

## 【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24年2月6日
【計算期間】	第9期 (自平成22年11月9日至平成23年11月7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】	雄谷 敦史
【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

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

## ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 追加型投信

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

## 内外

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

## 資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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。**

主として、国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に投資を行ないます。国際分散投資によりリスク低減をはかりながら、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

2.

**インデックスファンドで構成しています。**

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

## &lt;国内株式&gt;

## 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

## &lt;海外株式&gt;

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

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

## &lt;国内債券&gt;

## 「日本債券インデックスマザーファンド」

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

## &lt;海外債券&gt;

## 「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

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

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

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

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

### 3. 株式に60%、債券などに40%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%とします。

組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

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

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

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

購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

#### 〈ファンドの仕組み〉

※当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



#### 主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

#### 分配方針

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

## 信託金限度額

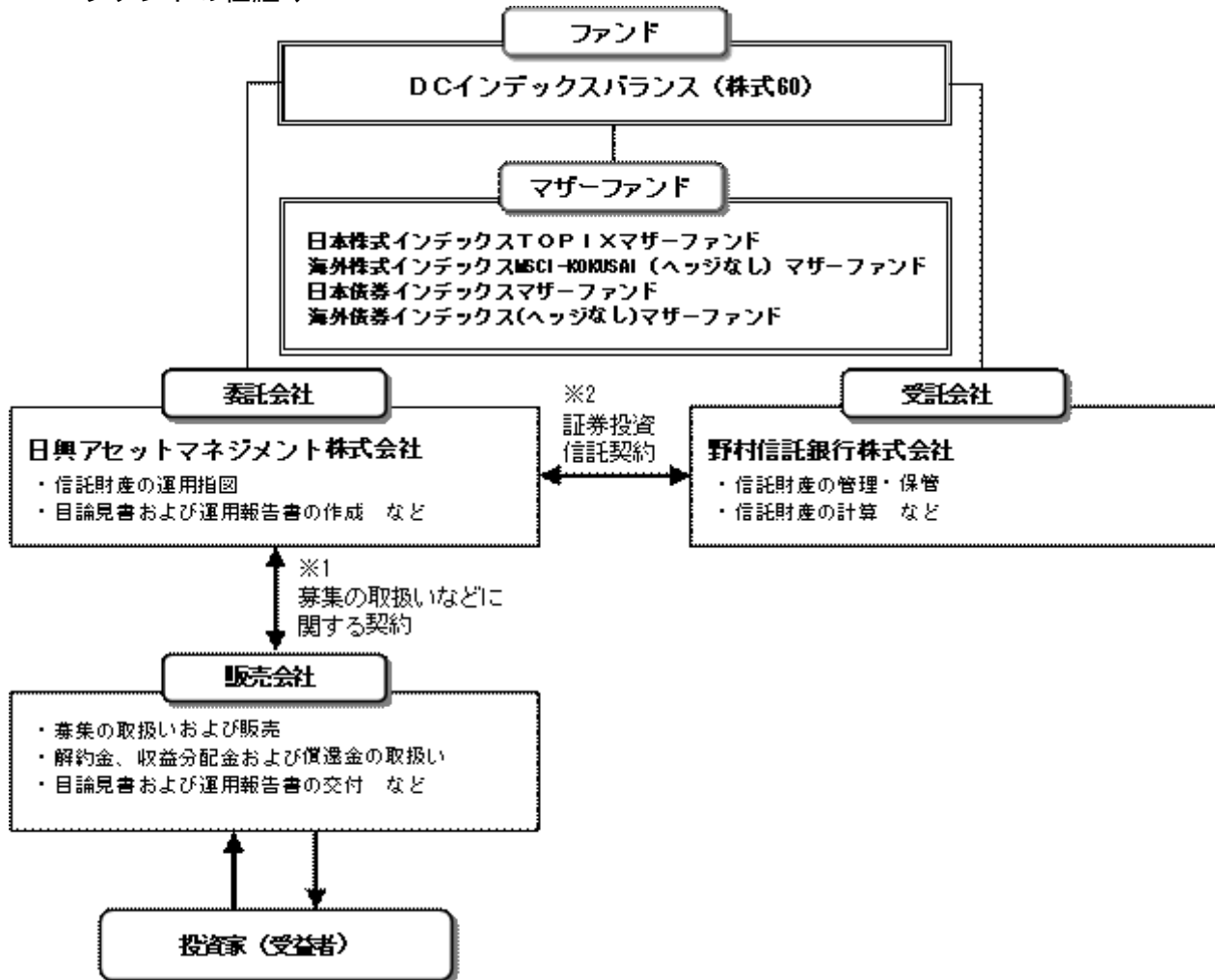
- ・ 1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成14年12月10日 ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファンドの仕組み



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

## 委託会社の概況（平成23年12月末現在）

## 1) 資本金

17,363百万円

## 2) 沿革

昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

## 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「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) 金利先渡し取引
  - 5) 有価証券の貸付
  - 6) 公社債の空売
  - 7) 公社債の借入

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（平成11年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

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

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

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

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

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

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

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

## &lt; 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド &gt;

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

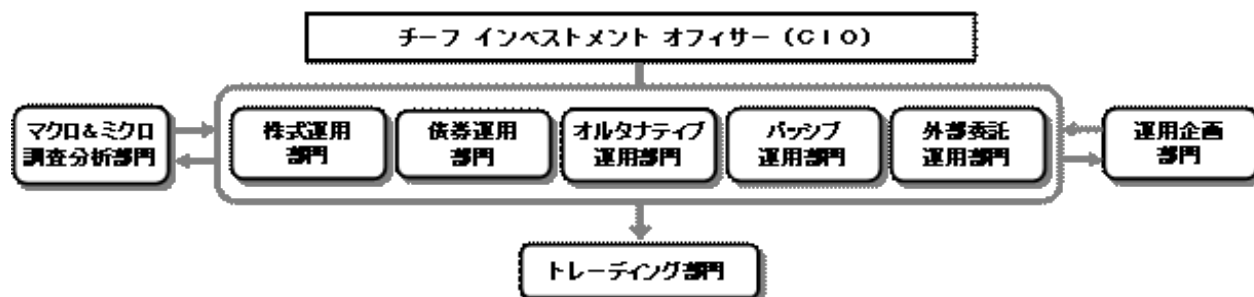
\*シティグループ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

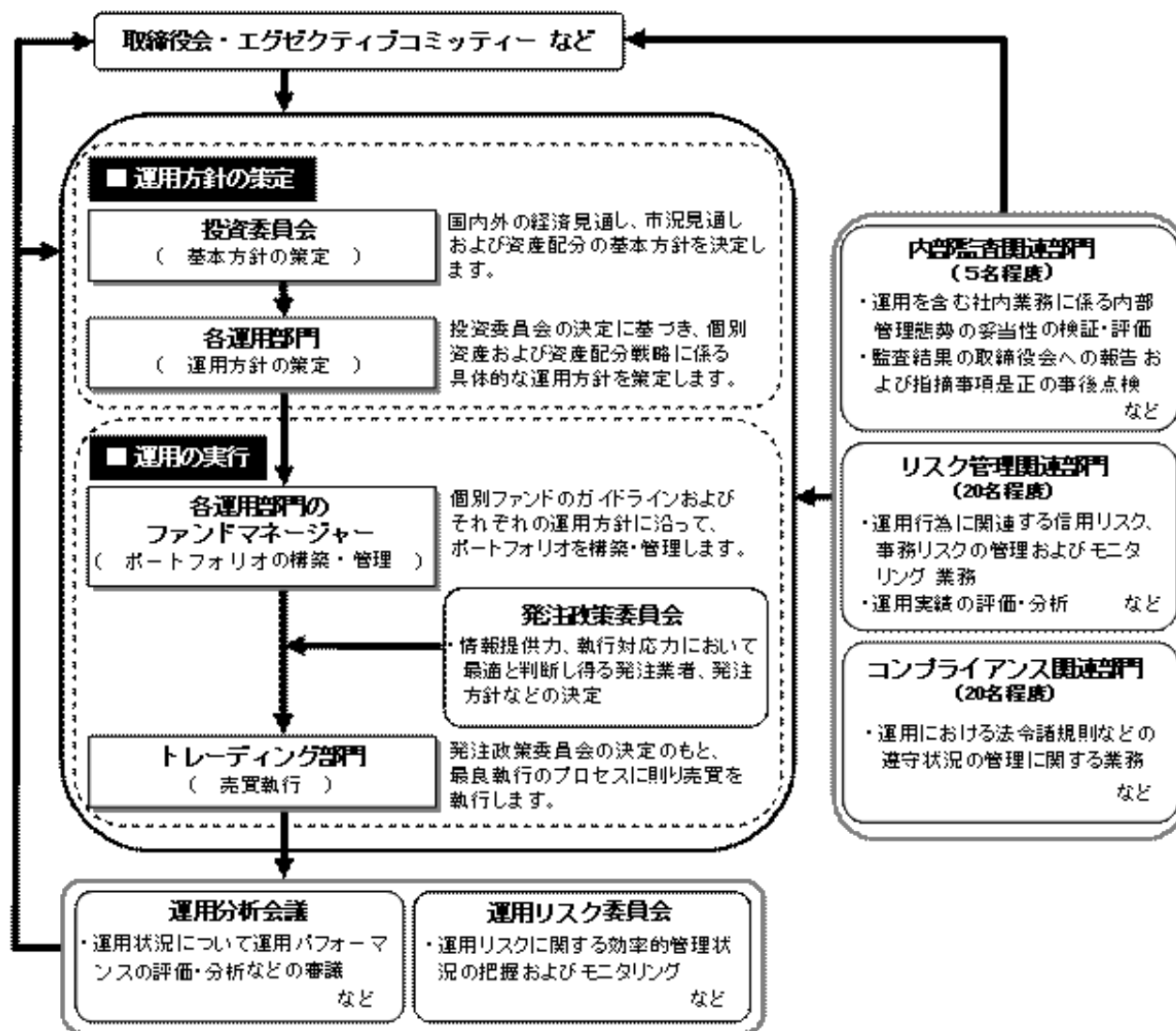


## (3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

上記体制は平成23年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

## 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

## &lt;DCインデックスバランス(株式60)&gt;

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

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

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

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

#### < その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取り扱いを停止する場合があります。

- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

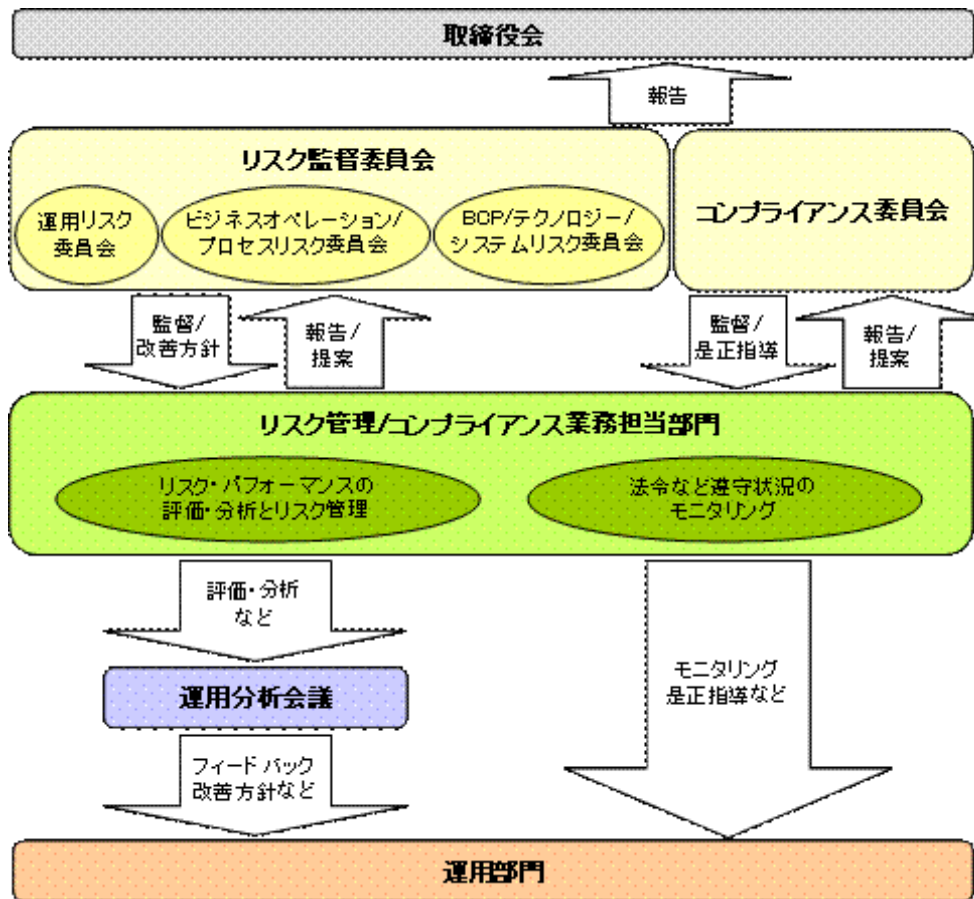
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。



## (2) リスク管理体制



## 全社的リスク管理

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

## リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

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

## 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は平成23年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.25%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

## (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】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

## 1) 個人受益者の場合

イ) 収益分配金に対する課税

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

- ・なお、平成26年1月1日以降は、上記の10%の税率は20%（所得税15%および地方税

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

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

## 2) 法人受益者の場合

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

### 個別元本

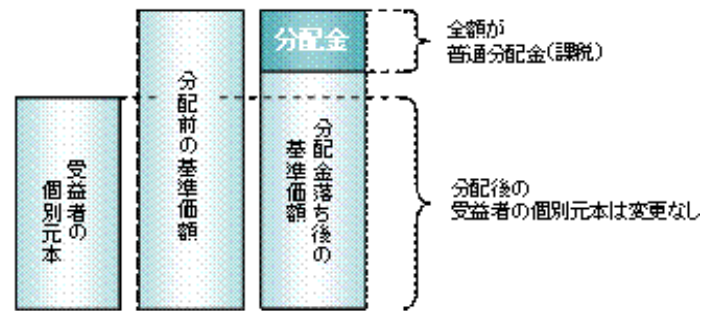
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

### 普通分配金と特別分配金

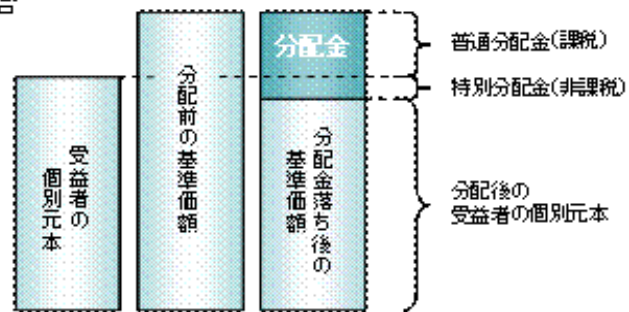
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「特別分配金」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
  - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
  - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が特別分配金となり、収益分配金から特別分配金を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本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

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

## 5【運用状況】

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,667,087,693	95.08
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	-	86,214,103	4.92
合計(純資産総額)		1,753,301,796	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,395,428,018	0.5831	813,681,358	0.5665	790,509,972	45.09
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	352,140,803	1.2295	432,974,876	1.2255	431,548,554	24.61
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	344,106,066	0.8239	283,523,998	0.7853	270,226,493	15.41
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	125,396,467	1.4328	179,677,592	1.3940	174,802,674	9.97

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.08
合計	95.08

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】  
【純資産の推移】

期別		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末	2003年11月 6日	17	17	1.1076	1.1076
第2計算期間末	2004年11月 8日	124	124	1.1864	1.1864
第3計算期間末	2005年11月 7日	704	704	1.4271	1.4271
第4計算期間末	2006年11月 6日	1,087	1,087	1.5395	1.5405
第5計算期間末	2007年11月 6日	1,488	1,489	1.5896	1.5906
第6計算期間末	2008年11月 6日	1,250	1,251	1.1336	1.1346
第7計算期間末	2009年11月 6日	1,543	1,545	1.1600	1.1610
第8計算期間末	2010年11月 8日	1,707	1,709	1.1601	1.1611
第9計算期間末	2011年11月 7日	1,789	1,790	1.1104	1.1114
	2010年11月末日	1,721	-	1.1637	-
	12月末日	1,783	-	1.1899	-
	2011年 1月末日	1,815	-	1.2017	-
	2月末日	1,851	-	1.2308	-
	3月末日	1,825	-	1.2018	-
	4月末日	1,833	-	1.1987	-
	5月末日	1,822	-	1.1827	-
	6月末日	1,859	-	1.1863	-
	7月末日	1,836	-	1.1709	-
	8月末日	1,765	-	1.1131	-
	9月末日	1,760	-	1.0990	-
	10月末日	1,807	-	1.1248	-
	11月末日	1,753	-	1.0835	-

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2002年12月10日～2003年11月 6日	0
第2期	2003年11月 7日～2004年11月 8日	0
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	0
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	0.0010
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	0.0010
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	0.0010
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	0.0010
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.0010
第9期	2010年11月 9日～2011年11月 7日	0.0010

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2002年12月10日～2003年11月 6日	10.76
第2期	2003年11月 7日～2004年11月 8日	7.11
第3期	2004年11月 9日～2005年11月 7日	20.29
第4期	2005年11月 8日～2006年11月 6日	7.95
第5期	2006年11月 7日～2007年11月 6日	3.32
第6期	2007年11月 7日～2008年11月 6日	28.62
第7期	2008年11月 7日～2009年11月 6日	2.42
第8期	2009年11月 7日～2010年11月 8日	0.09

第9期	2010年11月9日～2011年11月7日	4.20
-----	-----------------------	------

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

#### (4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2002年12月10日～2003年11月6日	16,498,909	1,008,692
第2期	2003年11月7日～2004年11月8日	92,350,899	2,927,912
第3期	2004年11月9日～2005年11月7日	403,896,673	15,141,759
第4期	2005年11月8日～2006年11月6日	273,043,849	60,611,294
第5期	2006年11月7日～2007年11月6日	302,235,212	72,140,595
第6期	2007年11月7日～2008年11月6日	291,424,215	124,332,611
第7期	2008年11月7日～2009年11月6日	339,597,238	112,048,719
第8期	2009年11月7日～2010年11月8日	274,906,943	133,566,015
第9期	2010年11月9日～2011年11月7日	270,923,990	131,707,074

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## (参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

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

## その他の資産の投資状況

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

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	317,000	2,527.87	801,336,300	2,509.00	795,353,000	3.20
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,843,700	330.99	610,248,200	328.00	604,733,600	2.44
日本	株式	キヤノン	電気機器	153,300	3,509.58	538,020,000	3,420.00	524,286,000	2.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	208,200	2,328.85	484,866,900	2,389.00	497,389,800	2.00
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	112,100	3,852.63	431,880,000	3,775.00	423,177,500	1.71
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	184,200	2,125.86	391,585,000	2,089.00	384,793,800	1.55
日本	株式	ファナック	電気機器	25,700	12,507.23	321,436,000	12,270.00	315,339,000	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	3,127,000	107.97	337,644,000	100.00	312,700,000	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	96,800	3,509.14	339,685,000	3,145.00	304,436,000	1.23
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	110,400	2,428.41	268,097,500	2,547.00	281,188,800	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	177,400	1,525.94	270,701,900	1,551.00	275,147,400	1.11
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	2,006	135,801.99	272,418,800	135,000.00	270,810,000	1.09
日本	株式	三井物産	卸売業	210,200	1,107.05	232,702,400	1,182.00	248,456,400	1.00
日本	株式	日立製作所	電気機器	554,000	423.95	234,869,000	423.00	234,342,000	0.94
日本	株式	小松製作所	機械	122,500	1,843.08	225,777,300	1,895.00	232,137,500	0.94
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	613	378,567.69	232,062,000	364,500.00	223,438,500	0.90
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	101,900	2,084.92	212,454,100	2,127.00	216,741,300	0.87
日本	株式	三菱地所	不動産業	171,000	1,328.47	227,170,000	1,262.00	215,802,000	0.87
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	311,700	689.97	215,064,700	690.00	215,073,000	0.87
日本	株式	ソニー	電気機器	154,000	1,577.31	242,906,200	1,372.00	211,288,000	0.85
日本	株式	パナソニック	電気機器	282,000	781.73	220,449,100	727.00	205,014,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	42,900	4,525.93	194,162,500	4,695.00	201,415,500	0.81
日本	株式	KDDI	情報・通信業	378	561,883.59	212,392,000	505,000.00	190,890,000	0.77
日本	株式	東芝	電気機器	520,000	350.57	182,298,000	347.00	180,440,000	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	46,300	3,955.90	183,158,500	3,805.00	176,171,500	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	247,000	729.75	180,249,000	712.00	175,864,000	0.71
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	336	524,031.25	176,074,500	504,000.00	169,344,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	92,400	1,810.00	167,244,200	1,832.00	169,276,800	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	57,400	2,819.35	161,830,700	2,938.00	168,641,200	0.68
日本	株式	任天堂	その他製品	14,100	11,180.00	157,638,000	11,630.00	163,983,000	0.66



## ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
 < 有価証券先物取引等 >

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
-------	----	-----	----	----	----	----	---------------	--------	-----------------

株価指数先物取引	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物 2011年1月2月	買建	38	日本円	282,304,849	276,450,000	1.11
----------	----	---------	--------------------	----	----	-----	-------------	-------------	------

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

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

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### (1) 投資状況

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



## その他の資産の投資状況

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

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

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

合 計	97.61
-----	-------

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
 < 有価証券先物取引等 >

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

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

< 為替予約取引 >

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (参考) 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1.300	2019/03/20	750,000,000	104.98	787,395,000	104.27	782,010,000	2.48
日本	国債証券	第69回利付国債(5年)	0.900	2012/12/20	633,000,000	100.88	638,590,050	100.81	638,133,630	2.02
日本	国債証券	第60回利付国債(20年)	1.400	2022/12/20	545,000,000	102.97	561,219,200	102.30	557,524,100	1.77
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1.400	2018/03/20	446,000,000	105.69	471,413,080	105.10	468,750,460	1.49
日本	国債証券	第81回利付国債(5年)	0.800	2014/03/20	444,000,000	101.50	450,691,080	101.48	450,575,640	1.43
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	1.400	2019/09/20	361,000,000	105.46	380,739,480	104.75	378,133,060	1.20
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	1.500	2015/03/20	361,000,000	104.28	376,454,410	104.11	375,837,100	1.19
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	358,000,000	104.49	374,102,840	103.74	371,382,040	1.18
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	340,000,000	103.37	351,461,400	102.59	348,816,200	1.11
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	2.300	2026/06/20	300,000,000	111.13	333,402,000	110.07	330,222,000	1.05
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	0.500	2015/12/20	300,000,000	100.85	302,574,000	100.72	302,154,000	0.96
日本	国債証券	第291回利付国債(10年)	1.300	2018/03/20	287,000,000	105.04	301,482,020	104.49	299,897,780	0.95
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	1.700	2016/09/20	274,000,000	106.53	291,914,120	106.21	291,020,880	0.92
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	0.500	2013/06/20	285,000,000	100.59	286,695,750	100.58	286,641,600	0.91
日本	国債証券	第261回利付国債(10年)	1.800	2014/06/20	270,000,000	104.26	281,510,100	104.14	281,164,500	0.89
日本	国債証券	第29回利付国債(30年)	2.400	2038/09/20	246,000,000	110.57	272,002,200	109.85	270,235,920	0.86
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	268,000,000	101.23	271,320,520	100.53	269,415,040	0.85
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1.500	2017/12/20	254,000,000	106.23	269,844,520	105.71	268,500,860	0.85
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1.700	2018/03/20	241,000,000	107.58	259,289,490	106.96	257,763,960	0.82
日本	国債証券	第50回利付国債(20年)	1.900	2021/03/22	237,000,000	108.70	257,628,480	107.84	255,571,320	0.81
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	0.500	2015/03/20	245,000,000	100.92	247,261,350	100.85	247,077,600	0.78
日本	国債証券	第33回利付国債(20年)	3.800	2016/09/20	200,000,000	116.77	233,550,000	116.23	232,462,000	0.74
日本	国債証券	第252回利付国債(10年)	1.000	2013/06/20	228,000,000	101.41	231,217,080	101.34	231,064,320	0.73
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1.300	2018/12/20	221,000,000	105.04	232,138,400	104.31	230,516,260	0.73



日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1.700	2017/03/20	216,000,000	106.99	231,102,720	106.57	230,182,560	0.73
日本	国債証券	第251回利付国債(10年)	0.900	2013/06/20	227,000,000	101.24	229,832,960	101.19	229,701,300	0.73
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1.500	2014/09/20	221,000,000	103.77	229,347,170	103.67	229,101,860	0.73
日本	国債証券	第70回利付国債(5年)	0.800	2013/03/20	227,000,000	100.93	229,115,640	100.87	228,968,090	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	2.400	2034/03/20	208,000,000	110.72	230,299,680	109.72	228,213,440	0.72
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	2.100	2026/12/20	210,000,000	108.13	227,083,500	107.17	225,048,600	0.71

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド

以下の運用状況は2011年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 投資状況

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

## その他の資産の投資状況

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

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

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

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

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.59
合計	98.59

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
 <為替予約取引>

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

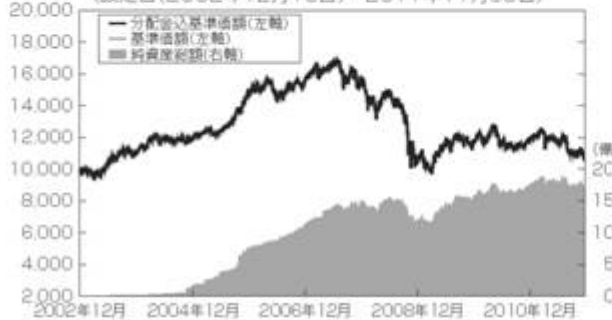
(参考情報)

## 運用実績

2011年11月30日現在

### 基準価額・純資産の推移

(円) (設定日(2002年12月10日)～2011年11月30日)



基準価額……………10.835円

純資産総額……………17.53億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。  
 ※分配金込基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

### 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2007年11月	2008年11月	2009年11月	2010年11月	2011年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	60円

### 主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45.09%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSA(ヘッジなし)マザーファンド	15.41%
日本債券インデックスマザーファンド	24.61%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.97%
現金その他	4.92%

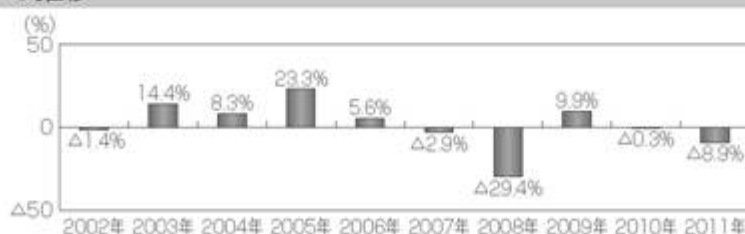
※当ファンドの対純資産総額比です。

## &lt;組入上位銘柄&gt;

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

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2002年は、設定時から2002年末までの騰落率です。

※2011年は、2011年11月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

#### (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (3) 取扱時間

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

#### (4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

#### (5) 申込単位

1円以上1円単位

#### (6) 申込代金の支払い

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

#### (7) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金(解約)手続等】

### <解約請求による換金>

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (2) 取扱時間

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

#### (3) 解約制限

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

#### (4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(当該基準価額に0.25%の率を乗じて得た額)を控除した価額とします。

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

#### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

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

#### (6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

#### (7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

#### (8) 受付の中止および取消

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

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。



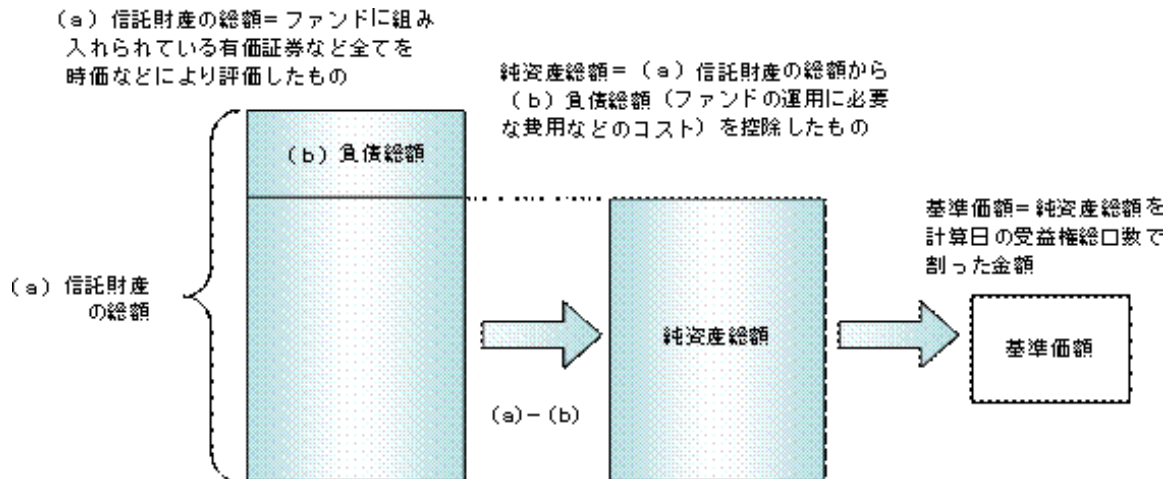
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日\*における以下のいずれかの価額で評価します。

a) 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

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

c) 価格情報会社の提供する価額

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

##### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限とします（平成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。

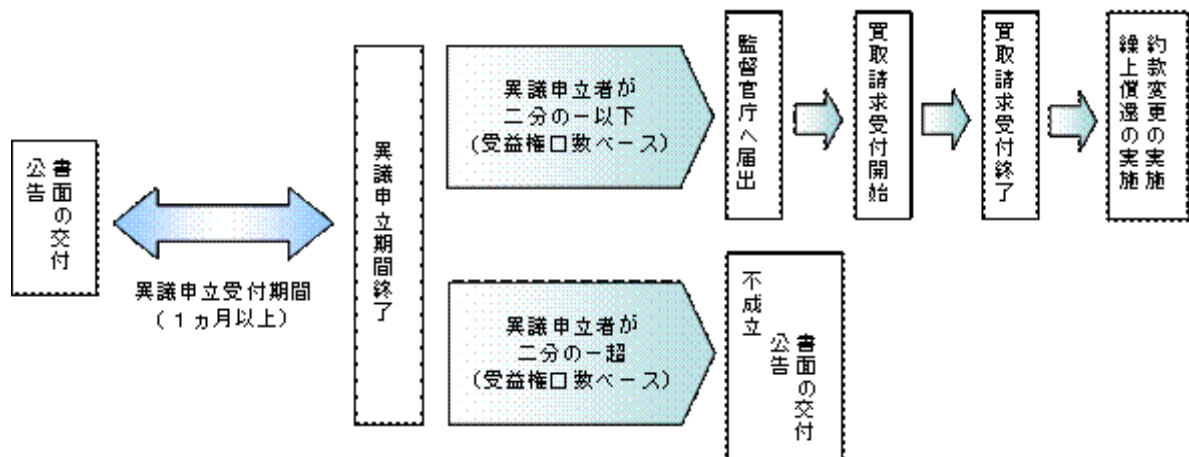
信託約款の変更

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

## &lt;繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ&gt;



## 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

## 運用報告書の作成

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

## 関係法人との契約について

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

## 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、その後の改正を含みます。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号、その後の改正を含みます。）に基づき作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（平成21年11月7日から平成22年11月8日まで）及び第9期計算期間（平成22年11月9日から平成23年11月7日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

DCインデックスバランス（株式60）

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 平成22年11月8日現在	第9期 平成23年11月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	86,202,389	95,853,506
親投資信託受益証券	1,626,071,228	1,700,418,071
未収入金	2,105,075	1,706,426
未収利息	201	181
流動資産合計	1,714,378,893	1,797,978,184
資産合計		
	1,714,378,893	1,797,978,184
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,472,176	1,611,393
未払解約金	2,158,552	4,018,404
未払受託者報酬	265,323	285,326
未払委託者報酬	2,565,369	2,758,778
その他未払費用	70,697	76,045
流動負債合計	6,532,117	8,749,946
負債合計		
	6,532,117	8,749,946
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,472,176,341	1,611,393,257
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	235,670,435	177,834,981
（分配準備積立金）	173,984,960	190,563,255
元本等合計	1,707,846,776	1,789,228,238
純資産合計		
	1,707,846,776	1,789,228,238
負債純資産合計		
	1,714,378,893	1,797,978,184

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期	第9期
	自 平成21年11月7日 至 平成22年11月8日	自 平成22年11月9日 至 平成23年11月7日
<b>営業収益</b>		
受取利息	81,437	61,780
有価証券売買等損益	5,057,919	73,376,420
営業収益合計	5,139,356	73,314,640
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	520,850	563,368
委託者報酬	5,036,039	5,447,088
その他費用	138,792	150,147
営業費用合計	5,695,681	6,160,603
営業利益又は営業損失（ ）	556,325	79,475,243
経常利益又は経常損失（ ）	556,325	79,475,243
当期純利益又は当期純損失（ ）	556,325	79,475,243
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,860,308	2,086,474
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	212,979,992	235,670,435
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,897,717	46,433,446
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	47,897,717	46,433,446
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,318,465	21,095,790
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,318,465	21,095,790
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1,472,176	1,611,393
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	235,670,435	177,834,981

## （ 3 ） 【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	期別	第8期	第9期
		自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月7日から翌年11月6日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成21年11月 7日から平成22年11月 8日までとなっております。	当ファンドの計算期間は原則として、毎年11月7日から翌年11月6日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当計算期間は平成22年11月 9日から平成23年11月 7日までとなっております。

## （貸借対照表に関する注記）

	第8期	第9期
	平成22年11月 8日現在	平成23年11月 7日現在
1. 期首元本額	1,330,835,413円	1,472,176,341円
期中追加設定元本額	274,906,943円	270,923,990円
期中一部解約元本額	133,566,015円	131,707,074円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,472,176,341口	1,611,393,257口

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

	第8期	第9期
	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
分配金の計算過程		
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	27,096,493円	32,226,440円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円	0円
C 信託約款に定める収益調整金	428,163,255円	499,751,069円
D 信託約款に定める分配準備積立金	148,360,643円	159,948,208円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	603,620,391円	691,925,717円
F 分配対象収益(1口当たり) (1万口当たり)	0.4100円 4,100円	0.4293円 4,293円
G 分配金額	1,472,176円	1,611,393円
H 分配金額(1口当たり) (1万口当たり)	0.0010円 10円	0.0010円 10円

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

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

## I 金融商品の状況に関する事項

	第8期 自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	第9期 自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第8期 自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	第9期 自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第8期（自 平成21年11月7日 至 平成22年11月8日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	910,754

