12,595	36.91000	464,881.45	
84590510	SOVEREIGN BANCORP INC	18,075	2.86000	51,694.50	
84756010	SPECTRA ENERGY CORP	24,184	18.17000	439,423.28	
85206110	SPRINT NEXTEL CORPORATION	100,862	3.71000	374,198.02	
85461610	STANLEY WORKS	2,182	35.88000	78,290.16	
85503010	STAPLES INC	26,709	18.71000	499,725.39	
85524410	STARBUCKS CORP	26,092	11.67000	304,493.64	
85590520	STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	6,187	20.19000	124,915.53	
85747710	STATE STREET CORP	16,187	42.76000	692,156.12	
85811910	STEEL DYNAMICS INC	5,640	10.36000	58,430.40	
86083110	JANUS CAPITAL GROUP INC	5,715	10.53000	60,178.95	
86366710	STRYKER CORP	11,103	53.01000	588,570.03	
86676210	SUNOCO INC	4,158	30.59000	127,193.22	

86681010	SUN MICROSYSTEMS INC	29,386	4.62000	135,763.32	
86765210	SUNPOWER CORP-CLASS A	1,955	32.99000	64,495.45	
86791410	SUNTRUST BANKS INC	12,657	39.94000	505,520.58	
86853610	SUPERVALU INC	7,550	14.54000	109,777.00	
87150310	SYMANTEC CORP	32,010	13.20000	422,532.00	
87160710	SYNOPSYS INC	4,727	17.63000	83,337.01	
87182910	SYSCO CORP	22,966	24.74000	568,178.84	
87236Y10	TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,915	13.14000	104,003.10	
87254010	TJX COMPANIES INC	16,224	25.99000	421,661.76	
87294110	MONSTER WORLDWIDE INC	3,580	12.53000	44,857.40	
87943310	TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	2,240	26.28000	58,867.20	
88077910	TEREX CORP	3,205	16.00000	51,280.00	
88160910	TESORO CORP	4,450	9.23000	41,073.50	
88250810	TEXAS INSTRUMENTS INC	49,737	18.28000	909,192.36	
88320310	TEXTRON INC	8,516	16.93000	144,175.88	
88355610	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,164	40.17000	649,307.88	
88654710	TIFFANY & CO	5,030	24.90000	125,247.00	
88706M10	TIM HORTONS INC	6,709	25.23000	169,268.07	
88732J10	TIME WARNER CABLE INC	6,755	19.90000	134,424.50	
88947810	TOLL BROTHERS INC	5,526	20.73000	114,553.98	
89102710	TORCHMARK CORP	4,181	43.00000	179,783.00	
89190610	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	5,336	13.29000	70,915.44	
89595310	YUM! BRANDS INC	17,804	28.33000	504,387.32	
90212410	TYCO INTERNATIONAL LTD	18,805	25.34000	476,518.70	
90249410	TYSON FOODS INC	11,206	8.63000	96,707.78	
90290582	MARATHON OIL CORPORATION	26,892	29.96000	805,684.32	
90291110	UST INC	5,630	68.10000	383,403.00	
90297310	US BANCORP	65,046	29.73000	1,933,817.58	
90319210	UNUM GROUP	12,933	17.36000	224,516.88	
90337T10	UNITED STATES STEEL CORP	4,537	37.75000	171,271.75	
90390U10	SLM CORP	16,687	10.35000	172,710.45	
90391410	ULTRA PETROLEUM CORP	5,899	47.05000	277,547.95	
90781810	UNION PACIFIC CORP	18,513	64.46000	1,193,347.98	
91058110	UNITEDHEALTH GROUP INC	45,915	22.77000	1,045,484.55	
91131210	UNITED PARCEL SERVICE INC-CL B	25,632	52.44000	1,344,142.08	
91301710	UNITED TECHNOLOGIES CORP	34,550	53.67000	1,854,298.50	
91820410	VF CORP	3,535	54.62000	193,081.70	
91913Y10	VALERO ENERGY CORPORATION	19,137	20.70000	396,135.90	
92220P10	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,819	43.02000	207,313.38	
92343E10	VERISIGN INC	7,695	21.00000	161,595.00	
92552430	VIACOM INC-CLASS B	19,503	19.85000	387,134.55	
92826C83	VISA INC	14,870	56.47000	839,708.90	
92916010	VULCAN MATERIALS CO	4,158	56.30000	234,095.40	
93114210	WAL-MART STORES INC	88,162	54.13000	4,772,209.06	
93142210	WALGREEN CO	37,012	24.46000	905,313.52	
93964010	THE WASHINGTON POST COMPANY	207	445.50000	92,218.50	
94106L10	WASTE MANAGEMENT INC	18,439	31.21000	575,481.19	
94184810	WATERS CORP	4,046	43.10000	174,382.60	
94707410	WEATHERFORD INTERNATIONAL LTD	25,749	15.74000	405,289.26	
94974610	WELLS FARGO & COMPANY	116,714	31.68000	3,697,499.52	
95810210	WESTERN DIGITAL CORP	8,545	15.82000	135,181.90	
95980210	WESTERN UNION CO/THE	28,251	15.49000	437,607.99	
96216610	WEYERHAEUSER CO	7,540	33.30000	251,082.00	
96332010	WHIRLPOOL CORP	2,494	46.77000	116,644.38	
96683710	WHOLE FOODS MARKET INC	4,540	10.31000	46,807.40	
96945710	THE WILLIAMS COMPANIES INC	22,384	19.59000	438,502.56	
96990410	WILLIAMS-SONOMA INC	2,647	9.35000	24,749.45	
97428010	WINDSTREAM CORPORATION	17,230	8.38000	144,387.40	
97665710	WISCONSIN ENERGY CORP	5,127	41.92000	214,923.84	

98310W10	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5,719	8.19000	46,838.61	
98313410	WYNN RESORTS LIMITED	2,045	47.39000	96,912.55	
98385X10	XTO ENERGY INC	20,937	36.38000	761,688.06	
98391910	XILINX INC	10,705	17.49000	187,230.45	
98412110	XEROX CORP	32,701	7.71000	252,124.71	
98433210	YAHOO! INC	49,730	13.92000	692,241.60	
98956P10	ZIMMER HOLDINGS INC	8,937	45.54000	406,990.98	
98970110	ZIONS BANCORPORATION	4,007	39.37000	157,755.59	
99990000	FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	30,311	4.01000	121,547.11	
G0070K10	ACE LTD	12,603	52.37000	660,019.11	
G0692U10	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,280	26.48000	139,814.40	
G1696210	BUNGE LIMITED	4,727	44.16000	208,744.32	
G2552X10	COVIDIEN LTD	18,935	43.58000	825,187.30	
G3223R10	EVEREST RE GROUP LTD	2,494	69.25000	172,709.50	
G3653513	FOSTER WHEELER LTD	5,570	27.77000	154,678.90	
G3726010	GARMIN LTD	3,860	21.24000	81,986.40	
G491BT10	INVESCO LTD	15,122	14.58000	220,478.76	
G5876H10	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	19,654	7.11000	139,739.94	
G6852T10	PARTNERRE LTD	2,372	64.85000	153,824.20	
G7496G10	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,362	43.69000	103,195.78	
G7945J10	SEAGATE TECHNOLOGY	16,969	7.01000	118,952.69	
G9007810	TRANSOCEAN INC	11,915	80.35000	957,370.25	
G9144P10	TYCO ELECTRONICS LTD	17,830	19.01000	338,948.30	
G9665510	WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	6,770	26.32000	178,186.40	
G9825510	XL CAPITAL LTD -CLASS A	10,191	10.07000	102,623.37	
V7780T10	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,188	13.90000	72,113.20	
アメリカドル 計		11,179,454		323,170,845.33	
(邦貨換算額)				(31,715,986,761)	

[次へ](#)

## 外国株式（カナダドル）

（単位：株、カナダドル）

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
ABX	BARRICK GOLD CORP	32,779	29.36000	962,391.44	
ACM/A	ASTRAL MEDIA INC	2,140	27.97000	59,855.80	
AER	GROUPE AEROPLAN INC	7,455	10.60000	79,023.00	
AGE	AGNICO-EAGLE MINES	5,170	38.14000	197,183.80	
AGU	AGRIUM INC	5,510	46.18000	254,451.80	
ATD/B	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	4,805	15.61000	75,006.05	
AXC	ADDAX PETROLEUM CORP	2,885	19.32000	55,738.20	
BBDB	BOMBARDIER INC 'B'	49,801	4.78000	238,048.78	
BCE	BCE INC	9,635	35.48000	341,849.80	
BMO	BANK OF MONTREAL	19,051	42.95000	818,240.45	
BNA	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	17,722	21.00000	372,162.00	
BNS	BANK OF NOVA SCOTIA	36,879	39.87000	1,470,365.73	
BPO	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	7,154	10.95000	78,336.30	
BVF	BIOVAIL CORPORATION	3,909	10.69000	41,787.21	
CAE	CAE INC	7,695	7.00000	53,865.00	
CCO	CAMECO CORP CORPORATION	11,537	21.17000	244,238.29	
CM	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	14,390	55.30000	795,767.00	
CNQ	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	20,202	60.41000	1,220,402.82	
CNR	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	17,889	51.14000	914,843.46	
CPZ	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,440	51.90000	282,336.00	
CTR/A	CANADIAN TIRE CORPORATION LIMITED -CL A	2,740	45.30000	124,122.00	
CU	CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,920	41.25000	79,200.00	
ECA	ENCANA CORP	28,013	60.24000	1,687,503.12	
ELD	ELDORADO GOLD CORP	10,715	5.97000	63,968.55	
ENB	ENBRIDGE INC	13,020	42.00000	546,840.00	
ESI	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	4,520	15.30000	69,156.00	
FFH	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	632	350.00000	221,200.00	
FM	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	2,185	26.53000	57,968.05	
FTS	FORTIS INC	6,415	26.27000	168,522.05	
FTT	FINNING INTERNATIONAL INC	5,795	15.51000	89,880.45	
G	GOLDCORP INC	27,387	26.78000	733,423.86	
GIB/A	CGI GROUP INC	9,350	9.44000	88,264.00	
GIL	GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	27.74000	108,740.80	
GWO	GREAT WEST LIFECO INC	10,294	26.85000	276,393.90	
HSE	HUSKY ENERGY INC	9,224	36.40000	335,753.60	
IGI	IGM FINANCIAL INC	4,555	35.86000	163,342.30	
IMN	INMET MINING CORP	1,500	28.67000	43,005.00	
IMO	IMPERIAL OIL LTD	11,822	40.32000	476,663.04	
IVN	IVANHOE MINES LTD	6,975	3.66000	25,528.50	
K	KINROSS GOLD CORP	24,883	14.95000	372,000.85	
L	LOBLAW COMPANIES LTD	4,479	28.84000	129,174.36	
LUN	LUNDIN MINING CORP	10,060	1.80000	18,108.00	
MDS	MDS INC	4,622	13.09000	60,501.98	
MFC	MANULIFE FINANCIAL CORP	56,061	25.80000	1,446,373.80	
MGA	MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	4,027	40.00000	161,080.00	
MRU/A	METRO INC-A	3,415	31.34000	107,026.10	
MX	METHANEX CORPORATION	3,335	13.58000	45,289.30	
NA	NATIONAL BANK OF CANADA	5,990	45.75000	274,042.50	
NCX	NOVA CHEMICALS CORPORATION	2,830	15.55000	44,006.50	
NKO	NIKO RESOURCES LTD	1,500	57.50000	86,250.00	
NT	NORTEL NETWORKS CORP	15,605	1.46000	22,783.30	
NXY	NEXEN INC	17,825	19.72000	351,509.00	
OCX	ONEX CORPORATION	3,840	22.50000	86,400.00	
OPC	OPTI CANADA INC	6,545	3.52000	23,038.40	

PAA	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,360	15.84000	37,382.40	
PCA	PETRO-CANADA	17,185	27.18000	467,088.30	
PD	PRECISION DRILLING TRUST	1,780	12.92000	22,997.60	
POT	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	11,824	102.00000	1,206,048.00	
POW	POWER CORP OF CANADA	12,410	28.00000	347,480.00	
PWF	POWER FINANCIAL CORPORATION	8,850	32.00000	283,200.00	
RBA	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	3,555	23.79000	84,573.45	
RCI/B	ROGERS COMMUNICATIONS INC-CL B	19,025	35.49000	675,197.25	
RIM	RESEARCH IN MOTION	18,968	62.40000	1,183,603.20	
RY	ROYAL BANK OF CANADA	48,339	46.71000	2,257,914.69	
SAP	SAPUTO INC	5,350	23.05000	123,317.50	
SC	SHOPPERS DRUG MART CORP	7,605	47.67000	362,530.35	
SHER	SHERRITT INTERNATIONAL CORP	8,195	3.48000	28,518.60	
SJRB	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,365	22.09000	295,232.85	
SLC	SUN LIFE FINANCIAL INC	20,699	29.94000	619,728.06	
SNC	SNC-LAVALIN GROUP INC	5,800	34.51000	200,158.00	
SU	SUNCOR ENERGY INC	34,703	27.87000	967,172.61	
T	TELUS CORP	1,440	42.43000	61,099.20	
T/A	TELUS CORPORATION -NON VOTE	4,348	39.48000	171,659.04	
TA	TRANSALTA CORP	7,070	23.50000	166,145.00	
TCW	TRICAN WELL SERVICE LTD	4,075	11.25000	45,843.75	
TD	TORONTO-DOMINION BANK	30,050	57.43000	1,725,771.50	
TEK/B	TECK COMINCO LIMIED-CL B	16,840	12.80000	215,552.00	
TLM	TALISMAN ENERGY INC	36,117	12.18000	439,905.06	
TOC	THOMSON REUTERS CORP	8,334	28.66000	238,852.44	
TRE	SINO-FOREST CORP	5,205	10.38000	54,027.90	
TRP	TRANSCANADA CORP	20,898	36.73000	767,583.54	
UUU	URANIUM ONE INC	15,185	1.38000	20,955.30	
WN	GEORGE WESTON LTD	1,907	59.49000	113,447.43	
X	TMX GROUP INC	2,990	28.66000	85,693.40	
YRI	YAMANA GOLD INC	20,686	5.86000	121,219.96	
カナダドル 計		1,023,205		30,532,850.62	
(邦貨換算額)				(2,561,400,839)	

## 外国株式（オーストラリアドル）

（単位：株、オーストラリアドル）

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AGK	AGL ENERGY LTD	15,775	15.50000	244,512.50	
AIO	ASCIANO GROUP	20,645	2.32000	47,896.40	
ALL	ARISTOCRAT LEISURE LTD	11,305	3.76000	42,506.80	
AMC	AMCOR LTD	31,910	6.30000	201,033.00	
AMP	AMP LIMITED	67,717	5.89000	398,853.13	
ANZ	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	71,817	19.00000	1,364,523.00	
ASX	ASX LTD	6,325	34.45000	217,896.25	
BBG	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	6,630	12.40000	82,212.00	
BHP	BHP BILLITON LTD	125,421	31.60000	3,963,303.60	
BLY	BOART LONGYEAR GROUP	45,685	0.47000	21,471.95	
BNB	BABCOCK & BROWN LTD	7,860	1.12500	8,842.50	
BOR	BORAL LIMITED	22,060	5.14000	113,388.40	
BSL	BLUESCOPE STEEL LIMITED	24,596	5.15000	126,669.40	
BXBAU	BRAMBLES LTD	52,093	8.54000	444,874.22	
CBA	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	49,557	41.00000	2,031,837.00	
CCL	COCA-COLA AMATIL LIMITED	18,620	8.30000	154,546.00	
COH	COCHLEAR LIMITED	2,157	58.03000	125,170.71	
CPU	COMPUTERSHARE LIMITED	17,960	8.45000	151,762.00	
CSL	CSL LIMITED	23,047	37.52000	864,723.44	
CSR	CSR LIMITED	31,278	2.24000	70,062.72	
CTX	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	4,880	9.68000	47,238.40	

CWN	CROWN LTD	13,100	7.30000	95,630.00	
FBG	FOSTER'S GROUP LTD	71,770	5.85000	419,854.50	
FMG	FORTESCUE METALS GROUP LTD	41,110	3.04000	124,974.40	
FXJ	FAIRFAX MEDIA LTD	44,850	2.07000	92,839.50	
GFF	GOODMAN FIELDER LTD	52,445	1.67000	87,583.15	
HVN	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	16,110	3.00000	48,330.00	
IPL	INCITEC PIVOT LTD	41,100	4.48000	184,128.00	
JHX	JAMES HARDIE INDUSTRIES NW	16,765	5.22000	87,513.30	
LEI	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,795	28.65000	166,026.75	
LLC	LEND LEASE CORP LIMITED	12,302	7.60000	93,495.20	
LNN	LION NATHAN LIMITED	14,855	8.78000	130,426.90	
MAP	MACQUARIE AIRPORTS	22,500	2.24000	50,400.00	
MBL	MACQUARIE GROUP LIMITED	10,201	35.00000	357,035.00	
MIG	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP	80,542	2.02000	162,694.84	
NAB	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	60,988	25.90000	1,579,589.20	
NCM	NEWCREST MINING LIMITED	16,344	22.50000	367,740.00	
NMH	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	29,990	4.60000	137,954.00	
NRM	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	67,243	4.09000	275,023.87	
ORG	ORIGIN ENERGY LIMITED	32,600	16.59000	540,834.00	
ORI	ORICA LTD	13,360	18.90000	252,504.00	
OST	ONESTEEL LIMITED	26,170	4.06000	106,250.20	
OXR	OZ MINERALS LTD	98,313	1.07000	105,194.91	
PDN	PALADIN ENERGY LTD	18,300	2.77000	50,691.00	
PPT	PERPETUAL LTD	1,530	38.99000	59,654.70	
QAN	QANTAS AIRWAYS LIMITED	29,640	2.88000	85,363.20	
QBE	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	33,565	27.38000	919,009.70	
RIO	RIO TINTO LIMITED	10,805	86.60000	935,713.00	
SGB	ST GEORGE BANK LTD	21,380	29.51000	630,923.80	
SGM	SIMS GROUP LTD	5,305	17.50000	92,837.50	
SHL	SONIC HEALTHCARE LTD	13,140	13.35000	175,419.00	
STO	SANTOS LTD	21,220	14.89000	315,965.80	
SUN	SUNCORP-METWAY LIMITED	33,755	9.35000	315,609.25	
TAH	TABCORP HOLDINGS LIMITED	16,580	7.20000	119,376.00	
TCL	TRANSURBAN GROUP	44,545	5.75000	256,133.75	
TLS	TELSTRA CORP LTD	165,019	4.18000	689,779.42	
TOL	TOLL HOLDINGS LIMITED	21,205	6.92000	146,738.60	
TTS	TATTS GROUP LTD	33,415	2.70000	90,220.50	
WBC	WESTPAC BANKING CORPORATION	70,194	21.54000	1,511,978.76	
WES	WESFARMERS LIMITED	22,990	24.44000	561,875.60	
WESN	WESFARMERS LTD-PPS	4,957	24.62000	122,041.34	
WMC	ALUMINA LIMITED	46,597	2.39000	111,366.83	
WOR	WORLEYPARSONS LTD	4,935	18.26000	90,113.10	
WOW	WOOLWORTHS LIMITED	46,027	29.37000	1,351,812.99	
WPL	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,388	45.00000	827,460.00	
オーストラリアドル 計		2,129,283		25,649,428.98	
(邦貨換算額)				(1,709,790,936)	