合計	910,754
----	---------

第9期(自平成22年11月9日 至 平成23年11月7日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	76,368,002
合計	76,368,002

(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8期 平成22年11月 8日現在		第9期 平成23年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.1601円	1口当たり純資産額	1.1104円
(1万口当たり純資産額)	(11,601円)	(1万口当たり純資産額)	(11,104円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	316,973,009	262,960,808	
	日本債券インデックスマザーファンド	369,153,061	453,910,603	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	126,461,597	181,270,053	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1,374,938,488	802,276,607	
親投資信託受益証券 合計		2,187,526,155	1,700,418,071	
合計		2,187,526,155	1,700,418,071	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)



## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2011年11月30日現在です。

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,755,115,094 円
負債総額	1,813,298 円
純資産総額( - )	1,753,301,796 円
発行済口数	1,618,135,662 口
1口当たり純資産額( / )	1.0835 円

## (参考) 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

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

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

## 純資産額計算書

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

## (参考) 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	31,651,981,733 円
負債総額	97,301,010 円
純資産総額( - )	31,554,680,723 円
発行済口数	25,747,841,010 口
1口当たり純資産額( / )	1.2255 円

## (参考) 海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	439,765,198,262 円
負債総額	1,968,162,447 円
純資産総額( - )	437,797,035,815 円

発行済口数	314,052,972,172 口
1口当たり純資産額( / )	1.3940 円

**第4【内国投資信託受益証券事務の概要】****(1) 名義書換**

該当事項はありません。

**(2) 受益者に対する特典**

該当事項はありません。

**(3) 譲渡制限の内容**

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

**(4) 受益証券の再発行**

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

**(5) 受益権の再分割**

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

**(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて**

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

平成23年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

##### 過去5年間における主な資本金の増減

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

##### (2) 会社の意思決定機関

###### ・株主総会

取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などを行いません。

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

###### ・取締役会

当社の業務執行を決定し、取締役の職務の執行について監督します。

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

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

###### ・監査役会

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

（平成23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/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

（平成23年12月末現在）

## 2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成23年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	418	67,032
株式投資信託	352	53,652
単位型	42	1,017
追加型	310	52,635
公社債投資信託	66	13,379
単位型	49	608
追加型	17	12,771
投資法人合計	1	30

### 3【委託会社等の経理状況】

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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



## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：百万円)

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

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

## 重要な会計方針

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

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

## 会計方針の変更

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

## 追加情報

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

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

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

## （損益計算書関係）

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第51期（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加及び減少は、自己株式の取得及び処分であります。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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



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

## 第52期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

(注) 自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

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

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

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

## （金融商品関係）

第51期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

## (4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

## 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

## (4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

## (有価証券関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

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

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

## 2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

## 第52期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

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

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

## 2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

## 3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

## (持分法損益等)

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



## (退職給付関係)

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

## (ストックオプション等関係)

第51期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

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

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

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

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

## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

### ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

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

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

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

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

## 単価情報

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第52期(自 平成22年4月1日至 平成23年3月31日)

## 1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。



## (2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

## ストックオプション(新株予約権)の数

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

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

(注) 1 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

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

## （税効果会計関係）

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

## ( 関連当事者情報 )

第51期(自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第52期(自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

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

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

## (注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

## (セグメント情報等)

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1 セグメント情報

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

## 2 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 3 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。



## ( 1 株当たり情報 )

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

## (注) 算定上の基礎

## 1 1株当たり純資産額

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

## 2 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失

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

## (重要な後発事象)

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

- 1 当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
  
- 2 金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期中間会計期間(平成23年4月1日から平成23年9月30日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

## 中間財務諸表等

## (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第53期中間会計期間  
(平成23年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		17,081
未収委託者報酬		5,482
未収収益		589
関係会社短期貸付金		434
繰延税金資産		678
その他	2	1,292
流動資産合計		25,558

## 固定資産

有形固定資産	1	217
無形固定資産		84
投資その他の資産		
投資有価証券		2,765
関係会社株式		24,320
長期差入保証金		784
繰延税金資産		982
その他		60
投資その他の資産合計		28,913

固定資産合計 29,214

資産合計 54,773

(単位：百万円)

第53期中間会計期間  
(平成23年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金	2,944
未払費用	3,149
未払法人税等	687
未払消費税等	231
賞与引当金	1,130
役員賞与引当金	100
その他	1,588
流動負債合計	9,831

## 固定負債

退職給付引当金	859
その他	55
固定負債合計	915

## 負債合計

10,746

## 純資産の部

## 株主資本

資本金	17,363
資本剰余金	
資本準備金	5,220
資本剰余金合計	5,220

## 利益剰余金

その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	21,604
利益剰余金合計	21,604

自己株式 68

株主資本合計 44,119

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	92
評価・換算差額等合計	92

純資産合計 44,027

負債純資産合計 54,773

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第53期中間会計期間  
(自 平成23年4月1日  
至 平成23年9月30日)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：百万円)

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

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

## 重要な会計方針

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



## 追加情報

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

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

## (中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

## 第53期中間会計期間（自平成23年4月1日至平成23年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

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

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

2 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

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

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

## 4 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

## (リース取引関係)

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

## (金融商品関係)

## 第53期中間会計期間（平成23年9月30日）

## 1 金融商品の時価等に関する事項

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

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

( )負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

## (4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

## (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

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

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

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

## (有価証券関係)

第53期中間会計期間(平成23年9月30日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

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

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

## 2 その他有価証券

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

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

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

## (持分法損益等)

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

## (ストックオプション等関係)

第53期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。



## (セグメント情報等)

第53期中間会計期間(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

## 1 セグメント情報

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

## 2 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスは単一であるため、記載しておりません。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。



## (1株当たり情報)

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

## (注) 算定上の基礎

## 1 1株当たり純資産額

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

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

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

## (重要な後発事象)

第53期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

## 新株予約権（ストックオプション）の付与

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

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称	資本金の額 (平成23年9月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成23年9月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日本生命保険相互会社	300,000百万円 (基金の総額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
富国生命保険相互会社	35,000百万円 (基金の総額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。

## 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23年2月4日	有価証券報告書
平成23年2月4日	有価証券届出書
平成23年8月8日	半期報告書
平成23年8月8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とおりです。

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

### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### （1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成22年11月 8日現在	平成23年11月 7日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		143,906,876	132,035,625
株式		31,005,602,591	25,190,584,681
派生商品評価勘定		3,316,572	4,432,704
未収入金		379,188	
未収配当金		259,123,747	254,905,116
未収利息		336	250
流動資産合計		31,412,329,310	25,581,958,376
資産合計		31,412,329,310	25,581,958,376
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		753,513	387,724
前受金		886,000	5,270,000
未払金			46,084,660
未払解約金		5,417,949	722,309
流動負債合計		7,057,462	52,464,693
負債合計		7,057,462	52,464,693
純資産の部			
元本等			
元本		49,163,789,188	43,750,772,096
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		17,758,517,340	18,221,278,413
元本等合計		31,405,271,848	25,529,493,683
純資産合計		31,405,271,848	25,529,493,683
負債純資産合計		31,412,329,310	25,581,958,376

#### （2）注記表

##### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	対象期間	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法		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。	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>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>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>(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> <p>デリバティブ取引 同左</p>
------------------------------	--	---

## (貸借対照表に関する注記)

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1. 期首	平成21年11月 7日	1. 期首	平成22年11月 9日
期首元本額	47,805,931,750円	期首元本額	49,163,789,188円
期首からの追加設定元本額	5,337,955,552円	期首からの追加設定元本額	5,573,821,634円
期首からの一部解約元本額	3,980,098,114円	期首からの一部解約元本額	10,986,838,726円
平成22年11月 8日現在の元本の内訳		平成23年11月 7日現在の元本の内訳	
DCインデックスバランス(株式20)	176,578,654円	DCインデックスバランス(株式20)	207,329,463円
DCインデックスバランス(株式40)	642,759,525円	DCインデックスバランス(株式40)	731,928,439円
DCインデックスバランス(株式60)	1,212,283,908円	DCインデックスバランス(株式60)	1,374,938,488円
DCインデックスバランス(株式80)	1,338,191,755円	DCインデックスバランス(株式80)	1,500,135,833円
インデックスファンド日本株式(DC専用)	827,699,601円	インデックスファンド日本株式(DC専用)	867,407,699円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	23,625,859,881円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	17,854,792,189円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	16,438,335円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	18,463,705円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	210,234,997円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	118,365,522円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	204,863,066円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	189,329,485円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	183,986,623円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	179,221,353円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	308,174,214円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	285,021,275円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	397,108,008円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	369,566,923円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	15,717,656,118円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	15,412,394,449円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	109,931,785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)	103,774,740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)	139,232,169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)	122,318,984円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	156,177,709円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	87,210,578円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	86,264,583円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	80,792,748円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	370,073,860円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	424,713,658円



年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	955,290,527円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	1,076,646,728円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	1,251,746,198円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	1,390,068,613円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	1,233,237,672円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	1,356,351,224円
計	49,163,789,188円	計	43,750,772,096円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	49,163,789,188口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	43,750,772,096口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は17,758,517,340円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は18,221,278,413円であります。	
4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりであります。		4. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券 として担保に供している資産は次のとおりでありま す。	
株式	222,536,500円	株式	206,464,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

## I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

対象期間(自平成21年11月7日 至 平成22年11月8日)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	883,469,516
合計	883,469,516

対象期間(自平成22年11月9日 至 平成23年11月7日)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	123,844,163
合計	123,844,163

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (株式関連)

(平成22年11月8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	384,180,000		386,860,000	2,680,000
	合計	384,180,000		386,860,000	2,680,000

(平成23年11月7日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	333,355,000		337,500,000	4,145,000
	合計	333,355,000		337,500,000	4,145,000

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## ( 1口当たり情報 )

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	0.6388円	1口当たり純資産額	0.5835円
( 1万口当たり純資産額 )	( 6,388円 )	( 1万口当たり純資産額 )	( 5,835円 )

## ( 3 ) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

( 単位 : 円 )

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	11,000	176.00	1,936,000	
1332	日本水産	32,000	266.00	8,512,000	
1334	マルハニチロホールディングス	55,000	136.00	7,480,000	
1377	サカタのタネ	4,100	1,089.00	4,464,900	
1379	ホクト	2,800	1,619.00	4,533,200	
1514	住石ホールディングス	8,800	68.00	598,400	
1515	日鉄鉱業	7,000	318.00	2,226,000	
1518	三井松島産業	18,000	138.00	2,484,000	
1605	国際石油開発帝石	335	535,000.00	179,225,000	
1606	日本海洋掘削	700	2,454.00	1,717,800	
1661	関東天然瓦斯開発	3,000	395.00	1,185,000	
1662	石油資源開発	3,900	3,160.00	12,324,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,500	1,813.00	4,532,500	
1417	ミライト・ホールディングス	7,800	592.00	4,617,600	
1712	ダイセキ環境ソリューション	3	185,000.00	555,000	
1719	間組	10,100	163.00	1,646,300	
1720	東急建設	9,620	215.00	2,068,300	
1721	コムシスホールディングス	13,400	746.00	9,996,400	
1722	ミサワホーム	2,700	472.00	1,274,400	
1762	高松コンストラクショングループ	2,100	1,213.00	2,547,300	
1766	東建コーポレーション	1,030	2,801.00	2,885,030	
1780	ヤマウラ	1,500	209.00	313,500	
1801	大成建設	140,000	218.00	30,520,000	
1802	大林組	83,000	363.00	30,129,000	
1803	清水建設	84,000	341.00	28,644,000	
1808	長谷工コーポレーション	173,000	50.00	8,650,000	
1810	松井建設	3,000	310.00	930,000	
1812	鹿島建設	129,000	258.00	33,282,000	
1813	不動テトラ	19,900	170.00	3,383,000	
1814	大末建設	12,000	44.00	528,000	
1815	鉄建建設	16,000	92.00	1,472,000	
1816	安藤建設	10,000	100.00	1,000,000	
1819	太平工業	5,000	427.00	2,135,000	
1820	西松建設	36,000	134.00	4,824,000	
1821	三井住友建設	17,800	52.00	925,600	
1822	大豊建設	8,000	99.00	792,000	
1824	前田建設工業	17,000	298.00	5,066,000	
1827	ナカノフドー建設	2,000	180.00	360,000	
1833	奥村組	26,000	303.00	7,878,000	

1834	大和小田急建設	1,500	197.00	295,500	
1835	東鉄工業	4,000	675.00	2,700,000	
1852	浅沼組	9,000	70.00	630,000	
1860	戸田建設	30,000	288.00	8,640,000	
1861	熊谷組	20,000	72.00	1,440,000	
1865	青木あすなろ建設	2,000	413.00	826,000	
1866	北野建設	6,000	168.00	1,008,000	
1867	植木組	4,000	162.00	648,000	
1868	三井ホーム	4,000	388.00	1,552,000	
1870	矢作建設工業	3,400	387.00	1,315,800	
1871	ピーエス三菱	2,000	239.00	478,000	
1878	大東建託	10,500	7,020.00	73,710,000	
1879	新日本建設	3,300	200.00	660,000	
1881	N I P P O	6,000	687.00	4,122,000	
1882	東亜道路工業	5,000	148.00	740,000	
1883	前田道路	8,000	802.00	6,416,000	
1884	日本道路	8,000	203.00	1,624,000	
1885	東亜建設工業	24,000	137.00	3,288,000	
1888	若築建設	15,000	123.00	1,845,000	
1890	東洋建設	41,000	82.00	3,362,000	
1893	五洋建設	35,000	265.00	9,275,000	
1896	大林道路	4,000	188.00	752,000	
1899	福田組	4,000	289.00	1,156,000	
1911	住友林業	19,000	680.00	12,920,000	
1914	日本基礎技術	3,300	257.00	848,100	
1916	日成ビルド工業	9,000	178.00	1,602,000	
1919	エス・バイ・エル	15,000	194.00	2,910,000	
1921	巴コーポレーション	3,600	275.00	990,000	
1924	パナホーム	10,000	551.00	5,510,000	
1925	大和ハウス工業	69,000	975.00	67,275,000	
1926	ライト工業	5,900	353.00	2,082,700	
1928	積水ハウス	77,000	679.00	52,283,000	
1929	日特建設	7,000	99.00	693,000	
1930	北陸電気工事	2,000	212.00	424,000	
1934	ユアテック	4,000	376.00	1,504,000	
1937	西部電気工業	3,000	336.00	1,008,000	
1939	四電工	2,000	307.00	614,000	
1941	中電工	4,000	860.00	3,440,000	
1942	関電工	13,000	339.00	4,407,000	
1944	きんでん	18,000	651.00	11,718,000	
1945	東京エネシス	3,000	391.00	1,173,000	
1946	トーエネック	4,000	394.00	1,576,000	
1949	住友電設	2,000	458.00	916,000	
1950	日本電設工業	5,000	756.00	3,780,000	
1951	協和エクシオ	9,000	698.00	6,282,000	
1952	新日本空調	2,200	390.00	858,000	
1956	日本電話施設	5,000	246.00	1,230,000	
1959	九電工	5,000	478.00	2,390,000	
1961	三機工業	6,000	411.00	2,466,000	

1963	日揮	26,000	2,189.00	56,914,000	
1964	中外炉工業	9,000	237.00	2,133,000	
1967	ヤマト	3,000	304.00	912,000	
1968	太平電業	4,000	487.00	1,948,000	
1969	高砂熱学工業	7,900	632.00	4,992,800	
1972	三晃金属工業	3,000	256.00	768,000	
1975	朝日工業社	3,000	315.00	945,000	
1979	大氣社	4,200	1,727.00	7,253,400	
1980	ダイダン	4,000	508.00	2,032,000	
1982	日比谷総合設備	3,400	778.00	2,645,200	
1983	東芝プラントシステム	4,000	812.00	3,248,000	
6330	東洋エンジニアリング	15,000	261.00	3,915,000	
6366	千代田化工建設	22,000	876.00	19,272,000	
6379	新興ブランテック	5,700	716.00	4,081,200	
2001	日本製粉	17,000	348.00	5,916,000	
2002	日清製粉グループ本社	25,000	930.00	23,250,000	
2003	日東富士製粉	2,000	300.00	600,000	
2004	昭和産業	11,000	240.00	2,640,000	
2009	鳥越製粉	2,400	699.00	1,677,600	
2052	協同飼料	10,000	87.00	870,000	
2053	中部飼料	2,500	493.00	1,232,500	
2056	日本配合飼料	9,000	104.00	936,000	
2107	東洋精糖	5,000	90.00	450,000	
2108	日本甜菜製糖	15,000	159.00	2,385,000	
2109	三井製糖	10,000	330.00	3,300,000	
2201	森永製菓	27,000	183.00	4,941,000	
2204	中村屋	6,000	403.00	2,418,000	
2206	江崎グリコ	10,000	912.00	9,120,000	
2207	名糖産業	1,300	1,020.00	1,326,000	
2211	不二家	16,000	152.00	2,432,000	
2212	山崎製パン	20,000	1,028.00	20,560,000	
2215	第一屋製パン	5,000	78.00	390,000	
2217	モロゾフ	5,000	277.00	1,385,000	
2229	カルビー	1,500	3,305.00	4,957,500	
2264	森永乳業	23,000	309.00	7,107,000	
2267	ヤクルト本社	14,800	2,238.00	33,122,400	
2269	明治ホールディングス	8,200	3,325.00	27,265,000	
2270	雪印メグミルク	5,900	1,468.00	8,661,200	
2281	プリマハム	15,000	109.00	1,635,000	
2282	日本ハム	21,000	936.00	19,656,000	
2284	伊藤ハム	15,000	277.00	4,155,000	
2286	林兼産業	10,000	62.00	620,000	
2288	丸大食品	13,000	256.00	3,328,000	
2290	米久	2,400	688.00	1,651,200	
2292	S F o o d s	1,500	593.00	889,500	
2501	サッポロホールディングス	45,000	288.00	12,960,000	
2502	アサヒグループホールディングス	51,700	1,585.00	81,944,500	
2503	キリンホールディングス	111,000	937.00	104,007,000	

2531	宝ホールディングス	23,000	479.00	11,017,000	
2533	オエノンホールディングス	7,000	180.00	1,260,000	
2540	養命酒製造	2,000	713.00	1,426,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	2,800	675.00	1,890,000	
2579	コカ・コーラウエスト	9,400	1,367.00	12,849,800	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	3,100	1,018.00	3,155,800	
2590	ダイドードリンコ	1,300	2,966.00	3,855,800	
2593	伊藤園	8,300	1,329.00	11,030,700	
2594	キーコーヒー	2,400	1,400.00	3,360,000	
2597	ユニカフェ	800	348.00	278,400	
2599	ジャパンフーズ	400	787.00	314,800	
2602	日清オイリオグループ	11,000	338.00	3,718,000	
2607	不二製油	6,700	1,098.00	7,356,600	
2613	J - オイルミルズ	10,000	228.00	2,280,000	
2801	キッコーマン	22,000	853.00	18,766,000	
2802	味の素	73,000	858.00	62,634,000	
2809	キューピー	14,000	1,046.00	14,644,000	
2810	ハウス食品	9,800	1,403.00	13,749,400	
2811	カゴメ	10,600	1,486.00	15,751,600	
2812	焼津水産化学工業	1,300	718.00	933,400	
2815	アリアケジャパン	2,500	1,364.00	3,410,000	
2871	ニチレイ	31,000	340.00	10,540,000	
2875	東洋水産	12,000	1,904.00	22,848,000	
2897	日清食品ホールディングス	10,700	2,946.00	31,522,200	
2899	永谷園	3,000	857.00	2,571,000	
2908	フジッコ	3,000	962.00	2,886,000	
2910	ロック・フィールド	1,300	1,245.00	1,618,500	
2914	日本たばこ産業	612	393,000.00	240,516,000	
2918	わらべや日洋	1,500	990.00	1,485,000	
2922	なとり	1,300	829.00	1,077,700	
4404	ミヨシ油脂	9,000	104.00	936,000	
3001	片倉工業	3,200	761.00	2,435,200	
3002	グンゼ	19,000	234.00	4,446,000	
3101	東洋紡績	109,000	109.00	11,881,000	
3103	ユニチカ	58,000	44.00	2,552,000	
3104	富士紡ホールディングス	11,000	148.00	1,628,000	
3105	日清紡ホールディングス	17,000	705.00	11,985,000	
3106	倉敷紡績	26,000	148.00	3,848,000	
3109	シキボウ	17,000	93.00	1,581,000	
3201	日本毛織	9,000	607.00	5,463,000	
3202	大東紡織	5,000	57.00	285,000	
3204	トーア紡コーポレーション	12,000	52.00	624,000	
3205	ダイドーリミテッド	3,200	780.00	2,496,000	
3302	帝国繊維	3,000	513.00	1,539,000	
3401	帝人	105,000	247.00	25,935,000	
3402	東レ	187,000	580.00	108,460,000	
3408	サカイオーベックス	8,000	110.00	880,000	
3501	住江織物	7,000	136.00	952,000	

3512	日本フエルト	1,400	380.00	532,000	
3513	イチカワ	2,000	145.00	290,000	
3514	日本バイリーン	3,000	330.00	990,000	
3524	日東製網	4,000	106.00	424,000	
3526	芦森工業	6,000	116.00	696,000	
3529	アツギ	20,000	93.00	1,860,000	
3551	ダイニック	5,000	131.00	655,000	
3569	セーレン	6,400	475.00	3,040,000	
3577	東海染工	4,000	86.00	344,000	
3580	小松精練	4,000	347.00	1,388,000	
3591	ワコールホールディングス	15,000	948.00	14,220,000	
3593	ホギメディカル	1,600	3,280.00	5,248,000	
3606	レナウン	5,900	146.00	861,400	
3607	クラウドディア	300	981.00	294,300	
3608	T S Iホールディングス	11,500	398.00	4,577,000	
8011	三陽商会	13,000	182.00	2,366,000	
8013	ナイガイ	9,000	37.00	333,000	
8016	オンワードホールディングス	16,000	555.00	8,880,000	
8029	ルック	5,000	179.00	895,000	
8111	ゴールドウイン	6,000	267.00	1,602,000	
8114	デサント	6,000	429.00	2,574,000	
8127	ヤマトインターナショナル	1,500	354.00	531,000	
3708	特種東海製紙	16,000	169.00	2,704,000	
3861	王子製紙	114,000	395.00	45,030,000	
3864	三菱製紙	38,000	74.00	2,812,000	
3865	北越紀州製紙	16,000	517.00	8,272,000	
3877	中越パルプ工業	10,000	120.00	1,200,000	
3878	巴川製紙所	4,000	167.00	668,000	
3880	大王製紙	11,000	600.00	6,600,000	
3893	日本製紙グループ本社	12,500	1,695.00	21,187,500	
3941	レンゴー	21,000	559.00	11,739,000	
3946	トーモク	8,000	213.00	1,704,000	
3950	ザ・バック	1,500	1,165.00	1,747,500	
3405	クラレ	41,000	1,100.00	45,100,000	
3407	旭化成	150,000	456.00	68,400,000	
3553	共和レザー	1,600	264.00	422,400	
4003	コープケミカル	4,000	94.00	376,000	
4004	昭和電工	160,000	155.00	24,800,000	
4005	住友化学	177,000	276.00	48,852,000	
4007	日本化成	5,000	146.00	730,000	
4008	住友精化	5,000	341.00	1,705,000	
4021	日産化学工業	19,600	743.00	14,562,800	
4022	ラサ工業	11,000	123.00	1,353,000	
4023	クレハ	17,000	363.00	6,171,000	
4027	テイカ	4,000	313.00	1,252,000	
4028	石原産業	44,000	90.00	3,960,000	
4031	片倉チッカリン	2,000	182.00	364,000	
4041	日本曹達	15,000	344.00	5,160,000	
4042	東ソー	69,000	243.00	16,767,000	



4043	トクヤマ	40,000	258.00	10,320,000	
4044	セントラル硝子	25,000	377.00	9,425,000	
4045	東亜合成	32,000	337.00	10,784,000	
4046	ダイソー	10,000	252.00	2,520,000	
4047	関東電化工業	6,000	390.00	2,340,000	
4061	電気化学工業	54,000	288.00	15,552,000	
4063	信越化学工業	46,200	3,960.00	182,952,000	
4064	日本カーバイド工業	8,000	112.00	896,000	
4078	堺化学工業	8,000	297.00	2,376,000	
4088	エア・ウォーター	21,000	1,020.00	21,420,000	
4091	大陽日酸	34,000	560.00	19,040,000	
4092	日本化学工業	10,000	133.00	1,330,000	
4095	日本パーカライズニング	6,000	1,034.00	6,204,000	
4097	高圧ガス工業	4,000	413.00	1,652,000	
4099	四国化成工業	4,000	430.00	1,720,000	
4100	戸田工業	3,000	619.00	1,857,000	
4109	ステラ ケミファ	1,200	2,270.00	2,724,000	
4112	保土谷化学工業	5,000	218.00	1,090,000	
4114	日本触媒	19,000	850.00	16,150,000	
4116	大日精化工業	9,000	358.00	3,222,000	
4118	カネカ	32,000	422.00	13,504,000	
4182	三菱瓦斯化学	44,000	463.00	20,372,000	
4183	三井化学	110,000	234.00	25,740,000	
4185	J S R	23,500	1,480.00	34,780,000	
4186	東京応化工業	4,600	1,597.00	7,346,200	
4188	三菱ケミカルホールディングス	161,000	454.00	73,094,000	
4201	日本合成化学工業	5,000	422.00	2,110,000	
4202	ダイセル	34,000	419.00	14,246,000	
4203	住友ベークライト	22,000	435.00	9,570,000	
4204	積水化学工業	54,000	610.00	32,940,000	
4205	日本ゼオン	24,000	691.00	16,584,000	
4206	アイカ工業	6,900	1,083.00	7,472,700	
4208	宇部興産	108,000	230.00	24,840,000	
4212	積水樹脂	4,000	699.00	2,796,000	
4215	タキロン	6,000	257.00	1,542,000	
4216	旭有機材工業	9,000	201.00	1,809,000	
4217	日立化成工業	11,100	1,420.00	15,762,000	
4218	ニチバン	3,000	263.00	789,000	
4220	リケンテクノス	4,000	237.00	948,000	
4221	大倉工業	6,000	289.00	1,734,000	
4228	積水化成成品工業	7,000	293.00	2,051,000	
4229	群栄化学工業	7,000	206.00	1,442,000	
4231	タイガースポリマー	1,300	302.00	392,600	
4271	日本カーリット	2,100	402.00	844,200	
4272	日本化薬	18,000	743.00	13,374,000	
4362	日本精化	2,200	510.00	1,122,000	
4401	A D E K A	11,100	774.00	8,591,400	
4403	日油	20,000	363.00	7,260,000	
4410	ハリマ化成	2,200	627.00	1,379,400	

4452	花王	68,400	2,042.00	139,672,800	
4461	第一工業製薬	5,000	228.00	1,140,000	
4471	三洋化成工業	8,000	499.00	3,992,000	
4611	大日本塗料	15,000	85.00	1,275,000	
4612	日本ペイント	24,000	587.00	14,088,000	

[次へ](#)

4613	関西ペイント	29,000	727.00	21,083,000	
4614	トウベ	3,000	65.00	195,000	
4617	中国塗料	8,000	518.00	4,144,000	
4619	日本特殊塗料	2,000	300.00	600,000	
4620	藤倉化成	3,200	375.00	1,200,000	
4626	太陽ホールディングス	2,100	2,012.00	4,225,200	
4631	D I C	99,000	138.00	13,662,000	
4633	サカタインクス	5,000	341.00	1,705,000	
4634	東洋インキS Cホールディングス	23,000	302.00	6,946,000	
4901	富士フイルムホールディングス	55,100	1,778.00	97,967,800	
4911	資生堂	42,800	1,403.00	60,048,400	
4912	ライオン	30,000	439.00	13,170,000	
4914	高砂香料工業	8,000	376.00	3,008,000	
4917	マンダム	2,600	2,024.00	5,262,400	
4919	ミルボン	1,400	2,470.00	3,458,000	
4921	ファンケル	6,500	1,089.00	7,078,500	
4922	コーセー	4,200	1,827.00	7,673,400	
4924	ドクターシーラボ	16	407,000.00	6,512,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	2,129.00	5,535,400	
4951	エステー	1,600	1,002.00	1,603,200	
4956	コニシ	1,900	1,018.00	1,934,200	
4958	長谷川香料	3,300	1,258.00	4,151,400	
4967	小林製薬	3,600	3,910.00	14,076,000	
4968	荒川化学工業	2,000	645.00	1,290,000	
4971	メック	1,900	277.00	526,300	
4973	日本高純度化学	7	203,500.00	1,424,500	
4975	荏原ユーザライト	400	1,938.00	775,200	
4985	アース製薬	1,800	2,880.00	5,184,000	
4989	イハラケミカル工業	4,000	266.00	1,064,000	
4992	北興化学工業	3,000	222.00	666,000	
4994	大成ラミック	700	2,371.00	1,659,700	
4996	クミアイ化学工業	6,000	273.00	1,638,000	
4997	日本農薬	6,000	343.00	2,058,000	
5142	アキレス	21,000	110.00	2,310,000	
5208	有沢製作所	4,300	333.00	1,431,900	
6988	日東電工	21,300	3,130.00	66,669,000	
7874	レック	700	1,458.00	1,020,600	
7908	きもと	2,100	623.00	1,308,300	
7917	藤森工業	1,900	1,280.00	2,432,000	
7925	前澤化成工業	1,800	814.00	1,465,200	
7942	J S P	1,700	1,120.00	1,904,000	
7947	エフピコ	1,100	5,020.00	5,522,000	
7958	天馬	2,100	671.00	1,409,100	
7970	信越ポリマー	5,000	379.00	1,895,000	
7971	東リ	7,000	142.00	994,000	
7988	ニフコ	5,800	2,028.00	11,762,400	
7995	日本バルカー工業	10,000	198.00	1,980,000	

8113	ユニ・チャーム	14,200	3,650.00	51,830,000	
4151	協和発酵キリン	35,000	908.00	31,780,000	
4502	武田薬品工業	96,600	3,425.00	330,855,000	代用有価証券10,000株
4503	アステラス製薬	57,200	3,005.00	171,886,000	
4506	大日本住友製薬	18,300	810.00	14,823,000	
4507	塩野義製薬	40,300	1,012.00	40,783,600	
4508	田辺三菱製薬	25,700	1,309.00	33,641,300	
4512	わかもと製薬	3,000	233.00	699,000	
4514	あすか製薬	3,000	550.00	1,650,000	
4516	日本新薬	5,000	884.00	4,420,000	
4519	中外製薬	29,900	1,174.00	35,102,600	
4521	科研製薬	10,000	977.00	9,770,000	
4523	エーザイ	31,700	3,090.00	97,953,000	
4527	ロート製薬	11,000	925.00	10,175,000	
4528	小野薬品工業	12,600	4,170.00	52,542,000	
4530	久光製薬	8,000	3,130.00	25,040,000	
4531	有機合成薬品工業	2,000	157.00	314,000	
4534	持田製薬	9,000	815.00	7,335,000	
4536	参天製薬	8,600	3,140.00	27,004,000	
4538	扶桑薬品工業	9,000	201.00	1,809,000	
4539	日本ケミファ	4,000	295.00	1,180,000	
4540	ツムラ	7,000	2,206.00	15,442,000	
4541	日医工	4,400	1,748.00	7,691,200	
4547	キッセイ薬品工業	4,800	1,468.00	7,046,400	
4548	生化学工業	5,000	861.00	4,305,000	
4549	栄研化学	2,000	1,005.00	2,010,000	
4550	日水製薬	1,100	678.00	745,800	
4551	鳥居薬品	1,800	1,453.00	2,615,400	
4553	東和薬品	1,300	3,470.00	4,511,000	
4555	沢井製薬	1,700	7,320.00	12,444,000	
4559	ゼリア新薬工業	4,000	1,214.00	4,856,000	
4568	第一三共	86,700	1,485.00	128,749,500	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	6,000	1,412.00	8,472,000	
4574	大幸薬品	1,200	825.00	990,000	
4577	ダイト	700	1,298.00	908,600	
4578	大塚ホールディングス	51,100	2,032.00	103,835,200	
4581	大正製薬ホールディングス	6,200	5,200.00	32,240,000	
3315	日本コークス工業	21,000	106.00	2,226,000	
5002	昭和シェル石油	23,100	535.00	12,358,500	
5007	コスモ石油	71,000	200.00	14,200,000	
5011	ニチレキ	3,000	396.00	1,188,000	
5012	東燃ゼネラル石油	39,000	906.00	35,334,000	
5013	ユシロ化学工業	1,400	901.00	1,261,400	
5015	ピーピー・カストロール	900	337.00	303,300	
5017	AOCホールディングス	6,000	469.00	2,814,000	
5018	MORESCO	600	739.00	443,400	
5019	出光興産	3,100	7,880.00	24,428,000	
5020	JXホールディングス	285,900	467.00	133,515,300	

5101	横浜ゴム	31,000	436.00	13,516,000	
5105	東洋ゴム工業	19,000	202.00	3,838,000	
5108	ブリヂストン	80,800	1,865.00	150,692,000	
5110	住友ゴム工業	20,100	975.00	19,597,500	
5121	藤倉ゴム工業	1,500	296.00	444,000	
5122	オカモト	9,000	324.00	2,916,000	
5185	フコク	1,100	664.00	730,400	
5186	ニッタ	2,500	1,350.00	3,375,000	
5191	東海ゴム工業	4,800	945.00	4,536,000	
5192	三ツ星ベルト	7,000	418.00	2,926,000	
5195	バンドー化学	9,000	315.00	2,835,000	
3110	日東紡績	19,000	267.00	5,073,000	
5201	旭硝子	127,000	622.00	78,994,000	
5202	日本板硝子	111,000	152.00	16,872,000	
5204	石塚硝子	4,000	150.00	600,000	
5210	日本山村硝子	10,000	183.00	1,830,000	
5214	日本電気硝子	50,000	689.00	34,450,000	
5218	オハラ	1,000	745.00	745,000	
5232	住友大阪セメント	52,000	243.00	12,636,000	
5233	太平洋セメント	152,000	153.00	23,256,000	
5234	デイ・シイ	2,600	233.00	605,800	
5262	日本ヒューム	3,000	293.00	879,000	
5269	日本コンクリート工業	4,000	188.00	752,000	
5301	東海カーボン	22,000	367.00	8,074,000	
5302	日本カーボン	12,000	232.00	2,784,000	
5310	東洋炭素	1,400	3,645.00	5,103,000	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	13,000	243.00	3,159,000	
5332	TOTO	40,000	667.00	26,680,000	
5333	日本碍子	33,000	921.00	30,393,000	
5334	日本特殊陶業	22,000	993.00	21,846,000	
5337	ダントーホールディングス	5,000	76.00	380,000	
5344	MARUWA	800	3,205.00	2,564,000	
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	221.00	1,326,000	
5352	黒崎播磨	6,000	255.00	1,530,000	
5363	東京窯業	3,000	159.00	477,000	
5367	ニッカトー	900	426.00	383,400	
5384	フジミインコーポレーテッド	2,300	903.00	2,076,900	
5391	エーアンドエーマテリアル	6,000	79.00	474,000	
5393	ニチアス	11,000	444.00	4,884,000	
7943	ニチハ	2,900	951.00	2,757,900	
5401	新日本製鐵	676,000	194.00	131,144,000	
5405	住友金属工業	478,000	139.00	66,442,000	
5406	神戸製鋼所	357,000	128.00	45,696,000	
5407	日新製鋼	91,000	118.00	10,738,000	
5408	中山製鋼所	13,000	74.00	962,000	
5410	合同製鐵	14,000	191.00	2,674,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディ ングス	61,100	1,418.00	86,639,800	
5423	東京製鐵	13,100	643.00	8,423,300	