## 外国株式(イギリスポンド)

(単位:株、イギリスポンド)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AAL	ANGLO AMERICAN PLC	49,409	15.57000	769,298.13	
ABF	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,330	6.96500	92,843.45	
AMEC	AMEC PLC	11,010	5.39500	59,398.95	
ANTO	ANTOFAGASTA PLC	13,365	4.15000	55,464.75	
AZN	ASTRAZENECA PLC	54,418	26.49000	1,441,532.82	
BA	BAE SYSTEMS PLC	131,795	3.48250	458,976.08	
BATS	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	65,412	17.39000	1,137,514.68	
BAW	BRITISH AIRWAYS PLC	16,785	1.48200	24,875.37	



BCS	BARCLAYS PLC	304,361	1.95900	596,243.19	
BG	BG GROUP PLC	125,034	9.51500	1,189,698.51	
BGY	BRITISH ENERGY GROUP PLC	39,540	7.46000	294,968.40	
BICC	BALFOUR BEATTY PLC	17,175	2.90750	49,936.31	
BKG	BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	2,781	7.68500	21,371.98	
BLT	BHP BILLITON PLC	82,476	11.40000	940,226.40	
BNZL	BUNZL PLC	12,086	6.64000	80,251.04	
BP	BP PLC	699,903	5.23000	3,660,492.69	
BRBY	BURBERRY GROUP PLC	14,884	2.68750	40,000.75	
BSY	BRITISH SKY BROADCASTING GROUP PLC	42,174	4.23250	178,501.45	
BT	BT GROUP PLC	289,237	1.26300	365,306.33	
CBRY	CADBURY SCHWEPES PLC	51,950	5.67500	294,816.25	
CGU	AVIVA PLC	98,540	3.90250	384,552.35	
CNA	CENTRICA PLC	136,925	3.29500	451,167.87	
CNE	CAIRN ENERGY PLC	5,195	17.00000	88,315.00	
COB	COBHAM PLC	39,625	1.89000	74,891.25	
CPG	COMPASS GROUP PLC	66,618	3.06000	203,851.08	
CPI	CAPITA GROUP PLC	20,454	6.44000	131,723.76	
CPW	CARPHONE WAREHOUSE GROUP	13,490	1.50500	20,302.45	
CW	CABLE & WIRELESS PLC	89,661	1.35300	121,311.33	
DGE	DIAGEO PLC	95,322	9.57500	912,708.15	
DMGT	DAILY MAIL&GENERAL TRUST-A NV	11,040	3.08750	34,086.00	
DRX	DRAX GROUP PLC	12,800	6.29500	80,576.00	
EMG	MAN GROUP PLC	62,641	3.92250	245,709.32	
ENRC	EURASIAN NATURAL RESOURCES CORP	10,000	3.59000	35,900.00	
ETI	ENTERPRISE INNS PLC	14,723	1.15000	16,931.45	
EXPN	EXPERIAN PLC	39,018	3.70750	144,659.23	
FGP	FIRSTGROUP PLC	18,545	4.59750	85,260.63	
FPLN	FRIENDS PROVIDENT PLC	92,704	0.73700	68,322.84	
GFS	G4S PLC	50,679	2.00500	101,611.39	
GKN	GKN PLC	24,530	1.21250	29,742.62	
GLXO	GLAXOSMITHKLINE PLC	203,456	11.91000	2,423,160.96	
HAS	HAYS PLC	45,162	0.70000	31,613.40	
HBOS	HBOS PLC	205,292	1.13700	233,417.00	
HG	LADBROKES PLC	18,322	1.75500	32,155.11	
HOME	HOME RETAIL GROUP	32,048	2.30250	73,790.52	
HSBA	HSBC HOLDINGS PLC	446,071	7.75000	3,457,050.25	
IAP	ICAP PLC	20,840	3.56000	74,190.40	
IHG	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	9,602	5.86500	56,315.73	
III	3I GROUP PLC	14,691	5.91500	86,897.26	
IMI	IMI PLC	10,730	2.97250	31,894.92	
IMT	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	37,977	17.03000	646,748.31	
INCH	INCHCAPE PLC	13,700	0.95250	13,049.25	
INVP	INVESTEC PLC	14,340	2.95250	42,338.85	
ITV	ITV PLC	117,458	0.31500	36,999.27	
JMAT	JOHNSON MATTHEY PLC	7,119	9.95500	70,869.64	
KAZ	KAZAKHMYS PLC	7,345	3.54250	26,019.66	
KGF	KINGFISHER PLC	90,327	1.27200	114,895.94	
LGEN	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	214,906	0.78000	167,626.68	
LLOY	LLOYDS TSB GROUP PLC	219,675	2.08750	458,571.56	
LMI	LONMIN PLC	5,290	11.66000	61,681.40	
LOG	LOGICA PLC	44,442	0.76750	34,109.23	
LSE	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	5,408	6.54500	35,395.36	
MAB	MITCHELLS&BUTLERS PLC	11,367	1.88500	21,426.79	
MGGT	MEGGITT PLC	22,510	1.53750	34,609.12	
MKS	MARKS & SPENCER GROUP PLC	59,255	2.44750	145,026.61	
MNDI	MONDI PLC	12,908	2.40000	30,979.20	
MRW	WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	88,055	2.64750	233,125.61	

NEX	NATIONAL EXPRESS GROUP PLC	4,095	6.02000	24,651.90	
NGG	NATIONAL GRID PLC	93,260	7.29000	679,865.40	
NPW	INTERNATIONAL POWER PLC	57,495	2.56250	147,330.93	
NXT	NEXT PLC	6,787	11.89000	80,697.43	
OML	OLD MUTUAL PLC	191,265	0.53600	102,518.04	
POC	CARNIVAL PLC	5,960	14.36000	85,585.60	
PRU	PRUDENTIAL PLC	93,872	4.01500	376,896.08	
PSN	PERSIMMON PLC	9,109	3.22750	29,399.29	
PSON	PEARSON PLC	28,079	6.15500	172,826.24	
RB/	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	22,615	26.65000	602,689.75	
RBOS	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	609,719	0.69000	420,706.11	
RDSA	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	131,993	17.74000	2,341,555.82	
RDSB	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	102,374	17.72000	1,814,067.28	
REED	REED ELSEVIER PLC	40,956	5.38500	220,548.06	
REX	REXAM PLC	28,945	3.80250	110,063.36	
RIO	RIO TINTO PLC	37,298	29.48000	1,099,545.04	
RR	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	65,515	3.25000	212,923.75	
RRC/F09 -1	ROLLS-ROYCE GROUP PLC-C(新)	3,747,458	0.00100	3,747.45	
RSA	RSA INSURANCE GROUP PLC	125,927	1.50100	189,016.42	
RTOL	RENTOKIL INITIAL PLC	54,528	0.50000	27,264.00	
RTRS	THOMSON REUTERS PLC	6,850	11.90000	81,515.00	
SAB	SABMILLER PLC	33,796	9.85500	333,059.58	
SBRY	J SAINSBURY PLC	49,036	2.86500	140,488.14	
SDR	SCHRODERS PLC	4,981	8.61500	42,911.31	
SGC	STAGECOACH GROUP PLC	19,901	1.93900	38,588.03	
SGL	SAGE GROUP PLC	43,620	1.74100	75,942.42	
SHP	SHIRE PLC	22,015	8.04000	177,000.60	
SL/	STANDARD LIFE PLC	79,560	2.42750	193,131.90	
SMIN	SMITHS GROUP PLC	13,248	8.46500	112,144.32	
SMU	SMITH & NEPHEW PLC	34,566	5.49500	189,940.17	
SRP	SERCO GROUP PLC	19,635	3.94500	77,460.07	
SSE	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY PLC	32,092	12.77000	409,814.84	
STAN	STANDARD CHARTERED PLC	53,085	10.20000	541,467.00	
SVT	SEVERN TRENT PLC	8,298	13.77000	114,263.46	
TATL	TATE & LYLE PLC	16,201	3.69750	59,903.19	
TCG	THOMAS COOK GROUP PLC	15,475	1.77500	27,468.12	
TLW	TULLOW OIL PLC	28,295	5.56000	157,320.20	
TOMK	TOMKINS PLC	29,479	1.23500	36,406.56	
TSCO	TESCO PLC	293,489	3.41000	1,000,797.49	
TT	TUI TRAVEL PLC	18,855	1.88100	35,466.25	
UBM	UNITED BUSINESS MEDIA LTD	8,998	4.49500	40,446.01	
ULVR	UNILEVER PLC	48,512	14.74000	715,066.88	
UU	UNITED UTILITIES GROUP PLC	24,945	7.23000	180,352.35	
VED	VEDANTA RESOURCES PLC	4,610	9.08000	41,858.80	
VOD	VODAFONE GROUP PLC	1,976,605	1.17000	2,312,627.85	
WMH	WILLIAN HILL PLC	10,670	2.13000	22,727.10	
WOS	WOLSELEY PLC	22,776	3.71500	84,612.84	
WPP	WPP GROUP PLC	40,494	4.00500	162,178.47	
WTB	WHITBREAD PLC	5,445	9.78000	53,252.10	
XTA	XSTRATA PLC	24,155	11.90000	287,444.50	
イギリス債券 計		13,364,868		40,144,851.78	
(邦貨換算額)				(6,253,765,010)	

## 外国株式(スイスフラン)

(単位:株、スイスフラン)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ABBN	ABB LTD	82,225	15.81000	1,299,977.25	
ADEN	ADECCO SA-REG	4,267	43.46000	185,443.82	

ARYN	ARYZTA AG	2,905	37.20000	108,066.00	
ATLN	ACTELION LTD	3,885	59.80000	232,323.00	
BAER	JULIUS BAER HOLDING AG	7,730	48.00000	371,040.00	
BALN	BALOISE HOLDING -R	1,850	68.50000	126,725.00	
CS	CREDIT SUISSE GROUP AG	39,100	40.70000	1,591,370.00	
EFGN	EFG INTERNATIONAL AG	1,695	24.75000	41,951.25	
GEBN	GEBERIT AG-REG	1,395	125.00000	174,375.00	
GIVN	GIVAUDAN-REG	234	819.50000	191,763.00	
HOL	HOLCIM LTD-REG	7,423	63.75000	473,216.25	
KNI	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG	2,115	76.15000	161,057.25	
LISP	LINDT & SPRUENGLI AG	30	2,535.00000	76,050.00	
LOGN	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,665	18.64000	105,595.60	
LONN	LONZA GROUP AG-REG	2,025	94.80000	191,970.00	
NESZ	NESTLE SA	146,070	46.80000	6,836,076.00	
NOBE	NOBEL BIOCARE HOLDING AG	4,485	22.48000	100,822.80	
NOVN	NOVARTIS AG-REG SHS	88,465	56.75000	5,020,388.75	
PARG	PARGESA HOLDING SA-BEARER	800	86.80000	69,440.00	
PHBN	SONOVA HOLDING AG	1,645	54.20000	89,159.00	
RAN	SCHWEIZERISCHE LEBENSVERSICHERUNGS-UND RENTENANSTALT/SWISS LIFE-RE	1,295	132.00000	170,940.00	
RIFZ	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG	19,739	26.02000	513,608.78	
ROCZ	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,133	167.80000	4,385,117.40	
RUZK	SWISS REINSURANCE COMPANY LTD	13,094	53.80000	704,457.20	
SCHP	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,630	53.55000	87,286.50	
SCMZ	SWISSCOM AG-REG	849	360.00000	305,640.00	
SGSN	SGS SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDINGS SA	181	1,123.00000	203,263.00	
STMN	STRAUMANN HOLDING AG-REG	291	207.20000	60,295.20	
SUN	SULZER AG-REG	900	80.70000	72,630.00	
SYNN	SYNGENTA AG	3,931	219.20000	861,675.20	
SYST	SYNTHES INC	2,279	139.00000	316,781.00	
UBSZ	UBS AG-REGISTERED	109,842	19.29000	2,118,852.18	
UHR	SWATCH GROUP AG-B	1,245	188.10000	234,184.50	
UHRN	SWATCH GROUP AG-REG	1,345	34.70000	46,671.50	
UNAX	OC OERLIKON CORP AG	210	117.40000	24,654.00	
ZURN	ZURICH FINANCIAL SERVICES	5,441	251.00000	1,365,691.00	
スイスフラン 計		592,414		28,918,557.43	
(邦貨換算額)				(2,444,774,845)	

## 外国株式(香港ドル)

(単位:株、香港ドル)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
AP	HANG LUNG PROPERTIES LTD	79,000	19.00000	1,501,000.00	
ASMP	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	26.50000	172,250.00	
BKEA	BANK OF EAST ASIA	51,800	17.60000	911,680.00	
BOC	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	135,000	9.70000	1,309,500.00	
CATH	CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	39,000	9.43000	367,770.00	
CCL	C C LAND HOLDINGS LTD	26,000	1.44000	37,440.00	
CGK	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	50,682	81.00000	4,105,242.00	
CHES	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	33,000	6.02000	198,660.00	
CHL	CLP HOLDINGS LTD	79,000	52.50000	4,147,500.00	
CKIZ	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	17,000	29.30000	498,100.00	
EPA	ESPRIT HOLDINGS LTD	38,300	43.15000	1,652,645.00	
FOXCON	FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	65,000	2.89000	187,850.00	
HAC	HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG	2,000	74.00000	148,000.00	
HCG	HONG KONG & CHINA GAS CO LTD	157,981	13.40000	2,116,945.40	

HEL	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	52,500	41.20000	2,163,000.00	
HKEX	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	37,000	81.00000	2,997,000.00	
HL	HANG LUNG GROUP LIMITED	32,000	24.40000	780,800.00	
HNDH	HENDERSON LAND DEVELOPMENT CO LTD	35,426	30.60000	1,084,035.60	
HPWH	HOPEWELL HOLDINGS	24,000	26.80000	643,200.00	
HSGH	HANG SENG BANK LTD	29,500	106.70000	3,147,650.00	
HTEL	HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS INTERNATIONAL LIMITED	65,000	8.99000	584,350.00	
HTW	HUTCHISON WHAMPOA LTD	76,823	43.00000	3,303,389.00	
HWD	NEW WORLD DEVELOPMENT CO LTD	77,000	7.28000	560,560.00	
HYS	HYSAN DEVELOPMENT CO LTD	22,000	12.96000	285,120.00	
KERP	KERRY PROPERTIES LTD	19,950	19.10000	381,045.00	
KING	KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS LTD	19,500	12.56000	244,920.00	
LEE	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	10,400	2.98000	30,992.00	
LIFE	LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	26,500	5.31000	140,715.00	
LIFU	LI & FUNG LTD	88,000	17.26000	1,518,880.00	
MTRC	MTR CORP	43,000	18.38000	790,340.00	
NWC	MONGOLIA ENERGY CO LTD	104,000	2.88000	299,520.00	
ORIO	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	6,000	15.44000	92,640.00	
PACBS	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	64,000	4.54000	290,560.00	
PAP	NWS HOLDINGS LTD	27,000	9.00000	243,000.00	
SHGH	SHANGRI-LA ASIA LTD.	38,000	11.84000	449,920.00	
SHK	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	52,480	70.65000	3,707,712.00	
SINO	SINO LAND CO	57,500	7.45000	428,375.00	
STE	SHUN TAK HOLDINGS LIMITED	46,000	1.92000	88,320.00	
SWPA	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	30,017	57.50000	1,725,977.50	
TVB	TELEVISION BROADCASTS LTD	12,000	24.90000	298,800.00	
WHB	WING HANG BANK LIMITED	7,500	43.75000	328,125.00	
WHEL	WHEELLOCK&CO LTD	33,000	12.46000	411,180.00	
WHH	WHARF HOLDINGS LTD	46,800	17.34000	811,512.00	
YYN	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	28,000	16.04000	449,120.00	
香港ドル 計		1,991,159		45,635,340.50	
(邦貨換算額)				(577,743,411)	

## 外国株式(スウェーデンクローナ)

(単位:株、スウェーデンクローナ)

銘柄	株数	評価額		備考	
		単価	金額		
ALFA	ALFA LAVAL AB	12,800	64.25000	822,400.00	
ASSA	ASSA ABLOY AB-B	11,485	88.25000	1,013,551.25	
ATCOA	ATLAS COPCO AB-A SHS	23,830	64.50000	1,537,035.00	
ATCOB	ATLAS COPCO AB-B SHS	13,605	57.50000	782,287.50	
BOL	BOLIDEN AB	10,110	22.00000	222,420.00	
ELUX	ELECTROLUX AB-SER B	7,790	75.00000	584,250.00	
GETIB	GETINGE AB-B SHS	8,670	115.25000	999,217.50	
HMB	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	18,914	292.50000	5,532,345.00	
HUSQB	HUSQVARNA AB	8,770	56.00000	491,120.00	
INVEB	INVESTOR AB	15,715	120.50000	1,893,657.50	
LMEB	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON AB-B SHS	112,850	60.90000	6,872,565.00	
LUPE	LUNDIN PETROLEUM AB	8,410	43.10000	362,471.00	
MIC	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA-SDR	2,655	345.00000	915,975.00	
MODO	HOLMEN AB-B SHARES	2,005	232.00000	465,160.00	
MTGB	MODERN TIMES GROUP-B SHS	1,870	196.00000	366,520.00	
NBH	NORDEA BANK AB	76,998	70.10000	5,397,559.80	
NCOMB	TELE2 AB -B SHS	10,565	78.00000	824,070.00	
SAND	SANDVIK AB	35,625	54.00000	1,923,750.00	

SCAB	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	17,830	63.00000	1,123,290.00	
SCVB	SCANIA AB-B SHS	11,455	64.75000	741,711.25	
SEBA	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	16,245	89.00000	1,445,805.00	
SECB	SECURITAS AB-B SHS	12,394	78.50000	972,929.00	
SHBA	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,610	152.00000	2,524,720.00	
SKAB	SKANSKA AB-B SHS	13,030	76.00000	990,280.00	
SKFB	SKF AB-B SHS	12,909	75.00000	968,175.00	
SSABA	SSAB SVENSKT STAL AB-SER A	6,295	84.75000	533,501.25	
SSABB	SSAB SVENSKT STAL AB	2,765	76.50000	211,522.50	
SWEDA	SWEDBANK AB	11,850	78.00000	924,300.00	
SWMA	SWEDISH MATCH AB	9,765	123.50000	1,205,977.50	
TLIA	TELIASONERA AB	80,860	37.30000	3,016,078.00	
VOLV	VOLVO AB-B SHS	37,160	43.20000	1,605,312.00	
スウェーデンクローナ 計		631,835		47,269,956.05	
(邦貨換算額)				(594,183,348)	