5440	共英製鋼	2,800	1,427.00	3,995,600	
5444	大和工業	5,900	2,025.00	11,947,500	
5445	東京鐵鋼	5,000	216.00	1,080,000	
5449	大阪製鐵	1,600	1,370.00	2,192,000	
5451	淀川製鋼所	18,000	317.00	5,706,000	
5453	東洋鋼鈹	6,000	292.00	1,752,000	
5457	住友鋼管	1,500	510.00	765,000	
5463	丸一鋼管	7,900	1,744.00	13,777,600	
5464	モリ工業	4,000	285.00	1,140,000	
5471	大同特殊鋼	43,000	491.00	21,113,000	
5476	日本高周波鋼業	11,000	83.00	913,000	
5479	日本金属工業	20,000	73.00	1,460,000	
5480	日本冶金工業	19,000	121.00	2,299,000	
5481	山陽特殊製鋼	13,000	413.00	5,369,000	
5482	愛知製鋼	14,000	408.00	5,712,000	
5486	日立金属	17,000	887.00	15,079,000	
5491	日本金属	6,000	151.00	906,000	
5541	大平洋金属	18,000	432.00	7,776,000	
5563	日本電工	9,000	383.00	3,447,000	
5602	栗本鐵工所	13,000	126.00	1,638,000	
5606	旭テック	21,000	24.00	504,000	
5612	日本鑄鉄管	3,000	164.00	492,000	
5632	三菱製鋼	16,000	211.00	3,376,000	
5658	日亜鋼業	4,000	195.00	780,000	
5659	日本精線	2,000	389.00	778,000	
6319	シンニッタン	2,300	299.00	687,700	
7305	新家工業	6,000	119.00	714,000	
5701	日本軽金属	59,000	109.00	6,431,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	4,000	280.00	1,120,000	
5706	三井金属鈹業	70,000	204.00	14,280,000	
5707	東邦亜鉛	15,000	325.00	4,875,000	
5711	三菱マテリアル	161,000	205.00	33,005,000	
5713	住友金属鈹山	67,000	1,056.00	70,752,000	
5714	DOWAホールディングス	31,000	478.00	14,818,000	
5715	古河機械金属	43,000	72.00	3,096,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	2,500	4,435.00	11,087,500	
5727	東邦チタニウム	4,200	1,708.00	7,173,600	
5738	住友軽金属工業	63,000	69.00	4,347,000	
5741	古河スカイ	11,000	187.00	2,057,000	
5801	古河電気工業	81,000	192.00	15,552,000	
5802	住友電気工業	91,000	855.00	77,805,000	
5803	フジクラ	39,000	232.00	9,048,000	
5805	昭和電線ホールディングス	34,000	77.00	2,618,000	
5809	タツタ電線	5,000	369.00	1,845,000	
5812	日立電線	20,000	181.00	3,620,000	
5815	沖電線	3,000	147.00	441,000	
5819	カナレ電気	300	1,228.00	368,400	
5821	平河ヒューテック	500	768.00	384,000	
5851	リョービ	14,000	323.00	4,522,000	

5857	アサヒホールディングス	3,600	1,546.00	5,565,600	
3421	稲葉製作所	1,300	893.00	1,160,900	
3431	宮地エンジニアリンググループ	9,000	82.00	738,000	
3432	三協・立山ホールディングス	35,000	101.00	3,535,000	
3433	トーカロ	1,500	1,662.00	2,493,000	
3434	アルファC o	900	876.00	788,400	
3436	SUMCO	15,800	745.00	11,771,000	
3443	川田テクノロジーズ	600	1,143.00	685,800	
5901	東洋製罐	18,200	1,124.00	20,456,800	
5902	ホッカンホールディングス	6,000	229.00	1,374,000	
5909	コロナ	1,200	1,384.00	1,660,800	
5911	横河ブリッジホールディングス	5,000	477.00	2,385,000	
5915	駒井ハルテック	5,000	201.00	1,005,000	
5929	三和ホールディングス	26,000	231.00	6,006,000	
5930	文化シャッター	7,000	246.00	1,722,000	
5936	東洋シャッター	900	346.00	311,400	
5938	住生活グループ	33,500	1,734.00	58,089,000	
5942	日本フィルコン	1,900	420.00	798,000	
5943	ノーリツ	5,000	1,444.00	7,220,000	
5946	長府製作所	2,500	1,915.00	4,787,500	
5947	リンナイ	4,100	5,870.00	24,067,000	
5951	ダイニチ工業	1,400	823.00	1,152,200	
5957	日東精工	4,000	194.00	776,000	
5958	三洋工業	4,000	144.00	576,000	
5959	岡部	5,100	384.00	1,958,400	
5974	中国工業	5,000	81.00	405,000	
5975	東プレ	5,000	760.00	3,800,000	
5976	高周波熱錬	3,400	595.00	2,023,000	
5981	東京製綱	16,000	177.00	2,832,000	
5988	パイオラックス	1,100	1,625.00	1,787,500	
5991	日本発條	18,600	706.00	13,131,600	
5992	中央発條	3,000	255.00	765,000	
5998	アドバネクス	6,000	61.00	366,000	
8155	三益半導体工業	2,200	658.00	1,447,600	
1978	アタカ大機	2,000	243.00	486,000	
5631	日本製鋼所	40,000	516.00	20,640,000	
5963	日立ツール	1,400	798.00	1,117,200	
6005	三浦工業	3,800	2,152.00	8,177,600	
6013	タクマ	9,000	379.00	3,411,000	
6101	ツガミ	6,000	467.00	2,802,000	
6103	オークマ	16,000	591.00	9,456,000	
6104	東芝機械	14,000	404.00	5,656,000	
6113	アマダ	36,000	490.00	17,640,000	
6118	アイダエンジニアリング	6,700	385.00	2,579,500	
6135	牧野フライス製作所	13,000	540.00	7,020,000	
6136	オーエスジー	11,400	979.00	11,160,600	
6138	ダイジェット工業	3,000	143.00	429,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	6,400	1,169.00	7,481,600	
6141	森精機製作所	13,600	722.00	9,819,200	

6146	ディスコ	2,600	4,270.00	11,102,000	
6151	日東工器	1,500	1,850.00	2,775,000	
6203	豊和工業	14,000	63.00	882,000	
6205	大阪機工	10,000	86.00	860,000	
6210	東洋機械金属	2,000	191.00	382,000	

[次へ](#)



6217	津田駒工業	6,000	149.00	894,000	
6222	島精機製作所	3,400	1,412.00	4,800,800	
6247	日阪製作所	3,000	888.00	2,664,000	
6250	やまびこ	1,000	910.00	910,000	
6262	ベガサスミシン製造	2,500	208.00	520,000	
6268	ナプテスコ	10,700	1,685.00	18,029,500	
6269	三井海洋開発	2,100	1,358.00	2,851,800	
6272	レオン自動機	3,000	174.00	522,000	
6273	S M C	7,700	12,340.00	95,018,000	
6274	新川	2,100	399.00	837,900	
6277	ホソカワミクロン	4,000	321.00	1,284,000	
6278	ユニオンツール	1,400	1,403.00	1,964,200	
6282	オイレス工業	2,800	1,434.00	4,015,200	
6287	サトーホールディングス	2,700	913.00	2,465,100	
6291	日本エアータック	800	333.00	266,400	
6293	日精樹脂工業	2,100	251.00	527,100	
6298	ワイエイシイ	1,100	676.00	743,600	
6301	小松製作所	122,200	1,966.00	240,245,200	
6302	住友重機械工業	66,000	444.00	29,304,000	
6305	日立建機	13,200	1,563.00	20,631,600	
6306	日工	3,000	282.00	846,000	
6309	巴工業	1,000	1,411.00	1,411,000	
6310	井関農機	26,000	177.00	4,602,000	
6315	T O W A	2,300	348.00	800,400	
6316	丸山製作所	6,000	173.00	1,038,000	
6317	北川鉄工所	12,000	116.00	1,392,000	
6326	クボタ	118,000	655.00	77,290,000	
6328	荏原実業	600	1,227.00	736,200	
6331	三菱化工機	8,000	145.00	1,160,000	
6332	月島機械	4,000	581.00	2,324,000	
6333	帝国電機製作所	900	1,524.00	1,371,600	
6339	新東工業	5,600	705.00	3,948,000	
6340	澁谷工業	1,400	789.00	1,104,600	
6345	アイチ コーポレーション	4,200	309.00	1,297,800	
6349	小森コーポレーション	7,400	445.00	3,293,000	
6351	鶴見製作所	2,000	630.00	1,260,000	
6355	住友精密工業	4,000	553.00	2,212,000	
6358	酒井重工業	5,000	130.00	650,000	
6361	荏原製作所	42,000	281.00	11,802,000	
6362	石井鐵工所	4,000	139.00	556,000	
6363	西島製作所	3,000	1,001.00	3,003,000	
6367	ダイキン工業	31,400	2,340.00	73,476,000	
6368	オルガノ	5,000	624.00	3,120,000	
6369	トーヨーカネツ	14,000	142.00	1,988,000	
6370	栗田工業	14,200	2,086.00	29,621,200	
6371	椿本チエイン	13,000	391.00	5,083,000	
6373	大同工業	5,000	134.00	670,000	
6375	日本コンベヤ	8,000	72.00	576,000	
6378	木村化工機	2,400	311.00	746,400	

6381	アネスト岩田	4,000	324.00	1,296,000	
6383	ダイフク	11,500	413.00	4,749,500	
6390	加藤製作所	6,000	217.00	1,302,000	
6393	油研工業	5,000	166.00	830,000	
6395	タダノ	12,000	528.00	6,336,000	
6406	フジテック	7,000	405.00	2,835,000	
6407	シーケーディ	6,900	520.00	3,588,000	
6409	キトー	10	54,900.00	549,000	
6412	平和	5,300	1,383.00	7,329,900	
6413	理想科学工業	1,800	1,308.00	2,354,400	
6417	SANKYO	7,500	4,060.00	30,450,000	
6418	日本金銭機械	2,300	614.00	1,412,200	
6419	マースエンジニアリング	1,400	1,319.00	1,846,600	
6420	福島工業	700	896.00	627,200	
6428	オーイズミ	1,000	278.00	278,000	
6430	ダイコク電機	1,100	684.00	752,400	
6436	アマノ	7,400	688.00	5,091,200	
6440	JUKI	15,000	174.00	2,610,000	
6444	サンデン	13,000	249.00	3,237,000	
6445	蛇の目マシン工業	25,000	56.00	1,400,000	
6454	マックス	4,000	924.00	3,696,000	
6457	グローリー	7,300	1,669.00	12,183,700	
6459	大和冷機工業	3,000	392.00	1,176,000	
6460	セガサミーホールディングス	26,500	1,720.00	45,580,000	
6461	日本ピストンリング	9,000	147.00	1,323,000	
6462	リケン	9,000	301.00	2,709,000	
6463	T P R	2,700	877.00	2,367,900	
6465	ホシザキ電機	4,900	1,850.00	9,065,000	
6470	大豊工業	1,700	668.00	1,135,600	
6471	日本精工	55,000	575.00	31,625,000	
6472	N T N	57,000	330.00	18,810,000	
6473	ジェイテクト	23,600	842.00	19,871,200	
6474	不二越	25,000	443.00	11,075,000	
6480	日本トムソン	8,000	491.00	3,928,000	
6481	T H K	16,400	1,508.00	24,731,200	
6482	ユーシン精機	1,200	1,430.00	1,716,000	
6485	前澤給装工業	900	1,057.00	951,300	
6486	イーグル工業	3,000	813.00	2,439,000	
6489	前澤工業	2,000	183.00	366,000	
6490	日本ビラー工業	2,000	472.00	944,000	
6498	キッツ	10,200	300.00	3,060,000	
6581	日立工機	6,600	578.00	3,814,800	
6586	マキタ	16,100	2,840.00	45,724,000	
7004	日立造船	97,000	106.00	10,282,000	
7011	三菱重工業	413,000	331.00	136,703,000	
7013	I H I	168,000	175.00	29,400,000	
4062	イビデン	16,200	1,793.00	29,046,600	
4902	コニカミノルタホールディングス	65,000	583.00	37,895,000	

6448	ブラザー工業	31,800	1,043.00	33,167,400	
6479	ミネベア	37,000	306.00	11,322,000	
6501	日立製作所	553,000	431.00	238,343,000	
6502	東芝	518,000	354.00	183,372,000	
6503	三菱電機	246,000	726.00	178,596,000	
6504	富士電機	75,000	239.00	17,925,000	
6505	東洋電機製造	4,000	337.00	1,348,000	
6506	安川電機	29,000	670.00	19,430,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	15,000	189.00	2,835,000	
6508	明電舎	24,000	290.00	6,960,000	
6513	オリジン電気	4,000	285.00	1,140,000	
6517	デンヨー	2,300	1,082.00	2,488,600	
6588	東芝テック	15,000	288.00	4,320,000	
6590	芝浦メカトロニクス	5,000	231.00	1,155,000	
6592	マブチモーター	3,400	3,420.00	11,628,000	
6594	日本電産	13,300	6,540.00	86,982,000	
6621	高岳製作所	10,000	188.00	1,880,000	
6622	ダイヘン	14,000	275.00	3,850,000	
6632	JVCケンウッド	15,000	321.00	4,815,000	
6640	第一精工	600	2,103.00	1,261,800	
6641	日新電機	5,000	492.00	2,460,000	
6644	大崎電気工業	3,000	749.00	2,247,000	
6645	オムロン	27,400	1,713.00	46,936,200	
6651	日東工業	3,700	947.00	3,503,900	
6652	I D E C	3,200	770.00	2,464,000	
6665	エルピーダメモリ	33,300	450.00	14,985,000	
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	48,000	423.00	20,304,000	
6675	サクサホールディングス	7,000	114.00	798,000	
6676	メルコホールディングス	1,400	2,170.00	3,038,000	
6678	テクノメディカ	2	273,700.00	547,400	
6701	日本電気	339,000	170.00	57,630,000	
6702	富士通	237,000	417.00	98,829,000	
6703	沖電気工業	96,000	68.00	6,528,000	
6704	岩崎通信機	11,000	69.00	759,000	
6706	電気興業	7,000	297.00	2,079,000	
6707	サンケン電気	12,000	304.00	3,648,000	
6715	ナカヨ通信機	3,000	177.00	531,000	
6718	アイホン	1,400	1,395.00	1,953,000	
6723	ルネサスエレクトロニクス	6,400	612.00	3,916,800	
6724	セイコーエプソン	16,800	998.00	16,766,400	
6727	ワコム	48	119,800.00	5,750,400	
6728	アルバック	4,600	1,094.00	5,032,400	
6730	アクセル	1,100	1,754.00	1,929,400	
6737	ナナオ	2,100	1,567.00	3,290,700	
6741	日本信号	5,700	530.00	3,021,000	
6742	京三製作所	5,000	338.00	1,690,000	
6744	能美防災	3,000	485.00	1,455,000	
6745	ホーチキ	2,000	350.00	700,000	

6749	マスプロ電工	200	1,061.00	212,200	
6751	日本無線	5,000	189.00	945,000	
6752	パナソニック	281,300	726.00	204,223,800	
6753	シャープ	119,000	715.00	85,085,000	
6754	アンリツ	12,000	947.00	11,364,000	
6755	富士通ゼネラル	6,000	459.00	2,754,000	
6756	日立国際電気	6,000	579.00	3,474,000	
6758	ソニー	153,600	1,403.00	215,500,800	
6762	T D K	12,900	3,420.00	44,118,000	
6763	帝国通信工業	6,000	133.00	798,000	
6767	ミツミ電機	8,800	524.00	4,611,200	
6768	タムラ製作所	8,000	197.00	1,576,000	
6770	アルプス電気	19,500	580.00	11,310,000	
6771	池上通信機	9,000	49.00	441,000	
6773	パイオニア	35,000	303.00	10,605,000	
6779	日本電波工業	1,900	1,014.00	1,926,600	
6788	日本トリム	300	1,803.00	540,900	
6789	ローランド ディー . ジー .	1,100	832.00	915,200	
6794	フォスター電機	2,300	1,226.00	2,819,800	
6796	クラリオン	15,000	135.00	2,025,000	
6798	S M K	8,000	265.00	2,120,000	
6800	ヨコオ	1,900	415.00	788,500	
6801	東光	12,000	169.00	2,028,000	
6803	ティアック	15,000	29.00	435,000	
6804	ホシデン	6,700	503.00	3,370,100	
6806	ヒロセ電機	4,300	7,010.00	30,143,000	
6807	日本航空電子工業	6,000	525.00	3,150,000	
6809	T O A	3,000	442.00	1,326,000	
6815	ユニデン	7,000	305.00	2,135,000	
6816	アルパイン	4,800	903.00	4,334,400	
6817	スミダコーポレーション	1,500	600.00	900,000	
6820	アイコム	1,400	1,855.00	2,597,000	
6839	船井電機	2,200	1,620.00	3,564,000	
6841	横河電機	26,700	716.00	19,117,200	
6844	新電元工業	9,000	315.00	2,835,000	
6845	山武	6,300	1,652.00	10,407,600	
6849	日本光電工業	4,900	1,815.00	8,893,500	
6850	チノー	5,000	193.00	965,000	
6853	共和電業	2,000	254.00	508,000	
6855	日本電子材料	1,000	405.00	405,000	
6856	堀場製作所	4,500	2,451.00	11,029,500	
6857	アドバンテスト	18,400	868.00	15,971,200	
6858	小野測器	3,000	210.00	630,000	
6859	エスベック	2,600	472.00	1,227,200	
6860	パナソニック電工 S U N X	2,200	419.00	921,800	
6861	キーエンス	5,500	20,110.00	110,605,000	
6866	日置電機	1,200	1,420.00	1,704,000	
6869	シスメックス	8,600	2,504.00	21,534,400	
6875	メガチップス	2,000	1,149.00	2,298,000	

6877	O B A R A G R O U P	1,700	999.00	1,698,300	
6883	日本電産コパル電子	2,500	491.00	1,227,500	
6885	ミヤチテクノス	1,200	673.00	807,600	
6900	東京電波	800	388.00	310,400	
6901	澤藤電機	2,000	225.00	450,000	
6905	コーセル	3,600	1,084.00	3,902,400	
6910	日立メディコ	2,000	835.00	1,670,000	
6911	新日本無線	2,000	115.00	230,000	
6914	オブテックス	1,700	967.00	1,643,900	
6915	千代田インテグレ	1,200	1,010.00	1,212,000	
6921	東光電気	2,000	356.00	712,000	
6923	スタンレー電気	16,600	1,120.00	18,592,000	
6924	岩崎電気	9,000	170.00	1,530,000	
6925	ウシオ電機	14,900	1,099.00	16,375,100	
6926	岡谷電機産業	1,300	347.00	451,100	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	149.00	327,800	
6929	日本セラミック	1,600	1,395.00	2,232,000	
6934	新神戸電機	2,000	1,320.00	2,640,000	
6935	日本デジタル研究所	2,100	698.00	1,465,800	
6937	古河電池	2,000	376.00	752,000	
6938	双信電機	1,300	351.00	456,300	
6941	山一電機	2,600	182.00	473,200	
6947	函研	1,600	528.00	844,800	
6951	日本電子	9,000	211.00	1,899,000	
6952	カシオ計算機	23,500	455.00	10,692,500	
6954	ファナック	25,600	12,940.00	331,264,000	
6958	日本シイエムケイ	5,400	272.00	1,468,800	
6961	エンプラス	1,300	1,579.00	2,052,700	
6963	ローム	12,100	4,025.00	48,702,500	
6965	浜松ホトニクス	9,600	2,985.00	28,656,000	
6966	三井ハイテック	3,200	361.00	1,155,200	
6967	新光電気工業	8,300	553.00	4,589,900	
6971	京セラ	20,500	6,890.00	141,245,000	
6976	太陽誘電	11,100	570.00	6,327,000	
6981	村田製作所	25,800	4,310.00	111,198,000	
6985	ユーション	3,500	648.00	2,268,000	
6986	双葉電子工業	4,200	1,460.00	6,132,000	
6989	北陸電気工業	10,000	123.00	1,230,000	
6996	ニチコン	7,800	850.00	6,630,000	
6997	日本ケミコン	14,000	301.00	4,214,000	
6999	K O A	3,100	726.00	2,250,600	
7244	市光工業	6,000	130.00	780,000	
7276	小糸製作所	12,000	1,193.00	14,316,000	
7280	ミツバ	4,000	595.00	2,380,000	
7718	スター精密	4,100	749.00	3,070,900	
7735	大日本スクリーン製造	23,000	582.00	13,386,000	
7739	キヤノン電子	2,200	1,982.00	4,360,400	
7751	キヤノン	152,900	3,415.00	522,153,500	代用有価証券10,000株
7752	リコー	74,000	660.00	48,840,000	

7757	日本電産サンキョー	6,000	506.00	3,036,000	
7999	MUTOHホールディングス	3,000	124.00	372,000	
8035	東京エレクトロン	20,700	4,155.00	86,008,500	
3116	トヨタ紡織	8,600	905.00	7,783,000	

[次へ](#)

5196	鬼怒川ゴム工業	6,000	613.00	3,678,000	
5949	ユニプレス	3,900	2,106.00	8,213,400	
6201	豊田自動織機	22,400	2,163.00	48,451,200	
6455	モリタホールディングス	4,000	419.00	1,676,000	
6584	三櫻工業	3,100	563.00	1,745,300	
6902	デンソー	60,800	2,356.00	143,244,800	
6995	東海理化電機製作所	5,800	1,237.00	7,174,600	
7003	三井造船	95,000	121.00	11,495,000	
7007	佐世保重工業	16,000	120.00	1,920,000	
7012	川崎重工業	179,000	219.00	39,201,000	
7102	日本車輛製造	9,000	313.00	2,817,000	
7105	日本輸送機	3,000	217.00	651,000	
7122	近畿車輛	4,000	263.00	1,052,000	
7201	日産自動車	311,000	723.00	224,853,000	
7202	いすゞ自動車	156,000	337.00	52,572,000	
7203	トヨタ自動車	316,300	2,546.00	805,299,800	代用有価証券35,000株
7205	日野自動車	35,000	461.00	16,135,000	
7211	三菱自動車工業	550,000	100.00	55,000,000	
7212	エフテック	900	923.00	830,700	
7220	武蔵精密工業	2,400	1,805.00	4,332,000	
7221	トヨタ車体	4,400	1,142.00	5,024,800	
7222	日産車体	7,000	711.00	4,977,000	
7223	関東自動車工業	3,800	633.00	2,405,400	
7224	新明和工業	11,000	264.00	2,904,000	
7226	極東開発工業	4,300	429.00	1,844,700	
7230	日信工業	4,500	1,064.00	4,788,000	
7231	トピー工業	18,000	188.00	3,384,000	
7236	ティラド	9,000	272.00	2,448,000	
7238	曙ブレーキ工業	12,500	339.00	4,237,500	
7239	タチエス	3,200	1,366.00	4,371,200	
7240	NOK	11,900	1,315.00	15,648,500	
7241	フタバ産業	7,000	506.00	3,542,000	
7242	カヤバ工業	17,000	424.00	7,208,000	
7243	シロキ工業	5,000	225.00	1,125,000	
7245	大同メタル工業	4,000	753.00	3,012,000	
7246	プレス工業	11,000	338.00	3,718,000	
7248	カルソニックカンセイ	15,000	439.00	6,585,000	
7250	太平洋工業	5,000	354.00	1,770,000	
7251	ケーヒン	5,100	1,210.00	6,171,000	
7256	河西工業	3,000	440.00	1,320,000	
7259	アイシン精機	20,300	2,457.00	49,877,100	
7260	富士機工	3,000	224.00	672,000	
7261	マツダ	204,000	152.00	31,008,000	
7262	ダイハツ工業	23,000	1,385.00	31,855,000	
7263	愛知機械工業	6,000	226.00	1,356,000	
7266	今仙電機製作所	1,800	916.00	1,648,800	
7267	本田技研工業	207,700	2,371.00	492,456,700	
7269	スズキ	51,500	1,640.00	84,460,000	
7270	富士重工業	78,000	478.00	37,284,000	

7272	ヤマハ発動機	40,100	1,106.00	44,350,600	
7274	ショーワ	5,300	447.00	2,369,100	
7277	T B K	3,000	338.00	1,014,000	
7278	エクセディ	3,300	2,355.00	7,771,500	
7282	豊田合成	6,900	1,349.00	9,308,100	
7283	愛三工業	2,600	688.00	1,788,800	
7294	ヨロズ	1,500	1,849.00	2,773,500	
7296	エフ・シー・シー	4,000	1,662.00	6,648,000	
7309	シマノ	9,300	3,845.00	35,758,500	
7312	タカタ	4,400	1,793.00	7,889,200	
7313	テイ・エス テック	5,200	1,081.00	5,621,200	
7728	日本電産トーソク	1,200	895.00	1,074,000	
4543	テルモ	19,300	3,780.00	72,954,000	
5187	クリエートメディック	700	798.00	558,600	
6376	日機装	8,000	653.00	5,224,000	
7701	島津製作所	29,000	643.00	18,647,000	
7702	J M S	4,000	246.00	984,000	
7714	モリテックス	600	325.00	195,000	
7715	長野計器	1,700	750.00	1,275,000	
7717	ブイ・テクノロジー	3	329,500.00	988,500	
7721	東京計器	9,000	122.00	1,098,000	
7723	愛知時計電機	3,000	244.00	732,000	
7729	東京精密	4,400	1,413.00	6,217,200	
7731	ニコン	42,900	1,799.00	77,177,100	
7732	トプコン	5,800	400.00	2,320,000	
7733	オリンパス	29,100	1,034.00	30,089,400	
7734	理研計器	2,000	545.00	1,090,000	
7740	タムロン	2,200	2,107.00	4,635,400	
7741	H O Y A	59,800	1,630.00	97,474,000	
7744	ノーリツ鋼機	2,300	354.00	814,200	
7745	エー・アンド・デイ	2,400	294.00	705,600	
7756	日本電産コパル	1,900	827.00	1,571,300	
7762	シチズンホールディングス	29,600	405.00	11,988,000	
7769	リズム時計工業	11,000	107.00	1,177,000	
7775	大研医器	300	784.00	235,200	
8050	セイコーホールディングス	14,000	191.00	2,674,000	
8086	ニプロ	9,700	675.00	6,547,500	
7817	パラマウントベッドホールディングス	2,200	1,855.00	4,081,000	
7819	S H O - B I	500	454.00	227,000	
7825	S R I スポーツ	1,500	837.00	1,255,500	
7832	パンダイナムコホールディングス	26,400	1,151.00	30,386,400	
7838	共立印刷	3,100	159.00	492,900	
7840	フランスベッドホールディングス	17,000	118.00	2,006,000	
7846	パイロットコーポレーション	21	158,900.00	3,336,900	
7862	トッパン・フォームズ	5,200	598.00	3,109,600	
7864	フジシールインターナショナル	2,800	1,448.00	4,054,400	
7867	タカラトミー	8,100	536.00	4,341,600	



7868	廣済堂	2,300	199.00	457,700	
7885	タカノ	1,000	447.00	447,000	
7893	プロネクサス	2,700	390.00	1,053,000	
7897	ホクシン	2,000	137.00	274,000	
7898	ウッドワン	4,000	281.00	1,124,000	
7905	大建工業	10,000	240.00	2,400,000	
7911	凸版印刷	75,000	573.00	42,975,000	
7912	大日本印刷	75,000	795.00	59,625,000	
7913	図書印刷	4,000	150.00	600,000	
7914	共同印刷	8,000	182.00	1,456,000	
7915	日本写真印刷	4,200	930.00	3,906,000	
7916	光村印刷	3,000	247.00	741,000	
7921	宝印刷	1,400	606.00	848,400	
7936	アシックス	23,000	966.00	22,218,000	
7937	ツツミ	1,200	1,756.00	2,107,200	
7944	ローランド	2,600	653.00	1,697,800	
7949	小松ウオール工業	1,000	741.00	741,000	
7951	ヤマハ	18,200	746.00	13,577,200	
7952	河合楽器製作所	9,000	155.00	1,395,000	
7955	クリナップ	2,900	490.00	1,421,000	
7956	ビジョン	2,200	2,905.00	6,391,000	
7961	兼松日産農林	4,000	150.00	600,000	
7962	キングジム	2,100	563.00	1,182,300	
7966	リンテック	4,700	1,543.00	7,252,100	
7968	田崎真珠	6,000	50.00	300,000	
7972	イトーキ	5,400	174.00	939,600	
7974	任天堂	14,100	12,100.00	170,610,000	
7976	三菱鉛筆	2,100	1,303.00	2,736,300	
7981	タカラスタンド	11,000	564.00	6,204,000	
7984	コクヨ	12,800	571.00	7,308,800	
7987	ナカバヤシ	6,000	182.00	1,092,000	
7994	岡村製作所	9,000	474.00	4,266,000	
8022	美津濃	12,000	390.00	4,680,000	
8170	アデランス	3,100	830.00	2,573,000	
9501	東京電力	196,800	319.00	62,779,200	
9502	中部電力	81,100	1,374.00	111,431,400	
9503	関西電力	100,500	1,148.00	115,374,000	
9504	中国電力	34,000	1,148.00	39,032,000	
9505	北陸電力	24,100	1,220.00	29,402,000	
9506	東北電力	61,600	823.00	50,696,800	
9507	四国電力	22,700	1,939.00	44,015,300	
9508	九州電力	54,400	1,041.00	56,630,400	
9509	北海道電力	23,100	986.00	22,776,600	
9511	沖縄電力	1,500	3,165.00	4,747,500	
9513	電源開発	15,300	1,963.00	30,033,900	
9531	東京瓦斯	297,000	323.00	95,931,000	
9532	大阪瓦斯	239,000	290.00	69,310,000	
9533	東邦瓦斯	63,000	455.00	28,665,000	
9534	北海道瓦斯	4,000	254.00	1,016,000	

9536	西部瓦斯	28,000	192.00	5,376,000	
9543	静岡瓦斯	6,500	475.00	3,087,500	
9001	東武鉄道	140,000	372.00	52,080,000	
9003	相鉄ホールディングス	39,000	235.00	9,165,000	
9005	東京急行電鉄	145,000	373.00	54,085,000	
9006	京浜急行電鉄	63,000	702.00	44,226,000	
9007	小田急電鉄	79,000	737.00	58,223,000	
9008	京王電鉄	69,000	525.00	36,225,000	
9009	京成電鉄	40,000	525.00	21,000,000	
9010	富士急行	7,000	448.00	3,136,000	
9020	東日本旅客鉄道	42,800	4,670.00	199,876,000	
9021	西日本旅客鉄道	21,400	3,265.00	69,871,000	
9022	東海旅客鉄道	214	660,000.00	141,240,000	
9031	西日本鉄道	32,000	360.00	11,520,000	
9037	ハマキョウレックス	700	2,088.00	1,461,600	
9039	サカイ引越センター	400	1,623.00	649,200	
9041	近畿日本鉄道	223,000	273.00	60,879,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	165,000	331.00	54,615,000	
9044	南海電気鉄道	52,000	321.00	16,692,000	
9045	京阪電気鉄道	55,000	359.00	19,745,000	
9047	名糖運輸	1,100	589.00	647,900	
9048	名古屋鉄道	86,000	203.00	17,458,000	
9062	日本通運	97,000	308.00	29,876,000	
9064	ヤマトホールディングス	50,100	1,305.00	65,380,500	
9065	山九	30,000	303.00	9,090,000	
9067	丸運	1,300	191.00	248,300	
9068	丸全昭和運輸	8,000	259.00	2,072,000	
9069	センコー	10,000	305.00	3,050,000	
9070	トナミホールディングス	5,000	147.00	735,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	7,400	778.00	5,757,200	
9074	日本石油輸送	3,000	186.00	558,000	
9075	福山通運	15,000	399.00	5,985,000	
9076	セイノーホールディングス	19,000	578.00	10,982,000	
9081	神奈川中央交通	3,000	408.00	1,224,000	
9086	日立物流	5,100	1,429.00	7,287,900	
9101	日本郵船	195,000	191.00	37,245,000	
9104	商船三井	129,000	278.00	35,862,000	
9107	川崎汽船	76,000	148.00	11,248,000	
9110	NSユナイテッド海運	11,000	113.00	1,243,000	
9113	乾汽船	2,700	302.00	815,400	
9115	明治海運	2,300	215.00	494,500	
9119	飯野海運	11,900	390.00	4,641,000	
9130	共栄タンカー	3,000	111.00	333,000	
9132	第一中央汽船	16,000	104.00	1,664,000	
9202	全日本空輸	329,000	233.00	76,657,000	
9232	パスコ	3,000	244.00	732,000	
9234	国際航業ホールディングス	2,000	217.00	434,000	
9066	日新	9,000	182.00	1,638,000	
9301	三菱倉庫	18,000	850.00	15,300,000	

9302	三井倉庫	11,000	278.00	3,058,000	
9303	住友倉庫	18,000	346.00	6,228,000	
9304	澁澤倉庫	6,000	222.00	1,332,000	
9306	東陽倉庫	4,000	164.00	656,000	
9310	日本トランスシティ	5,000	233.00	1,165,000	
9312	ケイヒン	5,000	90.00	450,000	
9324	安田倉庫	1,900	446.00	847,400	
9351	東洋埠頭	7,000	128.00	896,000	
9358	宇徳	1,900	260.00	494,000	
9364	上組	27,000	672.00	18,144,000	
9366	サンリツ	700	522.00	365,400	
9368	キムラユニティー	500	684.00	342,000	
9369	キューソー流通システム	800	870.00	696,000	
9370	郵船ロジスティクス	2,000	1,050.00	2,100,000	
9375	近鉄エクスプレス	2,200	2,240.00	4,928,000	
9380	東海運	1,700	187.00	317,900	
1973	NEC ネットエスアイ	2,300	1,136.00	2,612,800	
2317	システナ	29	47,200.00	1,368,800	
2327	新日鉄ソリューションズ	1,600	1,710.00	2,736,000	
2359	コア	1,000	629.00	629,000	
3371	ソフトクリエイト	300	1,089.00	326,700	
3620	デジタルハーツ	2	149,800.00	299,600	
3626	ITホールディングス	7,400	869.00	6,430,600	
3632	グリー	10,600	2,804.00	29,722,400	
3635	コーエーテクモホールディングス	4,800	735.00	3,528,000	
3636	三菱総合研究所	1,000	1,325.00	1,325,000	
3639	ボルテージ	300	1,081.00	324,300	
3715	ダウンゴ	12	136,800.00	1,641,600	
3724	ベリサーブ	2	146,100.00	292,200	
3730	マクロミル	2,800	900.00	2,520,000	
3738	ティーガイア	16	149,600.00	2,393,600	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	5	391,000.00	1,955,000	
3770	ザッパラス	13	76,400.00	993,200	
3774	インターネットイニシアティブ	14	287,800.00	4,029,200	
3789	ソネットエンタテインメント	14	290,200.00	4,062,800	
3817	SRAホールディングス	1,200	756.00	907,200	
3820	JBSホールディングス	2,600	243.00	631,800	
3834	朝日ネット	2,000	352.00	704,000	
4283	パナソニック電工インフォメーションシステ	600	2,130.00	1,278,000	
4295	フェイス	85	8,350.00	709,750	
4307	野村総合研究所	13,700	1,840.00	25,208,000	
4312	サイバネットシステム	21	20,000.00	420,000	
4326	インテージ	700	1,524.00	1,066,800	
4340	シンプレクス・ホールディングス	41	31,200.00	1,279,200	
4344	ソースネクスト	8	17,230.00	137,840	
4674	クレスコ	700	515.00	360,500	

4676	フジ・メディア・ホールディングス	253	113,000.00	28,589,000	
4684	オービック	760	14,910.00	11,331,600	

[次へ](#)

4687	ティーディーシーソフトウェアエンジニアリ	500	725.00	362,500	
4689	ヤフー	1,777	24,210.00	43,021,170	
4704	トレンドマイクロ	10,700	2,739.00	29,307,300	
4716	日本オラクル	3,900	2,725.00	10,627,500	
4719	アルファシステムズ	700	1,090.00	763,000	
4722	フューチャーアーキテクト	29	32,000.00	928,000	
4725	シーエーシー	1,700	595.00	1,011,500	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	600	655.00	393,000	
4728	トーセ	700	506.00	354,200	
4733	オービックビジネスコンサルタント	600	3,725.00	2,235,000	
4738	日立ビジネスソリューション	800	995.00	796,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	2,900	3,490.00	10,121,000	
4743	アイティフォー	2,800	291.00	814,800	
4746	東計電算	400	1,121.00	448,400	
4762	エックスネット	2	115,500.00	231,000	
4768	大塚商会	1,900	5,590.00	10,621,000	
4776	サイボウズ	46	19,320.00	888,720	
4779	ソフトブレイン	40	7,750.00	310,000	
4799	アグレックス	700	745.00	521,500	
4812	電通国際情報サービス	1,500	717.00	1,075,500	
4825	ウェザーニューズ	800	2,577.00	2,061,600	
4826	C I J	2,400	265.00	636,000	
4839	WOWOW	7	167,200.00	1,170,400	
6791	日本コロムビア	26,000	29.00	754,000	
7518	ネットワンシステムズ	55	224,100.00	12,325,500	
7595	アルゴグラフィックス	900	993.00	893,700	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	4,600	906.00	4,167,600	
8056	日本ユニシス	5,900	448.00	2,643,200	
8096	兼松エレクトロニクス	1,500	775.00	1,162,500	
9401	東京放送ホールディングス	14,600	974.00	14,220,400	
9404	日本テレビ放送網	2,130	11,230.00	23,919,900	
9409	テレビ朝日	61	124,000.00	7,564,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	184	42,050.00	7,737,200	
9413	テレビ東京ホールディングス	1,500	1,136.00	1,704,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	2,100	481.00	1,010,100	
9427	イー・アクセス	186	21,960.00	4,084,560	
9430	N E C モバイリング	900	2,615.00	2,353,500	
9432	日本電信電話	111,900	3,980.00	445,362,000	代用有価証券12,300株
9433	K D D I	377	598,000.00	225,446,000	
9435	光通信	2,200	1,774.00	3,902,800	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,001	139,700.00	279,539,700	
9449	G M O インターネット	7,300	333.00	2,430,900	
9470	学研ホールディングス	8,000	147.00	1,176,000	
9474	ゼンリン	3,500	682.00	2,387,000	
9475	昭文社	1,400	576.00	806,400	

9477	角川グループホールディングス	2,300	2,577.00	5,927,100	
9479	インプレスホールディングス	2,400	85.00	204,000	
9600	アイネット	1,100	445.00	489,500	
9601	松竹	16,000	719.00	11,504,000	
9602	東宝	17,300	1,362.00	23,562,600	
9605	東映	10,000	364.00	3,640,000	
9607	葵プロモーション	1,000	404.00	404,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	150	259,000.00	38,850,000	
9682	D T S	2,500	923.00	2,307,500	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	1,600.00	12,800,000	
9692	シーイーシー	1,500	363.00	544,500	
9697	カプコン	4,700	2,142.00	10,067,400	
9717	ジャステック	1,600	513.00	820,800	
9719	S C S K	5,000	1,215.00	6,075,000	
9739	日本システムウエア	800	291.00	232,800	
9742	アイネス	3,000	540.00	1,620,000	
9746	T K C	2,000	1,507.00	3,014,000	
9749	富士ソフト	3,300	1,260.00	4,158,000	
9759	N S D	4,700	593.00	2,787,100	
9766	コナミ	11,000	2,590.00	28,490,000	
9790	福井コンピュータ	400	350.00	140,000	
9889	J B C Cホールディングス	1,900	514.00	976,600	
9984	ソフトバンク	110,100	2,568.00	282,736,800	
1352	ハウスイ	2,000	96.00	192,000	
2657	インターニックス	1,000	340.00	340,000	
2676	高千穂交易	1,000	865.00	865,000	
2692	伊藤忠食品	600	2,705.00	1,623,000	
2715	エレマテック	1,900	1,277.00	2,426,300	
2729	J A L U X	700	720.00	504,000	
2737	トーメンデバイス	300	1,730.00	519,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	5	136,000.00	680,000	
2768	双日	162,700	135.00	21,964,500	
2784	アルフレッサ ホールディングス	6,300	2,960.00	18,648,000	
2874	横浜冷凍	5,600	590.00	3,304,000	
3004	神栄	3,000	131.00	393,000	
3022	山下医科器械	200	984.00	196,800	
3023	ラサ商事	1,100	329.00	361,900	
3036	アルコニックス	700	1,691.00	1,183,700	
3076	あい ホールディングス	4,200	333.00	1,398,600	
3107	ダイワボウホールディングス	24,000	193.00	4,632,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,600	591.00	2,718,600	
3156	U K Cホールディングス	1,400	755.00	1,057,000	
3167	T O K A Iホールディングス	11,800	400.00	4,720,000	
3321	ミタチ産業	500	380.00	190,000	
3332	J F E 商事ホールディングス	16,000	332.00	5,312,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	3,200	1,965.00	6,288,000	

5009	富士興産	9,000	67.00	603,000	
6973	協栄産業	3,000	135.00	405,000	
7414	小野建	2,000	643.00	1,286,000	
7420	佐島電機	1,700	481.00	817,700	
7427	エコートレーディング	600	707.00	424,200	
7433	伯東	1,400	710.00	994,000	
7438	コンドーテック	900	868.00	781,200	
7442	中山福	1,300	589.00	765,700	
7447	ナガイレーベン	3,200	1,100.00	3,520,000	
7451	三菱食品	2,200	1,811.00	3,984,200	
7456	松田産業	1,800	1,107.00	1,992,600	
7459	メディパルホールディングス	26,200	755.00	19,781,000	
7463	アドヴァン	1,500	705.00	1,057,500	
7466	S P K	600	1,284.00	770,400	
7476	アズワン	1,600	1,545.00	2,472,000	
7480	スズデン	800	501.00	400,800	
7482	シモジマ	1,500	957.00	1,435,500	
7483	ドウシシャ	1,100	2,024.00	2,226,400	
7504	高速	1,500	615.00	922,500	
7517	黒田電気	2,900	827.00	2,398,300	
7537	丸文	1,900	311.00	590,900	
7552	ハピネット	700	1,355.00	948,500	
7558	トーマンエレクトロニクス	1,100	930.00	1,023,000	
7591	エクセル	1,100	723.00	795,300	
7594	マルカキカイ	800	671.00	536,800	
7599	ガリバーインターナショナル	740	3,400.00	2,516,000	
7600	日本エム・ディ・エム	2,200	172.00	378,400	
7607	進和	1,400	899.00	1,258,600	
7608	エスケイジャパン	700	239.00	167,300	
7609	ダイトエレクトロン	1,100	502.00	552,200	
7613	シークス	1,500	993.00	1,489,500	
7619	田中商事	800	393.00	314,400	
7628	オーハシテクニカ	1,300	560.00	728,000	
7631	マクニカ	1,200	1,674.00	2,008,800	
7637	白銅	800	750.00	600,000	
8001	伊藤忠商事	193,700	808.00	156,509,600	
8002	丸紅	213,000	477.00	101,601,000	
8007	高島	5,000	172.00	860,000	
8008	F & A アクアホールディングス	1,900	770.00	1,463,000	
8012	長瀬産業	13,700	838.00	11,480,600	
8014	蝶理	14,000	88.00	1,232,000	
8015	豊田通商	27,000	1,277.00	34,479,000	
8018	三共生興	4,100	257.00	1,053,700	
8020	兼松	51,000	71.00	3,621,000	
8025	ツカモトコーポレーション	5,000	86.00	430,000	
8031	三井物産	209,700	1,162.00	243,671,400	
8032	日本紙パルプ商事	13,000	262.00	3,406,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	7,400	1,666.00	12,328,400	
8037	カメイ	3,000	519.00	1,557,000	

8038	東都水産	5,000	139.00	695,000	
8043	スターゼン	8,000	227.00	1,816,000	
8051	山善	9,400	557.00	5,235,800	
8052	椿本興業	3,000	207.00	621,000	
8053	住友商事	143,200	1,055.00	151,076,000	
8057	内田洋行	6,000	218.00	1,308,000	
8058	三菱商事	176,900	1,617.00	286,047,300	
8059	第一実業	5,000	325.00	1,625,000	
8060	キャノンマーケティングジャ パン	8,100	896.00	7,257,600	
8061	西華産業	9,000	201.00	1,809,000	
8065	佐藤商事	2,100	445.00	934,500	
8068	菱洋エレクトロ	2,700	717.00	1,935,900	
8070	東京産業	2,500	245.00	612,500	
8074	ユアサ商事	25,000	110.00	2,750,000	
8075	神鋼商事	6,000	180.00	1,080,000	
8078	阪和興業	24,000	334.00	8,016,000	
8081	カナデン	3,000	498.00	1,494,000	
8084	菱電商事	4,000	441.00	1,764,000	
8087	フルサト工業	1,500	607.00	910,500	
8088	岩谷産業	27,000	273.00	7,371,000	
8089	すてきなイスグループ	11,000	161.00	1,771,000	
8090	昭光通商	9,000	116.00	1,044,000	
8091	ニチモウ	4,000	146.00	584,000	
8093	極東貿易	3,000	194.00	582,000	
8095	イワキ	4,000	194.00	776,000	
8097	三愛石油	6,000	346.00	2,076,000	
8098	稲畑産業	6,400	435.00	2,784,000	
8101	G S Iクレオス	6,000	99.00	594,000	
8103	明和産業	2,000	223.00	446,000	
8129	東邦ホールディングス	7,800	1,049.00	8,182,200	
8130	サンゲツ	4,300	2,006.00	8,625,800	
8131	ミツウロコグループホールディ ングス	3,900	459.00	1,790,100	
8132	シナネン	5,000	352.00	1,760,000	
8133	伊藤忠エネクス	5,300	425.00	2,252,500	
8136	サンリオ	6,200	4,100.00	25,420,000	
8137	サンワテクノス	1,200	655.00	786,000	
8140	リョーサン	3,900	1,697.00	6,618,300	
8141	新光商事	2,600	612.00	1,591,200	
8142	トーホー	5,000	304.00	1,520,000	
8150	三信電気	3,400	628.00	2,135,200	
8151	東陽テクニカ	3,500	826.00	2,891,000	
8153	モスフードサービス	3,200	1,486.00	4,755,200	
8154	加賀電子	2,600	759.00	1,973,400	
8158	ソーダニッカ	3,000	340.00	1,020,000	
8159	立花エレテック	1,400	596.00	834,400	
8283	P a l t a c	1,700	1,369.00	2,327,300	
8835	太平洋興発	9,000	67.00	603,000	



9305	ヤマタネ	13,000	122.00	1,586,000	
9763	丸紅建材リース	3,000	138.00	414,000	
9810	日鐵商事	5,000	202.00	1,010,000	
9830	トラスコ中山	3,000	1,448.00	4,344,000	
9832	オートボックスセブン	2,900	3,610.00	10,469,000	
9869	加藤産業	3,500	1,506.00	5,271,000	
9880	イノテック	1,500	565.00	847,500	
9882	イエローハット	2,300	1,083.00	2,490,900	
9883	富士エレクトロニクス	1,200	1,050.00	1,260,000	
9896	J Kホールディングス	2,100	340.00	714,000	
9902	日伝	1,000	2,583.00	2,583,000	
9930	北沢産業	2,500	153.00	382,500	
9932	杉本商事	1,300	702.00	912,600	
9934	因幡電機産業	2,800	2,281.00	6,386,800	
9938	住金物産	11,000	173.00	1,903,000	
9962	ミスミグループ本社	9,000	1,673.00	15,057,000	
9963	江守商事	400	876.00	350,400	
9972	アルテック	1,300	183.00	237,900	
9982	タキヒヨー	4,000	422.00	1,688,000	
9987	スズケン	9,300	1,952.00	18,153,600	
9991	ジェコス	1,700	303.00	515,100	
2651	ローソン	7,600	4,450.00	33,820,000	
2659	サンエー	800	3,050.00	2,440,000	
2660	キリン堂	1,100	485.00	533,500	
2662	ダイユーエイト	400	654.00	261,600	
2664	カワチ薬品	1,700	1,563.00	2,657,100	
2670	エービーシー・マート	3,400	3,040.00	10,336,000	
2674	ハードオフコーポレーション	1,200	444.00	532,800	
2678	アスクル	1,900	1,107.00	2,103,300	
2681	ゲオホールディングス	40	84,000.00	3,360,000	
2685	ポイント	2,050	3,340.00	6,847,000	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	98.00	196,000	
2695	くらコーポレーション	1,300	977.00	1,270,100	
2698	キャンドゥ	14	85,900.00	1,202,600	
2726	バル	700	2,929.00	2,050,300	
2730	エディオン	9,700	618.00	5,994,600	
2734	サーラコーポレーション	2,000	470.00	940,000	
2738	パルス	12	99,000.00	1,188,000	
2753	あみやき亭	4	192,800.00	771,200	
2764	ひらまつ	11	54,500.00	599,500	
2772	ゲンキー	200	1,625.00	325,000	
2792	ハニーズ	2,160	1,109.00	2,395,440	
3028	アルペン	1,600	1,304.00	2,086,400	
3048	ビックカメラ	92	41,800.00	3,845,600	
3050	D C Mホールディングス	12,600	613.00	7,723,800	
3064	MonotaRO	1,400	813.00	1,138,200	
3086	J . フロント リテイリング	58,000	346.00	20,068,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	3,800	958.00	3,640,400	

3088	マツモトキヨシホールディングス	4,500	1,472.00	6,624,000	
3097	物語コーポレーション	300	1,319.00	395,700	
3098	ココカラファイン	2,500	2,003.00	5,007,500	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	48,300	798.00	38,543,400	
3148	クリエイトSDホールディングス	1,000	1,622.00	1,622,000	
3159	丸善CHIHホールディングス	900	195.00	175,500	
3313	ブックオフコーポレーション	1,400	666.00	932,400	
3333	あさひ	1,400	1,705.00	2,387,000	
3337	サークルKサンクス	5,300	1,284.00	6,805,200	
3341	日本調剤	300	2,755.00	826,500	
3349	コスモス薬品	1,200	3,750.00	4,500,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	101,600	2,127.00	216,103,200	
3391	ツルハホールディングス	2,200	4,025.00	8,855,000	
3395	サンマルクホールディングス	700	2,900.00	2,030,000	
3396	フェリシモ	700	1,018.00	712,600	
3397	トリドール	2,100	754.00	1,583,400	
3398	クスリのアオキ	400	1,324.00	529,600	
4350	メディカルシステムネットワーク	400	861.00	344,400	
4775	総合メディカル	600	2,630.00	1,578,000	
7416	はるやま商事	1,100	364.00	400,400	
7421	カップ・クリエイト	1,750	1,687.00	2,952,250	
7445	ライトオン	1,900	506.00	961,400	
7448	ジーンズメイト	1,100	185.00	203,500	
7453	良品計画	2,600	3,565.00	9,269,000	
7455	三城ホールディングス	3,100	633.00	1,962,300	
7494	コナカ	3,000	271.00	813,000	
7506	ハウスオブローゼ	300	1,229.00	368,700	
7508	G-7ホールディングス	700	376.00	263,200	
7512	イオン北海道	1,500	332.00	498,000	
7513	コジマ	3,300	563.00	1,857,900	
7516	コーナン商事	2,500	1,347.00	3,367,500	
7520	エコス	900	457.00	411,300	
7522	ワタミ	2,900	1,861.00	5,396,900	
7524	マルシェ	700	695.00	486,500	
7532	ドン・キホーテ	4,700	2,874.00	13,507,800	
7541	メガネトップ	3,500	972.00	3,402,000	
7545	西松屋チェーン	5,300	586.00	3,105,800	
7550	ゼンショーホールディングス	9,300	984.00	9,151,200	
7554	幸楽苑	1,500	1,135.00	1,702,500	
7561	ハークスレイ	500	505.00	252,500	
7581	サイゼリヤ	3,600	1,240.00	4,464,000	
7601	ポプラ	800	428.00	342,400	
7606	ユナイテッドアローズ	2,600	1,535.00	3,991,000	
7611	ハイデイ日高	1,000	1,170.00	1,170,000	
7615	京都きもの友禅	1,700	930.00	1,581,000	
7616	コロワイド	8,000	502.00	4,016,000	

7630	壹番屋	1,000	2,348.00	2,348,000	
7640	トップカルチャー	900	358.00	322,200	
7649	スギホールディングス	4,300	2,118.00	9,107,400	
8005	スクロール	3,100	262.00	812,200	
8028	ファミリーマート	7,400	3,045.00	22,533,000	
8160	木曽路	2,800	1,407.00	3,939,600	
8165	千趣会	4,400	525.00	2,310,000	
8166	タカキュー	2,000	136.00	272,000	
8168	ケーヨー	4,600	462.00	2,125,200	
8173	上新電機	5,000	852.00	4,260,000	
8174	日本瓦斯	2,300	1,150.00	2,645,000	
8175	ベスト電器	7,500	214.00	1,605,000	
8178	マルエツ	5,000	276.00	1,380,000	
8179	ロイヤルホールディングス	4,100	893.00	3,661,300	
8181	東天紅	2,000	114.00	228,000	
8182	いなげや	2,700	902.00	2,435,400	
8184	島忠	5,500	1,730.00	9,515,000	
8185	チヨダ	3,200	1,377.00	4,406,400	
8194	ライフコーポレーション	1,500	1,420.00	2,130,000	
8196	カスミ	5,000	484.00	2,420,000	
8200	リンガーハット	2,200	1,064.00	2,340,800	
8201	さが美	3,000	76.00	228,000	
8203	M r M a x	2,500	304.00	760,000	
8207	テンアライド	2,100	255.00	535,500	
8214	A O K Iホールディングス	2,200	1,053.00	2,316,600	
8217	オークワ	3,000	1,125.00	3,375,000	
8218	コメリ	3,300	2,511.00	8,286,300	
8219	青山商事	6,700	1,272.00	8,522,400	
8227	しまむら	2,800	7,880.00	22,064,000	
8229	C F Sコーポレーション	1,500	326.00	489,000	
8233	高島屋	33,000	568.00	18,744,000	
8237	松屋	5,000	455.00	2,275,000	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	13,000	580.00	7,540,000	
8245	丸栄	5,000	82.00	410,000	
8248	ニッセンホールディングス	4,900	480.00	2,352,000	
8251	パルコ	4,400	565.00	2,486,000	
8252	丸井グループ	31,900	593.00	18,916,700	
8255	原信ナルスホールディングス	1,400	1,239.00	1,734,600	
8263	ダイエー	15,250	301.00	4,590,250	
8266	イズミヤ	9,000	380.00	3,420,000	
8267	イオン	85,700	1,047.00	89,727,900	
8270	ユニー	18,300	703.00	12,864,900	
8273	イズミ	7,300	1,214.00	8,862,200	
8274	東武ストア	3,000	258.00	774,000	
8276	平和堂	4,500	967.00	4,351,500	
8278	フジ	2,700	1,701.00	4,592,700	
8279	ヤオコー	1,100	2,669.00	2,935,900	
8281	ゼビオ	2,900	1,930.00	5,597,000	

8282	ケースホールディングス	6,100	3,335.00	20,343,500	
8289	O l y m p i c	1,700	705.00	1,198,500	
8291	日産東京販売ホールディングス	4,000	122.00	488,000	
9627	アインファーマシーズ	1,300	3,200.00	4,160,000	
9828	元気寿司	800	964.00	771,200	
9831	ヤマダ電機	11,820	5,870.00	69,383,400	
9842	アークランドサカモト	1,600	1,436.00	2,297,600	
9843	ニトリホールディングス	4,800	7,520.00	36,096,000	
9854	愛眼	2,100	384.00	806,400	
9861	吉野家ホールディングス	66	101,300.00	6,685,800	
9887	松屋フーズ	1,100	1,483.00	1,631,300	
9900	サガミチェーン	3,000	510.00	1,530,000	
9945	ブレナス	2,700	1,218.00	3,288,600	
9946	ミニストップ	1,800	1,347.00	2,424,600	
9948	アークス	3,382	1,418.00	4,795,676	
9956	パロー	4,800	1,155.00	5,544,000	
9974	ベルク	1,200	1,125.00	1,350,000	
9979	大庄	1,200	950.00	1,140,000	
9983	ファーストリテイリング	5,700	13,290.00	75,753,000	
9989	サンドラッグ	4,600	2,342.00	10,773,200	
9993	ヤマザワ	600	1,350.00	810,000	
9994	やまや	400	831.00	332,400	
9997	ベルーナ	3,050	575.00	1,753,750	
8303	新生銀行	190,000	84.00	15,960,000	
8304	あおぞら銀行	76,000	208.00	15,808,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,839,200	342.00	629,006,400	
8308	りそなホールディングス	211,400	352.00	74,412,800	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	476,000	259.00	123,284,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	183,700	2,170.00	398,629,000	
8324	第四銀行	32,000	252.00	8,064,000	
8325	北越銀行	25,000	148.00	3,700,000	
8327	西日本シティ銀行	85,000	212.00	18,020,000	
8328	札幌北洋ホールディングス	36,700	265.00	9,725,500	
8331	千葉銀行	96,000	500.00	48,000,000	
8332	横浜銀行	156,000	371.00	57,876,000	
8333	常陽銀行	94,000	343.00	32,242,000	
8334	群馬銀行	55,000	422.00	23,210,000	
8336	武蔵野銀行	3,900	2,571.00	10,026,900	
8337	千葉興業銀行	4,600	435.00	2,001,000	
8338	筑波銀行	10,200	264.00	2,692,800	
8339	東京都民銀行	4,600	922.00	4,241,200	
8341	七十七銀行	38,000	319.00	12,122,000	
8342	青森銀行	18,000	235.00	4,230,000	
8343	秋田銀行	17,000	234.00	3,978,000	
8344	山形銀行	15,000	382.00	5,730,000	
8345	岩手銀行	1,600	3,615.00	5,784,000	
8346	東邦銀行	20,000	207.00	4,140,000	

8349	東北銀行	13,000	125.00	1,625,000	
8350	みちのく銀行	12,000	154.00	1,848,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	309.00	30,591,000	
8355	静岡銀行	73,000	799.00	58,327,000	
8356	十六銀行	30,000	241.00	7,230,000	
8358	スルガ銀行	24,000	694.00	16,656,000	
8359	八十二銀行	45,000	446.00	20,070,000	
8360	山梨中央銀行	15,000	319.00	4,785,000	
8361	大垣共立銀行	32,000	251.00	8,032,000	
8362	福井銀行	21,000	235.00	4,935,000	
8363	北國銀行	29,000	276.00	8,004,000	
8364	清水銀行	800	3,095.00	2,476,000	
8366	滋賀銀行	23,000	519.00	11,937,000	
8367	南都銀行	23,000	441.00	10,143,000	
8368	百五銀行	22,000	306.00	6,732,000	
8369	京都銀行	43,000	681.00	29,283,000	
8374	三重銀行	10,000	181.00	1,810,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	170,000	150.00	25,500,000	
8379	広島銀行	72,000	363.00	26,136,000	
8381	山陰合同銀行	14,000	589.00	8,246,000	
8382	中国銀行	20,000	1,069.00	21,380,000	
8383	鳥取銀行	8,000	163.00	1,304,000	
8385	伊予銀行	26,000	752.00	19,552,000	
8386	百十四銀行	27,000	313.00	8,451,000	
8387	四国銀行	18,000	288.00	5,184,000	
8388	阿波銀行	21,000	539.00	11,319,000	
8390	鹿児島銀行	16,000	520.00	8,320,000	
8392	大分銀行	16,000	226.00	3,616,000	
8393	宮崎銀行	16,000	170.00	2,720,000	
8394	肥後銀行	19,000	431.00	8,189,000	
8395	佐賀銀行	15,000	195.00	2,925,000	
8396	十八銀行	16,000	208.00	3,328,000	
8397	沖縄銀行	1,800	3,285.00	5,913,000	
8399	琉球銀行	5,100	974.00	4,967,400	
8409	八千代銀行	1,300	2,006.00	2,607,800	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,119,300	109.00	340,003,700	
8415	紀陽ホールディングス	96,000	115.00	11,040,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	24,000	719.00	17,256,000	
8521	長野銀行	8,000	160.00	1,280,000	
8522	名古屋銀行	22,000	253.00	5,566,000	
8527	愛知銀行	900	4,450.00	4,005,000	
8529	第三銀行	14,000	167.00	2,338,000	
8530	中京銀行	10,000	197.00	1,970,000	
8536	東日本銀行	11,000	162.00	1,782,000	
8537	大光銀行	9,000	221.00	1,989,000	
8541	愛媛銀行	15,000	230.00	3,450,000	
8542	トマト銀行	9,000	136.00	1,224,000	

8543	みなと銀行	22,000	139.00	3,058,000	
8544	京葉銀行	20,000	388.00	7,760,000	
8545	関西アーバン銀行	34,000	144.00	4,896,000	
8550	栃木銀行	12,000	278.00	3,336,000	
8551	北日本銀行	800	1,845.00	1,476,000	

[次へ](#)

8558	東和銀行	24,000	92.00	2,208,000	
8562	福島銀行	29,000	38.00	1,102,000	
8563	大東銀行	17,000	57.00	969,000	
8600	トモニホールディングス	18,600	320.00	5,952,000	
8713	フィデアホールディングス	14,000	212.00	2,968,000	
8714	池田泉州ホールディングス	99,900	115.00	11,488,500	
8473	S B Iホールディングス	2,582	6,230.00	16,085,860	
8595	ジャフコ	3,100	1,602.00	4,966,200	
8601	大和証券グループ本社	241,000	270.00	65,070,000	
8604	野村ホールディングス	526,000	288.00	151,488,000	
8609	岡三証券グループ	21,000	236.00	4,956,000	
8613	丸三証券	8,300	276.00	2,290,800	
8614	東洋証券	9,000	117.00	1,053,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,000	218.00	6,104,000	
8617	光世証券	7,000	58.00	406,000	
8622	水戸証券	8,000	99.00	792,000	
8624	いちよし証券	5,500	439.00	2,414,500	
8628	松井証券	14,500	364.00	5,278,000	
8692	だいこう証券ビジネス	1,400	242.00	338,800	
8698	マネックスグループ	198	12,230.00	2,421,540	
8703	カブドットコム証券	9,900	223.00	2,207,700	
8706	極東証券	3,200	449.00	1,436,800	
8707	岩井コスモホールディングス	2,400	269.00	645,600	
8742	小林洋行	900	179.00	161,100	
8630	N K S Jホールディングス	50,800	1,561.00	79,298,800	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホール	72,600	1,529.00	111,005,400	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	23,300	1,318.00	30,709,400	
8750	第一生命保険	1,300	84,000.00	109,200,000	
8766	東京海上ホールディングス	92,200	1,896.00	174,811,200	
8795	T & Dホールディングス	88,700	756.00	67,057,200	
8253	クレディセゾン	19,900	1,546.00	30,765,400	
8424	芙蓉総合リース	2,400	2,586.00	6,206,400	
8425	興銀リース	3,500	1,756.00	6,146,000	
8439	東京センチュリーリース	6,600	1,555.00	10,263,000	
8511	日本証券金融	10,400	371.00	3,858,400	
8512	大阪証券金融	4,200	143.00	600,600	
8519	ポケットカード	3,000	270.00	810,000	
8566	リコーリース	1,800	1,678.00	3,020,400	
8570	イオンクレジットサービス	11,000	1,206.00	13,266,000	
8572	アコム	4,980	1,398.00	6,962,040	
8574	プロミス	12,500	776.00	9,700,000	
8584	ジャックス	15,000	259.00	3,885,000	
8585	オリエントコーポレーション	36,500	75.00	2,737,500	
8586	日立キャピタル	5,000	953.00	4,765,000	
8591	オリックス	12,650	6,850.00	86,652,500	
8593	三菱UFJリース	6,220	3,060.00	19,033,200	

8772	アサックス	4	91,200.00	364,800	
8793	NECキャピタルソリューション	1,000	1,125.00	1,125,000	
2353	日本駐車場開発	268	3,540.00	948,720	
3003	昭栄	4,500	595.00	2,677,500	
3225	東京建物不動産販売	1,000	226.00	226,000	
3231	野村不動産ホールディングス	11,600	1,284.00	14,894,400	
3258	常和ホールディングス	400	1,232.00	492,800	
3265	ヒューリック	7,900	868.00	6,857,200	
4666	パーク24	12,500	922.00	11,525,000	
8801	三井不動産	108,000	1,309.00	141,372,000	
8802	三菱地所	170,000	1,383.00	235,110,000	
8803	平和不動産	23,000	168.00	3,864,000	
8804	東京建物	47,000	235.00	11,045,000	
8806	ダイビル	7,200	528.00	3,801,600	
8809	サンケイビル	4,200	331.00	1,390,200	
8815	東急不動産	49,000	330.00	16,170,000	
8818	京阪神ビルディング	2,900	359.00	1,041,100	
8830	住友不動産	58,000	1,603.00	92,974,000	
8833	東宝不動産	2,600	425.00	1,105,000	
8840	大京	38,000	146.00	5,548,000	
8841	テーオーシー	9,400	351.00	3,299,400	
8842	東京楽天地	4,000	273.00	1,092,000	
8848	レオパレス21	19,000	212.00	4,028,000	
8860	フジ住宅	3,000	371.00	1,113,000	
8864	空港施設	2,600	301.00	782,600	
8869	明和地所	1,300	361.00	469,300	
8870	住友不動産販売	870	3,235.00	2,814,450	
8871	ゴールドクレスト	2,210	1,327.00	2,932,670	
8875	東栄住宅	1,600	778.00	1,244,800	
8877	日本エスリード	1,000	659.00	659,000	
8879	東急リバブル	2,200	678.00	1,491,600	
8880	飯田産業	2,700	644.00	1,738,800	
8881	日神不動産	1,500	436.00	654,000	
8895	アーネストワン	4,000	770.00	3,080,000	
8897	タカラレーベン	2,900	427.00	1,238,300	
8904	サンヨーハウジング名古屋	10	75,000.00	750,000	
8905	イオンモール	11,100	1,833.00	20,346,300	
8907	フージャースコーポレーション	39	28,450.00	1,109,550	
8915	タクトホーム	12	67,100.00	805,200	
8918	ランド	4,800	19.00	91,200	
8923	トーセイ	25	21,170.00	529,250	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	151	53,300.00	8,048,300	
8934	サンフロンティア不動産	23	8,160.00	187,680	
8944	ランドビジネス	18	16,220.00	291,960	
9706	日本空港ビルデング	7,800	1,033.00	8,057,400	
1954	日本工営	9,000	271.00	2,439,000	
2120	ネクスト	1,100	350.00	385,000	
2127	日本M&Aセンター	5	443,000.00	2,215,000	