## 外国株式(シンガポールドル)

(単位:株、シンガポールドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
CAPL	CAPITALAND LTD	56,000	3.10000	173,600.00	
CD	COMFORTDELGRO CORP	77,000	1.33000	102,410.00	
COS	COSCO CORP SINGAPORE LIMITED	27,000	0.82000	22,140.00	
CYCM	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,000	9.80000	49,000.00	
CYDM	CITY DEVELOPMENTS LTD	19,000	6.50000	123,500.00	
DBS	DBS GROUP HOLDINGS LTD	41,750	11.38000	475,115.00	
FN	FRASER AND NEAVE LTD	32,000	3.00000	96,000.00	
GIL	GENTING INTERNATIONAL PLC	64,000	0.39500	25,280.00	
JRSS	SEBACORP MARINE LTD	28,000	2.14000	59,920.00	
KPL	KEPPEL CORP LTD	43,600	5.19000	226,284.00	
NEPS	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	24,000	1.35000	32,400.00	
NOBL	NOBLE GROUP LIMITED	54,200	1.05000	56,910.00	
OCBM	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	97,240	5.28000	513,427.20	
SAL	SINGAPORE AIRLINES LTD	16,800	12.28000	206,304.00	
SCIL	SEBACORP INDUSTRIES LTD	35,000	2.73000	95,550.00	
SGX	SINGAPORE EXCHANGE LTD	30,000	5.54000	166,200.00	
SPR	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	62,050	3.34000	207,247.00	
SSTM	KEPPEL LAND LTD	13,000	2.28000	29,640.00	
STEG	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	45,000	2.27000	102,150.00	
TELE	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	297,810	2.31000	687,941.10	
UOBH	UNITED OVERSEAS BANK LTD	47,300	13.78000	651,794.00	
UTOS	UOL GROUP LIMITED	21,250	1.92000	40,800.00	
VENM	VENTURE CORP LTD	7,000	6.67000	46,690.00	
WIL	WILMAR INTERNATIONAL LTD	28,000	2.65000	74,200.00	
YLLG	YANLORD LAND GROUP LTD	12,000	0.85000	10,200.00	
シンガポールドル 計		1,184,000		4,274,702.30	
(邦貨換算額)				(282,258,593)	

## 外国株式(ニュージーランドドル)

(単位:株、ニュージーランドドル)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AIA	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	42,170	1.83000	77,171.10	
CEN	CONTACT ENERGY LTD	13,415	7.39000	99,136.85	
FBU	FLETCHER BUILDING LTD	17,570	6.24000	109,636.80	
SKC	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.18000	63,568.20	
TEL	TELECOM CORPORATION OF NEW ZEALAND LIMITED	60,962	2.36000	143,870.32	

ニュージーランドドル 計	154,107		493,383.27	
( 邦貨換算額 )			(28,946,796)	

[次へ](#)

## 外国株式(デンマーククローネ)

(単位:株、デンマーククローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
BRYB	CARLSBERG AS-B	1,985	243.50000	483,347.50	
CPLCB	COLOPLAST A/S	1,041	393.00000	409,113.00	
DANS	DANSKE BANK A/S	15,245	98.50000	1,501,632.50	
DSAC	A P MOLLER MAERSK A/S-B	41	34,800.00000	1,426,800.00	
DSC	DANISCO A/S	1,868	284.00000	530,512.00	
DSVB	DSV DE SAMMENSLUT VOGN	6,095	71.00000	432,745.00	
FLSB	FLSMIDTH & CO A/S	1,685	228.75000	385,443.75	
JYSK	JYSKE BANK	1,780	201.50000	358,670.00	
MAERSKA	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	18	34,700.00000	624,600.00	
NOVO	NOVO NORDISK A/S-B	17,280	309.00000	5,339,520.00	
NZYM	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,505	419.00000	630,595.00	
ROCKB	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS-B	200	434.00000	86,800.00	
SYDB	SYDBANK A/S	2,275	109.00000	247,975.00	
TDP	TOPDANMARK A/S	520	675.00000	351,000.00	
TRYG	TRYGVESTA AS	1,045	365.00000	381,425.00	
VWS	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,065	297.00000	2,098,305.00	
WDH	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	196.25000	196,250.00	
デンマーククローネ 計		60,648		15,484,733.75	
(邦貨換算額)				(263,550,168)	

## 外国株式(ノルウェークローネ)

(単位:株、ノルウェークローネ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AKVER	AKER SOLUTIONS ASA	4,795	41.55000	199,232.25	
DNBNOR	DNB NOR ASA	27,450	40.00000	1,098,000.00	
NHY	NORSK HYDRO ASA	23,450	29.80000	698,810.00	
ORK	ORKLA ASA	30,905	52.80000	1,631,784.00	
PGSO	PETROLEUM GEO-SERVICES	5,560	42.00000	233,520.00	
REC	RENEWABLE ENERGY CORP AS	5,750	76.90000	442,175.00	
SDRL	SEADRILL LTD	9,375	70.70000	662,812.50	
STB	STOREBRAND ASA	12,415	19.30000	239,609.50	
STL	STATOILHYDRO ASA	47,810	144.30000	6,898,983.00	
STO	ACERGY S.A.	6,405	50.60000	324,093.00	
TEL	TELENOR ASA	30,455	44.00000	1,340,020.00	
YAR	YARA INTERNATIONAL ASA	6,320	153.00000	966,960.00	
ノルウェークローネ 計		210,690		14,735,999.25	
(邦貨換算額)				(212,787,829)	

## 外国株式(ユーロ)

(単位:株、ユーロ)

銘柄		株数	評価額		備考
			単価	金額	
AC	ACCOR SA	7,156	31.45000	225,056.20	
ACA	CREDIT AGRICOLE SA	33,422	11.78500	393,878.27	
ACRX	ACERINOX SA	5,862	10.57000	61,961.34	
ACS	ACS ACTIVIDADES CONSTRUCTION Y SERVICIOS SA	7,231	30.00000	216,930.00	
ACSA	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	8,676	14.45000	125,368.20	
ACUM	UMICORE	7,380	14.68500	108,375.30	
ADP	AEROPORTS DE PARIS	1,175	51.38000	60,371.50	
ADS	ADIDAS AG	7,656	29.47000	225,622.32	
AEGO	AEGON NV	52,769	4.00000	211,076.00	
AEM	A2A SPA	43,140	1.64300	70,879.02	
AGL	AUTOGRILL SPA	4,025	6.98000	28,094.50	
AHLN	KONINKLIJKE AHOLD NV	46,264	8.42000	389,542.88	

AI	AIR LIQUIDE	9,172	70.95500	650,799.26	
AIB	ANGLO IRISH BANK CORP PLC	26,235	2.45000	64,275.75	
AIRF	AIR FRANCE-KLM	5,240	12.56000	65,814.40	
AKZO	AKZO NOBEL NV	10,373	31.90000	330,898.70	
AL	ALLEANZA ASSICURAZIONI	15,150	5.51000	83,476.50	
ALBI	ALLIED IRISH BANKS PLC	31,258	4.30000	134,409.40	
ALO	ALSTOM-NEW	8,125	40.55500	329,509.37	
ALPHA	ALPHA BANK A.E.	14,238	12.34000	175,696.92	
ALV	ALLIANZ SE-REG	16,903	68.85000	1,163,771.55	
ANDR	ANDRITZ AG	1,525	24.00000	36,600.00	
ASML	ASML HOLDING NV	16,502	13.93500	229,955.37	
AUTO	ATLANTIA SPA	8,859	15.15000	134,213.85	
BAK	BANKINTER SA	9,015	9.00000	81,135.00	
BASF	BASF SE	35,355	27.95000	988,172.25	
BAYE	BAYER AG	28,565	43.38000	1,239,149.70	
BBV	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	133,060	10.13000	1,347,897.80	
BCP	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	81,742	0.90600	74,058.25	
BCSA	BANCO SANTANDER SA	239,086	8.65000	2,068,093.90	
BEI	BEIERSDORF AG	3,130	44.47000	139,191.10	
BELG	BELGACOM SA	6,185	28.16500	174,200.52	
BESNN	BANCO ESPIRITO SANTO SA	7,445	7.90000	58,815.50	
BI	INTESA SANPAOLO SPA	287,833	3.10000	892,282.30	
BICP	SOCIETE BIC SA	1,175	43.71000	51,359.25	
BINR	INTESA SANPAOLO SPA	23,345	2.40750	56,203.08	
BKIR	BANK OF IRELAND	36,475	2.34000	85,351.50	
BMPS	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	90,985	1.56000	141,936.60	
BMW	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,840	22.80000	269,952.00	
BMW3	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG-PFD	1,185	17.37000	20,583.45	
BNP	BNP PARIBAS SA	30,462	57.60000	1,754,611.20	
BOUY	BOUYGUES SA	8,800	33.75000	297,000.00	
BP	BANCO POPOLARE SPA	23,814	9.75000	232,186.50	
BPE	BANCO POPULAR ESPANOL SA	30,249	7.65000	231,404.85	
BPIN	BANCO BPI SA	14,105	1.88000	26,517.40	
BPM	BANCA POPOLARE DI MILANO SCRL	13,502	4.96250	67,003.67	
BPU	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	22,039	13.01000	286,727.39	
BRISA	BRISA-PRIV SHR	10,745	6.55000	70,379.75	
BSN	GROUPE DANONE	16,321	43.91000	716,655.11	
BULG	BULGARI SPA	5,960	6.38000	38,024.80	
CAP	CAP GEMINI SA	4,939	27.28000	134,735.92	
CAR	CARREFOUR SA	24,078	33.07500	796,379.85	
CCB	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING COMPANY SA	5,468	12.70000	69,443.60	
CGCBV	CARGOTEC CORPORAITON-B SHARE	1,243	12.45000	15,475.35	
CGE	ALCATEL LUCENT	88,419	2.45100	216,714.96	
CIMP	CIMPOR CIMENTOS DE PORTUGAL SGPS SA	8,125	3.86700	31,419.37	
CIN	CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS DE TRANSPORTE SA	7,985	7.37000	58,849.45	
CNPP	CNP ASSURANCES	1,395	59.00000	82,305.00	
CO	CASINO GUICHARD- PERRACHON SA	1,819	56.33000	102,464.27	
COLR	COLRUYT NV	672	173.81000	116,800.32	
COM	COMMERZBANK AG	26,388	9.75500	257,414.94	
CRDI	UNICREDIT SPA	423,892	2.18750	927,263.75	
CRG	BANCA CARIGE SPA	28,825	1.94300	56,006.97	
CRH	CRH PLC	18,550	17.76000	329,448.00	
CRIS	CRITERIA CAIXACORP SA	31,535	2.70000	85,144.50	
CTG	GAS NATURAL SDG SA	3,930	25.94000	101,944.20	
CUBE	ACCIONA S.A.	971	78.50000	76,223.50	



DAST	DASSAULT SYSTEMES SA	2,380	33.62000	80,015.60	
DB1	DEUTSCHE BOERSE AG	7,459	64.00000	477,376.00	
DBK	DEUTSCHE BANK AG -REG	20,255	34.59500	700,721.72	
DCXG	DAIMLER AG-REG	32,427	27.64500	896,444.41	
DECX	JC DECAUX S.A.	2,520	13.65000	34,398.00	
DELB	DELHAIZE GROUP	3,866	43.38000	167,707.08	
DESC	ERSTE GROUP BANK AG	6,288	20.80000	130,790.40	
DEX	DEXIA	17,454	5.28400	92,226.93	
DG	VINCI S.A.	15,580	29.86000	465,218.80	
DPB	DEUTSCHE POSTBANK AG	2,715	18.61000	50,526.15	
DPW	DEUTSCHE POST AG-REG	32,038	9.74000	312,050.12	
DSMN	KONINKLIJKE DSM NV	5,142	22.35500	114,949.41	
DTEG	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	105,941	11.55000	1,223,618.55	
EAD	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE CO	12,583	13.51000	169,996.33	
EDF	ELECTRICITE DE FRANCE	7,200	50.20000	361,440.00	
EDPP	ENERGIAS DE PORTUGAL,S.A.	56,976	2.84700	162,210.67	
ELIAV	ELISA CORP-A SHARES	6,040	12.89000	77,855.60	
ELN	ELAN CORPORATION PLC	10,000	5.09000	50,900.00	
ELSN	REED ELSEVIER NV	22,963	9.85400	226,277.40	
ENEL	ENEL SPA	161,809	5.67500	918,266.07	
ENG	ENAGAS	7,585	14.86000	112,713.10	
ENI	ENI SPA	97,296	18.60000	1,809,705.60	
ERCK	MERCK KGAA	2,605	67.83000	176,697.15	
ERMT	ERAMET	190	160.10000	30,419.00	
ESSI	ESSILOR INTERNATIONAL SA	7,695	34.20500	263,207.47	
ETE	NATIONAL BANK OF GREECE SA	17,657	19.04000	336,189.28	
EURB	EFG EUROBANK ERGASIAS	11,670	8.70000	101,529.00	
EX	VIVENDI SA	43,547	21.55500	938,655.58	
EXHO	SODEXO	3,690	39.23000	144,758.70	
FCC	FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS SA-FCC	1,465	31.76000	46,528.40	
FER	GRUPO FERROVIAL SA	2,515	25.47000	64,057.05	
FGR	EIFFAGE SA	1,230	31.25000	38,437.50	
FIA	FIAT SPA	24,010	6.45500	154,984.55	
FME	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	7,298	32.90000	240,104.20	
FNS	UNION FENOSA, S.A.	13,473	17.10000	230,388.30	
FORB	FORTIS	69,259	1.14900	79,578.59	
FQDA	CHRISTIAN DIOR SA	1,835	48.18000	88,410.30	
FRA	FRAPORT AG	1,350	27.10000	36,585.00	
FRE	FRESENIUS SE-PRF	4,075	47.99000	195,559.25	
FSA	FONDIARIA-SAI SPA	2,115	16.75000	35,426.25	
FTE	FRANCE TELECOM SA	68,389	20.34500	1,391,374.20	
FUGR	FUGRO NV	1,960	29.86000	58,525.60	
FUM1V	FORTUM OYJ	16,835	20.48000	344,780.80	
G1A	GEA GROUP AG	5,065	12.67000	64,173.55	
GA	C I E G E N E R A L E D E GEOPHYSIQUE-VERITAS	4,350	13.56000	58,986.00	
GAM	GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA S. A.	6,755	14.35000	96,934.25	
GASI	ASSICURAZIONI GENERALI	39,520	20.47000	808,974.40	
GAZ	GDF SUEZ	40,949	36.21500	1,482,968.03	
GBF	BILFINGER BERGER AG	1,245	39.12000	48,704.40	
GBL	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,717	60.63000	164,731.71	
GEHG	CELESIO AG	3,185	24.60000	78,351.00	
HEI	HEIDELBERGCEMENT AG	790	59.00000	46,610.00	
HEIN	HEINEKEN NV	9,468	25.97000	245,883.96	
HEIO	HEINEKEN HOLDING NV	2,775	24.68000	68,487.00	
HEN	HENKEL AG & CO KGAA	6,933	23.26000	161,261.58	

HEN1	HENKEL KGAA	4,810	20.01000	96,248.10	
HNSY	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA	8,729	54.32500	474,202.92	
HO	THALES SA	3,050	33.23000	101,351.50	
HOC	HOCHTIEF AG	1,610	31.12000	50,103.20	
HRX	HYPO REAL ESTATE HLDG	3,000	4.88000	14,640.00	
HTO	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	10,545	11.24000	118,525.80	
IBER	IBERDROLA SA	130,635	6.25000	816,468.75	
IBLA	IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPANA SA	19,515	1.83000	35,712.45	
IBR	IBERDROLA RENOVABLES	32,030	2.58000	82,637.40	
IDR	INDRA SISTEMAS SA	4,864	16.04000	78,018.56	
IEA	IMMOEAST AG	11,185	0.80000	8,948.00	
IFL	IFIL - INVESTMENTS SPA	9,830	2.66000	26,147.80	
IFP	ISTITUTO FINANZIARIO INDUSTRIALE SPA	2,405	7.39000	17,772.95	
IFXG	INFINEON TECHNOLOGIES AG	25,974	2.86500	74,415.51	
IHC	SBM OFFSHORE NV	4,744	14.61000	69,309.84	
IIA	IMMOFINANZ AG	12,067	0.87000	10,498.29	
ING	ING GROEP NV-CVA	70,985	8.90000	631,766.50	
INTB	INBEV	6,086	29.15000	177,406.90	
IPM	IRISH LIFE & PERMANENT PLC	9,795	2.35000	23,018.25	
ITAI	ITALCEMENTI SPA	1,930	9.09500	17,553.35	
ITR	ITALCEMENTI SPA RNC	3,125	5.86000	18,312.50	
ITX	INDITEX	8,125	27.85000	226,281.25	
IVG	IVG IMMOBILIEN AG	2,990	6.21000	18,567.90	
KARG	ARCANDOR AG	3,380	2.25000	7,605.00	
KBC	KBC GROUP	5,359	34.75500	186,252.04	
KBCA	KBC ANCORA	1,175	23.00000	27,025.00	
KESBV	KESKO OYJ-B SHS	2,305	17.98000	41,443.90	
KN	NATIXIS	31,515	2.26000	71,223.90	
KONBS	KONE OYJ	6,032	17.99000	108,515.68	
KPN	KONINKLIJKE KPN NV	69,161	11.00200	760,909.32	
KSZ	K+S AG	5,490	34.27000	188,142.30	
KYGA	KERRY GROUP PLC-A	5,430	18.70000	101,541.00	
LAFA	LAFARGE SA	5,368	54.05500	290,167.24	
LEGP	LEGRAND S.A.	4,050	14.28000	57,834.00	
LHA	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	8,140	11.19500	91,127.30	
LIN	LINDE AG	5,055	69.50000	351,322.50	
LTO	LOTTOMATICA SPA	2,425	19.18000	46,511.50	
LUX	LUXOTTICA GROUP SPA	4,491	16.69000	74,954.79	
MAN	MAN AG	3,904	39.76000	155,223.04	
MAP	MAPFRE SA	26,725	2.52000	67,347.00	
MB	MEDIOBANCA SPA	17,020	9.16500	155,988.30	
MCNB	MICHELIN (CGDE)-B	5,549	44.43500	246,569.81	
MED	MEDIOLANUM SPA	8,725	3.33250	29,076.06	
MEL	ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE	10,210	4.10000	41,861.00	
MEOG	METRO AG	5,035	26.36000	132,722.60	
MF	WENDEL	870	44.15000	38,410.50	
MIDI	AXA	57,832	16.67500	964,348.60	
MIG	MARFIN INVESTMENT GROUP SA	20,295	3.56000	72,250.20	
MMBP	LAGARDERE S.C.A.	4,160	34.00000	141,440.00	
MMT	M6-METROPOLE TELEVISION	2,845	13.03000	37,070.35	
MOBB	MOBISTAR SA	1,539	54.10500	83,267.59	
MS	MEDIASET SPA	28,356	4.66000	132,138.96	
MTP	ARCELOR MITTAL	32,486	20.71000	672,785.06	
MUVG	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,711	101.93000	785,982.23	
NAT	NATIONALE A PORTEFEUILLE	1,545	43.55000	67,284.75	
NEO	NEOPOST SA	1,197	63.25000	75,710.25	
NEST	NESTE OIL OYJ	4,235	13.19000	55,859.65	
NK	IMERYS SA	985	34.80000	34,278.00	