2128	ノバレーゼ	5	50,400.00	252,000	
2131	アコーディア・ゴルフ	104	59,200.00	6,156,800	
2168	パソナグループ	26	77,800.00	2,022,800	
2170	リンクアンドモチベーション	6	53,900.00	323,400	
2181	テンブホールディングス	3,500	695.00	2,432,500	
2301	学情	1,000	256.00	256,000	
2305	スタジオアリス	1,200	1,342.00	1,610,400	
2309	シミック	800	1,309.00	1,047,200	
2322	NECフィールディング	2,000	936.00	1,872,000	
2331	総合警備保障	9,400	843.00	7,924,200	
2371	カカクコム	4,000	3,150.00	12,600,000	
2378	ルネサンス	1,200	368.00	441,600	
2395	新日本科学	1,800	218.00	392,400	
2413	エムスリー	20	391,000.00	7,820,000	
2418	ベストプライダル	5	73,500.00	367,500	
2432	ディー・エヌ・エー	11,500	2,759.00	31,728,500	
2433	博報堂DYホールディングス	3,280	4,275.00	14,022,000	
2440	ぐるなび	1,800	923.00	1,661,400	
2450	一休	19	35,600.00	676,400	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	4	70,900.00	283,600	
2462	ジェイコムホールディングス	500	783.00	391,500	
2466	PGMホールディングス	62	51,800.00	3,211,600	
4282	イーピーエス	14	163,700.00	2,291,800	
4301	アミューズ	700	1,003.00	702,100	
4310	ドリームインキュベータ	9	59,800.00	538,200	
4319	TAC	1,400	183.00	256,200	
4321	ケネディクス	284	11,510.00	3,268,840	
4324	電通	23,400	2,330.00	54,522,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	113	4,865.00	549,745	
4337	ぴあ	800	792.00	633,600	
4343	イオンファンタジー	900	1,103.00	992,700	
4544	みらかホールディングス	6,700	2,972.00	19,912,400	
4641	アルプス技研	1,200	675.00	810,000	
4651	サニックス	3,900	271.00	1,056,900	
4653	ダイオーズ	500	481.00	240,500	
4658	日本空調サービス	600	696.00	417,600	
4661	オリエンタルランド	6,900	8,190.00	56,511,000	
4665	ダスキン	7,700	1,527.00	11,757,900	
4668	明光ネットワークジャパン	2,300	677.00	1,557,100	
4671	ファルコSDホールディングス	1,400	832.00	1,164,800	
4678	秀英予備校	500	308.00	154,000	
4679	田谷	400	652.00	260,800	
4680	ラウンドワン	8,100	587.00	4,754,700	
4681	リゾートトラスト	4,000	1,140.00	4,560,000	
4694	ビー・エム・エル	1,700	1,986.00	3,376,200	
4696	ワタベウェディング	800	609.00	487,200	
4708	もしもしホットライン	4,200	705.00	2,961,000	
4711	東急コミュニティー	600	2,510.00	1,506,000	

4714	リソー教育	258	4,230.00	1,091,340	
4724	ウェアハウス	600	232.00	139,200	
4732	ユー・エス・エス	3,350	6,510.00	21,808,500	
4745	東京個別指導学院	1,400	140.00	196,000	
4767	テー・オー・ダブリュー	800	448.00	358,400	
4801	セントラルスポーツ	800	939.00	751,200	
5261	リゾートソリューション	2,000	141.00	282,000	
9603	エイチ・アイ・エス	2,600	2,017.00	5,244,200	
9616	共立メンテナンス	1,300	1,246.00	1,619,800	
9619	イチネンホールディングス	2,700	386.00	1,042,200	
9621	建設技術研究所	1,500	560.00	840,000	
9628	燦ホールディングス	600	1,255.00	753,000	
9632	スバル興業	2,000	229.00	458,000	
9633	東京テアトル	11,000	114.00	1,254,000	
9667	ホリプロ	800	647.00	517,600	
9671	よみうりランド	5,000	251.00	1,255,000	
9672	東京都競馬	20,000	107.00	2,140,000	
9675	常磐興産	8,000	84.00	672,000	
9678	カナモト	3,000	528.00	1,584,000	
9681	東京ドーム	21,000	175.00	3,675,000	
9715	トランス・コスモス	3,300	870.00	2,871,000	
9716	乃村工藝社	5,000	231.00	1,155,000	
9722	藤田観光	7,000	255.00	1,785,000	
9726	近畿日本ツーリスト	9,000	85.00	765,000	
9728	日本管財	900	1,436.00	1,292,400	
9729	トーカイ	1,000	1,618.00	1,618,000	
9731	白洋舎	3,000	208.00	624,000	
9735	セコム	25,000	3,605.00	90,125,000	
9740	セントラル警備保障	1,200	786.00	943,200	
9743	丹青社	3,000	224.00	672,000	
9744	メイテック	4,000	1,476.00	5,904,000	
9747	アサツー ディ・ケイ	4,500	1,936.00	8,712,000	
9755	応用地質	2,700	757.00	2,043,900	
9757	船井総合研究所	2,700	533.00	1,439,100	
9760	進学会	1,300	284.00	369,200	
9783	ベネッセホールディングス	7,900	3,685.00	29,111,500	
9787	イオンディライト	2,900	1,635.00	4,741,500	
9788	ナック	600	1,478.00	886,800	
9792	ニチイ学館	5,000	803.00	4,015,000	
9793	ダイセキ	4,100	1,394.00	5,715,400	
	合計	37,595,011		25,190,584,681	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

科目	対象年月日	平成22年11月 8日現在	平成23年11月 7日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		228,501,028	848,128,578
コール・ローン		706,078,869	993,893,972
株式		70,091,074,400	60,244,965,941
投資証券		1,167,268,763	1,113,737,179
派生商品評価勘定		58,902,012	36,045,288
未収入金		15,865,741	472,131
未収配当金		58,222,058	58,991,745
未収利息		1,652	1,884
差入委託証拠金		397,551,523	266,365,634
流動資産合計		72,723,466,046	63,562,602,352
資産合計		72,723,466,046	63,562,602,352
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		113,025	12,765,180
未払金		75,115	
未払解約金		89,069,953	219,701,991
流動負債合計		89,258,093	232,467,171
負債合計		89,258,093	232,467,171
純資産の部			
元本等			
元本		82,536,534,536	76,336,143,090
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		9,902,326,583	13,006,007,909
元本等合計		72,634,207,953	63,330,135,181
純資産合計		72,634,207,953	63,330,135,181
負債純資産合計		72,723,466,046	63,562,602,352

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>	<p>株式、投資証券及び新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>(1) デリバティブ取引 同左</p> <p>(2) 為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1. 期首	平成21年11月 7日	1. 期首	平成22年11月 9日
期首元本額	81,335,224,282円	期首元本額	82,536,534,536円
期首からの追加設定元本額	10,433,421,317円	期首からの追加設定元本額	8,836,745,461円
期首からの一部解約元本額	9,232,111,063円	期首からの一部解約元本額	15,037,136,907円
平成22年11月 8日現在の元本の内訳		平成23年11月 7日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	11,205,790,908円	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	13,146,180,752円
DCインデックスバランス(株式20)	42,745,912円	DCインデックスバランス(株式20)	52,061,736円
DCインデックスバランス(株式40)	155,678,366円	DCインデックスバランス(株式40)	180,368,648円
DCインデックスバランス(株式60)	302,541,526円	DCインデックスバランス(株式60)	316,973,009円
DCインデックスバランス(株式80)	325,835,653円	DCインデックスバランス(株式80)	345,870,307円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	17,253,615,405円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	12,975,229,183円
日興五大陸株式ファンド	24,055,974,081円	日興五大陸株式ファンド	21,157,373,624円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	88,464,786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	87,711,927円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	202,161,662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)	108,098,871円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	25,342,554円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	23,650,312円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	22,736,233円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	21,635,050円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	38,538,776円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	33,535,186円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	48,997,827円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	44,686,198円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	20,197,095,640円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	19,000,290,280円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	112,934,709円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	65,065,502円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	26,468,943円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	24,949,275円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	45,396,324円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,872,631円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	118,872,511円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	135,790,587円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	151,704,078円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	175,365,634円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド （株式80）	151,454,369円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド （株式80）	170,895,437円
年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	7,964,184,273円	年金積立 インデックス ファンド海外株式（ヘッ ジなし）	8,218,538,941円
計	82,536,534,536円	計	76,336,143,090円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	82,536,534,536口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	76,336,143,090口
3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、そ の差額は9,902,326,583円であります。		3. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、 その差額は13,006,007,909円であります。	

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

#### Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

[次へ](#)



## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

対象期間（自 平成21年11月7日 至 平成22年11月8日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,649,374,351
投資証券	25,203,708
合計	1,674,578,059

対象期間（自 平成22年11月9日 至 平成23年11月7日）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	671,603,245
投資証券	27,063,840
合計	698,667,085

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (株式関連)

(平成22年11月8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,295,200,324		1,347,323,785	52,123,461
	合計	1,295,200,324		1,347,323,785	52,123,461

(平成23年11月7日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,887,091,209		1,909,441,364	22,350,155
	合計	1,887,091,209		1,909,441,364	22,350,155

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (通貨関連)

(平成22年11月8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	724,289,179		731,067,730	6,778,551
	米ドル	531,519,736		534,752,480	3,232,744
	ユーロ	192,769,443		196,315,250	3,545,807
	売建	33,060,175		33,173,200	113,025
	加ドル	14,112,175		14,220,500	108,325
	ニュージーランドドル	7,067,720		7,070,800	3,080
	ノルウェークローネ	6,216,320		6,217,200	880
	デンマーククローネ	5,663,960		5,664,700	740
	合計	757,349,354		764,240,930	6,665,526

（平成23年11月7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建	1,533,995,427		1,535,417,760	1,422,333
	米ドル	1,042,424,093		1,045,158,880	2,734,787
	ユーロ	491,571,334		490,258,880	1,312,454
	売建	748,666,070		749,158,450	492,380
	米ドル	624,560,000		625,120,000	560,000
	シンガポールドル	16,440,070		16,358,450	81,620
	ユーロ	107,666,000		107,680,000	14,000
	合計	2,282,661,497		2,284,576,210	929,953

## (注)1.時価の算定方法

- (1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 2.換算において円未満の端数は切り捨てております。
  - 3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在
1口当たり純資産額	0.8800円	1口当たり純資産額	0.8296円
(1万口当たり純資産額)	(8,800円)	(1万口当たり純資産額)	(8,296円)

(3) 附属明細表  
 第1 有価証券明細表  
 (1) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,280	28.09	232,585.20	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18,673	82.46	1,539,775.58	
APACHE CORP	14,394	100.20	1,442,278.80	
ARCH COAL INC	7,385	18.12	133,816.20	
BAKER HUGHES INC	16,315	56.15	916,087.25	
CABOT OIL & GAS CORP	3,950	83.64	330,378.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	9,281	50.97	473,052.57	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	24,685	27.07	668,222.95	
CHEVRON CORP	75,616	106.43	8,047,810.88	
CIMAREX ENERGY CO	3,355	64.87	217,638.85	
CONCHO RESOURCES INC	3,645	98.02	357,282.90	
CONOCOPHILLIPS	50,510	70.71	3,571,562.10	
CONSOL ENERGY INC	8,638	44.84	387,327.92	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,630	66.07	107,694.10	
DENBURY RESOURCES INC	15,145	17.38	263,220.10	
DEVON ENERGY CORPORATION	15,086	65.38	986,322.68	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	2,585	65.59	169,550.15	
EL PASO CORP	29,960	24.96	747,801.60	
ENERGEN CORP	2,310	49.97	115,430.70	
EOG RESOURCES INC	10,076	101.68	1,024,527.68	
EQT CORP	5,345	63.45	339,140.25	
EXXON MOBIL CORP	185,296	78.52	14,549,441.92	
FMC TECHNOLOGIES INC	9,065	46.72	423,516.80	
HALLIBURTON CO	34,347	37.16	1,276,334.52	
HELMERICH & PAYNE	4,100	54.80	224,680.00	
HESS CORP	11,580	63.44	734,635.20	
HOLLYFRONTIER CORP	7,800	33.39	260,442.00	
KINDER MORGAN INC	4,900	28.31	138,719.00	
MARATHON OIL CORP	26,707	27.03	721,890.21	
MARATHON PETROLEUM CORP	13,426	38.62	518,512.12	
MURPHY OIL CORP	6,965	55.39	385,791.35	
NABORS INDUSTRIES LTD	10,741	19.21	206,334.61	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	15,881	71.08	1,128,821.48	
NEWFIELD EXPLORATION CO	4,950	42.92	212,454.00	
NOBLE CORP	9,482	37.79	358,324.78	
NOBLE ENERGY INC	6,736	91.10	613,649.60	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,576	97.64	2,985,440.64	
PEABODY ENERGY CORP	10,365	43.57	451,603.05	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,990	93.17	371,748.30	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	5,655	36.46	206,181.30	
QEP RESOURCES INC	6,820	38.34	261,478.80	
RANGE RESOURCES CORP	6,030	71.98	434,039.40	
ROWAN COMPANIES INC	4,980	35.63	177,437.40	
SCHLUMBERGER LTD	51,039	74.97	3,826,393.83	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	13,265	42.66	565,884.90	
SPECTRA ENERGY CORP	25,424	29.33	745,685.92	
SUNOCO INC	4,938	37.65	185,915.70	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,524	36.47	201,460.28	
VALERO ENERGY CORP	21,922	25.80	565,587.60	

WEATHERFORD INTL LTD	28,429	16.18	459,981.22
WHITING PETROLEUM CORP	4,285	47.02	201,480.70
WILLIAMS COS INC	22,669	31.27	708,859.63
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,905	85.77	678,011.85
AIRGAS INC	2,860	71.19	203,603.40
ALCOA INC	39,339	10.93	429,975.27
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	4,010	49.62	198,976.20
BALL CORP	6,328	34.87	220,657.36
CELANESE CORP-SERIES A	6,010	43.90	263,839.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,695	173.82	468,444.90
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	5,350	71.45	382,257.50
CROWN HOLDINGS INC	6,195	33.75	209,081.25
DOW CHEMICAL	44,128	28.18	1,243,527.04
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	34,858	48.70	1,697,584.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,510	39.82	219,408.20
ECOLAB INC	8,685	55.03	477,935.55
FMC CORP	2,780	83.50	232,130.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER	35,558	40.32	1,433,698.56
INTERNATIONAL PAPER CO	15,520	28.81	447,131.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,224	61.07	196,889.68
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,450	35.01	365,854.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,070	73.89	152,952.30
MEADWESTVACO CORP	6,889	28.79	198,334.31
MONSANTO CO	20,121	72.50	1,458,772.50
MOSAIC CO/THE	11,390	58.09	661,645.10
NEWMONT MINING CORP	18,530	69.38	1,285,611.40
NUCOR CORP	12,224	39.01	476,858.24
OWENS-ILLINOIS INC	6,475	20.95	135,651.25
PPG INDUSTRIES INC	5,937	88.51	525,483.87
PRAXAIR INC	11,415	100.46	1,146,750.90
ROCK-TENN COMPANY-CL A	2,500	62.79	156,975.00
SEALED AIR CORP	4,356	17.70	77,101.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,327	86.28	287,053.56
SIGMA-ALDRICH	4,395	63.58	279,434.10
UNITED STATES STEEL CORP	5,237	27.92	146,217.04
VULCAN MATERIALS CO	4,443	30.60	135,955.80
WALTER ENERGY INC	2,240	75.63	169,411.20
3M CO	25,341	79.30	2,009,541.30
AGCO CORP	3,790	46.24	175,249.60
AMETEK INC	6,317	40.79	257,670.43
BOEING CO	26,327	65.80	1,732,316.60
CATERPILLAR INC	24,201	95.74	2,317,003.74
COOPER INDUSTRIES PLC	6,093	55.29	336,881.97
CUMMINS INC	6,955	103.39	719,077.45
DANAHER CORP	21,189	48.75	1,032,963.75
DEERE & CO	15,755	75.39	1,187,769.45
DOVER CORP	7,065	56.89	401,927.85
EATON CORP	12,221	45.94	561,432.74
EMERSON ELECTRIC CO	28,215	51.26	1,446,300.90
EXELIS INC	6,518	11.55	75,282.90
FASTENAL CO	10,363	40.27	417,318.01
FLOWSERVE CORP	2,185	99.80	218,063.00
FLUOR CORP	6,508	54.86	357,028.88
FOSTER WHEELER AG	5,590	19.84	110,905.60

GENERAL DYNAMICS CORP	11,767	63.45	746,616.15
GENERAL ELECTRIC CO.	398,928	16.39	6,538,429.92
GOODRICH CORP	4,615	122.50	565,337.50
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,066	53.95	1,514,160.70
ILLINOIS TOOL WORKS	16,770	49.23	825,587.10
INGERSOLL-RAND PLC	12,586	32.46	408,541.56
ITT CORPORATION	3,259	20.10	65,505.90
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	39.24	204,832.80
JOY GLOBAL INC	3,935	89.69	352,930.15
KBR INC	6,600	27.42	180,972.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,156	68.58	285,018.48
LOCKHEED MARTIN CORP	11,086	76.52	848,300.72
MASCO CORP	16,804	9.39	157,789.56
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,294	57.18	588,610.92
PACCAR INC	12,589	43.56	548,376.84
PALL CORP	4,486	52.18	234,079.48
PARKER HANNIFIN CORP	6,120	84.55	517,446.00
PENTAIR INC	3,864	36.96	142,813.44
PRECISION CASTPARTS CORP	5,365	168.07	901,695.55
QUANTA SERVICES INC	8,315	21.91	182,181.65
RAYTHEON COMPANY	13,177	44.18	582,159.86
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,398	69.98	377,752.04
ROCKWELL COLLINS INC.	5,725	54.50	312,012.50
ROPER INDUSTRIES INC	3,660	83.30	304,878.00
SPX CORP	2,362	61.12	144,365.44
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,081	66.77	406,028.37
TEXTRON INC	10,336	18.61	192,352.96
TYCO INTERNATIONAL LTD	17,430	45.35	790,450.50
UNITED TECHNOLOGIES CORP	32,640	77.80	2,539,392.00
URS CORP	3,890	36.47	141,868.30
WW GRAINGER INC	2,157	178.33	384,657.81
XYLEM INC	6,518	25.19	164,188.42
AVERY DENNISON CORP	4,680	26.61	124,534.80
CINTAS CORP	5,287	29.63	156,653.81
DUN & BRADSTREET CORP	2,367	66.45	157,287.15
EQUIFAX INC	5,159	35.74	184,382.66
IHS INC-CLASS A	1,710	84.60	144,666.00
IRON MOUNTAIN INC	6,817	30.23	206,077.91
MANPOWERGROUP	3,767	43.10	162,357.70
NIELSEN HOLDINGS NV	3,245	29.47	95,630.15
PITNEY BOWES INC	8,543	19.96	170,518.28
REPUBLIC SERVICES INC	11,045	28.18	311,248.10
ROBERT HALF INTL INC	5,715	26.89	153,676.35
RR DONNELLEY & SONS CO	9,760	16.64	162,406.40
STERICYCLE INC	3,025	81.09	245,297.25
VERISK ANALYTICS INC	4,000	37.97	151,880.00
WASTE MANAGEMENT INC	16,644	31.50	524,286.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,095	68.72	418,848.40
CSX CORP	41,108	21.76	894,510.08
DELTA AIR LINES INC	6,905	8.35	57,656.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,907	44.21	349,568.47
FEDEX CORP	11,143	82.01	913,837.43
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	9,780	11.93	116,675.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,875	41.95	162,556.25

HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	200,000	0.66	133,000.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,260	73.54	975,140.40
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,030	8.53	59,965.90
UNION PACIFIC CORP	18,418	101.24	1,864,638.32
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,495	18.72	46,706.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,692	69.99	1,938,163.08
AUTOLIV INC	3,510	56.55	198,490.50
BORGWARNER INC	4,135	75.75	313,226.25
FORD MOTOR COMPANY	132,915	11.27	1,497,952.05
GENERAL MOTORS CORP	29,135	23.61	687,877.35
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,915	14.30	156,084.50
HARLEY-DAVIDSON INC	8,894	38.99	346,777.06
JOHNSON CONTROLS INC	25,368	32.55	825,728.40
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	3,805	36.28	138,045.40
COACH INC	10,961	65.07	713,232.27
DR HORTON INC	12,086	11.55	139,593.30
FOSSIL INC	2,035	97.40	198,209.00
GARMIN LTD	4,625	35.70	165,112.50
HASBRO INC	4,903	38.66	189,549.98
LEGGETT & PLATT INC	4,468	21.85	97,625.80
LULULEMON ATHLETICA INC	3,600	55.98	201,528.00
MATTEL INC	12,894	28.80	371,347.20
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,758	53.29	146,973.82
NEWELL RUBBERMAID INC	12,735	15.91	202,613.85
NIKE INC -CL B	13,697	94.38	1,292,722.86
PULTE GROUP INC	16,294	5.48	89,291.12
RALPH LAUREN CORP	2,385	157.34	375,255.90
TOLL BROTHERS INC	4,501	17.36	78,137.36
VF CORP	3,315	136.96	454,022.40
WHIRLPOOL CORP	2,934	51.64	151,511.76
APOLLO GROUP INC-CL A	4,612	47.24	217,870.88
CARNIVAL CORP	17,087	34.08	582,324.96
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,155	338.97	391,510.35
DARDEN RESTAURANTS INC	5,223	47.36	247,361.28
DEVRY INC	2,085	37.93	79,084.05
H&R BLOCK INC	12,000	15.31	183,720.00
INTL GAME TECHNOLOGY	11,686	17.68	206,608.48
LAS VEGAS SANDS CORP	13,660	48.04	656,226.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,746	31.61	339,681.06
MCDONALD'S CORP	39,026	93.81	3,661,029.06
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,000	10.92	152,880.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,908	28.81	141,399.48
STARBUCKS CORP	28,137	44.19	1,243,374.03
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,417	50.63	375,522.71
WYNN RESORTS LTD	3,060	131.65	402,849.00
YUM! BRANDS INC	17,504	53.98	944,865.92
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	8,425	14.87	125,279.75
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	23,738	25.18	597,722.84
COMCAST CORP-CLASS A	78,241	22.75	1,779,982.75
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	25,841	22.43	579,613.63
DIRECTV-CLASS A	28,819	46.66	1,344,694.54
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	5,500	44.02	242,110.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,635	40.22	186,419.70
DISH NETWORK CORP-A	7,659	23.48	179,833.32

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,376	9.68	187,559.68	
LIBERTY GLOBAL INC-A	3,743	41.42	155,035.06	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	4,683	39.53	185,118.99	

[次へ](#)



MCGRAW-HILL COMPANIES INC	11,657	42.49	495,305.93
NEWS CORP-CL A	68,622	16.80	1,152,849.60
NEWS CORP-CLASS B	17,844	17.43	311,020.92
OMNICOM GROUP	10,512	44.21	464,735.52
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	3,320	41.82	138,842.40
SIRIUS XM RADIO INC	135,530	1.68	227,690.40
THE WALT DISNEY CO.	67,403	34.76	2,342,928.28
TIME WARNER CABLE	12,662	61.29	776,053.98
TIME WARNER INC	40,193	34.44	1,384,246.92
VIACOM INC-CLASS B	20,088	41.19	827,424.72
VIRGIN MEDIA INC	11,460	24.25	277,905.00
WASHINGTON POST-CLASS B	212	329.61	69,877.32
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	3,321	58.21	193,315.41
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,973	66.02	196,277.46
AMAZON.COM INC	13,600	216.48	2,944,128.00
AUTOZONE INC	932	325.00	302,900.00
BED BATH & BEYOND INC	9,467	62.03	587,238.01
BEST BUY CO INC	12,344	27.31	337,114.64
CARMAX INC	8,679	29.86	259,154.94
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	4,840	39.26	190,018.40
DOLLAR TREE INC	4,557	79.21	360,959.97
EXPEDIA INC	7,285	28.37	206,675.45
FAMILY DOLLAR STORES	4,623	58.97	272,618.31
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,150	25.69	132,303.50
GAP INC/THE	15,821	19.65	310,882.65
GENUINE PARTS CO	5,771	58.38	336,910.98
HOME DEPOT INC	59,985	36.39	2,182,854.15
J.C. PENNEY CO INC	6,061	33.69	204,195.09
KOHL'S CORP	10,432	56.08	585,026.56
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	22,020	16.48	362,999.70
LIMITED INC/THE	10,023	42.63	427,280.49
LOWE'S COS INC	48,874	21.54	1,052,745.96
MACY'S INC	16,209	31.36	508,314.24
NETFLIX INC	1,830	90.02	164,736.60
NORDSTROM INC	6,625	50.39	333,833.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,135	76.90	394,881.50
PETSMART INC	4,460	47.52	211,939.20
PRICELINE.COM INC	1,865	513.37	957,435.05
ROSS STORES INC	4,328	89.41	386,966.48
SEARS HOLDINGS CORP	1,516	78.15	118,475.40
STAPLES INC	26,819	14.87	398,798.53
TARGET CORP	24,575	52.17	1,282,077.75
TIFFANY & CO	4,560	77.94	355,406.40
TJX COMPANIES INC	14,459	60.59	876,070.81
URBAN OUTFITTERS INC	4,770	26.72	127,454.40
COSTCO WHOLESALE CORP	16,399	83.81	1,374,400.19
CVS CAREMARK CORP	50,897	38.02	1,935,103.94
KROGER CO	21,620	22.81	493,152.20
SAFEWAY INC	13,113	19.32	253,343.16
SYSCO CORP	22,006	27.80	611,766.80
WALGREEN CO	34,362	33.17	1,139,787.54
WAL-MART STORES INC	71,842	57.50	4,130,915.00
WHOLE FOODS MARKET INC	5,545	68.67	380,775.15
ALTRIA GROUP INC	78,578	27.37	2,150,679.86

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,373	29.05	708,035.65
BEAM INC	5,276	49.42	260,739.92
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,145	74.57	234,522.65
BUNGE LTD	5,487	61.18	335,694.66
CAMPBELL SOUP CO	7,215	33.15	239,177.25
COCA-COLA CO/THE	77,501	67.78	5,253,017.78
COCA-COLA ENTERPRISES	12,290	26.16	321,506.40
CONAGRA FOODS INC	15,880	25.39	403,193.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,965	19.94	158,822.10
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	8,259	37.13	306,656.67
GENERAL MILLS INC	23,974	38.67	927,074.58
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	4,875	70.67	344,516.25
HANSEN NATURAL CORPORATION	2,825	95.56	269,957.00
HERSHEY CO/THE	6,065	57.61	349,404.65
HJ HEINZ CO	12,205	52.65	642,593.25
HORMEL FOODS CORP	5,800	29.51	171,158.00
JM SMUCKER CO/THE	4,230	78.59	332,435.70
KELLOGG CO	9,653	49.91	481,781.23
KRAFT FOODS INC-CLASS A	62,685	35.18	2,205,258.30
LORILLARD INC	5,470	109.39	598,363.30
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,765	49.73	236,963.45
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7,816	71.26	556,968.16
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,920	38.87	230,110.40
PEPSICO INC	59,456	61.99	3,685,677.44
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	66,893	70.21	4,696,557.53
RALCORP HOLDINGS INC	1,820	79.84	145,308.80
REYNOLDS AMERICAN INC	13,220	38.11	503,814.20
SARA LEE CORP	21,913	18.52	405,828.76
TYSON FOODS INC-CL A	11,206	19.33	216,611.98
AVON PRODUCTS	15,953	18.52	295,449.56
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,515	43.39	239,295.85
CLOROX COMPANY	4,926	65.00	320,190.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	18,350	88.06	1,615,901.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,751	69.98	192,514.98
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,525	117.94	533,678.50
KIMBERLY-CLARK CORP	14,748	69.71	1,028,083.08
PROCTER & GAMBLE CO	104,994	63.03	6,617,771.82
AETNA INC	14,378	39.65	570,087.70
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,214	39.22	400,593.08
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,409	53.69	1,149,449.21
BECTON DICKINSON AND CO	8,196	72.68	595,685.28
BOSTON SCIENTIFIC CORP	58,938	5.77	340,072.26
CARDINAL HEALTH INC	13,270	43.75	580,562.50
CAREFUSION CORP	8,275	25.26	209,026.50
CERNER CORP	5,335	63.73	339,999.55
CIGNA CORP	10,330	42.99	444,086.70
COVENTRY HEALTH CARE INC	5,075	31.38	159,253.50
COVIDIEN PLC	18,535	45.61	845,381.35
CR BARD INC	3,174	87.30	277,090.20
DAVITA INC	3,699	73.97	273,615.03
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	5,687	35.79	203,537.73
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	4,300	76.44	328,692.00
EXPRESS SCRIPTS INC	18,757	45.21	848,003.97
HCA HOLDINGS INC	6,715	23.51	157,869.65

HENRY SCHEIN INC	3,595	65.18	234,322.10
HOLOGIC INC	10,708	16.36	175,182.88
HUMANA INC	6,315	86.58	546,752.70
INTUITIVE SURGICAL INC	1,495	432.23	646,183.85
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,685	81.83	301,543.55
MCKESSON CORP	9,424	80.62	759,762.88
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	14,962	55.06	823,807.72
MEDTRONIC INC	40,172	34.38	1,381,113.36
OMNICARE INC	3,640	30.64	111,529.60
PATTERSON COS INC	3,142	30.03	94,354.26
QUEST DIAGNOSTICS	6,136	55.82	342,511.52
ST JUDE MEDICAL INC	12,605	38.59	486,426.95
STRYKER CORP	11,148	48.56	541,346.88
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,670	45.58	1,853,738.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,304	57.98	249,545.92
WELLPOINT INC	13,761	67.42	927,766.62
ZIMMER HOLDINGS INC	7,277	51.30	373,310.10
ABBOTT LABORATORIES	58,462	53.33	3,117,778.46
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,235	36.91	488,503.85
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,820	66.04	450,392.80
ALLERGAN INC	11,485	83.61	960,260.85
AMGEN INC	34,901	55.17	1,925,488.17
BIOGEN IDEC INC	8,617	113.49	977,943.33
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	64,036	31.34	2,006,888.24
CELGENE CORP	17,372	63.73	1,107,117.56
COVANCE INC	2,000	48.07	96,140.00
ELI LILLY & CO	39,108	37.94	1,483,757.52
FOREST LABORATORIES INC	10,990	30.49	335,085.10
GILEAD SCIENCES INC	29,542	40.72	1,202,950.24
HOSPIRA INC	6,181	31.31	193,527.11
HUMAN GENOME SCIENCES INC	8,535	9.69	82,704.15
ILLUMINA INC	4,745	32.77	155,493.65
JOHNSON & JOHNSON	103,109	64.12	6,611,349.08
LIFE TECHNOLOGIES CORP	6,776	40.08	271,582.08
MERCK & CO. INC.	116,103	34.02	3,949,824.06
MYLAN INC	16,250	18.51	300,787.50
PERRIGO CO	3,180	88.84	282,511.20
PFIZER INC	297,200	19.66	5,842,952.00
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	3,080	33.06	101,824.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,444	48.86	705,733.84
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,990	36.63	292,673.70
WARNER CHILCOTT PLC	4,500	17.01	76,545.00
WATERS CORP	3,526	78.55	276,967.30
WATSON PHARMACEUTICALS INC	4,705	64.72	304,507.60
BB&T CORP	26,548	23.37	620,426.76
CIT GROUP INC	7,175	35.25	252,918.75
COMERICA INC	7,190	25.68	184,639.20
FIFTH THIRD BANCORP	35,519	12.01	426,583.19
HUDSON CITY BANCORP INC	19,870	5.75	114,252.50
KEYCORP	34,838	7.33	255,362.54
M & T BANK CORP	4,273	72.10	308,083.30
NATIONAL BANK OF GREECE-ADR	200,000	0.55	110,000.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	16,064	12.62	202,727.68
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,980	12.40	185,752.00

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,755	52.67	1,040,495.85
REGIONS FINANCIAL CORP	45,874	4.02	184,413.48
SUNTRUST BANKS INC	20,582	19.49	401,143.18
US BANCORP	72,321	25.53	1,846,355.13
WELLS FARGO & CO	189,005	25.40	4,800,727.00
AMERICAN EXPRESS CO	40,614	51.18	2,078,624.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,035	46.26	417,959.10
BANK OF AMERICA CORPORATION	381,154	6.49	2,473,689.46
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	46,612	20.99	978,385.88
BLACKROCK INC	3,465	157.60	546,084.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,185	46.16	793,259.60
CITIGROUP INC	109,307	30.34	3,316,374.38
CME GROUP INC	2,371	271.33	643,323.43
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,765	24.50	508,742.50
EATON VANCE CORP	3,790	26.11	98,956.90
FRANKLIN RESOURCES INC	5,845	106.93	625,005.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,463	105.04	1,939,353.52
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	2,760	127.49	351,872.40
INVESCO LTD	17,862	20.03	357,775.86
JEFFERIES GROUP INC	5,280	12.07	63,729.60
JPMORGAN CHASE & CO	149,470	33.97	5,077,495.90
LEGG MASON INC	5,775	26.93	155,520.75
LEUCADIA NATIONAL CORP	7,305	25.21	184,159.05
MOODY'S CORP	7,797	35.45	276,403.65
MORGAN STANLEY	52,185	16.72	872,533.20
NASDAQ OMX GROUP/THE	5,095	25.30	128,903.50
NORTHERN TRUST CORP	8,255	39.67	327,475.85
NYSE EURONEXT	9,700	26.66	258,602.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	40,144	12.66	508,223.04
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,325	16.50	71,362.50
SLM CORP	19,832	14.16	280,821.12
STATE STREET CORP	18,822	39.99	752,691.78
T ROWE PRICE GROUP INC	9,655	52.76	509,397.80
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,530	16.93	144,412.90
ACE LTD	12,563	72.04	905,038.52
AFLAC INC	17,422	45.29	789,042.38
ALLSTATE CORP	19,838	25.90	513,804.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,935	23.91	428,825.85
AON CORP	11,057	47.41	524,212.37
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,690	36.00	204,840.00
ASSURANT INC	3,640	38.43	139,885.20
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,390	31.26	168,491.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	33,880	77.24	2,616,891.20
CHUBB CORP	10,843	67.53	732,227.79
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,340	29.21	185,191.40
EVEREST RE GROUP LTD	2,254	91.51	206,263.54
FIDELITY NATIONAL FINL-A	5,881	15.27	89,802.87
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	18,645	7.19	134,057.55
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	16,187	17.83	288,614.21
LINCOLN NATIONAL CORP	11,528	19.28	222,259.84
LOEWS CORP	12,325	39.28	484,126.00
MARSH & MCLENNAN COS	20,428	30.58	624,688.24
METLIFE INC	39,680	34.77	1,379,673.60
OLD REPUBLIC INTL CORP	6,703	8.60	57,645.80