NOKS	NOKIA OYJ	142,016	12.78000	1,814,964.48
NOR1V	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,650	11.92000	43,508.00
OEEW	O E S T E R R E I C H I S C H E ELEKTRIZITAETSWIRTSCHAFTS AG-A	2,695	39.51000	106,479.45
OKOAS	POHJOLA BANK PLC	3,935	10.55000	41,514.25
OMV	OMV AG	6,195	25.49000	157,910.55
OPAP	OPAP SA	8,055	18.00000	144,990.00
ORL	L'OREAL SA	8,971	61.74500	553,914.39
ORNBV	ORION OYJ	3,595	11.75000	42,241.25
OUTO	OUTOKUMPU OYJ	4,060	8.75000	35,525.00
PAJ	PAGESJAUNES GROUPE SA	4,850	7.98000	38,703.00
PC	PIRELLI&C.	94,890	0.32350	30,696.91
PERP	PERNOD-RICARD SA	6,157	52.54000	323,488.78
PHG	PHILIPS ELECTRONICS NV	38,066	15.57500	592,877.95
PLT	PARMALAT SPA	65,055	1.35000	87,824.25
POR	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	3,285	64.74000	212,670.90
PPC	PUBLIC POWER CORP	3,916	10.42000	40,804.72
PRE	TUI AG	7,025	10.51000	73,832.75
PRS	PROMOTORA DE INFOMACIONES SA-PRISA	2,230	3.32000	7,403.60
PRTP	PPR	2,887	49.53000	142,993.11
PRYS	PRYSMIAN SPA	4,580	10.27000	47,036.60
PSAF	PEUGEOT SA	4,757	21.79000	103,655.03
PSM	PROSIEBEN SAT.1 MEDI AG-PFD	3,065	2.56000	7,846.40
PTCO	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	24,298	5.94200	144,378.71
PTM	ZON MULTIMEDIA SERVICOS DE TELECOMUNICACOES E MULTIMEDIA SGPS SA	6,188	4.17700	25,847.27
PUB	PUBLICIS GROUPE	5,530	18.58000	102,747.40
PUM	PUMA AG	296	144.88000	42,884.48
QCE	Q-CELLS SE	2,035	32.87000	66,890.45
REE	RED ELECTRICA CORP SA	3,990	33.67000	134,343.30
REIN	REINET INVESTMENTS SCA	2,576	9.00000	23,184.00
RENA	RENAULT SA	6,662	26.07000	173,678.34
RF	EURAZEO	929	48.41000	44,972.89
RHE	RHEINMETALL AG	1,295	24.64000	31,908.80
RIBH	RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK HOLDING AG	1,930	28.50000	55,005.00
RMS	HERMES INTERNATIONAL	2,544	101.39000	257,936.16
RPSL	REPSOL YPF SA	27,716	16.10000	446,227.60
RSTD	RANDSTAD HOLDING N.V.	3,070	16.75000	51,422.50
RTRKS	RAUTARUUKKI OYJ	2,770	13.83000	38,309.10
RWE	RWE AG	16,625	69.00000	1,147,125.00
RWEP	RWE AG-NON VTG PFD	1,250	49.34000	61,675.00
RYA	RYANAIR HOLDINGS PLC	9,890	3.01000	29,768.90
SAB	BANCO DE SABADELL SA	34,340	5.57000	191,273.80
SAG	SAFRAN SA	6,665	11.01000	73,381.65
SAMAS	SAMPO OYJ-A SHS	16,294	15.17000	247,179.98
SAP	SAP AG	32,612	29.42000	959,445.04
SCG	SOCIETE GENERALE-A	17,438	48.20000	840,511.60
SCHN	SCHNEIDER ELECTRIC SA	8,479	51.25500	434,591.14
SCR	SCOR SE	6,292	12.27000	77,202.84
SEGN	ATOS ORIGIN	2,555	19.27000	49,234.85
SESF	SES GLOBAL-FDR	12,005	13.43000	161,227.15
SEV	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	9,274	14.60000	135,400.40
SIF	FINMECCANICA SPA	11,930	10.30000	122,879.00
SM	SIEMENS AG-REG	32,457	48.92000	1,587,796.44
SNAM	SNAM RETE GAS SPA	28,855	4.09500	118,161.22
SOFP	SANOFI-AVENTIS SA	39,306	46.85500	1,841,682.63
SOLV	SOLVAY SA	2,161	74.61000	161,232.21

SON	SONAE SGPS, SA	32,160	0.52000	16,723.20	
SPM	SAIPEM	9,995	15.75000	157,421.25	
STER	STORA ENSO OYJ-R SHS	20,215	7.87000	159,092.05	
STGO	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	9,841	33.35500	328,246.55	
STM	STMICROELECTRONICS NV	26,138	6.87100	179,594.19	
SWS1V	SANOMA OYJ	3,275	13.03000	42,673.25	
SWV	SOLARWORLD AG	2,705	21.42000	57,941.10	
SZG	SALZGITTER AG	1,365	55.65000	75,962.25	
TECF	TECHNIP S.A.	4,043	25.21000	101,924.03	
TFFP	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	4,790	10.63000	50,917.70	
TITI	TELECOM ITALIA SPA	376,318	1.03000	387,607.54	
TITR	TELECOM ITALIA RNC	204,472	0.75000	153,354.00	
TKA	THYSSENKRUPP AG	13,755	15.62000	214,853.10	
TKAV	TELEKOM AUSTRIA AG	12,725	10.10000	128,522.50	
TL5	GESTEVISION TELECINCO SA	4,335	6.53000	28,307.55	
TNE	TELEFONICA S.A.	160,553	15.54000	2,494,993.62	
TOL	TOTAL SA	80,344	42.75000	3,434,706.00	
TOM2	TOMTOM NV	1,820	7.54000	13,722.80	
TP	TNT NV	13,755	16.32000	224,481.60	
TPEI	BANK OF PIRAEUS	13,315	10.86000	144,600.90	
TRN	TERNA SPA	43,397	2.50000	108,492.50	
TTNR	TITAN CEMENT CO. S.A.	2,075	13.90000	28,842.50	
UCB	UCB SA	3,588	24.26500	87,062.82	
UNI1	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA	29,785	1.39200	41,460.72	
UNIP	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA-PFD	32,420	0.97950	31,755.39	
UNL	UNILEVER NV-CVA	60,875	19.48500	1,186,149.37	
UPM1	UPM-KYMMENE OYJ	18,238	12.29000	224,145.02	
VALH	SACYR VALLEHERMOSO SA	2,665	8.29000	22,092.85	
VAST	VOESTALPINE AG	3,694	17.99000	66,455.06	
VEB	E.ON AG	71,039	32.44000	2,304,505.16	
VIE	VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,674	20.40000	278,949.60	
VK	VALLOUREC	1,955	87.88000	171,805.40	
VLMT	METSO OYJ	3,960	11.76000	46,569.60	
VLOF	VALEO	3,007	14.52000	43,661.64	
VOW	VOLKSWAGEN AG	5,441	398.00000	2,165,518.00	
VOWG	VOLKSWAGEN AG PFD	3,935	40.99000	161,295.65	
WBG	WIENERBERGER AG	2,770	13.90000	38,503.00	
WCH	WACKER CHEMIE AG	580	87.80000	50,924.00	
WLSN	WOLTERS KLUWER NV	11,587	14.22500	164,825.07	
WRTBV	WARTSILA OYJ	2,720	21.08000	57,337.60	
WST	VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	23.50000	33,135.00	
YIT	YIT OYJ	4,220	5.28000	22,281.60	
ZODC	ZODIAC SA	1,632	32.28000	52,680.96	
ZRDY	ZARDOYA OTIS SA	4,735	15.25000	72,208.75	
ユーロ計		6,220,262		77,309,959.21	
(邦貨換算額)				(9,792,852,533)	

(単位：円)

総合計			(56,438,041,069)	56,438,041,069	
-----	--	--	------------------	----------------	--

(注) 総合計の( )内の金額は外国株式の邦貨換算額合計であります。

[次へ](#)

## (2) 株式以外の有価証券

## (外国投資証券)

## 外国投資証券(アメリカドル)

(単位:アメリカドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
00163T10	AMB PROPERTY CORPORATION	3,550	83,247.50
03748R10	APARTMENT INVT&MGMT CO -A	3,302	49,761.14
05348410	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,035	191,903.05
10112110	BOSTON PROPERTIES INC	4,422	285,174.78
13313110	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,110	66,760.40
25159110	DEVELOPERS DIVERSIFIED REALTY CORPORATION	4,031	45,711.54
26441150	DUKE REALTY CORPORATION	5,375	69,713.75
29476L10	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	10,465	328,601.00
31374720	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,135	127,288.70
42191510	HCP INC	9,730	260,277.50
44107P10	HOST HOTELS & RESORTS INC	17,388	160,839.00
49446R10	KIMCO REALTY CORPORATION	8,895	183,148.05
53117210	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,193	95,306.89
55438210	THE MACERICH COMPANY	2,470	70,345.60
72925110	PLUM CREEK TIMBER CO	6,508	225,827.60
74341010	PROLOGIS	9,101	108,301.90
74460D10	PUBLIC STORAGE	4,664	355,210.24
75884910	REGENCY CENTERS CORPORATION	2,910	107,728.20
78440X10	SL GREEN REALTY CORP	1,952	63,830.40
82880610	SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	8,577	554,931.90
91019710	UDR INC	5,265	87,188.40
92276F10	VENTAS INC	5,525	166,136.75
92904210	VORNADO REALTY TRUST	5,052	338,585.04
アメリカドル 計	130,655	4,025,819.33	
(邦貨換算額)		(395,093,909)	

## 外国投資証券(カナダドル)

(単位:カナダドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
AET-U	ARC ENERGY TRUST	4,125	82,788.75
CIX	CI FINANCIAL INCOME FUND	1,805	28,934.15
COS-U	CANADIAN OIL SANDS TRUST	8,940	270,345.60
ERF-U	ENERPLUS RESOURCES FUND	6,455	204,171.65
HTE-U	HARVEST ENERGY TRUST	5,060	62,693.40
PVE-U	PROVIDENT ENERGY TRUST	9,500	69,825.00
PWT-U	PENN WEST ENERGY TRUST	14,333	296,406.44
REI-U	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,925	65,547.50
YLO-U	YELLOW PAGES INCOME FUND	7,750	63,007.50
カナダドル 計	61,893	1,143,719.99	
(邦貨換算額)		(95,946,670)	

## 外国投資証券(オーストラリアドル)

(単位:オーストラリアドル)

銘柄	券面総額	評価額	備考
DRT	DEXUS PROPERTY GROUP	109,590	83,288.40
GAN	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	65,850	138,285.00
GPT	GPT GROUP	69,350	60,681.25
MGQ	GOODMAN GROUP	47,650	49,794.25
MGR	MIRVAC GROUP	37,315	36,755.27
SGP	STOCKLAND	54,945	255,494.25
WDC	WESTFIELD GROUP	65,260	1,076,790.00
オーストラリアドル 計	449,960	1,701,088.42	
(邦貨換算額)		(113,394,554)	

## 外国投資証券(イギリスポンド)

(単位:イギリスポンド)

銘柄	券面総額	評価額	備考
BLND	BRITISH LAND COMPANY PLC	19,421	130,509.12
HMSO	HAMMERSON PLC	10,610	83,765.95
LAND	LAND SECURITIES GROUP PLC	16,919	199,644.20
LII	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	8,305	60,875.65
SLOU	SEGRO PLC	14,960	45,964.60

イギリスポンド 計	70,215	520,759.52	
(邦貨換算額)		(81,123,918)	

## 外国投資証券(香港ドル)

(単位:香港ドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
LINK	LINK REIT	86,500	1,249,060.00	
香港ドル 計		86,500	1,249,060.00	
(邦貨換算額)			(15,813,100)	

## 外国投資証券(シンガポールドル)

(単位:シンガポールドル)

銘柄		券面総額	評価額	備考
CCT	CAPITACOMMERCIAL TRUST	41,000	37,720.00	
CT	CAPITAMALL TRUST	42,000	87,360.00	
シンガポールドル 計		83,000	125,080.00	
(邦貨換算額)			(8,259,032)	

## 外国投資証券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

銘柄		券面総額	評価額	備考
CORA	CORIO NV	1,700	72,513.50	
EMGP	ICADE	660	35,211.00	
GFC	GECINA SA	560	30,889.60	
LI	KLEPIERRE	3,005	60,550.75	
UL	UNIBAIL-RODAMCO	3,125	385,187.50	
ユーロ 計		9,050	584,352.35	
(邦貨換算額)			(74,019,912)	

(単位:円)

総合計		(783,651,095)	783,651,095	
-----	--	---------------	-------------	--

(注1) 総合計の( )内の金額は外国投資証券の邦貨換算額合計であります。

(注2) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率 (%)	組入投資証券時価比 率(%)	合計額に対する比率 (%)
アメリカドル	株式 565銘柄	98.8	-	55.4
アメリカドル	投資証券 23銘柄	-	1.2	0.7
カナダドル	株式 85銘柄	96.4	-	4.5
カナダドル	投資証券 9銘柄	-	3.6	0.2
オーストラリアドル	株式 65銘柄	93.8	-	3.0
オーストラリアドル	投資証券 7銘柄	-	6.2	0.2
イギリスポンド	株式 116銘柄	98.7	-	10.9
イギリスポンド	投資証券 5銘柄	-	1.3	0.1
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0	-	4.3
香港ドル	株式 44銘柄	97.3	-	1.0
香港ドル	投資証券 1銘柄	-	2.7	0.0
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0	-	1.0
シンガポールドル	株式 25銘柄	97.2	-	0.5
シンガポールドル	投資証券 2銘柄	-	2.8	0.0
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0	-	0.1
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0	-	0.5
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0	-	0.4
ユーロ	株式 279銘柄	99.2	-	17.1
ユーロ	投資証券 5銘柄	-	0.8	0.1

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

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

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科目	対象年月日	平成19年11月6日現在	平成20年11月6日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		263,744,093	1,740,435,880
国債証券		34,602,283,030	24,848,355,200
地方債証券		2,904,404,000	2,015,535,000
特殊債券		5,236,653,000	4,034,791,000
社債券		4,430,446,000	3,898,676,000
未収入金		-	184,573,300
未収利息		152,163,413	113,391,003
前払費用		18,829,540	8,955,658
流動資産合計		47,608,523,076	36,844,713,041
資産合計		47,608,523,076	36,844,713,041
負債の部			
流動負債			
未払金		259,891,860	1,902,344,730
未払解約金		1,267,276	12,591,643
流動負債合計		261,159,136	1,914,936,373
負債合計		261,159,136	1,914,936,373
純資産の部			
元本等			
元本		42,314,592,963	30,626,854,082
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		5,032,770,977	4,302,922,586
元本等合計		47,347,363,940	34,929,776,668
純資産合計		47,347,363,940	34,929,776,668
負債純資産合計		47,608,523,076	36,844,713,041

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>



## (貸借対照表に関する注記)

平成19年11月6日現在		平成20年11月6日現在	
1. 期首	平成18年11月7日	1. 期首	平成19年11月7日
期首元本額	10,523,568,240 円	期首元本額	42,314,592,963 円
期首からの追加設定元本額	33,126,201,663 円	期首からの追加設定元本額	13,174,577,281 円
期首からの解約元本額	1,335,176,940 円	期首からの解約元本額	24,862,316,162 円
平成19年11月6日現在の元本の内訳		平成20年11月6日現在の元本の内訳	
DCインデックスバラン ス(株式20)	327,821,447 円	DCインデックスバラン ス(株式20)	326,986,464 円
DCインデックスバラン ス(株式40)	441,934,087 円	DCインデックスバラン ス(株式40)	397,938,815 円
DCインデックスバラン ス(株式60)	340,966,771 円	DCインデックスバラン ス(株式60)	274,197,088 円
DCインデックスバラン ス(株式80)	62,490,290 円	DCインデックスバラン ス(株式80)	44,910,602 円
インデックスファンド日 本債券(DC専用)	683,084,939 円	インデックスファンド日 本債券(DC専用)	816,161,685 円
世界の財産3分法ファン ド(不動産・債券・株 式)毎月分配型	24,987,565,446 円	世界の財産3分法ファン ド(不動産・債券・株式)毎 月分配型	14,294,603,293 円
グローバルコレクション (債券/株式/不動産・ 資源・食料等)隔月分配 型	24,266,287 円	グローバルコレクション (債券/株式/不動産・資 源・食料等)隔月分配型	14,989,007 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)	621,837 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	4,558,108 円
アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式80)	13,988,990 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)	226,131,829 円
アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式60)	69,284,398 円	アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式80)	8,286,108 円
アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式40)	325,991,426 円	アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式60)	51,195,999 円
アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式20)	1,381,782,423 円	アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式40)	253,399,369 円
国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	5,415,755,521 円	アセット・ナビゲーシ ョン・ファンド(株式20)	1,131,267,809 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)	2,856,974,227 円	国際分散型ファンド40(適 格機関投資家向け)	7,239,966,679 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)	211,911,542 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)	230,583,814 円
3資産バラン スファンド(適格機関投資家向け)	682,842,431 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)	279,674,752 円
日本債券インデックス	38,325,272 円	3資産バラン スファンド(適格機関投資家向け)	311,671,312 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド (株式20)	724,757,925 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド(株 式20)	695,821,771 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド (株式40)	695,497,485 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド(株 式40)	626,768,708 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド (株式60)	376,090,974 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド(株 式60)	293,217,329 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド (株式80)	62,040,461 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーシ ョン・ファンド(株 式80)	42,458,872 円

年金積立 インデックス ファンド日本債券 日本債券インデックス ファンド（個人型年金向 け）	2,536,074,767 円	年金積立 インデックス ファンド日本債券	2,992,609,751 円
	54,524,017 円	日本債券インデックスファ ンド（個人型年金向け）	69,454,918 円
	(合計) 42,314,592,963 円		(合計) 30,626,854,082 円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信 託の受益権の総数	42,314,592,963 円	2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信託の受 益権の総数	30,626,854,082 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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	34,602,283,030	96,152,392
地方債証券	2,904,404,000	11,647,000
特殊債証券	5,236,653,000	7,636,000
社債証券	4,430,446,000	6,105,000
合計	47,173,786,030	121,540,392

対象期間（自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	24,848,355,200	23,530,700
地方債証券	2,015,535,000	6,136,000
特殊債証券	4,034,791,000	8,019,000
社債証券	3,898,676,000	2,617,000
合計	34,797,357,200	40,302,700

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成19年11月6日現在		平成20年11月6日現在	
1口当たり純資産額	1.1189 円	1口当たり純資産額	1.1405 円
（1万口当たり純資産額）	（11,189 円）	（1万口当たり純資産額）	（11,405 円）

## ( 3 ) 附属明細表

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

## ( 邦貨建債券 )

( 単位 : 円 )