PARTNERRE LTD	2,372	67.11	159,184.92
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,120	24.99	302,878.80
PROGRESSIVE CORP	23,685	18.53	438,883.05
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,242	52.19	952,049.98
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,497	68.73	102,888.81
TORCHMARK CORP	4,906	41.60	204,089.60
TRAVELERS COS INC/THE	15,499	58.14	901,111.86
UNUM GROUP	10,918	21.86	238,667.48
WILLIS GROUP HOLDING	6,770	36.12	244,532.40
WR BERKLEY CORP	5,288	34.97	184,921.36
XL GROUP PLC	11,880	21.31	253,162.80
CBRE GROUP INC	11,490	16.67	191,538.30
ACCENTURE PLC-CL A	24,373	58.24	1,419,483.52
ACTIVISION BLIZZARD INC	19,170	13.56	259,945.20
ADOBE SYSTEMS INC	19,369	29.79	577,002.51
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,210	29.82	215,002.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,025	102.57	207,704.25
AUTODESK INC	8,720	35.02	305,374.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,756	51.63	968,372.28
BMC SOFTWARE INC	6,394	35.97	229,992.18
CA INC	14,815	21.68	321,189.20
CITRIX SYSTEMS INC	7,178	74.23	532,822.94
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	11,399	70.84	807,505.16
COMPUTER SCIENCES CORP	5,583	32.40	180,889.20
EBAY INC	43,847	32.71	1,434,235.37
ELECTRONIC ARTS INC	12,614	25.20	317,872.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	9,650	25.23	243,469.50
FISERV INC	5,139	58.01	298,113.39
GOOGLE INC-CL A	9,516	596.14	5,672,868.24
INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,557	186.38	8,490,913.66
INTUIT INC	10,826	53.72	581,572.72
MASTERCARD INC-CLASS A	4,075	360.09	1,467,366.75
MICROSOFT CORP	285,479	26.25	7,493,823.75
NUANCE COMMUNICATIONS INC	9,350	26.30	245,905.00
ORACLE CORP	152,283	32.55	4,956,811.65
PAYCHEX INC	11,862	29.41	348,861.42
RED HAT INC	7,270	50.59	367,789.30
SAIC INC	13,260	12.71	168,534.60
SALESFORCE.COM INC	4,870	131.33	639,577.10
SYMANTEC CORP	28,310	16.98	480,703.80
SYNOPSYS INC	4,627	27.11	125,437.97
TERADATA CORP	6,370	56.90	362,453.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,506	20.08	90,480.48
VERISIGN INC	6,275	32.99	207,012.25
VISA INC-CLASS A SHARES	19,640	92.64	1,819,449.60
VMWARE INC	3,115	100.32	312,496.80
WESTERN UNION CO	23,401	17.36	406,241.36
YAHOO! INC	46,320	15.24	705,916.80
AMPHENOL CORP-CL A	6,660	47.85	318,681.00
APPLE COMPUTER INC	34,786	400.24	13,922,748.64
ARROW ELECTRONICS INC	5,205	36.37	189,305.85
AVNET INC	6,080	30.92	187,993.60
CISCO SYSTEMS INC	206,890	18.03	3,730,226.70
CORNING INC	58,878	14.54	856,086.12

DELL INC	63,711	15.36	978,600.96
DOLBY LABORATORIES INC CLASS A	2,100	30.66	64,386.00
EMC CORP/MASS	77,234	24.67	1,905,362.78
F5 NETWORKS INC	3,005	109.62	329,408.10
FLEXTRONICS INTL LTD	30,311	6.68	202,477.48
FLIR SYSTEMS INC	5,565	27.12	150,922.80
HARRIS CORP	5,045	37.99	191,659.55
HEWLETT-PACKARD CO	81,225	26.97	2,190,638.25
JUNIPER NETWORKS INC	20,573	23.98	493,340.54
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	10,493	38.97	408,912.21
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,725	45.95	538,763.75
NETAPP INC	13,921	42.63	593,452.23
QUALCOMM INC	62,797	56.50	3,548,030.50
SANDISK CORP	8,963	51.31	459,891.53
SEAGATE TECHNOLOGY	16,314	18.34	299,198.76
TE CONNECTIVITY LTD	16,850	35.11	591,603.50
WESTERN DIGITAL CORP	8,555	27.95	239,112.25
XEROX CORP	52,349	8.46	442,872.54
AMERICAN TOWER CORP-CL A	15,049	57.92	871,638.08
AT&T INC	222,756	29.16	6,495,564.96
CENTURYLINK INC	23,291	36.23	843,832.93
CROWN CASTLE INTL CORP	11,535	41.84	482,624.40
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	39,734	5.66	224,894.44
METROPCS COMMUNICATIONS INC	11,720	8.97	105,128.40
NII HOLDINGS INC	6,497	23.83	154,823.51
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	5,020	39.62	198,892.40
SPRINT NEXTEL CORP	119,037	2.87	341,636.19
VERIZON COMMUNICATIONS INC	106,418	37.17	3,955,557.06
WINDSTREAM CORP	20,465	11.85	242,510.25
AES CORP	24,528	11.91	292,128.48
ALLIANT ENERGY CORP	3,610	40.92	147,721.20
AMEREN CORPORATION	8,922	32.29	288,091.38
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,058	39.70	716,902.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,080	30.59	216,577.20
CALPINE CORP	12,490	15.13	188,973.70
CENTERPOINT ENERGY INC	14,762	20.31	299,816.22
CONSOLIDATED EDISON INC	11,191	58.56	655,344.96
CONSTELLATION ENERGY GROUP	7,245	39.21	284,076.45
DOMINION RESOURCES INC/VA	21,612	51.56	1,114,314.72
DTE ENERGY COMPANY	6,468	52.12	337,112.16
DUKE ENERGY CORP	49,973	20.64	1,031,442.72
EDISON INTERNATIONAL	11,819	40.76	481,742.44
ENTERGY CORP	6,757	69.46	469,341.22
EXELON CORP	24,864	44.02	1,094,513.28
FIRSTENERGY CORP	15,755	45.51	717,010.05
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	2,420	52.94	128,114.80
MDU RESOURCES GROUP INC	8,455	20.87	176,455.85
NEXTERA ENERGY INC	15,110	56.44	852,808.40
NISOURCE INC	10,915	22.23	242,640.45
NORTHEAST UTILITIES	6,920	34.66	239,847.20
NRG ENERGY INC	9,360	21.52	201,427.20
NSTAR	3,415	45.34	154,836.10
ONEOK INC	3,910	77.53	303,142.30
P G & E CORP	15,211	40.86	621,521.46

PEPCO HOLDINGS INC	7,192	19.58	140,819.36	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,514	46.25	208,772.50	
PPL CORPORATION	22,173	29.67	657,872.91	
PROGRESS ENERGY INC	11,073	52.66	583,104.18	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,263	33.88	652,630.44	
SCANA CORP	4,853	42.62	206,834.86	

[次へ](#)

SEMPRA ENERGY	8,592	53.58	460,359.36	
SOUTHERN CO	31,875	43.20	1,377,000.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	8,949	32.72	292,811.28	
XCEL ENERGY INC	18,014	26.06	469,444.84	
ADVANCED MICRO DEVICES	23,671	5.67	134,214.57	
ALTERA CORPORATION	12,226	39.05	477,425.30	
ANALOG DEVICES INC	11,196	37.25	417,051.00	
APPLIED MATERIALS INC	50,278	12.42	624,452.76	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	8,140	34.38	279,853.20	
BROADCOM CORP-CL A	18,361	36.01	661,179.61	
CREE INC	3,840	30.57	117,388.80	
FIRST SOLAR INC	2,040	49.59	101,163.60	
INTEL CORP	199,437	23.74	4,734,634.38	
KLA-TENCOR CORPORATION	6,579	47.48	312,370.92	
LAM RESEARCH CORP	4,827	43.83	211,567.41	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	8,904	33.08	294,544.32	
LSI CORP	20,595	6.28	129,336.60	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	20,184	14.24	287,420.16	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,295	26.87	303,496.65	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,429	37.02	275,021.58	
MICRON TECHNOLOGY INC	32,857	5.89	193,527.73	
NVIDIA CORP	22,805	14.82	337,970.10	
TEXAS INSTRUMENTS INC	43,587	31.79	1,385,630.73	
XILINX INC	9,885	32.85	324,722.25	
米ドル小計	11,861,462		437,852,197.35 (34,218,149,222)	
加ドル				
ARC RESOURCES LTD	10,615	25.46	270,257.90	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	11,180	13.38	149,588.40	
BAYTEX ENERGY CORP	4,425	53.65	237,401.25	
BONAVISTA ENERGY CORP	4,985	26.12	130,208.20	
CAMECO CORP	15,332	21.77	333,777.64	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	41,034	37.73	1,548,212.82	
CANADIAN OIL SANDS LTD	18,725	22.54	422,061.50	
CENOVUS ENERGY INC	28,298	35.21	996,372.58	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	9,325	43.07	401,627.75	
ENBRIDGE INC	28,530	35.18	1,003,685.40	
ENCANA CORP	27,648	21.55	595,814.40	
ENERPLUS CORP	6,630	29.29	194,192.70	
HUSKY ENERGY INC	10,659	25.45	271,271.55	
IMPERIAL OIL LTD	10,992	42.10	462,763.20	
MEG ENERGY CORP	4,510	45.41	204,799.10	
NEXEN INC	20,125	17.60	354,200.00	
NIKO RESOURCES LTD	1,695	54.69	92,699.55	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	9,390	21.65	203,293.50	
PENGROWTH ENERGY CORP	12,780	10.97	140,196.60	
PENN WEST PETROLEUM LTD	17,873	18.72	334,582.56	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	2,800	9.41	26,348.00	
PRECISION DRILLING CORP	8,865	11.50	101,947.50	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	8,615	14.31	123,280.65	
SUNCOR ENERGY INC	58,980	32.89	1,939,852.20	
TALISMAN ENERGY INC	39,372	14.47	569,712.84	
TOURMALINE OIL CORP	4,005	33.75	135,168.75	
TRANSCANADA CORP	26,368	42.37	1,117,212.16	



VERMILION ENERGY INC	3,000	49.20	147,600.00
AGNICO-EAGLE MINES LTD	6,375	46.01	293,313.75
AGRIUM INC	5,965	79.97	477,021.05
BARRICK GOLD CORP	37,509	52.23	1,959,095.07
CENTERRA GOLD INC	6,530	21.03	137,325.90
ELDORADO GOLD CORP	20,510	19.19	393,586.90
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	17,720	22.81	404,193.20
FRANCO-NEVADA CORP	4,495	41.86	188,160.70
GOLDCORP INC	29,992	52.41	1,571,880.72
IAMGOLD CORP	14,165	23.09	327,069.85
INMET MINING CORPORATION	2,100	61.80	129,780.00
IVANHOE MINES LTD	9,940	22.82	226,830.80
KINROSS GOLD CORP	42,395	14.56	617,271.20
NEW GOLD INC	16,160	12.40	200,384.00
OSISKO MINING CORP	13,590	13.13	178,436.70
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,115	30.39	125,054.85
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	32,087	48.89	1,568,733.43
SILVER WHEATON CORP	13,240	36.64	485,113.60
TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,740	39.47	858,077.80
YAMANA GOLD INC	27,931	16.47	460,023.57
BOMBARDIER INC 'B'	52,816	4.13	218,130.08
CAE INC	12,135	10.47	127,053.45
FINNING INTERNATIONAL INC	6,675	24.39	162,803.25
SNC-LAVALIN GROUP INC	5,715	49.99	285,692.85
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,495	20.93	94,080.35
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17,109	79.75	1,364,442.75
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,245	62.52	390,437.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,149	35.17	286,600.33
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,920	27.02	105,918.40
TIM HORTONS INC	6,045	49.98	302,129.10
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,305	20.42	271,688.10
THOMSON REUTERS CORP	14,089	29.41	414,357.49
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,970	59.48	176,655.60
ALIMENTATION COUCHE SUB VTG	4,700	30.10	141,470.00
EMPIRE CO LTD 'A'	1,000	60.77	60,770.00
LOBLAW COMPANIES LTD	3,849	38.57	148,455.93
METRO INC -A	3,975	48.92	194,457.00
SHOPPERS DRUG MART INC	8,180	42.60	348,468.00
WESTON (GEORGE) LTD	1,872	69.14	129,430.08
SAPUTO INC	5,200	40.75	211,900.00
VITERRA INC	14,445	10.27	148,350.15
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	10,754	45.03	484,252.62
BANK OF MONTREAL	23,881	58.07	1,386,769.67
BANK OF NOVA SCOTIA	40,439	52.24	2,112,533.36
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,900	73.96	1,102,004.00
NATIONAL BANK OF CANADA	6,080	69.61	423,228.80
ROYAL BANK OF CANADA	53,574	45.85	2,456,367.90
TORONTO-DOMINION BANK	33,260	72.95	2,426,317.00
CI FINANCIAL CORP	5,690	20.45	116,360.50
IGM FINANCIAL INC	4,295	42.95	184,470.25
ONEX CORPORATION	4,475	34.89	156,132.75
TMX GROUP INC	2,295	44.69	102,563.55
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	752	424.00	318,848.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,084	21.21	235,091.64

INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	3,955	27.00	106,785.00	
INTACT FINANCIAL CORP	4,025	58.31	234,697.75	
MANULIFE FINANCIAL CORP	66,461	12.79	850,036.19	
POWER CORP OF CANADA	12,990	24.53	318,644.70	
POWER FINANCIAL CORP	9,735	26.33	256,322.55	
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,564	22.16	477,858.24	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,397	28.62	612,382.14	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES CORP	8,664	16.76	145,208.64	
CGI GROUP INC - CL A	8,920	20.66	184,287.20	
OPEN TEXT CORPORATION	2,255	61.40	138,457.00	
RESEARCH IN MOTION	18,038	19.31	348,313.78	
BCE INC	10,310	39.43	406,523.30	
BELL ALIANT INC	2,800	27.45	76,860.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,720	37.75	593,430.00	
TELUS CORP	2,500	53.94	134,850.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	5,628	50.95	286,746.60	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,115	62.88	195,871.20	
FORTIS INC	7,035	33.68	236,938.80	
TRANSALTA CORP	7,950	21.75	172,912.50	
加ドル小計	1,414,745		45,974,837.73 (3,528,568,795)	
豪ドル				
CALTEX AUSTRALIA LTD	6,385	13.36	85,303.60	
ORIGIN ENERGY LTD	41,320	14.03	579,719.60	
PALADIN ENERGY LTD	18,790	1.39	26,118.10	
SANTOS LTD	33,605	13.12	440,897.60	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	23,868	36.67	875,239.56	
WORLEYPARSONS LTD	7,260	27.91	202,626.60	
ALUMINA LTD	94,332	1.50	141,969.66	
AMCOR LIMITED	44,030	7.14	314,374.20	
BHP BILLITON LTD	120,801	37.95	4,584,397.95	
BLUESCOPE STEEL LTD	72,831	0.76	55,351.56	
BORAL LTD	32,450	3.68	119,416.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	49,920	5.08	253,593.60	
ILUKA RESOURCES LTD	15,185	17.08	259,359.80	
INCITEC PIVOT LTD	64,675	3.49	225,715.75	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	13,935	6.08	84,724.80	
LYNAS CORP LTD	61,300	1.17	71,721.00	
MACARTHUR COAL LTD	6,700	16.19	108,473.00	
NEWCREST MINING LTD	28,729	35.00	1,005,515.00	
ONESTEEL LTD	33,285	0.97	32,286.45	
ORICA LIMITED	13,435	24.30	326,470.50	
OZ MINERALS LTD	14,421	10.97	158,198.37	
RIO TINTO LTD	16,358	69.97	1,144,569.26	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	6,495	13.22	85,863.90	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	5,867	20.60	120,860.20	
BRAMBLES LTD	53,968	6.68	360,506.24	
ASCIANO LTD	109,000	1.49	162,410.00	
MAP GROUP	16,920	3.45	58,374.00	
QANTAS AIRWAYS LTD	34,245	1.61	55,305.67	
QR NATIONAL LTD	59,950	3.31	198,434.50	
TOLL HOLDINGS LTD	24,745	4.78	118,281.10	
TRANSURBAN GROUP	47,535	5.35	254,312.25	
CROWN LTD	17,690	8.13	143,819.70	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	23,977	3.87	92,790.99	

TABCORP HOLDINGS LTD	23,977	2.95	70,732.15	
TATTS GROUP LTD	60,640	2.33	141,291.20	
FAIRFAX MEDIA LTD	100,125	0.94	94,117.50	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	25,515	2.04	52,050.60	
METCASH LTD	36,285	4.12	149,494.20	
WESFARMERS LTD	37,730	32.03	1,208,491.90	
WESFARMERS LTD-PPS	5,907	32.22	190,323.54	
WOOLWORTHS LTD	45,662	24.30	1,109,586.60	
COCA-COLA AMATIL LTD	20,630	12.41	256,018.30	
FOSTER'S GROUP LTD	72,680	5.34	388,111.20	
COCHLEAR LTD	2,157	53.00	114,321.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,895	18.74	91,732.30	
SONIC HEALTHCARE LTD	14,760	11.17	164,869.20	
CSL LTD	19,732	29.33	578,739.56	
AUST AND NZ BANKING GROUP	97,479	21.02	2,049,008.58	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	15,708	9.22	144,827.76	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	58,627	49.03	2,874,481.81	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	81,448	25.19	2,051,675.12	
WESTPAC BANKING CORP	112,971	22.08	2,494,399.68	
ASX LTD	6,590	30.14	198,622.60	
MACQUARIE GROUP LTD	13,366	24.00	320,784.00	
AMP LTD	106,402	4.24	451,144.48	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	77,998	3.13	244,133.74	
QBE INSURANCE GROUP LTD	40,780	14.40	587,232.00	
SUNCORP GROUP LTD	49,265	8.61	424,171.65	
COMPUTERSHARE LTD	17,960	7.30	131,108.00	
TELSTRA CORPORATION LTD	165,734	3.13	518,747.42	
AGL ENERGY LTD	17,300	14.73	254,829.00	
豪ドル小計	2,546,330		30,102,045.60 (2,443,985,082)	
英bond				
AMEC PLC	13,270	9.01	119,562.70	
BG GROUP PLC	127,484	13.83	1,763,103.72	
BP PLC	709,908	4.52	3,212,688.65	
CAIRN ENERGY PLC	54,760	2.91	159,844.44	
ESSAR ENERGY PLC	10,660	3.12	33,269.86	
PETROFAC LTD	9,765	14.03	137,002.95	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	135,228	21.69	2,933,095.32	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	101,404	22.19	2,250,154.76	
TULLOW OIL PLC	33,380	14.30	477,334.00	
ANGLO AMERICAN PLC	49,644	23.38	1,160,924.94	
ANTOFAGASTA PLC	14,880	12.11	180,196.80	
BHP BILLITON PLC	80,266	19.87	1,595,286.75	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	10,270	6.75	69,322.50	
FRESNILLO PLC	6,750	18.39	124,132.50	
GLENCORE INTERNATIONAL-WI	32,380	4.34	140,723.48	
JOHNSON MATTHEY PLC	8,419	18.44	155,246.36	
KAZAKHMYS PLC-	7,325	9.51	69,660.75	
LONMIN PLC	7,445	10.63	79,140.35	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3,455	73.10	252,560.50	
REXAM PLC	32,225	3.45	111,240.70	
RIO TINTO PLC	53,625	34.85	1,868,831.25	
VEDANTA RESOURCES PLC	3,810	12.57	47,891.70	
XSTRATA PLC	77,900	10.02	780,558.00	
BAE SYSTEMS PLC ORD	129,800	2.73	355,522.20	

BALFOUR BEATTY PLC	18,710	2.45	45,989.18
BUNZL PLC	10,376	8.00	83,059.88
COBHAM PLC	34,695	1.76	61,271.37
INVENSYS PLC	27,080	2.23	60,388.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS -C SHR(N)	4,947,645	0.00	4,947.64
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	69,575	7.14	497,113.37
SMITHS GROUP PLC	15,713	9.66	151,787.58
WEIR GROUP PLC/THE	8,360	19.31	161,431.60
WOLSELEY PLC	10,805	18.51	200,000.55
AGGREKO PLC	10,021	17.87	179,075.27
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	9,775	7.05	68,913.75
CAPITA GROUP PLC	23,289	7.07	164,769.67
EXPERIAN PLC	37,623	7.99	300,795.88
G4S PLC	55,329	2.53	140,480.33
INTERTEK GROUP PLC	6,595	19.51	128,668.45
SERCO GROUP PLC	19,895	5.10	101,563.97
GKN PLC	58,715	1.90	111,734.64
BURBERRY GROUP PLC	16,414	13.68	224,543.52
CARNIVAL PLC	6,710	21.83	146,479.30
COMPASS GROUP PLC	71,918	5.65	406,696.29
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,647	10.87	126,602.89
TUI TRAVEL PLC	21,725	1.62	35,237.95
WHITBREAD PLC	6,950	16.44	114,258.00
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	43,129	7.39	318,723.31
ITV PLC	147,795	0.65	96,288.44
PEARSON PLC	30,264	11.52	348,641.28
REED ELSEVIER PLC	46,281	5.46	252,925.66
WPP PLC	47,769	6.63	316,947.31
KINGFISHER PLC	88,782	2.62	233,052.75
MARKS & SPENCER GROUP PLC	58,200	3.23	188,277.00
NEXT PLC	6,637	27.24	180,791.88
SAINSBURY (J) PLC	44,131	3.02	133,275.62
TESCO PLC	302,124	4.05	1,225,263.88
WM MORRISON SUPERMARKETS	84,045	3.12	262,388.49
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,365	11.30	151,024.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	74,772	29.21	2,184,090.12
DIAGEO PLC	93,972	13.08	1,229,153.76
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	38,237	22.86	874,097.82
SABMILLER PLC	35,751	22.16	792,242.16
UNILEVER PLC	48,177	20.67	995,818.59
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,235	32.93	765,128.55
SMITH & NEPHEW PLC	33,686	5.49	184,936.14
ASTRAZENECA PLC	51,758	29.74	1,539,282.92
GLAXOSMITHKLINE PLC	194,076	13.79	2,676,308.04
SHIRE PLC	21,315	20.07	427,792.05
BARCLAYS PLC	434,631	1.83	797,765.20
HSBC HOLDINGS PLC	670,206	5.40	3,619,112.40
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,545,271	0.28	441,406.66
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681,204	0.23	157,290.00
STANDARD CHARTERED PLC	89,239	14.12	1,260,500.87
3I GROUP PLC	45,264	1.95	88,626.91
ICAP PLC	23,340	3.50	81,783.36
INVESTEC PLC	13,185	3.68	48,560.35
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,068	8.73	35,513.64

MAN GROUP PLC	68,256	1.40	95,558.40	
SCHRODERS PLC	4,981	13.70	68,239.70	
ADMIRAL GROUP PLC	6,965	11.86	82,604.90	
AVIVA PLC	107,165	3.28	352,358.52	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	224,901	1.05	237,720.35	
OLD MUTUAL PLC	208,740	1.08	225,856.68	
PRUDENTIAL PLC	95,632	6.20	593,396.56	
RESOLUTION LTD	59,463	2.71	161,442.04	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	123,607	1.09	135,596.87	
STANDARD LIFE PLC	87,275	2.08	181,793.82	
SAGE GROUP PLC/THE	53,555	2.76	147,865.35	
BT GROUP PLC	293,952	1.91	562,036.22	
INMARSAT PLC	16,910	4.63	78,310.21	
VODAFONE GROUP PLC	1,928,690	1.72	3,335,669.35	
CENTRICA PLC	192,610	2.97	573,399.97	
INTERNATIONAL POWER PLC	58,505	3.30	193,066.50	
NATIONAL GRID PLC	131,805	6.22	820,486.12	
SEVERN TRENT PLC	9,623	15.43	148,482.89	
SSE PLC	34,927	13.14	458,940.78	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,735	6.16	164,821.27	
ARM HOLDINGS PLC	50,630	6.45	326,563.50	
英ボンド小計	16,032,454		52,444,324.32 (6,565,504,961)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	11,995	44.33	531,738.35	
GIVAUDAN-REG	328	810.00	265,680.00	
HOLCIM LIMITED-REG SHRS	9,383	52.90	496,360.70	
SIKA AG-BR	85	1,617.00	137,445.00	
SYNGENTA AG-REG	3,551	271.80	965,161.80	
ABB LTD-REG	82,285	16.62	1,367,576.70	
GEBERIT AG-REG	1,525	184.50	281,362.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	780	104.60	81,588.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,900	103.60	196,840.00	
SULZER AG-REG	870	101.50	88,305.00	
ADECCO SA-REG	4,757	40.86	194,371.02	
SGS SA-REG	201	1,507.00	302,907.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,020	111.10	224,422.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	19,594	48.09	942,275.46	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,170	367.00	429,390.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	64.45	97,964.00	
ARYZTA AG	2,630	42.20	110,986.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	40	2,749.00	109,960.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	32,590.00	162,950.00	
NESTLE SA-REG	130,338	50.95	6,640,721.10	
SONOVA HOLDING AG-REG	1,940	93.70	181,778.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	211	155.00	32,705.00	
SYNTHES INC	2,494	148.70	370,857.80	
ACTELION LTD-REG	4,640	32.69	151,681.60	
LONZA GROUP AG-REG	1,650	56.20	92,730.00	
NOVARTIS AG-REG	87,783	49.72	4,364,570.76	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,428	143.50	3,792,418.00	
CREDIT SUISSE GROUP-REG	42,830	23.18	992,799.40	
GAM HOLDING LTD	5,635	9.88	55,673.80	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,140	33.50	272,690.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,280	66.50	85,120.00	

UBS AG-REG	136,612	10.90	1,489,070.80	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	71.20	98,968.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	850	106.00	90,100.00	

[次へ](#)

SWISS RE LTD	13,409	48.15	645,643.35	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	5,466	200.50	1,095,933.00	
SWISSCOM AG-REG	964	351.20	338,556.80	
スイスフラン小計	616,699		27,779,300.94 (2,439,022,622)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	81,823	72.10	5,899,438.30	
NWS HOLDINGS LTD	48,500	11.46	555,810.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	37,000	13.90	514,300.00	
MTR CORP	60,000	25.15	1,509,000.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	10,500	35.80	375,900.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	24,500	21.85	535,325.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	45,000	17.28	777,600.00	
SANDS CHINA LTD	92,600	24.95	2,310,370.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	48,000	15.62	749,760.00	
SJM HOLDINGS LTD	57,000	15.14	862,980.00	
WYNN MACAU LTD	58,200	23.10	1,344,420.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	43,575	10.78	469,738.50	
LI & FUNG LTD	218,000	15.22	3,317,960.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	26,500	20.35	539,275.00	
BANK OF EAST ASIA	60,440	27.90	1,686,276.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	137,500	18.40	2,530,000.00	
HANG SENG BANK LTD	28,600	99.05	2,832,830.00	
WING HANG BANK LTD	7,500	70.25	526,875.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	39,600	135.70	5,373,720.00	
AIA GROUP LTD	316,600	24.30	7,693,380.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	52,682	94.30	4,967,912.60	
HANG LUNG GROUP LTD	36,000	47.75	1,719,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	27.80	2,724,400.00	
HENDERSON LAND DVLP CO LTD	37,426	42.90	1,605,575.40	
HOPEWELL HOLDINGS	29,000	20.10	582,900.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	22,000	26.50	583,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	27,950	30.40	849,680.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	75,000	7.91	593,250.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT-RTS(N)	37,500	2.23	83,625.00	
SINO LAND CO	95,500	10.86	1,037,130.00	
SINO LAND CO(N)	9,550	10.86	103,713.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	53,480	107.20	5,733,056.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	28,017	94.75	2,654,610.75	
WHARF HOLDINGS LTD	57,800	42.00	2,427,600.00	
WHEELLOCK & CO LTD	34,000	23.10	785,400.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	76,000	5.26	399,760.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	15,000	43.30	649,500.00	
CLP HOLDINGS LTD	75,000	70.70	5,302,500.00	
HONG KONG & CHINA GAS	183,156	17.94	3,285,818.64	
POWER ASSETS HOLDINGS	52,500	59.10	3,102,750.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	6,500	83.85	545,025.00	
香港ドル小計	2,543,499		80,141,164.19 (806,220,111)	
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	47,000	0.98	46,060.00	
FRASER AND NEAVE LTD	37,000	6.11	226,070.00	
KEPPEL CORP LTD	55,660	9.40	523,204.00	
NOBLE GROUP LTD	141,854	1.56	222,001.51	

SEBICORP INDUSTRIES LTD	32,000	4.19	134,080.00	
SEBICORP MARINE LTD	27,000	4.17	112,590.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	64,000	2.85	182,400.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	71,000	0.95	67,805.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	77,000	1.42	109,340.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	30,000	1.10	33,000.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	20,800	11.28	234,624.00	
GENTING SINGAPORE PLC	222,000	1.72	382,950.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	55,050	3.88	213,594.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,000	45.98	183,920.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	47,000	2.52	118,440.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	220,000	0.65	144,100.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,000	5.50	407,000.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	65,625	12.66	830,812.50	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	96,240	8.53	820,927.20	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	48,300	16.43	793,569.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,000	6.49	227,150.00	
CAPITALAND LTD	101,000	2.73	275,730.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	50,000	1.35	67,750.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	20,000	10.58	211,600.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	60,000	1.76	105,900.00	
KEPPEL LAND LTD	30,000	2.79	83,700.00	
UOL GROUP LTD	22,250	4.48	99,680.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	294,810	3.15	928,651.50	
シンガポールドル小計	2,048,589		7,786,648.71 (480,747,691)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	23,390	6.45	150,865.50	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	43,390	2.35	102,183.45	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	19,990	3.48	69,565.20	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	72,897	2.63	191,719.11	
CONTACT ENERGY LIMITED	9,430	5.66	53,373.80	
ニュージーランドドル小計	169,097		567,707.06 (35,339,764)	
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	10,875	94.80	1,030,950.00	
HOLMEN AB-B SHS	2,500	186.10	465,250.00	
SSAB AB-A SHARES	6,295	64.55	406,342.25	
SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	21,345	97.25	2,075,801.25	
ALFA LAVAL AB	12,110	122.90	1,488,319.00	
ASSA ABLOY AB-B	11,670	162.10	1,891,707.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	24,945	141.80	3,537,201.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	14,760	126.20	1,862,712.00	
SANDVIK AB	37,770	89.45	3,378,526.50	
SCANIA AB-B SHS	12,030	110.80	1,332,924.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,750	105.30	1,553,175.00	
SKF AB-B SHS	14,614	145.50	2,126,337.00	
VOLVO AB-B SHARES	52,490	81.90	4,298,931.00	
SECURITAS AB-B SHS	12,199	57.55	702,052.45	
ELECTROLUX AB - B	8,875	122.10	1,083,637.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,220	32.01	455,182.20	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	2,085	350.00	729,750.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,378	211.70	8,124,622.60	
SWEDISH MATCH AB	8,145	218.00	1,775,610.00	
GETINGE AB-B SHS	7,610	168.50	1,282,285.00	



NORDEA BANK AB	98,453	57.90	5,700,428.70	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	53,625	40.69	2,182,001.25	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	19,085	184.20	3,515,457.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	30,470	90.95	2,771,246.50	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,390	80.15	351,858.50	
INVESTOR AB-B SHS	17,415	128.40	2,236,086.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	6,715	134.80	905,182.00	
RATOS AB-B SHS	7,000	86.80	607,600.00	
ERICSSON LM-B SHS	113,045	70.10	7,924,454.50	
HEXAGON AB-B SHS	8,970	100.00	897,000.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,970	723.00	2,147,310.00	
TELE2 AB-B SHS	12,235	134.40	1,644,384.00	
TELIASONERA AB	83,180	45.24	3,763,063.20	
スウェーデンクローナ小計	785,219		74,247,387.40 (882,058,962)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	6,800	65.40	444,720.00	
SEADRILL LTD	12,500	191.40	2,392,500.00	
STATOIL ASA	41,894	143.40	6,007,599.60	
SUBSEA 7 SA	10,615	111.30	1,181,449.50	
NORSK HYDRO A S	34,250	29.60	1,013,800.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	7,150	263.40	1,883,310.00	
ORKLA ASA	28,690	43.50	1,248,015.00	
DNB NOR ASA	38,240	64.05	2,449,272.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,250	60.95	441,887.50	
TELENOR ASA	28,855	97.70	2,819,133.50	
ノルウェークローネ小計	216,244		19,881,687.10 (276,951,901)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,655	816.00	1,350,480.00	
VESTAS WIND SYSTEMS AS	7,500	80.75	605,625.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	23	33,320.00	766,360.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S - B	48	35,200.00	1,689,600.00	
DSV A/S	7,370	107.20	790,064.00	
CARLSBERG AS-B	4,275	348.70	1,490,692.50	
COLOPLAST-B	881	849.50	748,409.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,000	425.20	425,200.00	
NOVO NORDISK A/S-B	15,965	594.00	9,483,210.00	
DANSKE BANK A/S	25,125	69.75	1,752,468.75	
TRYG A/S	1,045	298.80	312,246.00	
TDC A/S	14,545	44.97	654,088.65	
デンマーククローネ小計	79,432		20,068,444.40 (290,390,390)	
イスラエルシュケル				
ISRAEL CHEMICALS LTD	18,570	43.18	801,852.60	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	108	2,670.00	288,360.00	
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R	35,285	151.50	5,345,677.50	
BANK HAPOALIM BM	50,865	13.09	665,822.85	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,605	11.87	671,901.35	
NICE SYSTEMS LTD	2,860	127.90	365,794.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	81,755	7.62	622,973.10	
イスラエルシュケル小計	246,048		8,762,381.40 (187,164,466)	
ユーロ				
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	5,990	15.87	95,091.25	

ENI SPA	90,211	15.55	1,402,781.05
FUGRO NV-CVA	2,640	40.19	106,114.80
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	9,315	14.95	139,259.25
NESTE OIL OYJ	3,590	8.70	31,250.95
OMV AG	6,300	25.00	157,531.50
REPSOL YPF SA	29,891	20.66	617,697.51
SAIPEM SPA	10,135	31.82	322,495.70
SBM OFFSHORE NV	6,700	15.69	105,156.50
TECHNIP SA	3,748	66.58	249,541.84
TENARIS SA	17,925	12.53	224,600.25
TOTAL SA	79,847	37.03	2,957,133.64
ACERINOX SA	4,717	9.53	44,976.59
AIR LIQUIDE	10,642	90.67	964,910.14
AKZO NOBEL NV	8,668	38.23	331,377.64
ARCELORMITTAL	32,076	14.67	470,554.92
ARKEMA	2,005	49.02	98,295.12
BASF SE	34,475	51.32	1,769,257.00
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	5,550	5.25	29,137.50
CRH PLC	27,255	12.78	348,455.17
ERAMET SLN	170	110.45	18,776.50
HEIDELBERGCEMENT AG	5,055	32.80	165,804.00
IMERYS SA	1,520	40.91	62,183.20
K+S AG	6,500	44.87	291,687.50
KONINKLIJKE DSM NV	5,682	37.70	214,211.40
LAFARGE SA	7,458	29.56	220,458.48
LANXESS AG	3,300	42.99	141,867.00
LINDE AG	6,345	111.90	710,005.50
OUTOKUMPU OYJ	4,060	6.03	24,502.10
RAUTARUUKKI OYJ	3,980	7.26	28,914.70
SALZGITTER AG	1,685	40.80	68,756.42
SOLVAY ET CIE SA -A	2,181	68.45	149,289.45
STORA ENSO OYJ-R SHS	20,375	4.49	91,646.75
THYSSENKRUPP AG	14,570	20.86	304,003.05
UMICORE	4,445	30.96	137,617.20
UPM-KYMMENE OYJ	18,648	8.52	158,974.20
VOESTALPINE AG	4,239	26.21	111,125.38
WACKER CHEMIE AG	580	68.31	39,619.80
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	5,146	26.22	134,953.85
ALSTOM	7,905	27.11	214,304.55
BEKAERT NV	1,540	30.74	47,339.60
BOSKALIS WESTMINSTER	2,855	25.76	73,559.07
BOUYGUES SA	8,825	27.50	242,687.50
BRENTAG AG	1,125	74.40	83,700.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14,831	32.04	475,259.39
EADS NV	15,598	21.33	332,705.34
EIFFAGE	1,915	23.77	45,529.12
FERROVIAL SA	13,715	9.16	125,739.12
FIAT INDUSTRIAL	28,270	6.28	177,535.60
FINMECCANICA SPA	14,290	4.61	65,934.06
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,535	18.57	47,074.95
GEA GROUP AG	6,740	21.14	142,483.60
HOCHTIEF AG	1,655	51.28	84,868.40
KONE OYJ-B	5,907	40.46	238,997.22
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	37,821	14.93	564,856.63

LEGRAND SA	7,405	25.46	188,531.30
MAN SE	2,414	64.52	155,751.28
METSO OYJ	4,900	27.80	136,220.00
PRYSMIAN SPA	8,610	10.57	91,007.70
SAFRAN SA	6,190	24.31	150,509.85
SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,373	40.44	743,095.98
SIEMENS AG-REG	30,951	74.05	2,291,921.55
THALES SA	3,505	25.30	88,676.50
VALLOUREC	4,265	44.85	191,285.25
VINCI SA	16,635	34.37	571,828.12
WARTSILA OYJ	6,100	21.85	133,285.00
WENDEL	1,190	52.98	63,046.20
ZARDOYA OTIS SA	5,219	9.79	51,094.01
BUREAU VERITAS SA	1,770	53.74	95,119.80
EDENRED	6,096	19.25	117,348.00
RANDSTAD HOLDING NV	4,405	24.26	106,865.30
SOCIETE BIC SA	1,265	64.97	82,187.05
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	14,551	11.58	168,573.33
ADP	1,210	54.63	66,102.30
AIR FRANCE-KLM	6,390	5.24	33,483.60
ATLANTIA SPA	11,496	11.00	126,456.00
DEUTCHE LUFTHANSA	7,870	10.06	79,211.55
DEUTSCHE POST AG	31,433	10.70	336,490.26
FRAPORT AG	1,740	45.22	78,691.50
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	22,420	6.34	142,142.80
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	31,722	1.83	58,146.42
POSTNL	13,270	3.18	42,198.60
RYANAIR HOLDINGS PLC	16,845	3.35	56,430.75
TNT EXPRESS NV	13,270	5.30	70,344.27
VOPAK	2,440	38.02	92,768.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,430	57.86	719,199.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,090	38.79	81,071.10
CONTINENTAL AG	2,915	53.70	156,535.50
DAIMLER AG	34,002	34.99	1,189,729.98
FIAT SPA	26,775	4.14	110,848.50
MICHELIN (CGDE)-B	6,704	50.39	337,814.56
NOKIAN RENKAAT OYJ	4,245	26.76	113,596.20
PEUGEOT SA	5,872	14.68	86,200.96
PIRELLI & C.	11,251	6.25	70,375.00
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,740	42.42	243,490.80
RENAULT SA	7,317	29.78	217,900.26
VOLKSWAGEN AG	1,151	116.05	133,573.55
VOLKSWAGEN AG-PFD	5,473	125.30	685,766.90
ADIDAS AG	7,991	50.86	406,422.26
CHRISTIAN DIOR	2,000	98.36	196,720.00
LUXOTTICA GROUP SPA	3,976	20.72	82,382.72
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,514	115.40	1,097,915.60
ACCOR SA	5,606	22.01	123,388.06
AUTOGRILL SPA	6,045	8.25	49,901.47
OPAP SA	8,450	7.15	60,417.50
SODEXO	3,470	52.70	182,869.00
TUI AG	3,775	4.47	16,893.12
AXEL SPRINGER AG	1,665	30.53	50,832.45
EUTELSAT COMMUNICATIONS	3,795	29.74	112,863.30

JC DECAUX SA .	2,520	19.24	48,497.40
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	3,080	42.86	132,008.80
LAGARDERE S.C.A.	5,040	19.50	98,280.00
M6-METROPOLE TELEVISION	1,760	12.01	21,146.40
MEDIASET ESPANA COMUNICACION	6,845	4.60	31,493.84
MEDIASET SPA	25,926	2.58	66,940.93
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	2,855	16.29	46,522.22
PUBLICIS GROUPE	4,725	35.37	167,146.87
REED ELSEVIER NV	25,748	9.05	233,251.13
SANOMA OYJ	3,275	9.13	29,900.75
SES	11,190	19.00	212,665.95
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	5,550	9.36	51,992.40
WOLTERS KLUWER	11,107	12.84	142,669.41
INDITEX	8,240	64.89	534,693.60
PPR	2,892	108.50	313,782.00
CARREFOUR SA	21,653	19.66	425,697.98
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,004	66.48	133,225.92
COLRUYT SA	2,725	30.80	83,930.00
DELHAIZE GROUP	3,666	45.97	168,526.02
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	22,688	3.21	73,009.98
JERONIMO MARTINS	7,685	12.97	99,712.87
KESKO OYJ-B SHS	2,230	25.15	56,084.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	44,169	9.27	409,623.30
METRO AG	4,940	35.64	176,061.60
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	30,131	39.49	1,190,023.84
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	6,798	12.77	86,810.46
DANONE	21,919	48.75	1,068,551.25
HEINEKEN HOLDING NV	4,275	29.87	127,694.25
HEINEKEN NV	10,178	34.21	348,189.38
KERRY GROUP PLC-A	5,390	26.52	142,969.75
PARMALAT SPA	14,290	1.57	22,535.33
PERNOD-RICARD SA	7,436	67.65	503,045.40
SUEDZUCKER AG	2,400	19.57	46,980.00
UNILEVER NV-CVA	61,145	24.45	1,495,300.97
BEIERSDORF AG	3,745	41.27	154,556.15
HENKEL AG & CO KGAA	5,110	35.95	183,704.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,493	43.45	282,120.85
L'OREAL	9,021	77.83	702,104.43
CELESIO AG	3,620	11.07	40,091.50
ESSILOR INTERNATIONAL	7,680	53.05	407,424.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,933	51.14	405,693.62
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,370	73.59	321,588.30
BAYER AG	31,040	44.89	1,393,540.80
ELAN CORP PLC	18,000	8.56	154,134.00
GRIFOLS SA	5,290	12.84	67,923.60
MERCK KGAA	2,405	72.86	175,228.30
ORION OYJ-CLASS B	4,485	14.83	66,512.55
QIAGEN N.V.	7,635	9.99	76,327.09
SANOFI	41,936	49.34	2,069,331.92
UCB SA	3,708	30.68	113,779.98
BANCA CARIGE SPA	28,825	1.36	39,202.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	153,605	0.30	46,695.92
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	162,308	6.12	994,136.50
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	150,420	0.12	18,050.40

BANCO DE SABADELL SA	41,782	2.49	104,078.96
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	21,145	1.35	28,693.76
BANCO POPOLARE SCARL	62,764	0.99	62,136.36
BANCO POPULAR ESPANOL	36,697	3.13	115,045.09
BANCO SANTANDER SA	317,482	5.82	1,849,015.16
BANKIA SAU	32,000	3.60	115,232.00
BANKINTER SA	13,435	4.22	56,736.00
BNP PARIBAS	35,997	30.88	1,111,587.36
CAIXABANK	26,440	3.37	89,235.00
COMMERZBANK AG	134,443	1.64	220,755.40
CREDIT AGRICOLE SA	37,252	5.23	194,976.96
ERSTE GROUP BANK AG	7,118	15.05	107,125.90
INTESA SANPAOLO	377,913	1.12	425,907.95
INTESA SANPAOLO-RSP	44,110	0.93	41,375.18
KBC GROEP NV	6,119	14.22	87,012.18
NATIONAL BANK OF GREECE	22,263	1.84	40,963.92
NATIXIS	32,490	2.18	70,828.20
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,310	19.10	44,132.55
SOCIETE GENERALE	23,749	17.92	425,700.82
UBI BANCA SCPA	28,684	2.65	76,184.70
UNICREDIT SPA	506,731	0.77	393,729.98
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	34,890	28.37	989,829.30
DEUTSCHE BOERSE AG-SHARES	7,280	39.46	287,305.20
EURAZEO	1,442	32.94	47,499.48
EXOR SPA	1,714	15.47	26,515.58
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,912	55.40	161,324.80
ING GROEP NV-CVA	143,775	6.00	863,512.65
MEDIOBANCA SPA	19,150	5.41	103,697.25
POHJOLA BANK PLC	6,535	7.21	47,150.02
AEGON NV	66,229	3.32	220,277.65
AGEAS	84,144	1.39	117,044.30
ALLIANZ SE-REG	17,038	76.22	1,298,636.36
ASSICURAZIONI GENERALI	44,058	12.35	544,116.30
AXA	65,322	10.54	688,493.88
CNP ASSURANCES	6,070	10.54	63,977.80
DELTA LLOYD NV	3,600	12.52	45,072.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS	2,455	36.39	89,349.72
MAPFRE SA	26,034	2.62	68,287.18
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,076	93.47	661,393.72
SAMPO OYJ-A SHS	15,819	19.67	311,159.73
SCOR SE	6,822	16.69	113,859.18
VIENNA INSURANCE GROUP	1,410	30.54	43,061.40
IMMOEAST AG-TEMPORARY	16,150		
IMMOFINANZ AG	37,225	2.42	90,270.62
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	13,000		
AMADEUS IT HOLDING SA	10,060	13.14	132,188.40
ATOS	1,650	34.66	57,189.00
CAP GEMINI SA	5,469	27.00	147,663.00
DASSAULT SYSTEMES SA	2,315	60.26	139,501.90
INDRA SISTEMAS SA	4,269	12.07	51,548.17
SAP AG-COMMON	34,537	44.07	1,522,045.59
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,720	14.06	66,363.20
ALCATEL-LUCENT	91,534	1.66	152,678.71
NEOPOST SA	867	53.83	46,670.61

NOKIA OYJ	140,576	4.80	675,608.25	
BELGACOM SA	6,375	22.35	142,481.25	
DEUTSCHE TELEKOM AG	105,436	9.01	950,716.41	
ELISA OYJ	6,295	15.24	95,935.80	
FRANCE TELECOM SA	69,599	12.62	878,687.37	
ILIAD SA	815	82.74	67,433.10	
KONINKLIJKE KPN NV	58,396	9.56	558,265.76	
MOBISTAR SA	1,279	40.30	51,543.70	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	27,363	5.10	139,551.30	
TELECOM ITALIA SPA	368,818	0.86	319,580.79	
TELECOM ITALIA-RSP	234,007	0.74	173,516.19	
TELEFONICA SA	154,508	15.00	2,317,620.00	
TELEKOM AUSTRIA AG	14,020	8.37	117,347.40	
VIVENDI	46,457	15.47	718,922.07	
A2A SPA	50,790	0.94	47,767.99	
ACCIONA SA	976	68.08	66,446.08	
E.ON AG	67,599	16.63	1,124,509.36	
EDP RENOVAVEIS SA	8,115	4.30	34,894.50	
ELECTRICITE DE FRANCE	9,395	20.93	196,637.35	
ENAGAS	7,050	13.95	98,347.50	
ENEL GREEN POWER SPA	64,340	1.65	106,740.06	
ENEL SPA	247,079	3.29	814,866.54	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	80,271	2.27	182,215.17	
FORTUM OYJ	16,355	17.40	284,577.00	
GAS NATURAL SDG SA	11,902	13.08	155,737.67	
GDF SUEZ	46,474	20.07	932,965.55	
IBERDROLA SA	148,177	4.90	726,808.18	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,050	34.31	138,955.50	
RWE AG	15,365	28.91	444,202.15	
RWE AG-NON VTG PFD	1,845	26.31	48,541.95	
SNAM RETE GAS	58,840	3.42	201,232.80	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	10,319	10.91	112,580.29	
TERNA SPA	43,127	2.78	119,979.31	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	13,334	9.78	130,433.18	
VERBUND AG	2,370	20.45	48,478.35	
ASML HOLDING NV	16,632	30.79	512,099.28	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	42,120	6.50	273,864.24	
STMICROELECTRONICS NV	23,623	5.23	123,595.53	
ユーロ小計	7,034,039		75,131,042.57 (8,090,861,974)	
合計	45,593,857		60,244,965,941 (60,244,965,941)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	34,640	566,710.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,475	452,862.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,397	533,277.57	
		DUKE REALTY CORPORATION	6,875	83,668.75	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	11,275	659,249.25	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	2,475	220,992.75	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	17,145	249,459.75	
		HCP INC	15,380	584,593.80	
		HEALTH CARE REIT INC	6,530	326,500.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	26,659	387,621.86	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,255	264,216.60	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	100,581.03	
		PLUM CREEK TIMBER CO	6,458	240,689.66	
		PROLOGIS INC	17,042	498,819.34	
		PUBLIC STORAGE	5,389	672,654.98	
		RAYONIER INC	5,057	212,545.71	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	2,805	111,274.35	
		SIMON PROPERTY GROUP INC-REIT	11,009	1,418,399.56	
		THE MACERICH COMPANY	5,120	257,228.80	
	VENTAS INC	10,295	559,018.50		
VORNADO REALTY TRUST	6,396	514,878.00			
WEYERHAEUSER CO	20,336	352,016.16			
	投資証券小計		238,126	9,267,258.82 (724,236,276)	
米ドル合計				9,267,258.82 (724,236,276)	
加ドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,250	130,830.00	
	投資証券小計		5,250	130,830.00 (10,041,202)	
加ドル合計				130,830.00 (10,041,202)	
豪ドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	77,145	141,175.35	
		DEXUS PROPERTY GROUP	163,705	138,330.72	
		GOODMAN GROUP	273,860	169,793.20	
		GPT GROUP	63,695	197,454.50	
		LEND LEASE GROUP	21,287	162,632.68	
		MIRVAC GROUP	137,930	171,033.20	
		STOCKLAND	91,105	294,269.15	
		WESTFIELD GROUP	82,535	643,773.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	107,475	271,911.75		
	投資証券小計		1,018,737	2,190,373.55 (177,836,428)	
豪ドル合計				2,190,373.55 (177,836,428)	
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	32,561	164,921.46	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	24,090	76,485.75	
		HAMMERSON PLC	30,035	122,122.31	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	28,889	199,622.99	
	SEGRO PLC	20,223	46,856.69		
	投資証券小計		135,798	610,009.20 (76,367,051)	
英ポンド合計				610,009.20 (76,367,051)	

香港ドル	投資証券	LINK REIT	86,500	2,344,150.00	
	投資証券小計		86,500	2,344,150.00 (23,582,149)	
香港ドル合計				2,344,150.00 (23,582,149)	
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	125,860.00	
		CAPITAMALL TRUST	71,800	128,163.00	
	投資証券小計		133,800	254,023.00 (15,683,380)	
シンガポールドル合計				254,023.00 (15,683,380)	
ユーロ	投資証券	CORIO NV	1,970	70,329.00	
		FONCIERE DES REGIONS	1,005	51,466.05	
		GECINA SA	740	50,934.20	
		ICADE	1,080	68,569.20	
		KLEPIERRE	3,895	87,890.67	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	3,380	469,313.00	
	投資証券小計		12,070	798,502.12 (85,990,693)	
ユーロ合計				798,502.12 (85,990,693)	
合計				1,113,737,179 (1,113,737,179)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 568銘柄	97.9%		55.7%
	投資証券 22銘柄		2.1%	1.2%
加ドル	株式 100銘柄	99.7%		5.8%
	投資証券 1銘柄		0.3%	0.0%
豪ドル	株式 61銘柄	93.2%		4.0%
	投資証券 9銘柄		6.8%	0.3%
英ポンド	株式 99銘柄	98.9%		10.7%
	投資証券 5銘柄		1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%		4.0%
香港ドル	株式 41銘柄	97.2%		1.3%
	投資証券 1銘柄		2.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 28銘柄	96.8%		0.8%
	投資証券 2銘柄		3.2%	0.0%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%		0.1%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%		1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.5%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%		0.5%
イスラエルシケル	株式 7銘柄	100.0%		0.3%
ユーロ	株式 255銘柄	98.9%		13.2%
	投資証券 6銘柄		1.1%	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22年11月 8日現在	平成23年11月 7日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		11,574,847	39,825,498
国債証券		27,458,171,800	24,142,081,490
地方債証券		2,626,853,000	2,205,416,000
特殊債券		3,548,616,000	3,012,748,404
社債券		3,340,309,000	2,537,232,000
未収入金		30,505,800	
未収利息		128,030,573	107,954,399
前払費用		1,825,454	1,837,351
流動資産合計		37,145,886,474	32,047,095,142
資産合計		37,145,886,474	32,047,095,142
負債の部			
流動負債			
未払解約金		30,860,665	10,663,707
流動負債合計		30,860,665	10,663,707
負債合計		30,860,665	10,663,707
純資産の部			
元本等			
元本		30,569,300,516	26,055,168,581
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		6,545,725,293	5,981,262,854
元本等合計		37,115,025,809	32,036,431,435
純資産合計		37,115,025,809	32,036,431,435
負債純資産合計		37,145,886,474	32,047,095,142

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1. 期首	平成21年11月 7日	1. 期首	平成22年11月 9日
期首元本額	32,091,840,401円	期首元本額	30,569,300,516円
期首からの追加設定元本額	3,332,206,862円	期首からの追加設定元本額	1,884,074,696円
期首からの一部解約元本額	4,854,746,747円	期首からの一部解約元本額	6,398,206,631円
平成22年11月 8日現在の元本の内訳		平成23年11月 7日現在の元本の内訳	
DCインデックスバランス(株式20)	388,327,158円	DCインデックスバランス(株式20)	427,726,875円
DCインデックスバランス(株式40)	488,375,210円	DCインデックスバランス(株式40)	522,890,053円
DCインデックスバランス(株式60)	343,676,622円	DCインデックスバランス(株式60)	369,153,061円
DCインデックスバランス(株式80)	56,670,551円	DCインデックスバランス(株式80)	60,483,349円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	1,008,025,417円	インデックスファンド日本債券(DC専用)	949,635,339円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	12,032,952,519円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	8,512,238,178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	8,346,666円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	8,870,100円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	325,350,199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)	106,928,217円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	8,782,793円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,509,748円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,663,230円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	47,240,644円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	240,025,405円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	205,584,454円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	884,563,760円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	763,521,989円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	8,268,042,386円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,235,704,540円
世界アセットバランスファンド40(適格機関投資家向け)	139,097,795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)	125,669,891円
世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	246,653,379円	世界アセットバランスファンド25(適格機関投資家向け)	207,413,519円
3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	78,325,687円	3資産バランスファンド(適格機関投資家向け)	43,921,010円
グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	35,012,949円	グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	31,153,491円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	814,123,562円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	866,336,935円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	730,991,372円	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	772,788,439円

年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	352,126,506円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	367,337,499円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	52,777,783円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	53,842,707円
年金積立 インデックス ファンド日本債券	3,912,899,075円	年金積立 インデックス ファンド日本債券	4,252,842,849円
日本債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	101,490,492円	日本債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	116,375,694円
計	30,569,300,516円	計	26,055,168,581円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	30,569,300,516口	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	26,055,168,581口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

## I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

対象期間（自 平成21年11月7日 至 平成22年11月8日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	125,435,960
地方債証券	5,451,000
特殊債券	5,624,000
社債券	4,379,000
合計	140,889,960

対象期間（自 平成22年11月9日 至 平成23年11月7日）

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	239,560
地方債証券	199,000
特殊債券	465,000
社債券	1,614,000
合計	1,640,440

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.2141円	1口当たり純資産額	1.2296円
（1万口当たり純資産額）	（12,141円）	（1万口当たり純資産額）	（12,296円）

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第298回利付国債（2年）	120,000,000	119,980,800	
	第301回利付国債（2年）	70,000,000	70,074,900	
	第302回利付国債（2年）	120,000,000	120,128,400	
	第304回利付国債（2年）	70,000,000	70,079,100	
	第307回利付国債（2年）	40,000,000	40,052,400	
	第308回利付国債（2年）	220,000,000	219,896,600	
	第68回利付国債（5年）	170,000,000	171,844,500	
	第69回利付国債（5年）	633,000,000	638,469,120	
	第70回利付国債（5年）	227,000,000	229,088,400	
	第71回利付国債（5年）	45,000,000	45,718,650	



第72回利付国債(5年)	30,000,000	30,659,400	
第74回利付国債(5年)	57,000,000	57,800,280	
第75回利付国債(5年)	176,000,000	179,168,000	
第76回利付国債(5年)	138,000,000	140,739,300	
第78回利付国債(5年)	113,000,000	114,818,170	
第79回利付国債(5年)	143,000,000	144,698,840	
第81回利付国債(5年)	444,000,000	450,828,720	
第83回利付国債(5年)	62,000,000	63,199,700	
第84回利付国債(5年)	27,000,000	27,382,050	
第85回利付国債(5年)	47,000,000	47,708,760	
第87回利付国債(5年)	80,000,000	80,766,400	
第88回利付国債(5年)	245,000,000	247,366,700	
第89回利付国債(5年)	210,000,000	211,239,000	
第90回利付国債(5年)	50,000,000	50,116,000	
第91回利付国債(5年)	80,000,000	80,428,000	
第92回利付国債(5年)	15,000,000	15,025,800	
第93回利付国債(5年)	300,000,000	302,679,000	
第94回利付国債(5年)	70,000,000	70,910,000	
第95回利付国債(5年)	220,000,000	222,835,800	
第97回利付国債(5年)	220,000,000	220,798,600	
第98回利付国債(5年)	55,000,000	54,949,950	
第99回利付国債(5年)	150,000,000	150,429,000	
第2回利付国債(40年)	205,000,000	207,121,750	
第4回利付国債(40年)	30,000,000	30,063,300	
第245回利付国債(10年)	160,000,000	161,382,400	
第247回利付国債(10年)	17,000,000	17,156,400	
第250回利付国債(10年)	285,000,000	286,690,050	
第251回利付国債(10年)	227,000,000	229,803,450	
第252回利付国債(10年)	228,000,000	231,182,880	
第253回利付国債(10年)	35,000,000	35,954,800	
第254回利付国債(10年)	52,000,000	53,225,120	
第256回利付国債(10年)	88,000,000	90,341,680	
第258回利付国債(10年)	40,000,000	41,084,800	
第259回利付国債(10年)	7,000,000	7,222,670	
第261回利付国債(10年)	270,000,000	281,537,100	
第262回利付国債(10年)	85,000,000	88,853,050	
第264回利付国債(10年)	221,000,000	229,364,850	
第265回利付国債(10年)	100,000,000	104,049,000	
第266回利付国債(10年)	118,000,000	122,413,200	
第268回利付国債(10年)	361,000,000	376,519,390	
第269回利付国債(10年)	90,000,000	93,268,800	
第270回利付国債(10年)	88,000,000	91,369,520	
第271回利付国債(10年)	146,000,000	151,067,660	
第272回利付国債(10年)	178,000,000	185,789,280	
第273回利付国債(10年)	111,000,000	116,304,690	
第274回利付国債(10年)	73,000,000	76,617,880	
第276回利付国債(10年)	35,000,000	36,876,700	
第278回利付国債(10年)	80,000,000	85,177,600	
第279回利付国債(10年)	70,000,000	75,133,100	

第280回利付国債(10年)	156,000,000	167,267,880	
第281回利付国債(10年)	182,000,000	195,928,460	
第282回利付国債(10年)	274,000,000	291,883,980	
第283回利付国債(10年)	50,000,000	53,515,500	
第284回利付国債(10年)	107,000,000	114,250,320	
第285回利付国債(10年)	216,000,000	231,087,600	
第286回利付国債(10年)	156,000,000	168,024,480	
第287回利付国債(10年)	35,000,000	37,900,450	
第288回利付国債(10年)	18,000,000	19,317,600	
第289回利付国債(10年)	254,000,000	269,857,220	
第290回利付国債(10年)	446,000,000	471,453,220	
第291回利付国債(10年)	287,000,000	301,513,590	
第292回利付国債(10年)	241,000,000	259,294,310	
第293回利付国債(10年)	126,000,000	136,521,000	
第294回利付国債(10年)	32,000,000	34,467,200	
第295回利付国債(10年)	13,000,000	13,831,480	
第296回利付国債(10年)	196,000,000	208,585,160	
第297回利付国債(10年)	188,000,000	198,864,520	
第298回利付国債(10年)	241,000,000	253,192,190	
第299回利付国債(10年)	750,000,000	787,537,500	
第300回利付国債(10年)	31,000,000	33,000,430	
第301回利付国債(10年)	148,000,000	157,405,400	
第302回利付国債(10年)	79,000,000	83,446,120	
第303回利付国債(10年)	361,000,000	380,674,500	
第305回利付国債(10年)	358,000,000	374,195,920	
第306回利付国債(10年)	115,000,000	120,924,800	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	145,754,000	
第309回利付国債(10年)	162,000,000	165,913,920	
第310回利付国債(10年)	268,000,000	271,534,920	
第311回利付国債(10年)	93,000,000	92,616,840	
第312回利付国債(10年)	15,000,000	15,411,300	
第313回利付国債(10年)	340,000,000	351,430,800	
第315回利付国債(10年)	85,000,000	86,909,100	
第316回利付国債(10年)	35,000,000	35,462,000	
第317回利付国債(10年)	165,000,000	166,778,700	
第318回利付国債(10年)	80,000,000	80,107,200	
第14回利付国債(30年)	208,000,000	229,908,640	
第15回利付国債(30年)	162,000,000	182,123,640	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	61,882,150	
第24回利付国債(30年)	158,000,000	177,604,640	
第26回利付国債(30年)	140,000,000	154,488,600	
第27回利付国債(30年)	134,000,000	150,684,340	
第28回利付国債(30年)	54,000,000	60,757,020	
第29回利付国債(30年)	246,000,000	271,738,980	
第30回利付国債(30年)	127,000,000	137,379,710	
第31回利付国債(30年)	20,000,000	21,189,400	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	43,227,200	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	50,695,500	
第34回利付国債(30年)	110,000,000	116,218,300	

第35回利付国債(30年)	40,000,000	40,415,200	
第23回利付国債(20年)	100,000,000	109,955,000	
第26回利付国債(20年)	37,000,000	41,556,920	
第27回利付国債(20年)	16,000,000	18,198,720	
第29回利付国債(20年)	110,000,000	126,623,200	
第31回利付国債(20年)	40,000,000	45,536,400	
第33回利付国債(20年)	200,000,000	233,420,000	
第34回利付国債(20年)	85,000,000	99,076,850	
第37回利付国債(20年)	63,000,000	72,739,800	
第39回利付国債(20年)	86,000,000	97,304,700	
第41回利付国債(20年)	27,000,000	28,722,060	
第42回利付国債(20年)	178,000,000	203,582,160	
第43回利付国債(20年)	73,000,000	85,378,610	
第44回利付国債(20年)	51,000,000	58,086,450	
第47回利付国債(20年)	21,000,000	23,413,740	
第48回利付国債(20年)	99,000,000	112,958,010	
第49回利付国債(20年)	57,000,000	63,014,070	
第50回利付国債(20年)	237,000,000	257,573,970	
第51回利付国債(20年)	39,000,000	42,737,760	
第54回利付国債(20年)	15,000,000	16,721,700	
第55回利付国債(20年)	66,000,000	72,262,740	
第57回利付国債(20年)	137,000,000	148,468,270	
第58回利付国債(20年)	135,000,000	146,186,100	
第59回利付国債(20年)	33,000,000	35,012,010	
第60回利付国債(20年)	545,000,000	561,459,000	
第61回利付国債(20年)	27,000,000	26,579,610	
第63回利付国債(20年)	31,000,000	33,097,460	
第64回利付国債(20年)	54,000,000	58,196,340	
第65回利付国債(20年)	140,000,000	150,679,200	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	36,214,080	
第67回利付国債(20年)	54,000,000	58,035,960	
第68回利付国債(20年)	38,000,000	42,134,020	
第70回利付国債(20年)	49,000,000	55,408,710	
第72回利付国債(20年)	42,000,000	46,005,960	
第73回利付国債(20年)	13,000,000	14,066,520	
第74回利付国債(20年)	78,000,000	85,371,000	
第76回利付国債(20年)	206,000,000	220,189,280	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	333,351,000	
第90回利付国債(20年)	156,000,000	171,139,800	
第91回利付国債(20年)	200,000,000	222,004,000	
第92回利付国債(20年)	210,000,000	227,199,000	
第94回利付国債(20年)	100,000,000	108,028,000	
第95回利付国債(20年)	182,000,000	201,304,740	
第96回利付国債(20年)	98,000,000	105,636,160	
第97回利付国債(20年)	195,000,000	212,760,600	
第98回利付国債(20年)	44,000,000	47,382,280	
第99回利付国債(20年)	97,000,000	104,279,850	
第100回利付国債(20年)	140,000,000	152,271,000	
第101回利付国債(20年)	96,000,000	107,277,120	

第102回利付国債(20年)	106,000,000	118,369,140	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,121,670	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,397,120	
第105回利付国債(20年)	82,000,000	87,852,340	
第106回利付国債(20年)	142,000,000	154,233,300	
第107回利付国債(20年)	30,000,000	32,100,900	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	139,398,860	
第109回利付国債(20年)	119,000,000	123,596,970	
第110回利付国債(20年)	148,000,000	158,158,720	
第111回利付国債(20年)	90,000,000	97,417,800	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	21,315,000	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	55,339,440	
第116回利付国債(20年)	185,000,000	199,615,000	
第117回利付国債(20年)	30,000,000	31,902,000	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	73,278,800	
第119回利付国債(20年)	50,000,000	50,742,500	
第120回利付国債(20年)	70,000,000	68,815,600	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	22,660,660	
第122回利付国債(20年)	80,000,000	81,084,000	
第123回利付国債(20年)	55,000,000	58,341,250	
第124回利付国債(20年)	50,000,000	52,201,000	
第125回利付国債(20年)	80,000,000	86,076,000	
第126回利付国債(20年)	50,000,000	52,146,500	
第128回利付国債(20年)	20,000,000	20,527,800	
第129回利付国債(20年)	20,000,000	20,204,800	
第130回利付国債(20年)	100,000,000	100,960,000	
国債証券 合計	22,917,000,000	24,142,081,490	
地方債証券			
第597回東京都公募公債	100,000,000	100,633,000	
第598回東京都公募公債	100,000,000	100,503,000	
第636回東京都公募公債	100,000,000	107,563,000	
第682回東京都公募公債	100,000,000	103,986,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,581,000	
第123回神奈川県公募公債	100,000,000	102,652,000	
第1回大阪府公募公債(7年)	100,000,000	102,715,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,555,000	
平成19年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	107,602,000	
平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	102,355,000	
平成19年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	107,133,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	104,476,000	
平成18年度第1回広島県公募公債	100,000,000	108,040,000	
平成16年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,148,000	
平成16年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	104,629,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,644,000	
第55回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,832,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,106,000	
平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	103,750,000	
第12回め号名古屋市公募公債	100,000,000	104,221,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	107,292,000	
地方債証券 合計	2,100,000,000	2,205,416,000	

特殊債券	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,400,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,665,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,913,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,635,000	
	第332回政府保証道路債券	100,000,000	103,707,000	
	第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,633,000	
	第336回政府保証道路債券	100,000,000	103,713,000	
	第338回政府保証道路債券	100,000,000	104,187,000	
	第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,716,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,760,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	103,574,000	
	第20回公営企業債券	100,000,000	107,398,000	
	第820回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,100,404	
	第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,817,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,185,000	
	第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,650,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,931,000	
	第14回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,668,000	
	第8回農林漁業金融公庫債券	200,000,000	207,328,000	
	第3回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,068,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,660,000	
	い第709号農林債	100,000,000	102,074,000	
	い第714号農林債	100,000,000	101,552,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,390,000	
	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,268,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,508,000	
第234回信金中金債(5年)	100,000,000	102,248,000		
特殊債券 合計		2,900,000,000	3,012,748,404	
社債券	第324回東京交通債券	100,000,000	114,875,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2010)	100,000,000	99,952,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(2011)	100,000,000	97,937,000	
	第32回住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,672,000	
	第6回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,551,000	
	第16回太平洋セメント株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,431,000	
	第49回新日本製鐵株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,895,000	
	第20回三菱マテリアル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,948,000	
	第15回株式会社豊田自動織機無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,805,000	
	第15回ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,431,000	
	第11回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,487,000	

第17回三菱重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,729,000	
第26回三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	107,047,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債(担保提供制限等財務上特約無)	100,000,000	100,214,000	
第31回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,077,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	108,068,000	
第25回日本郵船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	111,803,000	
第47回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	100,886,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,716,000	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	82,016,000	
第523回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	65,220,000	
第461回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,746,000	
第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,146,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,874,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,706,000	
社債券 合計	2,500,000,000	2,537,232,000	
合計	30,417,000,000	31,897,477,894	

## 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。

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22年11月 8日現在	平成23年11月 7日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		220,621,982	303,588,587
コール・ローン		59,108,170	194,047,430
国債証券		584,818,735,580	456,676,546,276
派生商品評価勘定		18,043,273	7,473
未収入金		5,288,107,069	482,326,297
未収利息		7,080,690,971	5,918,955,978
前払費用		399,159,301	214,884,345
流動資産合計		597,884,466,346	463,790,356,386
資産合計		597,884,466,346	463,790,356,386
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,534,052	226,023
未払解約金		5,349,141,195	480,711,449
流動負債合計		5,356,675,247	480,937,472
負債合計		5,356,675,247	480,937,472
純資産の部			
元本等			
元本		404,804,880,931	323,217,716,090
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		187,722,910,168	140,091,702,824
元本等合計		592,527,791,099	463,309,418,914
純資産合計		592,527,791,099	463,309,418,914
負債純資産合計		597,884,466,346	463,790,356,386

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	対象期間 自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>