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考	
国債証券	0042 0263	利付国庫債券 ( 2 年 ) 第 2 6 3 回	133,000,000	133,433,580	
	0042 0265	利付国庫債券 ( 2 年 ) 第 2 6 5 回	214,000,000	213,985,020	
	0042 0266	利付国庫債券 ( 2 年 ) 第 2 6 6 回	92,000,000	92,109,480	
	0042 0267	利付国庫債券 ( 2 年 ) 第 2 6 7 回	20,000,000	20,021,200	
	0042 0269	利付国庫債券 ( 2 年 ) 第 2 6 9 回	260,000,000	261,497,600	
	0042 0272	利付国庫債券 ( 2 年 ) 第 2 7 2 回	190,000,000	190,518,700	
	0045 0042	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 4 2 回	124,000,000	124,128,960	
	0045 0044	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 4 4 回	70,000,000	70,168,700	
	0045 0045	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 4 5 回	100,000,000	100,107,000	
	0045 0046	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 4 6 回	236,000,000	235,936,280	
	0045 0048	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 4 8 回	170,000,000	170,486,200	
	0045 0049	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 4 9 回	70,000,000	70,070,700	
	0045 0050	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 0 回	190,000,000	190,889,200	
	0045 0052	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 2 回	490,000,000	492,601,900	
	0045 0053	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 3 回	127,000,000	128,189,990	
	0045 0054	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 4 回	215,000,000	217,670,300	
	0045 0055	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 5 回	16,000,000	16,310,240	
	0045 0056	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 6 回	124,000,000	126,692,040	
	0045 0057	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 7 回	330,000,000	336,685,800	
	0045 0058	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 5 8 回	255,000,000	260,819,100	
	0045 0060	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 0 回	206,000,000	209,147,680	
	0045 0062	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 2 回	134,000,000	136,485,700	
	0045 0063	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 3 回	135,000,000	137,076,300	
	0045 0064	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 4 回	482,000,000	494,425,960	
	0045 0065	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 5 回	124,000,000	126,762,720	
	0045 0066	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 6 回	200,000,000	202,244,000	
	0045 0068	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 8 回	225,000,000	227,502,000	
	0045 0069	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 6 9 回	392,000,000	393,164,240	
	0045 0070	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 7 0 回	162,000,000	161,659,800	
	0045 0071	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 7 1 回	230,000,000	234,441,300	
	0045 0072	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 7 2 回	127,000,000	130,600,450	
	0045 0074	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 7 4 回	97,000,000	97,557,750	
	0045 0075	利付国庫債券 ( 5 年 ) 第 7 5 回	89,000,000	89,869,530	
	0067 0216	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 1 6 回	183,000,000	185,411,940	
	0067 0217	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 1 7 回	40,000,000	40,571,200	
	0067 0218	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 1 8 回	117,000,000	118,800,630	
	0067 0219	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 1 9 回	596,000,000	606,209,480	
	0067 0220	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 0 回	584,000,000	593,215,520	
	0067 0221	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 1 回	158,000,000	161,450,720	
	0067 0222	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 2 回	200,000,000	204,050,000	
	0067 0223	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 3 回	115,000,000	117,452,950	
	0067 0224	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 4 回	106,000,000	108,456,020	
0067 0225	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 5 回	20,000,000	20,564,400		
0067 0226	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 6 回	84,000,000	86,204,160		
0067 0227	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 7 回	206,000,000	210,956,360		
0067 0229	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 2 9 回	102,000,000	103,967,580		
0067 0230	利付国庫債券 ( 1 0 年 ) 第 2 3 0 回	96,000,000	97,182,720		

0067 0231	利付国庫債券(10年)第231回	207,000,000	210,661,830
0067 0232	利付国庫債券(10年)第232回	55,000,000	55,832,150
0067 0233	利付国庫債券(10年)第233回	297,000,000	303,017,220
0067 0234	利付国庫債券(10年)第234回	70,000,000	71,472,800
0067 0236	利付国庫債券(10年)第236回	120,000,000	122,937,600
0067 0237	利付国庫債券(10年)第237回	148,000,000	151,704,440
0067 0238	利付国庫債券(10年)第238回	200,000,000	204,352,000
0067 0239	利付国庫債券(10年)第239回	487,000,000	497,675,040
0067 0240	利付国庫債券(10年)第240回	501,000,000	510,313,590
0067 0241	利付国庫債券(10年)第241回	84,000,000	85,603,560
0067 0245	利付国庫債券(10年)第245回	64,000,000	64,190,080
0067 0247	利付国庫債券(10年)第247回	17,000,000	16,964,300
0067 0250	利付国庫債券(10年)第250回	255,000,000	250,598,700
0067 0251	利付国庫債券(10年)第251回	155,000,000	155,170,500
0067 0252	利付国庫債券(10年)第252回	161,000,000	161,925,750
0067 0253	利付国庫債券(10年)第253回	150,000,000	155,031,000
0067 0254	利付国庫債券(10年)第254回	36,000,000	36,863,280
0067 0256	利付国庫債券(10年)第256回	346,000,000	354,445,860
0067 0258	利付国庫債券(10年)第258回	54,000,000	55,032,480
0067 0259	利付国庫債券(10年)第259回	260,000,000	267,693,400
0067 0261	利付国庫債券(10年)第261回	109,000,000	114,052,150
0067 0262	利付国庫債券(10年)第262回	53,000,000	55,738,510
0067 0264	利付国庫債券(10年)第264回	136,000,000	139,994,320
0067 0265	利付国庫債券(10年)第265回	143,000,000	147,157,010
0067 0266	利付国庫債券(10年)第266回	28,000,000	28,644,560
0067 0268	利付国庫債券(10年)第268回	236,000,000	242,685,880
0067 0269	利付国庫債券(10年)第269回	39,000,000	39,627,900
0067 0270	利付国庫債券(10年)第270回	198,000,000	201,057,120
0067 0271	利付国庫債券(10年)第271回	56,000,000	56,501,200
0067 0272	利付国庫債券(10年)第272回	56,000,000	57,216,880
0067 0273	利付国庫債券(10年)第273回	107,000,000	110,044,150
0067 0274	利付国庫債券(10年)第274回	100,000,000	103,214,000
0067 0275	利付国庫債券(10年)第275回	97,000,000	99,541,400
0067 0276	利付国庫債券(10年)第276回	82,000,000	85,207,840
0067 0279	利付国庫債券(10年)第279回	75,000,000	79,917,750
0067 0280	利付国庫債券(10年)第280回	61,000,000	64,379,400
0067 0281	利付国庫債券(10年)第281回	154,000,000	163,842,140
0067 0282	利付国庫債券(10年)第282回	333,000,000	344,212,110
0067 0283	利付国庫債券(10年)第283回	200,000,000	208,466,000
0067 0284	利付国庫債券(10年)第284回	446,000,000	459,250,660
0067 0285	利付国庫債券(10年)第285回	408,000,000	419,346,480
0067 0286	利付国庫債券(10年)第286回	156,000,000	161,224,440
0067 0287	利付国庫債券(10年)第287回	370,000,000	385,688,000
0067 0288	利付国庫債券(10年)第288回	505,000,000	516,529,150
0067 0289	利付国庫債券(10年)第289回	78,000,000	78,344,760
0067 0290	利付国庫債券(10年)第290回	275,000,000	273,641,500
0067 0291	利付国庫債券(10年)第291回	221,000,000	217,910,420
0067 0292	利付国庫債券(10年)第292回	241,000,000	246,164,630
0067 0293	利付国庫債券(10年)第293回	238,000,000	245,021,000
0067 0295	利付国庫債券(10年)第295回	185,000,000	185,543,900
0067 0296	利付国庫債券(10年)第296回	574,000,000	574,487,900
0068 0014	利付国庫債券(30年)第14回	118,000,000	119,889,180
0068 0015	利付国庫債券(30年)第15回	162,000,000	167,896,800
0068 0023	利付国庫債券(30年)第23回	55,000,000	57,146,650
0068 0024	利付国庫債券(30年)第24回	158,000,000	164,481,160
0068 0026	利付国庫債券(30年)第26回	185,000,000	189,147,700
0068 0027	利付国庫債券(30年)第27回	148,000,000	154,473,520
0068 0028	利付国庫債券(30年)第28回	82,000,000	85,548,140
0068 0029	利付国庫債券(30年)第29回	33,000,000	33,763,290

0069 0023	利付国庫債券(20年)第23回	100,000,000	122,090,000	
0069 0026	利付国庫債券(20年)第26回	37,000,000	44,566,870	
0069 0027	利付国庫債券(20年)第27回	16,000,000	19,757,760	
0069 0029	利付国庫債券(20年)第29回	110,000,000	133,152,800	
0069 0031	利付国庫債券(20年)第31回	140,000,000	163,870,000	
0069 0033	利付国庫債券(20年)第33回	200,000,000	238,794,000	
0069 0034	利付国庫債券(20年)第34回	85,000,000	99,653,150	
0069 0037	利付国庫債券(20年)第37回	63,000,000	72,035,460	
0069 0039	利付国庫債券(20年)第39回	86,000,000	94,769,420	
0069 0041	利付国庫債券(20年)第41回	27,000,000	26,951,670	
0069 0042	利付国庫債券(20年)第42回	158,000,000	174,277,160	
0069 0043	利付国庫債券(20年)第43回	73,000,000	82,657,900	
0069 0044	利付国庫債券(20年)第44回	51,000,000	55,731,270	
0069 0047	利付国庫債券(20年)第47回	21,000,000	22,211,700	
0069 0048	利付国庫債券(20年)第48回	99,000,000	107,873,370	
0069 0049	利付国庫債券(20年)第49回	57,000,000	59,510,850	
0069 0050	利付国庫債券(20年)第50回	92,000,000	93,926,480	
0069 0051	利付国庫債券(20年)第51回	39,000,000	40,131,390	
0069 0054	利付国庫債券(20年)第54回	15,000,000	15,711,150	
0069 0055	利付国庫債券(20年)第55回	66,000,000	67,384,680	
0069 0057	利付国庫債券(20年)第57回	102,000,000	102,721,140	
0069 0058	利付国庫債券(20年)第58回	135,000,000	135,669,600	
0069 0059	利付国庫債券(20年)第59回	33,000,000	32,247,600	
0069 0060	利付国庫債券(20年)第60回	121,000,000	113,448,390	
0069 0061	利付国庫債券(20年)第61回	27,000,000	23,869,080	
0069 0063	利付国庫債券(20年)第63回	31,000,000	30,367,600	
0069 0064	利付国庫債券(20年)第64回	54,000,000	53,503,740	
0069 0065	利付国庫債券(20年)第65回	140,000,000	138,455,800	
0069 0066	利付国庫債券(20年)第66回	34,000,000	33,191,820	
0069 0067	利付国庫債券(20年)第67回	54,000,000	53,302,860	
0069 0068	利付国庫債券(20年)第68回	38,000,000	39,007,000	
0069 0070	利付国庫債券(20年)第70回	49,000,000	51,453,430	
0069 0072	利付国庫債券(20年)第72回	42,000,000	42,378,000	
0069 0073	利付国庫債券(20年)第73回	13,000,000	12,944,750	
0069 0074	利付国庫債券(20年)第74回	78,000,000	78,709,800	
0069 0076	利付国庫債券(20年)第76回	206,000,000	201,842,920	
0069 0088	利付国庫債券(20年)第88回	300,000,000	307,710,000	
0069 0090	利付国庫債券(20年)第90回	156,000,000	157,411,800	
0069 0091	利付国庫債券(20年)第91回	200,000,000	204,662,000	
0069 0092	利付国庫債券(20年)第92回	195,000,000	193,477,050	
0069 0094	利付国庫債券(20年)第94回	100,000,000	99,081,000	
0069 0095	利付国庫債券(20年)第95回	182,000,000	185,627,260	
0069 0096	利付国庫債券(20年)第96回	98,000,000	96,962,180	
0069 0097	利付国庫債券(20年)第97回	220,000,000	220,882,200	
0069 0098	利付国庫債券(20年)第98回	44,000,000	43,500,160	
0069 0099	利付国庫債券(20年)第99回	321,000,000	317,321,340	
0069 0100	利付国庫債券(20年)第100回	170,000,000	170,926,500	
0069 0101	利付国庫債券(20年)第101回	96,000,000	99,483,840	
0069 0102	利付国庫債券(20年)第102回	106,000,000	109,881,720	
0069 0104	利付国庫債券(20年)第104回	33,000,000	32,682,210	
0069 0105	利付国庫債券(20年)第105回	110,000,000	108,930,800	
0069 0106	利付国庫債券(20年)第106回	65,000,000	65,406,250	
国債証券計		24,292,000,000	24,848,355,200	
地方債証券	0100 0596	東京都公募公債 596回	100,000,000	98,449,000
	0100 0597	東京都公募公債 597回	100,000,000	97,908,000
	0100 0598	東京都公募公債 598回	100,000,000	97,371,000
	0100 0636	東京都公募公債 636回	100,000,000	104,823,000
	0101 1404	北海道公募公債 平成14年度4回	100,000,000	100,003,000
	0103 0123	神奈川県公募公債 123回	100,000,000	101,438,000

0104 0261	大阪府公募公債 2 6 1 回	100,000,000	100,445,000		
0104 8001	大阪府公募公債 1 回	100,000,000	101,901,000		
0106 1904	兵庫県公募公債 平成 1 9 年度 4 回	100,000,000	100,429,000		
0107 1503	静岡県公募公債 平成 1 5 年度 3 回	100,000,000	101,202,000		
0107 1901	静岡県公募公債 平成 1 9 年度 1 回	100,000,000	100,738,000		
0109 1801	広島県公募公債 平成 1 8 年度 1 回	100,000,000	104,331,000		
0110 1601	埼玉県公募公債 平成 1 6 年度 1 回	100,000,000	101,399,000		
0120 1603	千葉県公募公債 平成 1 6 年度 3 回	100,000,000	103,508,000		
0121 1701	新潟県公募公債 平成 1 7 年度 1 回	100,000,000	99,589,000		
0150 1605	大阪市公募公債 平成 1 6 年度 5 回	100,000,000	100,629,000		
0151 1240	名古屋市公募公債 1 2 回め号	100,000,000	102,983,000		
0154 1502	横浜市公募公債 平成 1 5 年度 2 回	100,000,000	97,672,000		
0155 1407	札幌市公募公債 平成 1 4 年度 7 回	100,000,000	98,240,000		
0183 0005	鹿児島県公募公債 平成 1 8 年度 1 回	100,000,000	102,477,000		
地方債証券 計		2,000,000,000	2,015,535,000		
特殊債券	0903 0004	政府保証日本政策投資銀行債券 政府保証第 4 回	100,000,000	102,117,000	
	0903 9029	日本政策投資銀行債券 (財投機関債) 第 2 9 回	100,000,000	101,113,000	
	0905 0329	政府保証道路債券 政府保証第 3 2 9 回	100,000,000	102,810,000	
	0905 0332	政府保証道路債券 政府保証第 3 3 2 回	100,000,000	102,114,000	
	0905 0335	政府保証道路債券 政府保証第 3 3 5 回	100,000,000	101,500,000	
	0905 0336	政府保証道路債券 政府保証第 3 3 6 回	100,000,000	101,450,000	
	0905 0338	政府保証道路債券 政府保証第 3 3 8 回	100,000,000	101,997,000	
	0905 0343	政府保証道路債券 政府保証第 3 4 3 回	100,000,000	100,652,000	
	0905 8005	政府保証 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証第 5 回	100,000,000	102,535,000	
	0906 0794	政府保証公営企業債券 政府保証第 7 9 4 回	100,000,000	102,427,000	
	0906 0809	政府保証公営企業債券 政府保証第 8 0 9 回	100,000,000	101,846,000	
	0906 0812	政府保証公営企業債券 政府保証第 8 1 2 回	100,000,000	102,138,000	
	0906 0820	政府保証公営企業債券 政府保証第 8 2 0 回	100,000,000	101,518,000	
	0906 0832	政府保証公営企業債券 政府保証第 8 3 2 回	100,000,000	101,836,000	
	0906 0858	政府保証公営企業債券 政府保証第 8 5 8 回	100,000,000	102,085,000	
	0906 9012	公営企業債券 (財投機関債) 第 1 2 回	100,000,000	101,254,000	
	0906 9020	公営企業債券 (財投機関債) 第 2 0 回	100,000,000	104,257,000	
	0907 0199	政府保証首都高速道路債券 政府保証第 1 9 9 回	100,000,000	101,256,000	
	0910 0176	政府保証中小企業債券 政府保証第 1 7 6 回	100,000,000	102,729,000	
	0910 9020	中小企業債券 (財投機関債) 第 2 0 回	100,000,000	99,493,000	
	0916 9025	国際協力銀行債券 (財投機関債) 第 2 5 回	100,000,000	104,363,000	
	0917 7007	政府保証都市再生債券 政府保証第 7 回	100,000,000	101,131,000	
	0942 0108	政府保証預金保険機構債券 政府保証第 1 0 8 回	100,000,000	102,033,000	
0944 0014	政府保証国民生活債券 政府保証第 1 4 回	100,000,000	102,106,000		

0945 9008	農林漁業金融公庫債券（財投機関債） 第8回	200,000,000	201,306,000	
0949 0003	沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）第3回	100,000,000	101,826,000	
0949 0005	沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）第5回	200,000,000	200,090,000	
0953 1665	利附農林債券（5年）利附い第665号	100,000,000	99,331,000	
0953 1667	利附農林債券（5年）利附い第667号	100,000,000	99,375,000	
0953 1671	利附農林債券（5年）利附い第671号	100,000,000	100,640,000	
0954 1626	利附長期信用債券（5年）利附第626回	100,000,000	93,197,000	
0958 0185	利附しんきん中金債券（5年）利附第185回	100,000,000	99,293,000	
0958 0198	利附しんきん中金債券（5年）利附第198回	100,000,000	100,996,000	
0958 0201	利附しんきん中金債券（5年）利附第201回	100,000,000	100,979,000	
0959 1669	みずほコーポレート銀行債券（5年） 利附い第669号	100,000,000	99,178,000	
0972 3083	利附商工債券（3年）利附第83号	100,000,000	100,094,000	
0972 3085	利附商工債券（3年）利附第85号	100,000,000	99,923,000	
1094 1005	第5回韓国ガス公社円貨債券（2005）	100,000,000	91,803,000	
特殊債券計		4,000,000,000	4,034,791,000	
社債券	0931 0324 東京交通債券 324回	100,000,000	113,755,000	
	1210 1011 ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション 第11回円貨社債（2005）	100,000,000	84,126,000	
	1212 1004 ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー 第2回円貨社債（2004）	100,000,000	96,438,000	
	1218 1011 エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第11回円貨社債（2006）	100,000,000	92,402,000	
	1236 1003 ドイツ銀行AGロンドン支店 第3回円貨社債（2007）	100,000,000	93,940,000	
	2801 0401 キッコーマン（社債間限定同順位特約付）4回	100,000,000	99,421,000	
	4005 3201 住友化学（社債間限定同順位特約付）32回	100,000,000	101,269,000	
	4010 3201 三菱化学（社債間限定同順位特約付）32回	100,000,000	100,589,000	
	4043 1901 トクヤマ 19回	100,000,000	100,471,000	
	4631 3001 大日本インキ化学工業（社債間限定同順位特約付）30回	100,000,000	99,344,000	
	5001 1901 新日本石油（社債間限定同順位特約付）19回	100,000,000	102,075,000	
	5233 1605 太平洋セメント（社債間限定同順位特約付）16回	100,000,000	98,421,000	
	5401 4901 新日本製鉄（社債間限定同順位特約付）49回	100,000,000	98,136,000	
	5411 0801 ジェイ エフ イー ホールディングス（JFEスチール（株）保証付）8回	100,000,000	100,692,000	
	5711 2001 三菱マテリアル（社債間限定同順位特約付）20回	100,000,000	100,733,000	
	6201 1501 豊田自動織機（社債間限定同順位特約付）15回	100,000,000	101,904,000	
	6473 0305 ジェイテクト（社債間限定同順位特約付）（旧豊田工機）3回	100,000,000	99,419,000	

7011 1701	三菱重工業(社債間限定同順位特約付) 17回	100,000,000	97,605,000	
8002 6601	丸紅(社債間限定同順位特約付) 66回	100,000,000	100,837,000	
8053 2301	住友商事(社債間限定同順位特約付) 23回	100,000,000	100,773,000	
8310 0301	みずほコーポレート銀行(特定社債間限定同順位特約付) 3回	100,000,000	100,141,000	
8315 0085	三菱東京UFJ銀行(特定社債間限定同順位特約付) 85回	100,000,000	100,312,000	
8604 0501	野村ホールディングス 5回	100,000,000	98,660,000	
8801 2601	三井不動産(社債間限定同順位特約付) 26回	100,000,000	101,068,000	
8830 5001	住友不動産(社債間限定同順位特約付) 50回	100,000,000	99,255,000	
9005 5701	東京急行電鉄(社債間限定同順位特約付) 57回	100,000,000	100,072,000	
9020 3101	東日本旅客鉄道(社債間限定同順位特約付) 31回	100,000,000	102,024,000	
9022 1601	東海旅客鉄道(社債間限定同順位特約付) 16回	100,000,000	100,591,000	
9075 0601	福山通運(社債間限定同順位特約付) 6回	100,000,000	99,774,000	
9101 2601	日本郵船(社債間限定同順位特約付) 26回	100,000,000	102,030,000	
9432 0043	日本電信電話 43回	100,000,000	101,837,000	
9501 0496	東京電力 496回	100,000,000	101,517,000	
9501 0510	東京電力 510回	100,000,000	101,113,000	
9501 0523	東京電力 523回	100,000,000	102,292,000	
9502 0461	中部電力 461回	100,000,000	99,541,000	
9503 0433	関西電力 433回	100,000,000	100,119,000	
9503 0451	関西電力 451回	100,000,000	102,491,000	
9506 0434	東北電力 434回	100,000,000	102,993,000	
9507 0257	四国電力 257回	100,000,000	100,496,000	
社債券計		3,900,000,000	3,898,676,000	
合計		34,192,000,000	34,797,357,200	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)



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

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成19年11月6日現在	平成20年11月6日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		12,256,804,358	9,848,425,718
コール・ローン		723,228,971	7,914,961,799
国債証券		900,976,921,301	651,784,353,612
派生商品評価勘定		111,510	4,031,871
未収入金		3,252,978,589	545,066,567
未収利息		13,243,103,408	8,909,807,609
前払費用		1,354,501,889	855,537,122
流動資産合計		931,807,650,026	679,862,184,298
資産合計		931,807,650,026	679,862,184,298
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,370,258	144,570,420
未払金		12,991,829,997	18,058,373,750
未払解約金		15,317,277	23,338,739
流動負債合計		13,009,517,532	18,226,282,909
負債合計		13,009,517,532	18,226,282,909
純資産の部			
元本等			
元本		514,808,646,504	448,939,945,951
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		403,989,485,990	212,695,955,438
元本等合計		918,798,132,494	661,635,901,389
純資産合計		918,798,132,494	661,635,901,389
負債純資産合計		931,807,650,026	679,862,184,298

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	対象期間	自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）又は金融商品取引所等が発表する基準値で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法		<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引</p> <p>同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成19年11月6日現在		平成20年11月6日現在	
1. 期首	平成18年11月7日	1. 期首	平成19年11月7日
期首元本額	380,754,966,862 円	期首元本額	514,808,646,504 円
期首からの追加設定元本額	190,849,150,060 円	期首からの追加設定元本額	90,171,745,434 円
期首からの解約元本額	56,795,470,418 円	期首からの解約元本額	156,040,445,987 円
平成19年11月6日現在の元本の内訳		平成20年11月6日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	6,379,765,732 円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	7,468,553,937 円
DCインデックスバランス(株式20)	31,465,161 円	DCインデックスバランス(株式20)	39,346,021 円
DCインデックスバランス(株式40)	61,495,021 円	DCインデックスバランス(株式40)	69,134,465 円
DCインデックスバランス(株式60)	84,924,383 円	DCインデックスバランス(株式60)	85,692,741 円
DCインデックスバランス(株式80)	77,783,075 円	DCインデックスバランス(株式80)	70,067,152 円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	358,052,768,444 円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	249,364,585,669 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	15,732,343,312 円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	10,942,862,670 円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	116,528,324,393 円	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	161,287,544,346 円
グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	15,760,260 円	グローバルコレクション(債券/株式/不動産・資源・食料等)隔月分配型	11,667,592 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)	309,797 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	26,818,567 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,853,644 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)	519,827,629 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,771,411 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)	140,885,156 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	23,047,781 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	6,349,173 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	67,897,548 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,001,669 円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	2,491,737,151 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	22,015,049 円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,135,270,272 円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	66,551,313 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)	2,509,669,110 円	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,519,260,709 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)	151,951,229 円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,885,390,403 円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	427,275,588 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)	251,261,055 円
海外債券インデックス(ヘッジなし)	76,586,872 円	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	248,693,236 円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式20）	35,143,053 円	3 資産バランスファンド （適格機関投資家向け）	238,524,297 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式40）	48,738,222 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式20）	41,230,351 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式60）	47,331,495 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式40）	54,452,573 円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド（株 式80）	38,817,662 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式60）	45,827,111 円
年金積立 インデックス ファンド海外債券（ヘッジ なし）	10,643,486,653 円	年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	32,806,553 円
海外債券インデックスファ ンド（個人型年金向け）	129,129,235 円	年金積立 インデックス ファンド海外債券（ヘッ ジなし）	12,332,061,995 円
（合計）	514,808,646,504 円	海外債券インデックス ファンド（個人型年金向 け）	160,534,519 円
2. 本報告書における開示対象 ファンドの計算期間末日に おける当該親投資信託の受 益権の総数	514,808,646,504 円	（合計）	448,939,945,951 円
		2. 本報告書における開示対 象ファンドの計算期間末 日における当該親投資信 託の受益権の総数	448,939,945,951 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

（有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	900,976,921,301	152,901,154
合計	900,976,921,301	152,901,154

対象期間（自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日）

売買目的有価証券

（単位：円）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	651,784,353,612	2,381,357,134
合計	651,784,353,612	2,381,357,134

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の状況に関する事項

	自 平成18年11月7日 至 平成19年11月6日	自 平成19年11月7日 至 平成20年11月6日
取引の内容	当投資信託が利用することができるデリバティブ取引等は、内外の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨先物取引、通貨オプション取引、金利先物取引、金利オプション取引、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、および為替予約取引であります。	同左
取引の利用目的及び取引に対する取組方針	市場動向を勘案し、デリバティブ取引を行う方針であります。また信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。	同左
取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引には、有価証券、為替、金利等の市場価格が変動することによって発生するリスクがあります。	同左
取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従って、運用部門が執行し、リスク管理業務担当部門が日常的にこれを監視しております。	同左

## 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(単位：円)

区分	種類	平成19年11月6日現在			
		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	3,155,730,296	-	3,155,698,300	31,996
	アメリカドル	668,310,328	-	668,329,600	19,272
	カナダドル	83,643,208	-	83,681,400	38,192
	イギリスポンド	350,146,650	-	350,168,700	22,050
	ユーロ	2,053,630,110	-	2,053,518,600	111,510
	買建	680,058,104	-	677,767,360	2,290,744
	アメリカドル	598,232,340	-	597,436,200	796,140
	オーストラリアドル	81,825,764	-	80,331,160	1,494,604
	合計	3,835,788,400	-	3,833,465,660	2,258,748

(単位：円)

区分	種類	平成20年11月6日現在			
		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	193,110,863	-	189,185,252	3,925,611
	マレーシアリングット	193,110,863	-	189,185,252	3,925,611
	買建	8,207,903,460	-	8,063,439,300	144,464,160
	アメリカドル	2,591,975,930	-	2,552,361,300	39,614,630
	カナダドル	667,827,013	-	659,883,960	7,943,053
	イギリスポンド	778,158,255	-	762,133,680	16,024,575
	ポーランドズロチ	160,917,462	-	160,067,160	850,302
	ユーロ	4,009,024,800	-	3,928,993,200	80,031,600
	合計	8,401,014,323	-	8,252,624,552	140,538,549

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成19年11月6日現在	平成20年11月6日現在
1口当たり純資産額	1.7847 円	1.4738 円
(1万口当たり純資産額)	(17,847 円)	(14,738 円)

[次へ](#)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

## (外貨建債券)

外貨建債券(アメリカドル)

(単位:アメリカドル)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	109K00	アメリカ国債 3.5% 20091115	14,770,000.00	15,103,478.50
	109K01	アメリカ国債 4.625% 20091115	10,000,000.00	10,339,062.00
	109K02	アメリカ国債 3.125% 20091130	19,300,000.00	19,682,983.41
	109L00	アメリカ国債 3.5% 20091215	15,000,000.00	15,385,546.49
	109L01	アメリカ国債 3.25% 20091231	22,000,000.00	22,495,000.00
	110A00	アメリカ国債 3.625% 20100115	12,100,000.00	12,459,218.74
	110A01	アメリカ国債 2.125% 20100131	25,000,000.00	25,261,717.48
	110B00	アメリカ国債 6.5% 20100215	18,000,000.00	19,162,967.35
	110B01	アメリカ国債 3.5% 20100215	13,000,000.00	13,377,812.50
	110B02	アメリカ国債 4.75% 20100215	15,000,000.00	15,656,250.00
	110B03	アメリカ国債 2% 20100228	25,500,000.00	25,747,031.25
	110C00	アメリカ国債 4% 20100315	13,650,000.00	14,160,807.57
	110C01	アメリカ国債 1.75% 20100331	26,000,000.00	26,175,702.80
	110D00	アメリカ国債 4% 20100415	13,050,000.00	13,566,901.36
	110D01	アメリカ国債 2.125% 20100430	26,300,000.00	26,676,005.84
	110E00	アメリカ国債 3.875% 20100515	14,500,000.00	15,101,522.33
	110E01	アメリカ国債 4.5% 20100515	14,000,000.00	14,698,905.20
	110E02	アメリカ国債 2.625% 20100531	28,000,000.00	28,612,500.00
	110F00	アメリカ国債 3.625% 20100615	13,670,000.00	14,198,643.47
	110F01	アメリカ国債 2.875% 20100630	22,100,000.00	22,676,670.77
	110G00	アメリカ国債 2.75% 20100731	25,850,000.00	26,542,697.28
	110H00	アメリカ国債 5.75% 20100815	18,000,000.00	19,445,624.98
	110H01	アメリカ国債 4.125% 20100815	11,930,000.00	12,544,207.68
	110H02	アメリカ国債 2.375% 20100831	11,800,000.00	12,023,093.16
	110I00	アメリカ国債 3.875% 20100915	11,000,000.00	11,554,296.58
	110I01	アメリカ国債 2% 20100930	26,600,000.00	26,969,904.92
	110J00	アメリカ国債 4.25% 20101015	11,850,000.00	12,561,925.48
	110J01	アメリカ国債 3.875% 20100715	12,790,000.00	13,376,540.43
	110K00	アメリカ国債 4.5% 20101115	10,000,000.00	10,667,968.00
	110L00	アメリカ国債 4.375% 20101215	12,700,000.00	13,540,381.86
	111A00	アメリカ国債 4.25% 20110115	12,180,000.00	12,997,391.24
	111B00	アメリカ国債 5% 20110215	14,300,000.00	15,534,491.82
	111B01	アメリカ国債 4.5% 20110228	14,300,000.00	15,342,335.58
	111C00	アメリカ国債 4.75% 20110331	13,500,000.00	14,621,131.79
	111D00	アメリカ国債 4.875% 20110430	13,750,000.00	14,939,159.12
	111E00	アメリカ国債 4.875% 20110531	15,180,000.00	16,529,596.11
	111F00	アメリカ国債 5.125% 20110630	13,770,000.00	15,088,907.11
	111G00	アメリカ国債 4.875% 20110731	13,000,000.00	14,182,187.49
	111H00	アメリカ国債 5% 20110815	17,000,000.00	18,686,717.87
	111H01	アメリカ国債 4.625% 20110831	14,000,000.00	15,186,718.40
	111I00	アメリカ国債 4.5% 20110930	14,400,000.00	15,586,873.92
	111J00	アメリカ国債 4.625% 20111031	13,600,000.00	14,788,936.48
	111K00	アメリカ国債 4.5% 20111130	13,580,000.00	14,721,568.75
	111L00	アメリカ国債 4.625% 20111231	10,000,000.00	10,889,062.00
	112A00	アメリカ国債 4.75% 20120131	11,050,000.00	12,109,245.25
	112B00	アメリカ国債 4.875% 20120215	20,000,000.00	22,143,749.98
	112B01	アメリカ国債 4.625% 20120229	7,520,000.00	8,229,700.00
	112C00	アメリカ国債 4.5% 20120331	12,500,000.00	13,644,531.25
	112D00	アメリカ国債 4.5% 20120430	12,400,000.00	13,547,968.44
	112E00	アメリカ国債 4.75% 20120531	12,410,000.00	13,682,025.00
	112F00	アメリカ国債 4.875% 20120630	12,430,000.00	13,787,588.43
	112G00	アメリカ国債 4.625% 20120731	8,200,000.00	9,041,780.84

112H00	アメリカ国債 4.375% 20120815	14,000,000.00	15,373,750.00
112H01	アメリカ国債 4.125% 20120831	12,050,000.00	13,097,784.85
112I00	アメリカ国債 4.25% 20120930	12,000,000.00	13,136,250.00
112J00	アメリカ国債 3.875% 20121031	12,000,000.00	12,952,500.00
112K00	アメリカ国債 4% 20121115	14,400,000.00	15,612,749.27
112K01	アメリカ国債 3.375% 20121130	12,300,000.00	13,029,350.64
112L00	アメリカ国債 3.625% 20121231	12,000,000.00	12,836,249.99
113A00	アメリカ国債 2.875% 20130131	13,000,000.00	13,487,500.00
113B00	アメリカ国債 3.875% 20130215	16,750,000.00	17,987,928.80
113B01	アメリカ国債 2.75% 20130228	10,900,000.00	11,203,156.25
113C00	アメリカ国債 2.5% 20130331	17,000,000.00	17,268,280.40
113D00	アメリカ国債 3.125% 20130430	15,900,000.00	16,574,506.62
113E00	アメリカ国債 3.625% 20130515	16,900,000.00	17,874,389.75
113E01	アメリカ国債 3.5% 20130531	17,700,000.00	18,669,351.12
113F00	アメリカ国債 3.375% 20130630	19,300,000.00	20,228,812.50
113G00	アメリカ国債 3.375% 20130731	19,000,000.00	19,840,155.30
113H00	アメリカ国債 4.25% 20130815	23,500,000.00	25,508,514.42
113H01	アメリカ国債 3.125% 20130831	18,000,000.00	18,573,750.00
113I00	アメリカ国債 3.125% 20130930	16,500,000.00	17,000,156.25
113K00	アメリカ国債 4.25% 20131115	21,970,000.00	23,871,778.11
114B00	アメリカ国債 4% 20140215	23,430,000.00	25,154,300.32
114E00	アメリカ国債 4.75% 20140515	18,450,000.00	20,537,156.25
114H00	アメリカ国債 4.25% 20140815	22,500,000.00	24,532,031.24
114K01	アメリカ国債 4.25% 20141115	22,080,000.00	24,077,548.88
115B00	アメリカ国債 4% 20150215	27,300,000.00	29,040,375.00
115E00	アメリカ国債 4.125% 20150515	25,000,000.00	26,519,529.99
115H00	アメリカ国債 4.25% 20150815	23,000,000.00	24,433,905.08
115K01	アメリカ国債 4.5% 20151115	19,000,000.00	20,505,155.27
116B00	アメリカ国債 4.5% 20160215	19,800,000.00	21,300,467.74
116E00	アメリカ国債 5.125% 20160515	15,200,000.00	16,798,374.23
116H00	アメリカ国債 4.875% 20160815	20,350,000.00	22,102,006.77
116K00	アメリカ国債 4.625% 20161115	20,150,000.00	21,516,421.87
117B00	アメリカ国債 4.625% 20170215	20,000,000.00	21,434,374.00
117E00	アメリカ国債 4.5% 20170515	19,930,000.00	21,156,940.60
117H00	アメリカ国債 4.75% 20170815	20,000,000.00	21,584,373.99
117K00	アメリカ国債 4.25% 20171115	17,900,000.00	18,767,031.25
118B00	アメリカ国債 3.5% 20180215	26,000,000.00	25,805,000.00
118E00	アメリカ国債 3.875% 20180515	23,300,000.00	23,722,312.50
118H00	アメリカ国債 4% 20180815	23,400,000.00	23,985,000.00
118K00	アメリカ国債 9% 20181115	5,400,000.00	7,495,030.96
138B00	アメリカ国債 4.375% 20380215	12,000,000.00	12,438,750.00
215020	アメリカ国債 11.25% 20150215	8,600,000.00	12,384,000.00
216110	アメリカ国債 7.5% 20161115	10,200,000.00	12,595,405.72
216E00	アメリカ国債 7.25% 20160515	12,200,000.00	14,834,437.48
217050	アメリカ国債 8.75% 20170515	11,850,000.00	15,790,125.00
217080	アメリカ国債 8.875% 20170815	8,600,000.00	11,589,843.32
218E00	アメリカ国債 9.125% 20180515	4,520,000.00	6,284,212.50
219020	アメリカ国債 8.875% 20190215	10,000,000.00	13,767,186.99
219022	アメリカ国債 8.125% 20190815	11,100,000.00	14,629,452.55
220080	アメリカ国債 8.75% 20200815	13,000,000.00	18,009,062.47
220B00	アメリカ国債 8.5% 20200215	7,400,000.00	10,035,093.37
220E01	アメリカ国債 8.75% 20200515	1,200,000.00	1,659,187.44
221020	アメリカ国債 7.875% 20210215	7,760,000.00	10,157,112.10
221050	アメリカ国債 8.125% 20210515	7,600,000.00	10,169,750.00
221080	アメリカ国債 8.125% 20210815	7,060,000.00	9,432,821.48
221110	アメリカ国債 8% 20211115	20,000,000.00	26,643,749.96
222080	アメリカ国債 7.25% 20220815	8,050,000.00	10,202,116.78
222110	アメリカ国債 7.625% 20221115	5,100,000.00	6,686,577.87
223020	アメリカ国債 7.125% 20230215	12,820,000.00	16,187,252.44
223080	アメリカ国債 6.25% 20230815	18,800,000.00	22,128,186.52
224K01	アメリカ国債 7.5% 20241115	7,350,000.00	9,947,765.62
225020	アメリカ国債 7.625% 20250215	7,000,000.00	9,591,093.40
225080	アメリカ国債 6.875% 20250815	8,240,000.00	10,563,937.05
226020	アメリカ国債 6% 20260215	9,850,000.00	11,584,522.94
226080	アメリカ国債 6.75% 20260815	6,810,000.00	8,648,700.00