## (貸借対照表に関する注記)

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1. 期首	平成21年11月 7日	1. 期首	平成22年11月 9日
期首元本額	444,321,177,344円	期首元本額	404,804,880,931円
期首からの追加設定元本額	8,933,878,839円	期首からの追加設定元本額	13,619,686,128円
期首からの一部解約元本額	48,450,175,252円	期首からの一部解約元本額	95,206,850,969円
平成22年11月 8日現在の元本の内訳		平成23年11月 7日現在の元本の内訳	
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	8,919,319,862円	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	9,702,947,203円
DCインデックスバランス(株式20)	50,122,106円	DCインデックスバランス(株式20)	57,674,302円
DCインデックスバランス(株式40)	91,093,332円	DCインデックスバランス(株式40)	101,816,556円
DCインデックスバランス(株式60)	114,893,722円	DCインデックスバランス(株式60)	126,461,597円
DCインデックスバランス(株式80)	95,071,151円	DCインデックスバランス(株式80)	103,597,956円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	222,494,122,534円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	183,065,810,511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	10,084,086,262円	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	7,443,161,686円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	142,295,241,762円	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	104,175,281,722円
全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	51,745,534円	全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	48,580,292円
日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,504,446,151円	日興外国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,423,700,068円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	5,184,490円	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	10,134,733円
日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	222,618,134円	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(債券資産)	76,715,712円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,315,889円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	6,525,478円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,772,159円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	8,252,118円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	22,161,593円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	19,679,166円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	56,620,780円	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	51,137,418円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	2,817,142,239円	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	1,462,463,459円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,299,362,018円	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,125,182,549円

世界アセットバランス ファンド40(適格機関投 資家向け)	164,186,668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)	150,713,629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)	237,669,001円	世界アセットバランス ファンド25(適格機関投 資家向け)	203,065,227円
3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	66,008,769円	3資産バランスファンド (適格機関投資家向け)	37,440,232円
グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	66,195,683円	グローバルバランスファ ンド35(適格機関投資家 向け)	61,780,456円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式20)	52,556,879円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式20)	58,274,765円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式40)	67,941,580円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式40)	75,201,147円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式60)	59,200,173円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式60)	64,191,778円
年金積立 アセット・ナビ ゲーション・ファンド (株式80)	43,848,021円	年金積立 アセット・ナ ビゲーション・ファンド (株式80)	47,068,979円
年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし)	12,705,499,965円	年金積立 インデックス ファンド海外債券(ヘッ ジなし)	12,291,917,165円
海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	202,454,474円	海外債券インデックス ファンド(個人型年金向 け)	218,940,186円
計	404,804,880,931円	計	323,217,716,090円
2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	404,804,880,931円	2. 本報告書における開示対 象ファンドの当計算期間 末日における当該親投資 信託の受益権の総数	323,217,716,090円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

## I 金融商品の状況に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスクマネジメント部を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	自 平成21年11月 7日 至 平成22年11月 8日	自 平成22年11月 9日 至 平成23年11月 7日
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

対象期間(自平成21年11月7日至平成22年11月8日)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,419,568,384
合計	2,419,568,384

対象期間(自平成22年11月9日至平成23年11月7日)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,062,490,639
合計	1,062,490,639

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

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

(平成22年11月8日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	5,567,186,121		5,556,676,900	10,509,221
	米ドル	2,158,587,298		2,165,046,000	6,458,702
	加ドル	137,489,495		138,548,300	1,058,805
	英ポンド	387,598,986		386,886,780	712,206
	スイスフラン	75,880,095		75,893,580	13,485
	スウェーデンクローナ	22,455,264		22,435,200	20,064
	ノルウェークローネ	40,069,926		40,044,420	25,506
	デンマーククローネ	78,983,801		78,417,820	565,981
	ポーランドズロチ	96,747,296		95,892,800	854,496
	ユーロ	2,569,373,960		2,553,512,000	15,861,960
	合計	5,567,186,121		5,556,676,900	10,509,221

（平成23年11月7日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建	768,606,920		768,825,470	218,550
	米ドル	140,511,360		140,652,000	140,640
	加ドル	135,133,857		135,139,140	5,283
	シンガポールドル	75,742,832		75,742,710	122
	スウェーデンクローナ	72,722,971		72,715,620	7,351
	ユーロ	344,495,900		344,576,000	80,100
	合計	768,606,920		768,825,470	218,550

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成22年11月 8日現在		平成23年11月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.4637円	1口当たり純資産額	1.4334円
（1万口当たり純資産額）	（14,637円）	（1万口当たり純資産額）	（14,334円）

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	7,100,000	10,682,171.87	
		US TREASURY N/B-6.875%-25/08/15	5,000,000	7,556,250.00	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	8,300,000	11,719,859.37	
		US TREASURY N/B-6.5%-26/11/15	2,700,000	4,008,234.37	
		US TREASURY N/B-6.625%-27/02/15	4,000,000	6,021,875.00	
		US TREASURY N/B-6.375%-27/08/15	4,000,000	5,926,250.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	6,700,000	9,726,515.62	
		US TREASURY N/B-5.5%-28/08/15	4,870,000	6,697,010.93	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	5,100,000	6,840,375.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-17/06/30	15,200,000	16,373,250.00	
		US TREASURY N/B-6.125%-29/08/15	6,000,000	8,849,062.50	
		US TREASURY N/B-6.25%-23/08/15	10,300,000	14,495,640.62	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	4,500,000	6,224,765.62	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	13,000,000	16,406,406.24	
		US TREASURY N/B-4.75%-37/02/15	7,200,000	9,430,875.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	10,500,000	14,255,390.62	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	10,200,000	12,691,031.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	13,100,000	16,618,578.12	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	4,450,000	4,796,960.93	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	16,800,000	20,506,500.00	
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	7,200,000	9,672,750.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-19/08/15	26,200,000	30,039,937.50	
		US TREASURY N/B-4.75%-17/08/15	22,000,000	26,506,562.50	
		US TREASURY N/B-8.875%-17/08/15	4,000,000	5,753,125.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-17/11/15	22,400,000	26,428,500.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-18/02/15	22,400,000	25,431,000.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-18/05/15	17,550,000	20,360,742.18	
		US TREASURY N/B-4.0%-18/08/15	17,900,000	20,929,015.62	
		US TREASURY N/B-3.75%-18/11/15	16,500,000	19,057,500.00	
		US TREASURY N/B-8.875%-19/02/15	5,000,000	7,574,218.75	
		US TREASURY N/B-7.625%-25/02/15	3,000,000	4,767,656.25	
		US TREASURY N/B-3.125%-19/05/15	32,200,000	35,757,093.75	
		US TREASURY N/B-7.5%-24/11/15	6,500,000	10,199,921.87	
		US TREASURY N/B-3.375%-19/11/15	27,000,000	30,459,375.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	34,500,000	39,227,578.12	
		US TREASURY N/B-8.75%-20/08/15	7,950,000	12,446,718.75	
		US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	2,000,000	2,126,250.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	40,500,000	46,309,218.75	
		US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	12,000,000	18,526,875.00	
		US TREASURY N/B-7.25%-22/08/15	4,000,000	5,971,875.00	
		US TREASURY N/B-7.125%-23/02/15	8,000,000	11,921,250.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-12/10/31	9,800,000	10,155,250.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-19/02/15	19,600,000	21,262,937.50	
US TREASURY N/B-1.75%-14/01/31	13,800,000	14,258,203.12			
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	21,000,000	26,647,031.25			
US TREASURY N/B-2.625%-14/06/30	14,000,000	14,847,656.25			
US TREASURY N/B-2.25%-14/05/31	6,600,000	6,927,421.87			

US TREASURY N/B-4.75%-14/05/15	30,550,000	33,958,234.37	
US TREASURY N/B-1.875%-14/04/30	4,000,000	4,154,687.50	
US TREASURY N/B-1.75%-14/03/31	9,700,000	10,038,742.18	
US TREASURY N/B-1.875%-14/02/28	11,300,000	11,714,921.87	
US TREASURY N/B-1.125%-13/06/15	9,500,000	9,639,531.25	
US TREASURY N/B-4.25%-14/08/15	13,000,000	14,401,562.50	
US TREASURY N/B-4.0%-14/02/15	36,280,000	39,329,787.50	
US TREASURY N/B-2.375%-14/08/31	24,000,000	25,350,000.00	
US TREASURY N/B-1.5%-13/12/31	16,600,000	17,038,343.75	
US TREASURY N/B-2.0%-13/11/30	21,900,000	22,685,320.30	
US TREASURY N/B-4.25%-13/11/15	22,000,000	23,777,187.50	
US TREASURY N/B-2.75%-13/10/31	10,500,000	11,019,257.81	
US TREASURY N/B-3.125%-13/09/30	27,400,000	28,911,281.25	
US TREASURY N/B-3.125%-13/08/31	41,100,000	43,267,382.81	
US TREASURY N/B-4.25%-13/08/15	34,400,000	36,872,500.00	
US TREASURY N/B-3.375%-13/07/31	12,500,000	13,189,453.12	
US TREASURY N/B-1.0%-13/07/15	8,500,000	8,614,218.75	
US TREASURY N/B-3.375%-13/06/30	31,650,000	33,309,152.34	
US TREASURY N/B-2.75%-13/02/28	10,900,000	11,273,835.93	
US TREASURY N/B-8.125%-19/08/15	9,000,000	13,331,250.00	
US TREASURY N/B-4.0%-12/11/15	14,400,000	14,964,750.00	
US TREASURY N/B-1.375%-12/11/15	16,200,000	16,402,500.00	
US TREASURY N/B-3.375%-12/11/30	13,350,000	13,810,992.18	
US TREASURY N/B-1.125%-12/12/15	26,600,000	26,868,078.12	
US TREASURY N/B-3.625%-12/12/31	29,800,000	30,973,375.00	
US TREASURY N/B-1.375%-13/01/15	24,100,000	24,448,320.31	
US TREASURY N/B-2.875%-13/01/31	10,000,000	10,334,375.00	
US TREASURY N/B-2.625%-14/07/31	17,000,000	18,051,875.00	
US TREASURY N/B-3.875%-13/02/15	17,050,000	17,851,882.81	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	19,000,000	23,660,937.50	
US TREASURY N/B-1.375%-13/03/15	10,000,000	10,162,500.00	
US TREASURY N/B-2.5%-13/03/31	12,800,000	13,218,000.00	
US TREASURY N/B-1.75%-13/04/15	16,500,000	16,868,671.87	
US TREASURY N/B-3.125%-13/04/30	14,600,000	15,233,046.87	
US TREASURY N/B-3.625%-13/05/15	43,200,000	45,461,250.00	
US TREASURY N/B-1.375%-13/05/15	11,500,000	11,706,640.62	
US TREASURY N/B-3.5%-13/05/31	22,900,000	24,086,148.43	
US TREASURY N/B-2.375%-14/10/31	21,200,000	22,448,812.50	
US TREASURY N/B-2.375%-14/09/30	23,100,000	24,437,273.43	
US TREASURY N/B-1.375%-13/02/15	21,100,000	21,408,257.81	
US TREASURY N/B-3.625%-20/02/15	46,300,000	53,107,546.87	
US TREASURY N/B-4.5%-15/11/15	30,400,000	35,088,250.00	
US TREASURY N/B-2.625%-16/02/29	8,700,000	9,412,312.50	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	18,300,000	23,707,078.12	
US TREASURY N/B-7.5%-16/11/15	10,200,000	13,516,593.75	
US TREASURY N/B-2.625%-16/04/30	6,800,000	7,365,250.00	
US TREASURY N/B-5.125%-16/05/15	27,000,000	32,269,218.75	
US TREASURY N/B-7.25%-16/05/15	9,000,000	11,615,625.00	
US TREASURY N/B-3.25%-16/05/31	10,600,000	11,787,531.25	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	19,500,000	23,835,703.12	
US TREASURY N/B-4.25%-15/08/15	37,200,000	42,344,062.50	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	10,500,000	13,116,796.87	
US TREASURY N/B-4.5%-16/02/15	33,500,000	38,870,468.75	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	9,700,000	11,139,843.75	

		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	21,500,000	26,794,375.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	6,000,000	6,756,562.50	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/06/30	11,000,000	12,244,375.00	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/07/31	12,000,000	13,359,375.00	
		US TREASURY N/B-4.875%-16/08/15	12,000,000	14,285,625.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/08/31	9,800,000	10,799,906.25	
		US TREASURY N/B-3.0%-16/09/30	10,700,000	11,796,750.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-16/10/31	11,900,000	13,186,687.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-16/11/15	15,000,000	17,744,531.25	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	20,800,000	27,530,750.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-17/02/28	5,400,000	5,959,406.25	
		US TREASURY N/B-4.0%-15/02/15	17,000,000	18,978,906.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-15/02/28	20,700,000	22,021,242.18	
		US TREASURY N/B-2.75%-17/05/31	11,100,000	12,112,875.00	
		US TREASURY N/B-8.75%-17/05/15	8,000,000	11,335,000.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-17/05/15	14,100,000	16,723,921.87	
		US TREASURY N/B-2.25%-15/01/31	18,100,000	19,147,820.31	
		US TREASURY N/B-2.625%-14/12/31	18,500,000	19,768,984.37	
		US TREASURY N/B-2.375%-16/03/31	9,200,000	9,859,812.50	
		US TREASURY N/B-2.125%-14/11/30	10,700,000	11,259,242.18	
		US TREASURY N/B-1.75%-15/07/31	3,000,000	3,135,000.00	
		US TREASURY N/B-11.25%-15/02/15	3,000,000	4,051,406.25	
		US TREASURY N/B-3.25%-17/03/31	14,200,000	15,859,625.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-17/02/15	15,350,000	18,230,523.43	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/01/31	11,900,000	13,205,281.25	
		US TREASURY N/B-3.25%-16/12/31	13,400,000	14,947,281.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-16/11/30	1,600,000	1,744,500.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/03/31	17,500,000	18,715,429.68	
		US TREASURY N/B-2.5%-15/04/30	15,000,000	16,052,343.75	
		US TREASURY N/B-4.125%-15/05/15	23,100,000	26,041,640.62	
		US TREASURY N/B-2.125%-15/05/31	14,300,000	15,126,718.75	
		US TREASURY N/B-4.25%-14/11/15	22,800,000	25,429,125.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-15/06/30	14,300,000	15,003,828.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-17/04/30	7,000,000	7,775,468.75	
	国債証券小計		2,069,450,000	2,351,827,606.76 (183,795,327,468)	
米ドル合計				2,351,827,606.76 (183,795,327,468)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	7,350,000	10,183,425.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-9.0%-25/06/01	1,430,000	2,513,196.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-27/06/01	4,600,000	7,806,660.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	6,350,000	9,356,153.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-13/03/01	3,800,000	3,841,762.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	3,500,000	4,995,340.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-15/06/01	2,300,000	2,401,545.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-12/12/01	2,000,000	2,012,440.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	6,650,000	8,186,150.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-13/06/01	10,100,000	10,504,909.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-13/09/01	6,300,000	6,478,479.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-14/06/01	9,700,000	10,179,374.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.25%-13/06/01	14,500,000	15,473,675.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-14/12/01	5,700,000	5,848,656.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-8.0%-23/06/01	2,900,000	4,571,212.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-15/06/01	9,150,000	10,189,165.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-15/12/01	2,000,000	2,133,260.00	



		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-16/06/01	12,350,000	13,777,783.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-17/06/01	5,400,000	6,102,324.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.25%-18/06/01	5,700,000	6,597,237.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-19/06/01	8,000,000	9,050,480.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-20/06/01	5,750,000	6,401,187.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	1,000,000	1,093,000.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-14/06/01	11,600,000	12,758,492.00	
	国債証券小計		148,130,000	172,455,906.40 (13,235,990,816)	
加ドル合計				172,455,906.40 (13,235,990,816)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,450,000	1,467,489.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	7,900,000	8,205,516.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-13/12/15	4,500,000	4,661,761.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-12/11/15	4,000,000	4,032,412.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-15/04/15	8,000,000	8,639,304.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-16/06/15	4,700,000	4,877,566.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	8,700,000	9,556,288.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-18/01/21	1,300,000	1,403,378.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.25%-19/03/15	6,900,000	7,383,793.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	7,600,000	7,742,234.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	6,250,000	6,945,875.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	3,750,000	4,178,156.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.25%-14/06/15	6,200,000	6,590,916.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	1,800,000	1,965,920.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-14/10/21	2,700,000	2,758,897.80	
	国債証券小計		75,750,000	80,409,510.65 (6,528,448,169)	
豪ドル合計				80,409,510.65 (6,528,448,169)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-2.0%-16/01/22	1,900,000	1,971,409.60	
		UK TREASURY-3.75%-21/09/07	3,200,000	3,599,353.92	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	8,750,000	10,248,339.05	
		UK TREASURY-2.75%-15/01/22	10,000,000	10,609,017.80	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	8,600,000	9,887,079.69	
		UK TREASURY-2.25%-14/03/07	11,300,000	11,728,927.43	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	6,300,000	8,943,712.72	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	7,900,000	9,833,226.77	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	7,450,000	8,717,001.90	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	7,750,000	9,372,404.76	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	8,900,000	10,408,381.79	
		UK TREASURY-8.0%-13/09/27	2,800,000	3,188,736.06	
		UK TREASURY-4.5%-13/03/07	13,200,000	13,891,619.14	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	9,000,000	10,560,776.31	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	8,440,000	10,667,776.82	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	7,500,000	8,779,655.02	
		UK TREASURY-4.75%-15/09/07	14,530,000	16,607,270.69	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	1,700,000	1,996,327.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	9,700,000	11,842,464.22	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	8,400,000	10,110,728.96	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	11,000,000	13,135,152.58	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	8,950,000	11,009,010.68	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	8,100,000	10,243,210.34	
		UK TREASURY-3.75%-20/09/07	4,400,000	4,956,752.68	
UK TREASURY-4.5%-19/03/07	9,300,000	10,999,241.03			

UK TREASURY-5.0%-18/03/07	5,300,000	6,389,393.53	
---------------------------	-----------	--------------	--

[次へ](#)

		UK TREASURY-4.75%-20/03/07	11,000,000	13,262,585.93	
		UK TREASURY-8.75%-17/08/25	5,300,000	7,444,949.27	
		UK TREASURY-8.0%-21/06/07	8,700,000	12,990,751.60	
		UK TREASURY-5.0%-14/09/07	14,050,000	15,736,281.14	
		UK TREASURY-4.0%-16/09/07	12,100,000	13,682,753.32	
		UK TREASURY-8.0%-15/12/07	6,600,000	8,447,421.04	
		UK TREASURY-3.75%-19/09/07	10,100,000	11,407,122.91	
	国債証券小計		272,220,000	322,668,835.70 (40,394,911,541)	
英債券合計				322,668,835.70 (40,394,911,541)	
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-4.0%-23/02/11	4,950,000	6,490,930.05	
		SWITZERLAND-3.0%-19/05/12	1,600,000	1,871,035.20	
		SWITZERLAND-4.0%-13/02/11	890,000	934,706.48	
		SWITZERLAND-4.25%-14/01/06	4,070,000	4,440,890.96	
		SWITZERLAND-2.5%-16/03/12	6,050,000	6,651,605.95	
		SWITZERLAND-3.0%-18/01/08	2,200,000	2,534,430.80	
		SWITZERLAND-4.0%-28/04/08	1,330,000	1,865,548.44	
	国債証券小計		21,090,000	24,789,147.88 (2,176,487,183)	
スイスフラン合計				24,789,147.88 (2,176,487,183)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.625%-14/07/01	2,770,000	3,008,981.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-13/04/01	1,300,000	1,325,350.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-13/07/01	3,000,000	3,099,375.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.75%-16/09/01	2,750,000	3,145,725.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-17/04/01	1,000,000	1,082,633.33	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	1,650,000	1,912,968.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000,000	1,109,166.67	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.125%-22/09/01	1,950,000	2,200,120.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	2,450,000	2,773,093.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.5%-19/06/01	800,000	862,640.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-4.0%-18/09/01	2,300,000	2,721,647.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.375%-14/10/01	600,000	616,740.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	1,470,000	1,600,878.99	
	SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-15/07/01	2,650,000	2,876,575.00		
国債証券小計		25,690,000	28,335,895.74 (1,749,458,202)		
シンガポールドル合計				28,335,895.74 (1,749,458,202)	
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.835%-15/08/12	2,000,000	2,036,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.814%-17/02/15	4,500,000	4,569,150.01	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.262%-16/09/15	6,000,000	6,251,400.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.72%-15/09/30	6,200,000	6,513,334.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.741%-15/02/27	4,000,000	4,066,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.702%-13/02/25	6,500,000	6,575,725.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.21%-13/05/31	3,900,000	3,922,100.01	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.012%-17/09/15	4,000,000	4,108,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.248%-28/09/15	2,650,000	3,039,955.37	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.461%-13/07/31	5,000,000	5,048,333.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	2,800,000	2,635,068.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.24%-18/02/07	9,000,000	9,498,157.29	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	4,000,000	4,180,100.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT-5.094%-14/04/30	14,900,000	15,621,958.04		

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.16%-21/07/15	4,800,000	4,962,240.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.378%-19/11/29	7,900,000	8,259,450.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	3,800,000	4,321,554.40	
	国債証券小計		91,950,000	95,608,526.46 (2,392,125,332)	
マレーシアリングット合計				95,608,526.46 (2,392,125,332)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.5%-15/08/12	28,380,000	31,498,790.86	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.0%-16/07/12	19,900,000	21,067,587.32	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.75%-17/08/12	23,200,000	25,886,533.78	
		SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	31,400,000	36,828,464.65	
		SWEDISH GOVERNMENT-5.0%-20/12/01	29,500,000	37,111,099.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	18,000,000	20,962,404.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	19,600,000	24,170,720.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-6.75%-14/05/05	38,300,000	42,972,491.99	
	国債証券小計		208,280,000	240,498,091.70 (2,857,117,329)	
スウェーデンクローナ合計				240,498,091.70 (2,857,117,329)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.75%-21/05/25	12,550,000	13,806,631.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-6.5%-13/05/15	27,400,000	29,297,395.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	12,300,000	14,031,249.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-4.25%-17/05/19	16,700,000	18,540,183.18	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-5.0%-15/05/15	23,900,000	26,409,691.20	
	国債証券小計		92,850,000	102,085,150.68 (1,422,046,148)	
ノルウェークローネ合計				102,085,150.68 (1,422,046,148)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-7.0%-24/11/10	13,750,000	20,435,250.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-17/11/15	25,600,000	29,375,820.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	47,700,000	65,203,801.20	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	45,600,000	53,195,500.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-12/11/15	30,400,000	31,419,646.40	
		KINGDOM OF DENMARK-5.0%-13/11/15	37,600,000	40,825,252.80	
		KINGDOM OF DENMARK-4.0%-15/11/15	54,300,000	60,722,169.60	
	国債証券小計		254,950,000	301,177,441.60 (4,358,037,579)	
デンマーククローネ合計				301,177,441.60 (4,358,037,579)	
メキシコペ ソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-9.0%-12/12/20	87,000,000	91,378,950.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-13/12/19	73,000,000	78,300,219.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	33,200,000	37,286,890.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	81,300,000	93,960,062.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-20/06/11	62,500,000	71,566,457.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-17/12/14	48,800,000	55,529,378.48	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-9.5%-14/12/18	75,000,000	85,671,747.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	31,700,000	40,895,719.54	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.25%-16/12/15	43,200,000	47,768,550.33	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	77,000,000	102,348,721.09	
			国債証券小計		612,700,000

メキシコペソ合計				704,706,696.25 (4,094,345,905)		
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-13/10/24	14,300,000	14,440,855.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-17/10/25	13,500,000	13,547,250.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-16/04/25	11,500,000	11,521,275.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-15/04/25	10,600,000	10,843,800.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	5,000,000	4,932,950.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-20/10/25	11,100,000	10,776,435.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.25%-15/10/24	12,900,000	13,549,515.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	13,000,000	12,992,200.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.25%-13/04/25	24,200,000	24,480,720.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	8,300,000	8,312,450.00		
	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-14/04/25	12,800,000	13,131,520.00			
	国債証券小計		137,200,000	138,528,970.00 (3,407,812,662)		
ポーランドズロチ合計				138,528,970.00 (3,407,812,662)		
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.0%-19/03/28	4,950,000	4,922,247.82		
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-12/12/24	4,400,000	4,679,007.08		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-13/03/28	5,100,000	5,204,313.36		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-13/09/28	7,300,000	7,506,148.34		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-14/03/28	5,900,000	6,028,611.15		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-14/09/28	5,300,000	5,453,702.64		
		BELGIUM KINGDOM-8.0%-15/03/28	3,300,000	3,780,434.79		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-17/03/28	6,000,000	6,035,363.40		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-18/03/28	4,100,000	4,103,692.46		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	3,350,000	3,023,756.56		
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-16/03/28	1,500,000	1,452,368.40		
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-15/03/28	3,950,000	3,964,453.84		
		BELGIUM KINGDOM-3.25%-16/09/28	7,340,000	7,195,697.80		
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	8,200,000	7,900,768.06		
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-15/09/28	5,900,000	5,974,138.22		
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-17/09/28	5,600,000	6,040,668.48		
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	5,800,000	5,618,146.80		
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	5,300,000	5,244,991.83		
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	1,900,000	1,869,221.14		
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	7,300,000	7,947,980.85		
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	7,250,000	7,433,187.92		
			B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-2.3%-13/04/30	4,500,000	4,379,547.15	
			B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.85%-20/10/31	9,300,000	8,909,910.57	
			B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.9%-40/07/30	7,600,000	6,159,770.36	
	B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.2%-37/01/31	7,500,000	5,543,424.75			
	B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.75%-32/07/30	7,300,000	6,850,087.86			
	B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-6.0%-29/01/31	8,850,000	8,600,671.60			
	B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-5.9%-26/07/30	2,200,000	2,134,484.00			
	B O N O S Y O B L I G D E L ESTADO-4.65%-25/07/30	4,100,000	3,586,171.60			

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	8,300,000	7,541,795.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	4,200,000	4,168,110.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	4,200,000	3,290,948.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-15/01/31	13,100,000	13,082,244.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.15%-13/01/31	9,750,000	9,969,484.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-20/04/30	5,200,000	4,740,039.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-13/07/30	11,450,000	11,440,611.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-13/10/31	1,000,000	967,099.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.25%-14/01/31	11,700,000	11,660,822.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.3%-14/10/31	7,000,000	6,777,926.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-12/10/31	4,500,000	4,484,737.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.0%-15/04/30	1,300,000	1,240,634.98	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-16/01/31	13,300,000	12,587,618.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-17/01/31	8,150,000	7,726,411.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-17/07/30	8,050,000	8,237,227.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-18/07/30	8,100,000	7,616,096.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.6%-19/07/30	6,300,000	6,029,225.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.3%-19/10/31	7,600,000	7,115,268.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.75%-14/07/30	9,100,000	9,171,237.53	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-14/04/11	7,000,000	7,315,800.10	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-15/02/27	8,900,000	9,441,411.92	
BUNDES OBLIGATION-2.5%-14/10/10	5,750,000	6,074,631.77	
BUNDES OBLIGATION-4.0%-13/10/11	9,800,000	10,472,410.34	
BUNDES OBLIGATION-2.25%-15/04/10	5,500,000	5,798,182.50	
BUNDES OBLIGATION-3.5%-13/04/12	18,500,000	19,319,083.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/01/04	13,200,000	14,282,382.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	8,200,000	11,716,347.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-14/07/04	11,500,000	12,627,447.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-15/01/04	14,500,000	15,916,091.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	9,000,000	12,050,944.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	6,550,000	9,249,204.56	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.5%-13/01/04	20,300,000	21,277,487.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	4,650,000	7,049,798.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	4,780,000	6,157,478.41	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	8,100,000	11,355,674.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	7,600,000	11,483,489.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-13/07/04	14,300,000	15,093,466.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.0%-16/06/20	4,400,000	5,382,561.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	9,800,000	12,091,635.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	7,000,000	9,135,635.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	7,600,000	10,753,281.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-18/01/04	10,200,000	11,874,317.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-16/01/04	29,200,000	32,444,379.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-21/07/04	12,500,000	14,081,997.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-16/07/04	12,060,000	13,755,868.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-17/01/04	9,800,000	11,132,841.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-17/07/04	8,750,000	10,238,020.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-18/07/04	8,900,000	10,553,261.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.75%-19/01/04	11,300,000	13,081,040.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.5%-19/07/04	11,200,000	12,799,588.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-20/01/04	12,900,000	14,534,506.11	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%-20/07/04	13,600,000	15,064,496.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-15/07/04	12,700,000	13,877,377.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	5,800,000	6,525,992.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/09/01	10,290,000	9,022,078.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	8,700,000	5,967,598.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	8,400,000	6,474,951.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	12,400,000	9,590,798.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-15/08/01	23,200,000	21,593,151.76	

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	15,000,000	12,734,851.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%-23/11/01	8,210,000	9,410,875.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-23/08/01	13,000,000	11,031,462.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-21/09/01	7,700,000	6,987,611.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-21/08/01	18,800,000	15,390,926.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-20/09/01	11,350,000	9,699,918.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-20/02/01	9,700,000	8,627,657.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-19/03/01	11,600,000	10,429,801.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-19/02/01	10,900,000	9,666,684.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-12/12/15	5,700,000	5,495,091.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/02/01	11,900,000	10,868,111.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	7,000,000	7,189,277.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	20,200,000	18,368,678.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-18/08/01	10,900,000	9,875,292.09	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/06/15	1,600,000	1,449,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-15/04/15	6,700,000	6,100,110.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-15/02/01	16,000,000	15,226,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-14/08/01	15,300,000	14,670,579.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-14/06/01	5,500,000	5,199,713.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-13/12/15	19,300,000	18,553,682.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/08/01	20,150,000	19,759,541.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-13/06/01	2,900,000	2,754,824.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-13/04/15	12,800,000	12,592,236.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-13/02/01	11,500,000	11,412,673.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	9,800,000	7,687,458.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.25%-20/03/01	11,300,000	9,877,745.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-17/02/01	9,600,000	8,753,344.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	10,800,000	9,048,049.92	



BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	10,600,000	10,162,476.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	8,800,000	7,622,150.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	14,700,000	13,190,079.21	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-17/08/01	13,500,000	12,938,958.90	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	4,350,000	4,962,124.17	
FINNISH GOVERNMENT-5.375%-13/07/04	3,350,000	3,614,161.23	
FINNISH GOVERNMENT-3.125%-14/09/15	3,100,000	3,298,147.35	
FINNISH GOVERNMENT-4.25%-15/07/04	4,550,000	5,060,818.03	
FINNISH GOVERNMENT-1.75%-16/04/15	1,180,000	1,203,198.32	
FINNISH GOVERNMENT-3.875%-17/09/15	3,550,000	3,976,574.39	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	2,900,000	3,367,986.92	
FINNISH GOVERNMENT-3.375%-20/04/15	2,550,000	2,777,320.51	
FINNISH GOVERNMENT-3.5%-21/04/15	1,200,000	1,318,458.11	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	22,000,000	23,317,212.60	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-21/10/25	6,000,000	6,090,093.60	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-23/04/25	9,000,000	13,397,230.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	13,500,000	14,634,475.20	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	9,800,000	12,371,284.80	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	3,600,000	3,610,684.08	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	7,500,000	7,522,227.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	8,700,000	9,612,649.14	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	10,150,000	10,348,420.32	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	7,800,000	8,836,671.48	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	11,000,000	13,929,086.60	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	2,300,000	2,216,970.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-15/10/25	18,360,000	19,236,605.54	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	13,900,000	14,528,161.85	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-19/10/25	9,200,000	9,819,206.92	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-19/10/25	6,550,000	9,219,979.77	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-19/04/25	13,500,000	14,912,453.70	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-18/10/25	8,400,000	9,283,736.28	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-18/04/25	10,500,000	11,465,105.40	
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-17/10/25	10,600,000	11,721,393.08	
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-17/04/25	10,000,000	10,781,989.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.0%-16/10/25	14,600,000	16,629,935.82	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	12,270,000	14,870,476.80	
FRANCE (GOVT OF)-8.5%-12/12/26	4,360,000	4,727,748.99	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-15/04/25	17,550,000	18,684,558.36	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/10/25	11,900,000	12,793,944.66	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-14/04/25	12,000,000	12,791,281.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/10/25	19,400,000	20,488,200.32	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-13/04/25	10,900,000	11,392,114.29	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-16/04/25	22,700,000	23,991,466.56	
FRANCE(GOVT OF)-3.5%-26/04/25	7,000,000	6,875,568.00	
FRENCH TREASURY NOTE-2.0%-15/07/12	1,600,000	1,620,443.68	
FRENCH TREASURY NOTE-3.75%-13/01/12	8,700,000	8,991,818.88	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-15/01/15	7,100,000	7,322,570.09	
FRENCH TREASURY NOTE-3.0%-14/07/12	7,300,000	7,622,318.36	
FRENCH TREASURY NOTE-2.5%-14/01/12	8,810,000	9,061,298.20	
FRENCH TREASURY NOTE-4.5%-13/07/12	17,800,000	18,845,712.62	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.5%-17/07/15	7,800,000	9,040,623.54	

	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	4,450,000	5,379,936.97	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	4,600,000	6,275,940.08	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-7.5%-23/01/15	5,500,000	8,231,707.55	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	4,400,000	4,968,377.04	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-21/07/15	1,000,000	1,085,725.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	9,800,000	10,868,595.92	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	5,650,000	6,911,809.41	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-18/07/15	7,200,000	8,204,538.96	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-16/07/15	8,100,000	9,100,107.81	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-15/01/15	7,550,000	7,970,132.58	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-14/07/15	8,450,000	9,102,194.66	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.25%-13/07/15	10,500,000	11,146,063.95	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-13/01/15	5,100,000	5,177,813.76	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-15/07/15	7,120,000	7,681,931.04	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-19/07/15	6,800,000	7,781,121.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-14/07/15	5,150,000	5,565,012.75	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.35%-19/03/15	5,700,000	6,324,062.79	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	6,280,000	6,762,754.27	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	6,300,000	6,585,746.58	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	3,400,000	3,577,438.86	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	3,550,000	4,102,779.02	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	3,600,000	4,797,193.32	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	5,350,000	5,802,532.42	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-15/07/15	5,700,000	6,079,626.84	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	2,700,000	2,845,638.27	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-13/10/20	5,500,000	5,799,926.55	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-14/10/20	5,600,000	5,927,785.92	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.65%-18/01/15	5,600,000	6,314,664.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.3%-17/09/15	3,550,000	3,935,785.24	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.0%-16/09/15	5,000,000	5,464,440.00	
	国債証券小計	1,695,110,000	1,766,779,069.02 (190,264,437,942)	
ユーロ合計			1,766,779,069.02 (190,264,437,942)	
合計			456,676,546,276 (456,676,546,276)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 135銘柄	100.0%	40.2%
加ドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.9%
豪ドル	国債証券 15銘柄	100.0%	1.4%
英ポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	8.8%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 17銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	1.0%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 197銘柄	100.0%	41.8%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

## 独立監査人の監査報告書

平成22年12月21日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式60）の平成21年11月7日から平成22年11月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の平成22年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年12月7日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式60）の平成22年11月9日から平成23年11月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の平成23年11月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## あらた監査法人

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

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

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

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

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

以 上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月17日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

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

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

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

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

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

以 上

---

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月9日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴司  
業務執行社員指定社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員

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

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以上

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