226110	アメリカ国債 6.5% 20261115	6,700,000.00	8,324,750.00	
227080	アメリカ国債 6.375% 20270815	6,280,000.00	7,730,287.50	
227110	アメリカ国債 6.125% 20271115	11,000,000.00	13,206,875.00	
228H00	アメリカ国債 5.5% 20280815	9,070,000.00	10,199,497.98	
228K00	アメリカ国債 5.25% 20281115	4,250,000.00	4,657,734.37	
229B00	アメリカ国債 5.25% 20290215	9,800,000.00	10,741,718.25	
229H00	アメリカ国債 6.125% 20290815	8,000,000.00	9,748,749.58	
230B00	アメリカ国債 6.25% 20300515	13,340,000.00	16,564,527.38	
231B00	アメリカ国債 5.375% 20310215	11,300,000.00	12,708,968.72	
236B00	アメリカ国債 4.5% 20360215	20,500,000.00	21,416,093.74	
237B00	アメリカ国債 4.75% 20370215	13,050,000.00	14,224,500.00	
237E00	アメリカ国債 5% 20370515	10,500,000.00	11,889,608.85	
238E00	アメリカ国債 4.5% 20380515	9,500,000.00	10,061,093.75	
N00106	アメリカ国債 6.625% 20270215	8,060,000.00	10,166,933.96	
国債証券 計		1,908,350,000.00	2,087,242,966.59	
アメリカドル 計		1,908,350,000.00	2,087,242,966.59	
(邦貨換算額)		(187,285,469,000)	(204,842,024,741)	

## 外貨建債券（カナダドル）

（単位：カナダドル）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	309L00	カナダ国債 4.25% 20091201	5,300,000.00	5,429,214.00	
	310F00	カナダ国債 5.5% 20100601	4,300,000.00	4,529,276.00	
	310F02	カナダ国債 3.75% 20100601	3,300,000.00	3,387,615.00	
	310I00	カナダ国債 4% 20100901	6,100,000.00	6,312,219.00	
	310L00	カナダ国債 2.75% 20101201	6,400,000.00	6,497,472.00	
	311F00	カナダ国債 6% 20110601	8,670,000.00	9,492,609.60	
	311I00	カナダ国債 3.75% 20110901	7,400,000.00	7,687,194.00	
	312F00	カナダ国債 5.25% 20120601	8,170,000.00	8,894,270.50	
	312F01	カナダ国債 3.75% 20120601	6,300,000.00	6,538,518.00	
	313F00	カナダ国債 5.25% 20130601	7,300,000.00	8,064,675.00	
	313F01	カナダ国債 3.5% 20130601	9,100,000.00	9,373,455.00	
	314F00	カナダ国債 5% 20140601	8,600,000.00	9,451,572.00	
	314F01	カナダ国債 3% 20140601	3,400,000.00	3,389,120.00	
	315F00	カナダ国債 4.5% 20150601	8,000,000.00	8,592,320.00	
	316F00	カナダ国債 4% 20160601	8,600,000.00	8,887,412.00	
	317F00	カナダ国債 4% 20170601	8,650,000.00	8,862,271.00	
	318F00	カナダ国債 4.25% 20180601	9,400,000.00	9,771,770.00	
	319F00	カナダ国債 3.75% 20190601	2,300,000.00	2,270,560.00	
	323F00	カナダ国債 8% 20230601	4,300,000.00	6,049,928.00	
	325F00	カナダ国債 9% 20250601	4,800,000.00	7,423,488.00	
	327F00	カナダ国債 8% 20270601	5,700,000.00	8,296,635.00	
	329F00	カナダ国債 5.75% 20290601	11,100,000.00	13,136,739.00	
	333F00	カナダ国債 5.75% 20330601	11,200,000.00	13,564,096.00	
	337F00	カナダ国債 5% 20370601	10,900,000.00	12,257,050.00	
国債証券 計		169,290,000.00	188,159,479.10		
カナダドル 計		169,290,000.00	188,159,479.10		
(邦貨換算額)		(14,201,738,100)	(15,784,698,702)		

## 外貨建債券（オーストラリアドル）

（単位：オーストラリアドル）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	310H00	オーストラリア国債 5.25% 20100815	4,240,000.00	4,330,485.84	
	311F00	オーストラリア国債 5.75% 20110615	5,300,000.00	5,483,528.40	
	312D00	オーストラリア国債 5.75% 20120415	4,300,000.00	4,468,783.60	
	313E00	オーストラリア国債 6.5% 20130515	4,400,000.00	4,733,436.40	
	314F00	オーストラリア国債 6.25% 20140615	1,200,000.00	1,284,907.20	
	315D00	オーストラリア国債 6.25% 20150415	4,900,000.00	5,248,919.20	
	317B00	オーストラリア国債 6% 20170215	4,500,000.00	4,748,526.00	
	319C00	オーストラリア国債 5.25% 20190315	4,240,000.00	4,212,965.76	
	321E00	オーストラリア国債 5.75% 20210515	3,380,000.00	3,451,105.06	

国債証券 計	36,460,000.00	37,962,657.46	
オーストラリアドル 計	36,460,000.00	37,962,657.46	
(邦貨換算額)	(2,430,423,600)	(2,530,590,746)	

## 外貨建債券(イギリスポンド)

(単位:イギリスポンド)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	309120	イギリス国債 5.75% 20091207	10,500,000.00	10,868,172.00	
	310F00	イギリス国債 4.75% 20100607	17,800,000.00	18,358,190.20	
	310K00	イギリス国債 6.25% 20101125	5,160,000.00	5,529,115.44	
	311C00	イギリス国債 4.25% 20110307	17,000,000.00	17,417,911.00	
	311G00	イギリス国債 9% 20110712	5,000,000.00	5,744,995.00	
	312C00	イギリス国債 5% 20120307	18,500,000.00	19,408,923.50	
	312F00	イギリス国債 5.25% 20120607	10,500,000.00	11,131,501.50	
	313C00	イギリス国債 4.5% 20130307	12,900,000.00	13,281,169.20	
	313I00	イギリス国債 8% 20130927	6,680,000.00	7,942,840.64	
	314I00	イギリス国債 5% 20140907	13,000,000.00	13,735,722.00	
	315I00	イギリス国債 4.75% 20150907	14,200,000.00	14,689,630.20	
	315L00	イギリス国債 8% 20151207	7,000,000.00	8,547,847.00	
	316I00	イギリス国債 4% 20160907	12,700,000.00	12,489,522.90	
	317H00	イギリス国債 8.75% 20170825	10,000,000.00	13,076,700.00	
	318C00	イギリス国債 5% 20180307	17,000,000.00	17,758,353.00	
	319C00	イギリス国債 4.5% 20190307	4,700,000.00	4,676,970.00	
	320C00	イギリス国債 4.75% 20200307	10,050,000.00	10,144,751.40	
	321F00	イギリス国債 8% 20210607	16,200,000.00	21,414,245.40	
	325C00	イギリス国債 5% 20250307	15,800,000.00	15,988,209.60	
	327L00	イギリス国債 4.25% 20271207	12,000,000.00	11,048,196.00	
	328L00	イギリス国債 6% 20281207	14,000,000.00	15,976,730.00	
	330L00	イギリス国債 4.75% 20301207	10,840,000.00	10,618,061.84	
	332F00	イギリス国債 4.25% 20320607	15,700,000.00	14,388,469.10	
	336C00	イギリス国債 4.25% 20360307	18,000,000.00	16,902,648.00	
	338L00	イギリス国債 4.75% 20381207	13,750,000.00	14,343,257.50	
342L00	イギリス国債 4.5% 20421207	15,000,000.00	15,008,520.00		
346L00	イギリス国債 4.25% 20461207	14,000,000.00	13,521,074.00		
349L00	イギリス国債 4.25% 20491207	4,050,000.00	3,957,736.95		
355L00	イギリス国債 4.25% 20551207	13,000,000.00	12,919,569.00		
国債証券 計		355,030,000.00	370,889,032.37		
イギリスポンド 計		355,030,000.00	370,889,032.37		
(邦貨換算額)		(55,306,573,400)	(57,777,093,463)		

## 外貨建債券(スイスフラン)

(単位:スイスフラン)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	306F00	スイス国債 4% 20110610	10,000,000.00	10,450,010.00	
	310H00	スイス国債 3.5% 20100807	500,000.00	514,653.50	
	312F00	スイス国債 2.75% 20120610	4,300,000.00	4,362,307.00	
	313B00	スイス国債 4% 20130211	9,600,000.00	10,145,990.40	
	314A00	スイス国債 4.25% 20140106	8,500,000.00	9,151,610.00	
	316C00	スイス国債 2.5% 20160312	6,400,000.00	6,371,910.40	
	317F00	スイス国債 4.25% 20170605	1,200,000.00	1,345,663.20	
	318A00	スイス国債 3% 20180108	3,600,000.00	3,683,365.20	
	319E00	スイス国債 3% 20190512	2,200,000.00	2,231,039.80	
	323B00	スイス国債 4% 20230211	8,700,000.00	9,491,151.90	
	328D00	スイス国債 4% 20280408	1,600,000.00	1,713,459.20	
	国債証券 計		56,600,000.00	59,461,160.60	
	スイスフラン 計		56,600,000.00	59,461,160.60	
(邦貨換算額)		(4,784,964,000)	(5,026,846,517)		

## 外貨建債券(スウェーデンクローナ)

(単位:スウェーデンクローナ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	309L00	スウェーデン国債 4% 20091201	44,100,000.00	44,682,296.40	
	311C00	スウェーデン国債 5.25% 20110315	42,100,000.00	44,461,810.00	
	312J00	スウェーデン国債 5.5% 20121008	47,100,000.00	51,315,450.00	
	314E00	スウェーデン国債 6.75% 20140505	50,000,000.00	58,645,000.00	
	315H00	スウェーデン国債 4.5% 20150812	32,100,000.00	34,234,650.00	
	316G00	スウェーデン国債 3% 20160712	33,100,000.00	32,032,525.00	
	317H01	スウェーデン国債 3.75% 20170812	49,000,000.00	49,600,054.00	
	319C00	スウェーデン国債 4.25% 20190312	25,900,000.00	27,127,660.00	

	320L00	スウェーデン国債 5% 20201201	46,100,000.00	51,577,832.50	
国債証券 計			369,500,000.00	393,677,277.90	
スウェーデンクローナ 計			369,500,000.00	393,677,277.90	
(邦貨換算額)			(4,644,615,000)	(4,948,523,383)	

## 外貨建債券（シンガポールドル）

（単位：シンガポールドル）

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310D00	シンガポール国債 2.625% 20100401	3,000,000.00	3,061,920.00	
	310G00	シンガポール国債 4.625% 20100701	4,350,000.00	4,594,148.10	
	310J00	シンガポール国債 2.5% 20121001	1,500,000.00	1,534,219.50	
	311B00	シンガポール国債 3.125% 20110201	1,950,000.00	2,027,500.80	
	311G00	シンガポール国債 3.625% 20110701	3,400,000.00	3,593,932.60	
	312D00	シンガポール国債 2.625% 20120401	2,100,000.00	2,162,038.20	
	312G00	シンガポール国債 3.5% 20120701	2,830,000.00	2,998,945.34	
	313D00	シンガポール国債 1.625% 20130401	2,300,000.00	2,274,610.30	
	313G04	シンガポール国債 2.25% 20130701	1,900,000.00	1,925,194.00	
	314G00	シンガポール国債 3.625% 20140701	4,400,000.00	4,728,253.20	
	316I00	シンガポール国債 3.75% 20160901	3,700,000.00	3,988,045.00	
	318I00	シンガポール国債 4% 20180901	3,200,000.00	3,512,620.80	
	320I00	シンガポール国債 3.25% 20200901	3,100,000.00	3,133,858.20	
	322I00	シンガポール国債 3.125% 20220901	2,750,000.00	2,664,197.25	
327C00	シンガポール国債 3.5% 20270301	2,650,000.00	2,623,669.60		
国債証券 計			43,130,000.00	44,823,152.89	
シンガポールドル 計			43,130,000.00	44,823,152.89	
(邦貨換算額)			(2,847,873,900)	(2,959,672,785)	

## 外貨建債券（マレーシアリングギット）

（単位：マレーシアリングギット）

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310D00	マレーシア国債 3.869% 20100413	9,100,000.00	9,115,733.90	
	310H00	マレーシア国債 3.644% 20100825	6,400,000.00	6,385,177.60	
	311D00	マレーシア国債 3.756% 20110428	14,100,000.00	14,075,748.00	
	311I00	マレーシア国債 3.833% 20110928	12,900,000.00	12,890,105.70	
	312F00	マレーシア国債 3.718% 20120615	12,500,000.00	12,403,212.50	
	313B00	マレーシア国債 3.702% 20130225	11,900,000.00	11,768,933.40	
	313G00	マレーシア国債 3.461% 20130731	6,300,000.00	6,147,640.80	
	314D00	マレーシア国債 5.094% 20140430	5,100,000.00	5,346,778.80	
	315I00	マレーシア国債 4.72% 20150930	4,500,000.00	4,654,075.50	
	316I00	マレーシア国債 4.262% 20160915	7,950,000.00	7,982,388.30	
	317B00	マレーシア国債 3.814% 20170215	9,800,000.00	9,438,105.60	
	318B00	マレーシア国債 4.24% 20180207	11,600,000.00	11,580,604.80	
	319G00	マレーシア国債 5.734% 20190730	3,450,000.00	3,860,139.45	
	327E00	マレーシア国債 3.502% 20270531	4,800,000.00	4,093,305.60	
	328I00	マレーシア国債 5.248% 20280915	3,500,000.00	3,717,003.50	
	国債証券 計			123,900,000.00	123,458,953.45
マレーシアリングギット 計			123,900,000.00	123,458,953.45	
(邦貨換算額)			(3,435,747,000)	(3,423,516,779)	

## 外貨建債券（デンマーククローネ）

（単位：デンマーククローネ）

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	309K00	デンマーク国債 6% 20091115	47,600,000.00	48,519,584.40	
	310K00	デンマーク国債 4% 20101115	41,700,000.00	41,952,285.00	
	311K00	デンマーク国債 6% 20111115	50,000,000.00	52,846,200.00	
	313K00	デンマーク国債 5% 20131115	61,000,000.00	63,591,219.00	
	315K00	デンマーク国債 4% 20151115	49,100,000.00	48,466,119.00	
	317K00	デンマーク国債 4% 20171115	43,600,000.00	42,715,399.60	
	324K00	デンマーク国債 7% 20241110	20,200,000.00	24,637,313.80	
国債証券 計			313,200,000.00	322,728,120.80	
デンマーククローネ 計			313,200,000.00	322,728,120.80	
(邦貨換算額)			(5,330,664,000)	(5,492,832,616)	

## 外貨建債券（ノルウェークローネ）

（単位：ノルウェークローネ）

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	311E01	ノルウェー国債 6% 20110516	37,500,000.00	39,535,762.50	
	313E00	ノルウェー国債 6.5% 20130515	42,100,000.00	46,624,823.80	
	315E00	ノルウェー国債 5% 20150515	32,100,000.00	33,776,871.90	
	317E00	ノルウェー国債 4.25% 20170519	20,100,000.00	20,125,647.60	

国債証券 計	131,800,000.00	140,063,105.80	
ノルウェークローネ 計	131,800,000.00	140,063,105.80	
(邦貨換算額)	(1,903,192,000)	(2,022,511,248)	

## 外貨建債券(ポーランドズロチ)

(単位:ポーランドズロチ)

種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
国債証券	310C00	ポーランド国債 5.75% 20100324	27,100,000.00	26,788,350.00	
	310K00	ポーランド国債 6% 20101124	26,500,000.00	26,142,250.00	
	311E00	ポーランド国債 4.25% 20110524	19,200,000.00	18,211,200.00	
	312D00	ポーランド国債 4.75% 20120425	23,500,000.00	22,242,750.00	
	313D00	ポーランド国債 5.25% 20130425	16,500,000.00	15,798,750.00	
	313J00	ポーランド国債 5% 20131024	21,200,000.00	19,864,400.00	
	315J00	ポーランド国債 6.25% 20151024	21,500,000.00	21,274,250.00	
	317J00	ポーランド国債 5.25% 20171025	22,600,000.00	20,927,600.00	
	322I00	ポーランド国債 5.75% 20220923	17,600,000.00	16,676,000.00	
国債証券 計			195,700,000.00	187,925,550.00	
ポーランドズロチ 計			195,700,000.00	187,925,550.00	
(邦貨換算額)			(7,148,921,000)	(6,864,920,342)	

[次へ](#)

## 外貨建債券(ユーロ)

(単位:ユーロ)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	304D00	フランス国債 5.5% 20290425	13,400,000.00	14,692,925.80	
	309K00	イタリア国債 4.25% 20091101	19,960,000.00	20,152,174.88	
	309L01	ドイツ国債 4% 20091211	13,300,000.00	13,509,475.00	
	310A00	ドイツ国債 5.375% 20100104	11,150,000.00	11,503,510.75	
	310A01	スペイン国債 4% 20100131	11,450,000.00	11,579,957.50	
	310A03	イタリア国債 3% 20100115	9,720,000.00	9,695,476.44	
	310A04	フランス国債 3% 20100112	15,200,000.00	15,220,626.40	
	310A05	オーストリア国債 5.5% 20100115	7,500,000.00	7,719,592.50	
	310A06	オランダ国債 3% 20100115	10,300,000.00	10,307,797.10	
	310C01	ベルギー国債 3% 20100328	7,450,000.00	7,459,886.15	
	310C02	イタリア国債 4% 20100301	14,000,000.00	14,128,996.00	
	310C03	ドイツ国債 3% 20100312	14,000,000.00	14,091,000.00	
	310D00	フランス国債 5.5% 20100425	14,500,000.00	15,038,863.50	
	310D01	ドイツ国債 3.25% 20100409	15,000,000.00	15,133,170.00	
	310D02	ギリシャ国債 3.1% 20100420	7,000,000.00	6,936,615.00	
	310E00	ギリシャ国債 6% 20100519	7,200,000.00	7,436,520.00	
	310E01	ポルトガル国債 5.85% 20100520	5,200,000.00	5,389,618.00	
	310F00	イタリア国債 2.75% 20100615	15,700,000.00	15,553,314.90	
	310F01	ドイツ国債 4.75% 20100611	13,900,000.00	14,362,175.00	
	310G00	ドイツ国債 5.25% 20100704	19,850,000.00	20,676,613.55	
	310G01	オランダ国債 5.5% 20100715	8,300,000.00	8,635,270.20	
	310G02	スペイン国債 3.25% 20100730	11,500,000.00	11,529,900.00	
	310H00	イタリア国債 4.5% 20100801	16,600,000.00	16,899,630.00	
	310I00	ベルギー国債 5.75% 20100928	13,700,000.00	14,323,802.10	
	310I02	フィンランド国債 2.75% 20100915	4,100,000.00	4,090,934.90	
	310I03	フランス国債 3.75% 20100912	8,000,000.00	8,096,400.00	
	310I04	ドイツ国債 4% 20100910	11,300,000.00	11,597,755.00	
	310J00	フランス国債 5.5% 20101025	13,800,000.00	14,473,536.60	
	310J01	ドイツ国債 2.5% 20101008	14,800,000.00	14,767,321.60	
	310J02	フランス国債 2.5% 20100712	14,220,000.00	14,136,955.20	
	310K00	イタリア国債 5.5% 20101101	17,800,000.00	18,492,544.60	
	311A00	ドイツ国債 5.25% 20110104	18,100,000.00	19,086,232.80	
	311A01	オーストリア国債 5.25% 20110104	7,000,000.00	7,293,552.00	
	311A02	フランス国債 3% 20110112	15,300,000.00	15,310,618.20	
	311A03	オランダ国債 4% 20110115	7,000,000.00	7,129,500.00	
	311B00	フィンランド国債 5.75% 20110223	4,900,000.00	5,186,718.60	
	311B01	イタリア国債 3.75% 20110201	18,000,000.00	18,077,400.00	
	311C00	イタリア国債 3.5% 20110315	13,000,000.00	12,989,886.00	
	311C01	ベルギー国債 3.5% 20110328	6,400,000.00	6,403,859.20	
	311C02	ギリシャ国債 3.8% 20110320	6,200,000.00	6,138,930.00	
	311D00	フランス国債 6.5% 20110425	16,600,000.00	17,945,164.40	
	311D01	ポルトガル国債 3.2% 20110415	4,900,000.00	4,856,458.60	
	311D02	ドイツ国債 3.5% 20110408	16,670,000.00	16,977,678.19	
	311D03	スペイン国債 4.1% 20110430	9,900,000.00	10,053,925.20	
	311E00	ギリシャ国債 5.35% 20110518	5,600,000.00	5,769,209.60	
	311F01	ポルトガル国債 5.15% 20110615	4,300,000.00	4,456,950.00	
	311G00	ドイツ国債 5% 20110704	21,900,000.00	23,140,218.90	
	311G01	スペイン国債 5.4% 20110730	10,300,000.00	10,820,150.00	
	311G02	オランダ国債 5% 20110715	10,850,000.00	11,345,964.35	
	311G03	フランス国債 3.5% 20110712	14,490,000.00	14,665,444.92	
	311H00	イタリア国債 5.25% 20110801	16,650,000.00	17,316,532.80	
	311H01	ギリシャ国債 3.9% 20110820	6,000,000.00	5,950,968.00	
	311I00	ベルギー国債 5% 20110928	9,800,000.00	10,197,733.00	
	311I01	イタリア国債 3.75% 20110915	13,400,000.00	13,432,883.60	
	311I02	イタリア国債 4.25% 20110901	8,000,000.00	8,097,600.00	
	311J00	スペイン国債 5.35% 20111031	10,500,000.00	11,054,400.00	
	311J01	ドイツ国債 3.5% 20111014	12,500,000.00	12,734,625.00	
	312A00	ドイツ国債 5% 20120104	22,900,000.00	24,329,990.50	
	312A01	フランス国債 3.75% 20120112	12,000,000.00	12,222,612.00	
	312B00	イタリア国債 5% 20120201	23,350,000.00	24,168,510.90	
	312D00	フランス国債 5% 20120425	13,650,000.00	14,443,174.20	
	312D01	ドイツ国債 4% 20120413	12,600,000.00	13,012,448.40	
	312D02	イタリア国債 4% 20120415	13,790,000.00	13,880,048.70	

312E00	ギリシャ国債 5.25% 20120518	7,000,000.00	7,166,929.00
312F00	ポルトガル国債 5% 20120615	5,000,000.00	5,208,680.00
312G00	オーストリア国債 5% 20120715	8,600,000.00	9,036,587.60
312G01	スペイン国債 5% 20120730	10,600,000.00	11,143,250.00
312G02	ドイツ国債 5% 20120704	23,100,000.00	24,647,700.00
312G03	オランダ国債 5% 20120715	10,400,000.00	10,987,048.80
312G04	フランス国債 4.5% 20120712	11,500,000.00	12,001,400.00
312H00	ギリシャ国債 4.1% 20120820	6,700,000.00	6,596,150.00
312I00	ベルギー国債 5% 20120928	10,100,000.00	10,591,607.40
312I01	フィンランド国債 4.25% 20120915	4,100,000.00	4,219,773.30
312J00	フランス国債 4.75% 20121025	17,600,000.00	18,555,310.40
312J01	スペイン国債 3.9% 20121031	9,300,000.00	9,436,561.20
312J02	ドイツ国債 4.25% 20121012	14,200,000.00	14,814,150.00
312J03	イタリア国債 4.25% 20121015	14,200,000.00	14,356,910.00
312L00	フランス国債 8.5% 20121226	4,360,000.00	5,219,216.48
312L01	ベルギー国債 8% 20121224	6,500,000.00	7,565,792.00
313A00	スペイン国債 6.15% 20130131	11,200,000.00	12,294,800.00
313A01	ドイツ国債 4.5% 20130104	21,000,000.00	22,138,809.00
313A02	フランス国債 3.75% 20130112	13,800,000.00	14,035,096.80
313B00	イタリア国債 4.75% 20130201	16,700,000.00	17,209,283.20
313C00	ベルギー国債 4% 20130328	8,700,000.00	8,800,050.00
313D00	フランス国債 4% 20130425	15,950,000.00	16,381,734.60
313D01	アイルランド国債 5% 20130418	5,000,000.00	5,189,875.00
313D02	ドイツ国債 3.5% 20130412	12,700,000.00	12,931,140.00
313D03	イタリア国債 4.25% 20130415	12,000,000.00	12,105,000.00
313E00	ギリシャ国債 4.6% 20130520	7,100,000.00	7,064,784.00
313G00	スペイン国債 4.2% 20130730	10,400,000.00	10,652,720.00
313G01	オランダ国債 4.25% 20130715	10,700,000.00	11,077,581.60
313G02	ドイツ国債 3.75% 20130704	19,000,000.00	19,550,202.00
313G03	フィンランド国債 5.375% 20130704	5,100,000.00	5,497,743.90
313G04	フランス国債 4.5% 20130712	8,000,000.00	8,378,144.00
313H00	イタリア国債 4.25% 20130801	21,450,000.00	21,696,996.75
313H01	ギリシャ国債 4% 20130820	5,000,000.00	4,820,250.00
313I00	ベルギー国債 4.25% 20130928	10,750,000.00	10,981,254.00
313I01	ポルトガル国債 5.45% 20130923	4,900,000.00	5,223,282.40
313J00	オーストリア国債 3.8% 20131020	10,600,000.00	10,626,415.20
313J01	フランス国債 4% 20131025	16,100,000.00	16,518,245.80
313J02	ドイツ国債 4% 20131011	9,300,000.00	9,688,740.00
314A00	ドイツ国債 4.25% 20140104	21,200,000.00	22,293,962.40
314A01	スペイン国債 4.25% 20140131	3,400,000.00	3,481,600.00
314C00	ベルギー国債 4% 20140328	5,600,000.00	5,626,202.40
314D00	フランス国債 4% 20140425	14,300,000.00	14,623,437.40
314E01	ギリシャ国債 4.5% 20140520	7,300,000.00	7,218,510.10
314F00	ポルトガル国債 4.375% 20140616	5,300,000.00	5,404,675.00
314G00	スペイン国債 4.75% 20140730	11,100,000.00	11,659,995.00
314G01	ドイツ国債 4.25% 20140704	22,100,000.00	23,212,558.20
314G02	オーストリア国債 4.3% 20140715	8,100,000.00	8,284,064.40
314G03	オランダ国債 3.75% 20140715	9,600,000.00	9,664,070.40
314H00	イタリア国債 4.25% 20140801	20,100,000.00	20,257,061.40
314I00	ベルギー国債 4.25% 20140928	10,250,000.00	10,414,010.25
314J00	フランス国債 4% 20141025	15,450,000.00	15,785,527.65
315A00	スペイン国債 4.4% 20150131	11,900,000.00	12,215,945.00
315A01	ドイツ国債 3.75% 20150104	20,700,000.00	21,150,804.60
315B00	イタリア国債 4.25% 20150201	19,200,000.00	19,271,289.60
315C00	ベルギー国債 8% 20150328	5,350,000.00	6,517,102.50
315D00	フランス国債 3.5% 20150425	17,500,000.00	17,302,565.00
315G00	フィンランド国債 4.25% 20150704	4,100,000.00	4,198,412.30
315G01	ギリシャ国債 3.7% 20150720	7,400,000.00	6,923,647.20
315G02	ドイツ国債 3.25% 20150704	17,000,000.00	16,813,697.00
315G03	オランダ国債 3.25% 20150715	8,400,000.00	8,113,728.00
315G04	オーストリア国債 3.5% 20150715	7,800,000.00	7,551,195.60
315H00	イタリア国債 3.75% 20150801	22,050,000.00	21,466,468.80
315I00	ベルギー国債 3.75% 20150928	9,600,000.00	9,396,105.60
315J00	フランス国債 3% 20151025	16,780,000.00	15,995,568.56
315J01	ポルトガル国債 3.35% 20151015	4,700,000.00	4,457,343.70

316A00	ドイツ国債 3.5% 20160104	19,800,000.00	19,723,176.00
316A01	スペイン国債 3.15% 20160131	10,300,000.00	9,707,235.00
316D00	アイルランド国債 4.6% 20160418	4,900,000.00	4,958,868.60
316D01	フランス国債 3.25% 20160425	16,650,000.00	15,989,444.55
316F00	ドイツ国債 6% 20160620	3,850,000.00	4,418,860.60
316G00	ギリシャ国債 3.6% 20160720	7,000,000.00	6,378,505.00
316G01	ドイツ国債 4% 20160704	18,430,000.00	18,820,955.59
316G02	オランダ国債 4% 20160715	8,500,000.00	8,463,390.50
316H00	イタリア国債 3.75% 20160801	20,500,000.00	19,551,567.50
316I00	ベルギー国債 3.25% 20160928	10,330,000.00	9,607,251.22
316I01	オーストリア国債 4% 20160915	9,100,000.00	8,962,817.50
316J00	フランス国債 5% 20161025	18,800,000.00	20,087,969.20
316J01	ポルトガル国債 4.2% 20161015	4,780,000.00	4,714,131.60
317A00	スペイン国債 3.8% 20170131	10,500,000.00	10,151,757.00
317A01	ドイツ国債 3.75% 20170104	16,300,000.00	16,330,089.80
317B00	イタリア国債 4% 20170201	18,600,000.00	17,899,003.20
317C00	ベルギー国債 4% 20170328	9,800,000.00	9,523,306.80
317D00	フランス国債 3.75% 20170425	17,200,000.00	16,795,748.40
317G00	スペイン国債 5.5% 20170730	12,300,000.00	13,319,670.00
317G01	ギリシャ国債 4.3% 20170720	8,900,000.00	8,394,586.80
317G02	ドイツ国債 4.25% 20170704	15,000,000.00	15,546,750.00
317G03	オランダ国債 4.5% 20170715	11,400,000.00	11,626,860.00
317H00	イタリア国債 5.25% 20170801	17,230,000.00	18,104,836.02
317I00	ベルギー国債 5.5% 20170928	6,900,000.00	7,451,165.10
317I01	フィンランド国債 3.875% 20170915	5,450,000.00	5,327,146.10
317I02	オーストリア国債 4.3% 20170915	5,400,000.00	5,389,740.00
317J00	ポルトガル国債 4.35% 20171016	4,600,000.00	4,530,356.00
317J01	フランス国債 4.25% 20171025	14,000,000.00	14,102,900.00
318A00	オーストリア国債 4.65% 20180115	8,500,000.00	8,702,283.00
318A01	ドイツ国債 4% 20180104	17,500,000.00	17,813,215.00
318B00	イタリア国債 4.5% 20180201	20,050,000.00	19,909,650.00
318C00	ベルギー国債 4% 20180328	6,900,000.00	6,645,169.20
318D00	フランス国債 4% 20180425	16,000,000.00	15,776,000.00
318F00	ポルトガル国債 4.45% 20180615	5,100,000.00	5,016,747.60
318G00	スペイン国債 4.1% 20180730	9,000,000.00	8,758,350.00
318G01	オランダ国債 4% 20180715	8,400,000.00	8,216,880.00
318G02	ギリシャ国債 4.6% 20180720	6,300,000.00	5,985,315.00
318G03	ドイツ国債 4.25% 20180704	17,750,000.00	18,418,287.50
318H00	イタリア国債 4.5% 20180801	15,300,000.00	15,021,540.00
318J00	アイルランド国債 4.5% 20181018	5,000,000.00	4,904,670.00
318J01	フランス国債 4.25% 20181025	5,100,000.00	5,090,310.00
319B00	イタリア国債 4.25% 20190201	17,200,000.00	16,592,736.80
319C00	オーストリア国債 4.35% 20190315	4,500,000.00	4,455,675.00
319D00	フランス国債 4.25% 20190425	16,000,000.00	15,967,296.00
319F00	アイルランド国債 4.4% 20190618	6,000,000.00	5,741,670.00
319G00	フィンランド国債 4.375% 20190704	3,100,000.00	3,107,192.00
319J00	フランス国債 8.5% 20191025	7,300,000.00	9,924,094.50
319J01	ギリシャ国債 6.5% 20191022	7,700,000.00	8,522,360.00
320B00	イタリア国債 4.5% 20200201	17,900,000.00	17,393,823.80
320D00	アイルランド国債 4.5% 20200418	5,800,000.00	5,582,030.20
320G00	オーストリア国債 3.9% 20200715	6,030,000.00	5,694,738.03
321D00	ポルトガル国債 3.85% 20210415	4,900,000.00	4,538,100.70
321D01	フランス国債 3.75% 20210425	17,400,000.00	16,325,932.80
321H00	イタリア国債 3.75% 20210801	16,450,000.00	14,740,516.00
321I00	オーストリア国債 3.5% 20210915	8,000,000.00	7,164,368.00
322C00	ベルギー国債 4% 20220328	8,150,000.00	7,635,906.15
322J00	ギリシャ国債 5.9% 20221022	7,150,000.00	7,582,017.30
323A00	オランダ国債 7.5% 20230115	4,300,000.00	5,646,416.00
323A01	オランダ国債 3.75% 20230115	6,200,000.00	5,725,892.20
323D00	フランス国債 8.5% 20230425	9,500,000.00	13,490,893.00
323H00	イタリア国債 4.75% 20230801	6,970,000.00	6,806,205.00
323I00	フランス国債 4.25% 20231025	10,800,000.00	10,503,928.80
323J00	ポルトガル国債 4.95% 20231025	3,600,000.00	3,617,726.40
323K00	イタリア国債 9% 20231101	12,010,000.00	17,120,687.36
324A00	ドイツ国債 6.25% 20240104	8,180,000.00	9,861,947.06

324A01	スペイン国債 4.8% 20240131	2,300,000.00	2,301,955.00	
324C00	ギリシャ国債 4.7% 20240320	9,100,000.00	8,275,995.00	
325J00	フランス国債 6% 20251025	6,730,000.00	7,834,002.66	
326K00	イタリア国債 7.25% 20261101	8,000,000.00	9,988,056.00	
327070	ドイツ国債 6.5% 20270704	9,500,000.00	11,837,209.00	
327G00	オーストリア国債 6.25% 20270715	5,600,000.00	6,557,320.00	
327K00	イタリア国債 6.5% 20271101	21,400,000.00	24,902,473.80	
328010	ドイツ国債 5.625% 20280104	12,600,000.00	14,272,158.60	
328070	ドイツ国債 4.75% 20280704	10,000,000.00	10,263,520.00	
328A00	オランダ国債 5.5% 20280115	7,600,000.00	8,344,746.80	
328C00	ベルギー国債 5.5% 20280328	10,000,000.00	10,733,770.00	
329A00	スペイン国債 6% 20290131	11,700,000.00	13,195,845.00	
329K00	イタリア国債 5.25% 20291101	19,350,000.00	19,616,139.90	
330A00	ドイツ国債 6.25% 20300104	8,650,000.00	10,566,329.65	
331A00	ドイツ国債 5.5% 20310104	13,100,000.00	14,734,827.60	
331E00	イタリア国債 6% 20310501	25,100,000.00	27,586,908.00	
332G00	スペイン国債 5.75% 20320730	10,000,000.00	11,027,000.00	
332J00	フランス国債 5.75% 20321025	15,000,000.00	17,157,555.00	
333B00	イタリア国債 5.75% 20330201	13,200,000.00	14,219,541.60	
334G00	ドイツ国債 4.75% 20340704	16,950,000.00	17,697,122.10	
334H00	イタリア国債 5% 20340801	15,700,000.00	15,484,344.80	
335C00	ベルギー国債 5% 20350328	11,650,000.00	11,941,949.00	
335D00	フランス国債 4.75% 20350425	13,900,000.00	14,126,736.80	
337A00	スペイン国債 4.2% 20370131	10,500,000.00	9,359,175.00	
337A01	オランダ国債 4% 20370115	9,900,000.00	9,072,558.00	
337A02	ドイツ国債 4% 20370104	19,800,000.00	18,738,997.20	
337B00	イタリア国債 4% 20370201	17,100,000.00	14,420,823.30	
337C00	オーストリア国債 4.15% 20370315	5,500,000.00	5,061,281.50	
337D00	ポルトガル国債 4.1% 20370415	5,100,000.00	4,533,940.80	
337I00	ギリシャ国債 4.5% 20370920	7,100,000.00	6,091,508.90	
338J00	フランス国債 4% 20381025	10,300,000.00	9,328,710.00	
339G00	ドイツ国債 4.25% 20390704	11,500,000.00	11,301,590.50	
339H00	イタリア国債 5% 20390801	9,000,000.00	8,919,900.00	
340G00	スペイン国債 4.9% 20400730	6,200,000.00	6,163,110.00	
340G01	ドイツ国債 4.75% 20400704	3,800,000.00	4,059,160.00	
340I00	ギリシャ国債 4.6% 20400920	7,300,000.00	6,276,175.00	
355D00	フランス国債 4% 20550425	13,700,000.00	12,259,143.60	
N00184	ギリシャ国債 6.5% 20140111	4,000,000.00	4,314,448.00	
N00238	フランス国債 5% 20111025	12,100,000.00	12,741,953.40	
国債証券計		2,624,030,000.00	2,685,017,149.21	
ユーロ計		2,624,030,000.00	2,685,017,149.21	
(邦貨換算額)		(332,385,880,100)	(340,111,122,290)	

(単位：円)

総合計	(621,706,061,100)	(651,784,353,612)	
	621,706,061,100	651,784,353,612	

(注) 総合計の( )内の金額は外貨建債券の邦貨換算額合計であります。



## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率(%)	合計額に対する比率(%)
アメリカドル	国債証券 131銘柄	100.0	31.4
カナダドル	国債証券 24銘柄	100.0	2.4
オーストラリアドル	国債証券 9銘柄	100.0	0.4
イギリスポンド	国債証券 29銘柄	100.0	8.9
スイスフラン	国債証券 11銘柄	100.0	0.8
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0	0.8
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0	0.5
マレーシアリングgit	国債証券 15銘柄	100.0	0.5
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0	0.8
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0	0.3
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	100.0	1.1
ユーロ	国債証券 232銘柄	100.0	52.1

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

独立監査人の監査報告書

平成19年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鳥飼 裕一  
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18年11月7日から平成19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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の平成19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。

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成20年12月17日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
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19年11月7日から平成20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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の平成20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。

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成19年6月28日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鳥飼 裕一  
業務執行社員

当監査法人は、証券取引法第193条の2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18年4月1日から平成19年3月31日までの第48期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成19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。

## 追記情報

1. 重要な後発事象2. に、株式の取得に関する記載がある。
2. 重要な後発事象4. に、新株予約権（ストックオプション）の発行に関する記載がある。

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

以上

---

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

独立監査人の監査報告書

平成20年6月23日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅  
業務執行社員指定社員 公認会計士 鳥飼裕一  
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19年4月1日から平成20年3月31日までの第49期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成20年12月18日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第50期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の平成20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20年4月1日から平成20年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

---

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